

德邦德利货币市场基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：德邦基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	德邦德利货币	
基金主代码	000300	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 9 月 16 日	
基金管理人	德邦基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,047,914,868.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
下属分级基金的交易代码:	000300	000301
报告期末下属分级基金的份额总额	88,633,676.43 份	2,959,281,192.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力求实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		德邦基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈星德	罗菲菲
	联系电话	021-26010999	010-58560666
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008217788	95568
传真		021-26010808	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.dbfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,238,119.89	19,886,666.49
本期利润	1,238,119.89	19,886,666.49
本期净值收益率	1.1382%	1.2590%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	88,633,676.43	2,959,281,192.13
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；
2、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦德利货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1945%	0.0049%	0.1110%	0.0000%	0.0835%	0.0049%
过去三个月	0.5504%	0.0031%	0.3366%	0.0000%	0.2138%	0.0031%
过去六个月	1.1382%	0.0028%	0.6695%	0.0000%	0.4687%	0.0028%
过去一年	2.4846%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	1.1346%	0.0028%
过去三年	9.4968%	0.0031%	4.0500%	0.0000%	5.4468%	0.0031%
自基金合同生效起至今	22.0672%	0.0053%	7.8189%	0.0000%	14.2483%	0.0053%

德邦德利货币 B

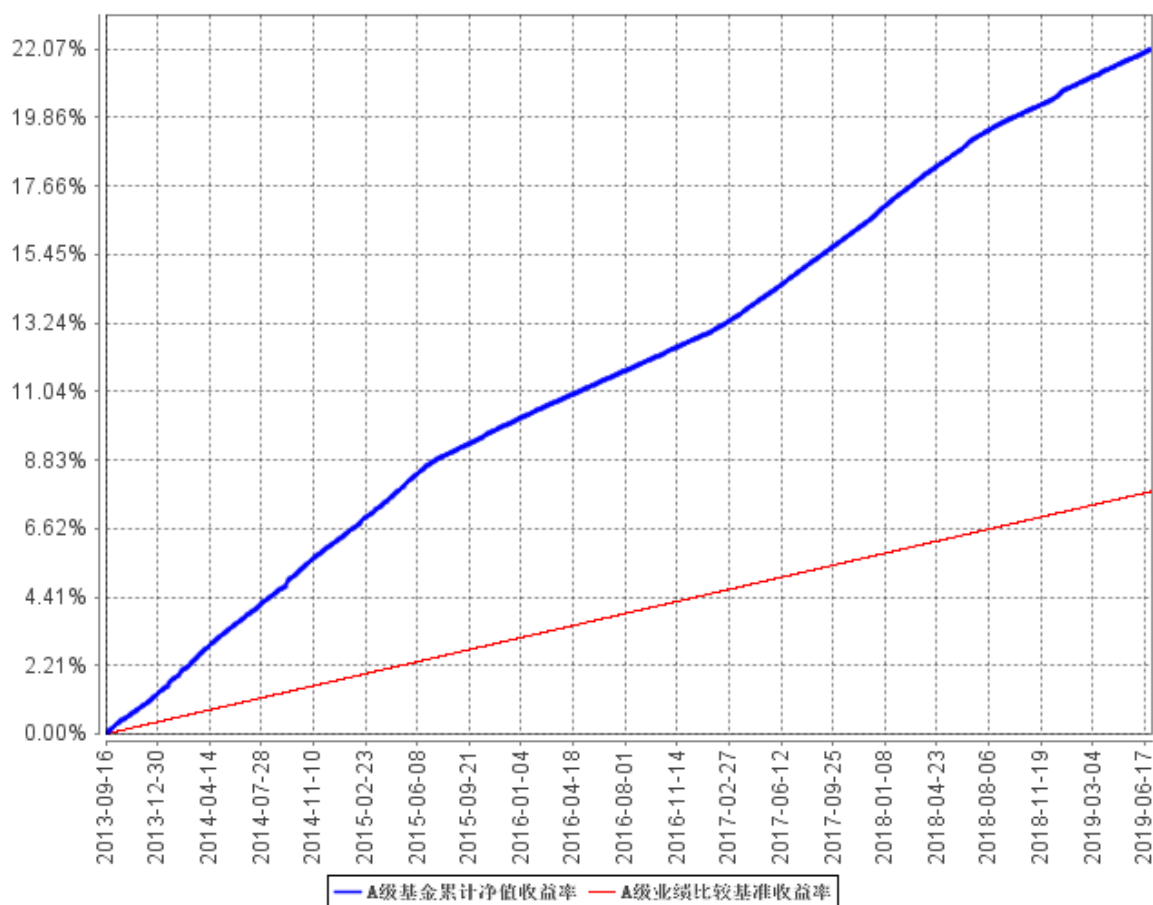
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2143%	0.0049%	0.1110%	0.0000%	0.1033%	0.0049%

过去三个月	0.6107%	0.0031%	0.3366%	0.0000%	0.2741%	0.0031%
过去六个月	1.2590%	0.0028%	0.6695%	0.0000%	0.5895%	0.0028%
过去一年	2.7316%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	1.3816%	0.0028%
过去三年	10.2883%	0.0031%	4.0500%	0.0000%	6.2383%	0.0031%
自基金合同生效起至今	23.7772%	0.0053%	7.8189%	0.0000%	15.9583%	0.0053%

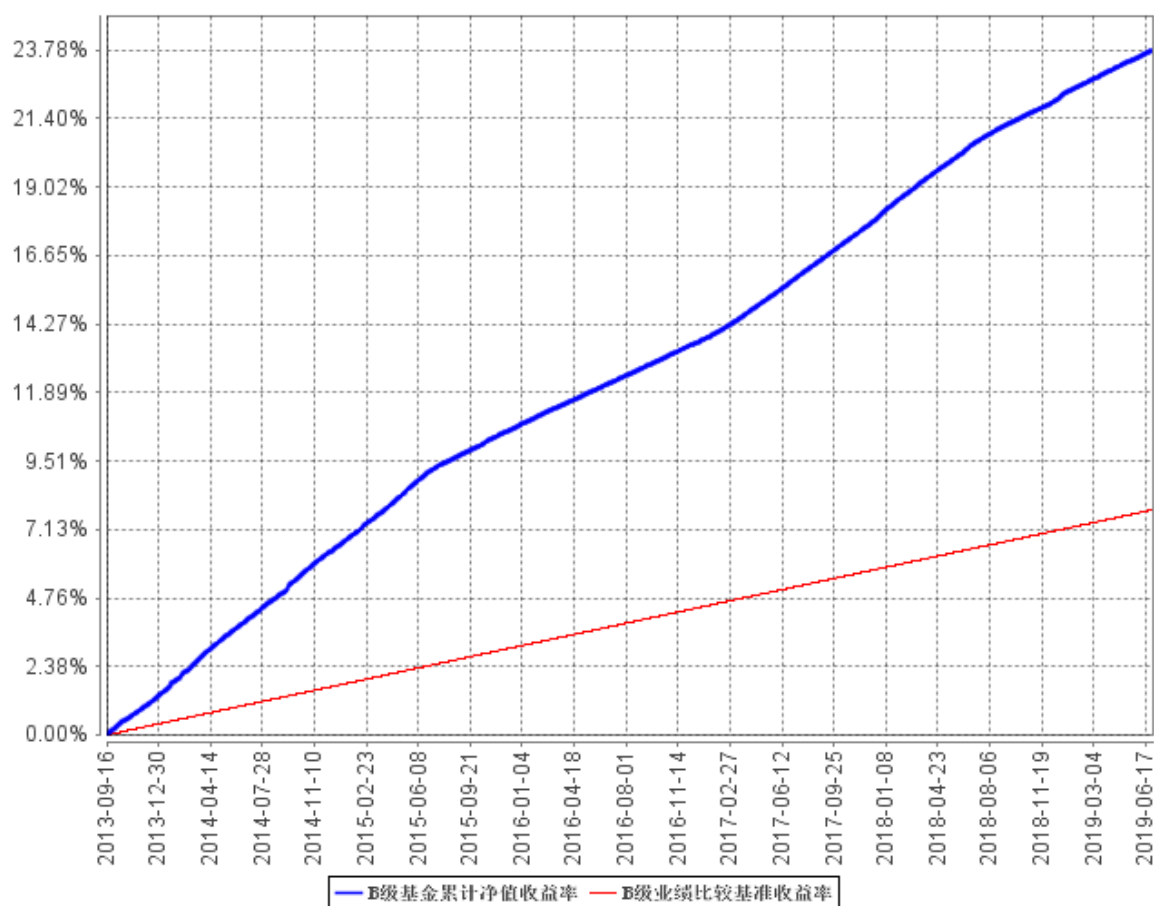
注：本基金的业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2013 年 9 月 16 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满 1 年。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2013 年 9 月 16 日至 2019 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

德邦基金管理有限公司经中国证监会（证监许可[2012]249 号）批准，于 2012 年 3 月 27 日正式成立。股东为德邦证券股份有限公司、西子联合控股有限公司、浙江省土产畜产进出口集团有限公司，注册资本为 5.9 亿元人民币。公司以修身、齐家、立业、助天下为己任，秉持长期的价值投资理念，坚守严谨的风险控制底线，致力于增加客户财富，为客户提供卓越的理财服务。

截止 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理十六只开放式基金：德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦新添利债券型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦如意货币市场基金、德邦纯债一年定期开放债券型证券投资基金、德邦景颐债券型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦锐乾债券型证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦量化优选股票型证券投资基金基金（LOF）、德邦量化新锐股票型证券投资基金（LOF）、德邦民裕进取量化精选灵活配置混合型证券投资基金以及德邦乐享生活混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张铮烁	投资二部副总监、本基金的基金经理、德邦如意货币市场基金、德邦纯债一年定期开放债券型证券投资基金、德邦锐乾债券型	2016 年 1 月 8 日	-	11 年	硕士，2007 年 7 月至 2010 年 7 月担任中诚信国际信用评级有限责任公司评级部分析师、项目经理；2010 年 8 月至 2015 年 5 月担任安邦资产管理有限责任公司固定收益部投资经理。2015 年 11 月加入德邦基金管理有限公司，现任本公司投资二部副总监、基金经理。

	证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。				
陈洁	本基金的基金经理、德邦纯债一年定期开放债券型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2018 年 9 月 19 日	-	6 年	硕士，2013 年 7 月至 2015 年 10 月担任上海银行股份有限公司市南管理总部（现为市南分行）同业资产投资岗。2015 年 11 月加入德邦基金管理有限公司，现任本公司基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投

投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度规定，对投资交易行为进行监察稽核，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，借助 IT 系统和人工监控等方式在各个环节严格控制交易公平执行；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并对连续两个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且未发现其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，货币政策的着重点在疏通政策传导机制、降低小微企业实际融资成本上，货币政策相机抉择的特征非常明显。与去年相比，全面宽松措施更加少见，而定向中期借贷便利（TMLF）、定向降准、增加再贴现和 SLF 额度等“精准滴灌”的方式更加常规化，逆回购操作也回归短期流动性调节工具，流动性总体合理充裕但不过分宽松，部分时点边际收紧。从货币市场利率来看，上半年，资金价格中枢较 2018 年下半年基本维持平稳，但货币市场利率的波动性显著加大。1-4 月，流动性分层现象虽较 2018 年下半年有所明显但总体仍较小。5 月，包商银行被监管层接管，使得各金融机构纷纷提高逆回购的交易对手准入门槛和质押券标准以求自保，期间，为维持市场稳定，央行流动性投放更加频繁，银行间流动性现象大幅加剧，同时大型银行和中小银行存单发行也出现分层现象，以股份制为代表的大型银行流动性极为充裕，平稳跨季，而中小型银行存单发行较为困难。2019 年上半年，3 个月股份制行同业存单发行利率低位徘徊，最高仅触及 3.05% 附近。

基本面方面，2019 年上半年，继一季度经济金融数据出现超预期修复后，二季度经济金融数据再度回落，经济下行的压力较一季度更加显现。工业增加值增速及固定资产投资增速持续出现

下滑，房地产投资增速也开始回落，PMI 指数也重新掉落至 50 荣枯线以下，而贸易战的长期影响尚未完全显现。通胀虽有上行但主要由食品价格推动，核心通胀延续下行趋势反映终端需求欠佳。

2019 年上半年，利率债长端收益率先上后下。一季度，利率债长端收益率整体震荡走平。4 月，受一季度宏观经济金融数据超预期、货币政策预期收紧等影响，收益率快速上行，10 年国债收益率振幅达 80BP 之多。进入 5 月，随着贸易争端再起波澜叠加经济重新下行、央行维稳释放充足流动性，长端收益率再度回落，但仍显著高于一季度的中枢水平。截至 2019 年 6 月末，10 年国债收益率报 3.22%附近，较年初上行 5BP，收益率曲线平坦化上行。

报告期内，本基金严格遵守货币基金相关法律法规，保持较为稳健的投资风格，按照法律法规所规定的品种、久期、杠杆比例等要求进行投资操作，并严格把控信用风险，优选投资标的。同时，本基金密切跟踪经济基本面、政策面、资金面等情形，做好组合投资安排，在预期资金紧张的时点，提前预备充足的流动性，做好基金的流动性管理，努力为投资人赚取合理收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期德邦德利货币 A 的基金份额净值收益率为 1.1382%，本报告期德邦德利货币 B 的基金份额净值收益率为 1.2590%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，基本面将对债券市场提供有利支撑，经济下行压力凸显，工业增加值增速及固定资产投资增速持续出现下滑，房地产投资也开始高位回落，PMI 指数也重新掉落至 50 荣枯线以下，而贸易战的长期影响尚未完全显现，基建投资有支撑但更多的是托底作用、难以大幅回升，通胀上行压力可控。同时，“包商银行事件”影响深远，同业信用收缩可能拖累实体经济信用投放。在此背景下，货币政策的转向也会比较犹豫，流动性仍需保持合理充裕，但货币政策进一步全面放松的可能性较小，预计仍将更强调结构性、精准滴灌、相机抉择，货币市场利率中枢易上难下。据此，预计利率债长端仍有震荡下行的空间，但由于绝对位置已较低，预计空间不大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《德邦基金基金估值业务管理制度》、《德邦基金估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员包括公司分管运营的副总经理、分管投资副总经理或投资总监、督察长、基金经理（或投资经理）、运营与数据中心负责人、基金会计部负责人、监察稽核部代表及风险控制人员等相关专业人士组成。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。在发生了影响估值政策和程序

的有效性、适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议批准后执行。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。本报告期内，德邦德利 A 实施利润分配金额为 1,348,638.16 元，德邦德利 B 实施利润分配的金额为 19,910,579.67 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人或基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：德邦德利货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	228,158,146.18	79,016,045.52
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,995,436,909.14	686,970,100.55
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,985,436,909.14	656,970,100.55
资产支持证券投资		10,000,000.00	30,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	840,223,620.34	352,290,448.45
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	5,008,556.06	4,206,898.31
应收股利		-	-
应收申购款		1,086,846.85	3,987,633.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,069,914,078.57	1,126,471,126.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		19,800,000.00	-
应付管理人报酬		371,650.65	359,279.35
应付托管费		112,621.44	108,872.52
应付销售服务费		28,942.12	37,960.79
应付交易费用	6.4.7.7	45,596.90	37,627.07
应交税费		28,712.22	44,004.47

应付利息		-	-
应付利润		1,419,248.94	1,859,788.12
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	192,437.74	469,000.00
负债合计		21,999,210.01	2,916,532.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,047,914,868.56	1,123,554,593.98
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,047,914,868.56	1,123,554,593.98
负债和所有者权益总计		3,069,914,078.57	1,126,471,126.30

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，德邦德利货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 88,633,676.43 份；德邦德利货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,959,281,192.13 份。德邦德利货币份额总额合计为 3,047,914,868.56 份。

6.2 利润表

会计主体：德邦德利货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		25,544,649.48	73,353,336.22
1.利息收入		25,494,521.57	73,414,248.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,514,477.63	32,532,670.75
债券利息收入		14,701,323.19	35,023,116.68
资产支持证券利息收入		271,051.76	219,335.10
买入返售金融资产收入		7,007,668.99	5,639,126.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		50,127.91	-60,912.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	50,000.51	-60,871.35
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	127.40	-41.28
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-

列)			
减：二、费用		4,419,863.10	8,536,283.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,790,549.65	5,331,205.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	845,621.08	1,615,516.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	214,517.28	475,662.83
4. 交易费用	6.4.7.19	341.08	-
5. 利息支出		411,221.86	845,866.34
其中：卖出回购金融资产支出		411,221.86	845,866.34
6. 税金及附加		14,850.05	21,611.08
7. 其他费用	6.4.7.20	142,762.10	246,421.33
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		21,124,786.38	64,817,052.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		21,124,786.38	64,817,052.82

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：德邦德利货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,123,554,593.98	-	1,123,554,593.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,124,786.38	21,124,786.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,924,360,274.58	-	1,924,360,274.58
其中：1. 基金申购款	6,541,156,602.55	-	6,541,156,602.55
2. 基金赎回款	-4,616,796,327.97	-	-4,616,796,327.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-21,124,786.38	-21,124,786.38

五、期末所有者权益(基金净值)	3,047,914,868.56	-	3,047,914,868.56
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,738,579,767.52	-	3,738,579,767.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	64,817,052.82	64,817,052.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,638,187,872.82	-	-1,638,187,872.82
其中：1. 基金申购款	8,047,974,810.62	-	8,047,974,810.62
2. 基金赎回款	-9,686,162,683.44	-	-9,686,162,683.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-64,817,052.82	-64,817,052.82
五、期末所有者权益(基金净值)	2,100,391,894.70	-	2,100,391,894.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>陈星德</u>	<u>洪双龙</u>	<u>洪双龙</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

德邦德利货币市场基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1018 号文《关于核准德邦德利货币市场基金募集的批复》的核准,由基金管理人德邦基金管理有限公司向社会公开募集,基金合同于 2013 年 9 月 16 日正式生效,首次设立募集规模为 2,080,430,071.60 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人、注册登记机构均为德邦基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金、通知存款、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单、短期融资券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 06 月 30 日的财务状况以及 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生

的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
德邦基金管理有限公司（“德邦基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	基金托管人、基金代销机构
德邦证券股份有限公司（“德邦证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.8.1.1 股票交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬**6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,790,549.65	5,331,205.16
其中：支付销售机构的客户维护费	128,127.88	247,542.73

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	845,621.08	1,615,516.66

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。其计算公式为：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B	合计
德邦基金	27,330.38	74,302.94	101,633.32
德邦证券	140.94	-	140.94
民生银行	102,308.46	672.28	102,980.74
合计	129,779.78	74,975.22	204,755.00
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B	合计
德邦基金	36,205.56	144,795.23	181,000.79
德邦证券	529.32	-	529.32
民生银行	286,288.04	2,970.60	289,258.64
合计	323,022.92	147,765.83	470,788.75

注：本基金 A 类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提；B 类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。

各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
期初持有的基金份额	—	9,230,885.38
期间申购/买入总份额	—	173,981,334.51
减：期间赎回/卖出总份额	—	118,030,885.38
期末持有的基金份额	—	65,181,334.51
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	2.2026%

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
期初持有的基金份额	—	20,000,000.00
期间申购/买入总份额	13,893,250.48	38,055,917.33
减：期间赎回/卖出总份额	13,893,250.48	49,393,250.48
期末持有的基金份额	—	8,662,666.85
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	0.2100%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

德邦德利货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
-------	------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
德邦证券股 份有限公司	185,633,589.73	6.2729%	—	—

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	2,158,146.18	1,674,319.63	176,991.33	15,931.41

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间获得的利息收入为人民币 4,076.1 元，2019 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 0 元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期未发生其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.4 受限证券类别：资产支持证券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 份)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
159312	信泽 03A1	2019 年 6 月 10 日	2019 年 7 月 1 日	非公 开发 行流 通受 限	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	—

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,995,436,909.14	65.00
	其中：债券	1,985,436,909.14	64.67
	资产支持证券	10,000,000.00	0.33
2	买入返售金融资产	840,223,620.34	27.37
3	银行存款和结算备付金合计	228,158,146.18	7.43
4	其他各项资产	6,095,402.91	0.20
5	合计	3,069,914,078.57	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.27	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：本报告期内，本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	33
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	56.35	—
2	30 天(含)—60 天	29.12	—
3	60 天(含)—90 天	13.08	—
4	90 天(含)—120 天	0.98	—
5	120 天(含)—397 天 (含)	0.98	—
合计		100.52	—

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内，本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	169,381,791.95	5.56
3	金融债券	50,112,696.04	1.64
	其中：政策性金融债	50,112,696.04	1.64
5	企业短期融资券	240,080,736.09	7.88
6	中期票据	40,019,995.31	1.31
7	同业存单	1,485,841,689.75	48.75
9	合计	1,985,436,909.14	65.14

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111809232	18 浦发银行 CD232	2,500,000	249,497,679.05	8.19
2	111810553	18 兴业银行 CD553	2,000,000	199,337,206.32	6.54
3	111813116	18 浙商银行 CD116	1,000,000	99,888,701.44	3.28
4	111921176	19 渤海银行 CD176	1,000,000	99,617,266.46	3.27
5	199925	19 贴现国债 25	1,000,000	99,491,264.15	3.26
6	120312	12 进出 12	500,000	50,112,696.04	1.64

7	111814203	18 江苏银行 CD203	500,000	49,947,916.59	1.64
8	111995974	19 厦门国际银行 CD050	500,000	49,931,498.51	1.64
9	111817167	18 光大银行 CD167	500,000	49,930,097.01	1.64
10	111808265	18 中信银行 CD265	500,000	49,928,007.44	1.64

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的最高值	0.1114%
报告期内偏离度的最低值	0.0171%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0570%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	159312	信泽 03A1	100,000	10,000,000.00	0.33

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

兴业银行股份有限公司存在资产托管部副总经理任职时“不符合法定条件，未通过相关高级管理人员证券投资法律知识考试，不具备任职资格”的情形。上海证监局责令兴业银行股份有限公司于 2018 年 10 月 25 日前整改，健全基金托管业务内部控制制度，加强从业人员管理，并于 2018 年 10 月 25 日前提交整改报告。

2018 年 12 月 7 日，银保监会发布处罚决定，对渤海银行罚款 2530 万元。原因为渤海银行内控管理严重违反审慎经营规则、理财及自营投资资金违规用于缴交土地款、理财业务风险隔离不到位、为非保本理财产品提供保本承诺、同业投资他行非保本理财产品审查不到位。

经过分析，以上事件对兴业银行、渤海银行的经营未产生重大的实质影响，对其偿债能力影响有限。本基金持有兴业银行、渤海银行的同业存单符合法律法规及公司制度流程的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
3	应收利息	5,008,556.06
4	应收申购款	1,086,846.85
8	合计	6,095,402.91

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入的原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
德邦 德利 货币 A	6,741	13,148.45	10,944,370.98	12.35%	77,689,305.45	87.65%
德邦 德利 货币 B	47	62,963,429.62	2,947,271,930.97	99.59%	12,009,261.16	0.41%
合计	6,788	449,015.15	2,958,216,301.95	97.06%	89,698,566.61	2.94%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	300,920,255.73	9.87%
2	保险类机构	300,000,000.00	9.84%
3	保险类机构	300,000,000.00	9.84%
4	券商类机构	200,000,000.00	6.56%
5	保险类机构	200,000,000.00	6.56%
6	保险类机构	199,301,741.16	6.54%
7	保险类机构	190,000,000.00	6.23%
8	券商类机构	170,533,344.33	5.60%
9	信托类机构	100,000,000.00	3.28%
10	券商类机构	78,000,000.00	2.56%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	德邦德利货币 A	1,058,033.86	1.1937%

	合计	1,058,033.86	1.1937%
--	----	--------------	---------

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	德邦德利货币 A	10~50
	德邦德利货币 B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	德邦德利货币 A	0~10
	德邦德利货币 B	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
基金合同生效日（2013 年 9 月 16 日）基金份额总额	1,422,469,897.34	657,960,174.26
本报告期期初基金份额总额	136,819,146.45	986,735,447.53
本报告期期间基金总申购份额	191,851,660.03	6,349,304,942.52
减：本报告期期间基金总赎回份额	240,037,130.05	4,376,759,197.92
本报告期期末基金份额总额	88,633,676.43	2,959,281,192.13

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2019 年 6 月 5 日公告，李定荣先生离任公司督察长，陈星德先生代任公司督察长。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘其审计的会计师事务所。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自基金合同生效日起至本报告期末，向本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	2	-	-	-	-	-

东北证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择基金专用交易单元的基本选择标准：

- （1）注册资本不低于 1 亿元人民币；
- （2）财务状况良好，各项风险监控指标符合证监会的相关规定；
- （3）经营行为规范，未就交易单元发生违约或侵权行为；
- （4）内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足投资组合资产运作高度保密的要求；
- （5）具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理各投资组合进行证券交易的需要；
- （6）研究实力较强，能根据需求提供质量较高的研究报告，以及相应的信息咨询服务；
- （7）收取的佣金费率合理。

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

- （1）研究部按照上述选择标准对证券公司进行初步筛选，经投资总监批准后提请总经理审批；
- （2）交易部办理相关交易单元，信息技术部、基金事务部和监察稽核部等相关部门配合完成交易单元租用的技术准备、参数调整及合同签订并及时通知各投资组合的托管机构等事宜。

2、本报告期内，本基金未新增、减少租用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
德邦证券	-	-	532,500,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内本基金未有偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101 – 20190109	251,998,861.65	103,331,348.50	355,330,210.15	0.00	0.00 %
	2	20190111 – 20190116	251,998,861.65	103,331,348.50	355,330,210.15	0.00	0.00 %
	3	20190522 – 20190602	251,998,861.65	103,331,348.50	355,330,210.15	0.00	0.00 %
	4	20190101 – 20190129	301,363,697.20	4,019,497.47	4,462,938.94	300,920,255.73	9.87 %
	5	20190220 – 20190225	301,363,697.20	4,019,497.47	4,462,938.94	300,920,255.73	9.87 %
	6	20190530 – 20190626	301,363,697.20	4,019,497.47	4,462,938.94	300,920,255.73	9.87 %
产品特有风险							
1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响； 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动； 4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合							

同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019 年 3 月 15 日，本基金管理人在中国证监会指定媒体及基金管理人网站刊登了《德邦基金管理有限公司关于住所变更的公告》，具体内容详见公告。

2019 年 3 月 26 日，本基金管理人在中国证监会指定媒体及基金管理人网站刊登了《德邦基金管理有限公司关于办公地址变更的公告》，具体内容详见公告。

2019 年 6 月 5 日，本基金管理人在中国证监会指定媒体及基金管理人网站刊登了《德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，具体内容详见公告。

德邦基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日