德邦德利货币市场基金 2016年年度报告摘要

2016年 12 月 31 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:2017 年 3 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 2017 年 03 月 24 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。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§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	8,925,823,109.80 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	171,026,400.87 份	8,754,796,708.93 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	李定荣	罗菲菲
	联系电话	021-26010999	010-58560666
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	tgbfxjtzx@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

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年		2015年		2014年	
	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
本期已实现收益	4,930,487.93	338,650,914.26	11,767,850.48	166,038,858.52	11,349,311.07	33,345,700.68
本期利润	4,930,487.93	338,650,914.26	11,767,850.48	166,038,858.52	11,349,311.07	33,345,700.68
本期净值收益率	2.3953%	2.6416%	3.6704%	3.9202%	4.8869%	5.1370%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末基金资产净值	171,026,400.87	8,754,796,708.93	230,607,481.77	15,599,767,396.11	484,381,938.63	3,335,831,964.23
期末基金份额净值	1	1	1	1	1	1
3.1.3 累计期末指标	2016年末		2015年末		2014年末	
累计净值收益率	12.8110%	13.7077%	10.1721%	10.7813%	6.2714%	6.6023%

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持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益要低于所列数字。

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

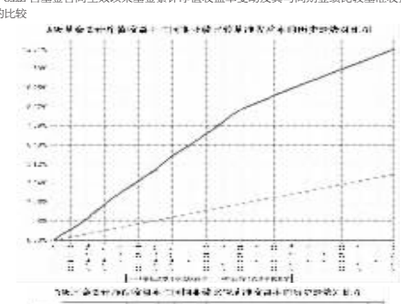
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5969%	0.0029%	0.3403%	0.0000%	0.2566%	0.0029%
过去六个月	1.1939%	0.0026%	0.6805%	0.0000%	0.5134%	0.0026%
过去一年	2.3953%	0.0023%	1.3537%	0.0000%	1.0416%	0.0023%
过去三年	11.3512%	0.0067%	4.0537%	0.0000%	7.2975%	0.0067%
自基金合同生效起至今	12.8110%	0.0065%	4.4495%	0.0000%	8.3615%	0.0065%

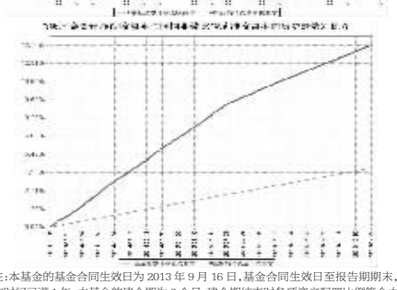
德邦德利货币 B

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
过去三个月	0.6577%	0.0029%	0.3403%	0.0000%	0.3174%	0.0029%
过去六个月	1.3161%	0.0026%	0.6805%	0.0000%	0.6356%	0.0026%
过去一年	2.6416%	0.0023%	1.3537%	0.0000%	1.2879%	0.0023%
过去三年	12.1556%	0.0067%	4.0537%	0.0000%	8.1019%	0.0067%
自基金合同生效起至今	13.7077%	0.0065%	4.4495%	0.0000%	9.2582%	0.0065%

注:本基金收益分配为按月结转份额。

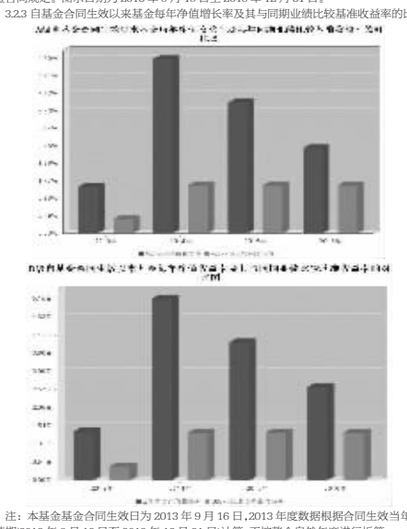
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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 2016 年 12 月 31 日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同生效日为 2013 年 9 月 16 日,2013 年度数据根据合同生效当年实际存续期(2013 年 9 月 16 日至 2013 年 12 月 31 日)计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

德邦德利货币 A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016	4,918,465.75	402,493.73	-390,471.55	4,930,487.93	
2015	13,777,527.17	854,799.60	-2,864,476.29	11,767,850.48	
2014	10,107,029.58	1,829,006.92	-586,725.43	11,349,311.07	
合计	28,803,022.50	3,086,300.25	-3,841,673.27	28,047,649.48	
德邦德利货币 B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016	338,265,288.23	7,419,896.87	-7,034,270.84	338,650,914.26	
2015	137,902,815.84	15,910,050.79	12,225,991.89	166,038,858.52	
2014	25,036,509.18	3,466,503.93	4,842,687.57	33,345,700.68	
合计	501,204,613.25	26,796,451.59	10,034,408.62	538,035,473.46	

§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 2 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 2016 年 12 月 31 日,本基金管理人共管理二十只开放式基金:德邦多元回报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 9 个月定期开放债券型证券投资基金、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、德邦德焕 9 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦德景一年定期开放债券型证券投资基金、德邦现金宝交易型货币市场基金、德邦锐瑞债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、德邦纯债 18 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金、德邦德利货币市场基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦新动力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、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星稳健灵活配置混合型证券投资基金和德邦新添利灵活配置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		
陈利	本基金的基金经理、德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金、德邦如意货币市场基金、德邦纯债 18 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦现金宝交易型货币市场基金的基金经理。	2015 年 7 月 6 日	-	5年	硕士,曾在德邦证券股份有限公司投资研究部担任助理研究员,2011 年 11 月起担任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员,现任本公司基金经理。
张铮栎	本基金的基金经理、德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金、德邦如意货币市场基金、德邦现金宝交易型货币市场基金的基金经理。	2016 年 1 月 8 日	-	9年	硕士,2007 年 7 月至 2010 年 7 月在中诚信国际信用评级有限责任公司评级部担任分析师,项目经理,2010 年 8 月至 2015 年 5 月在安邦资产管理有限责任公司固定收益部担任投资经理。2015 年 11 月加入德邦基金管理有限公司担任基金经理助理,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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易控制机制,确保管理的不同受托资产得到公平对待,保护投资者合法权益。

在投资决策方面,本基金管理人建立了科学的研究方法以及规范的研究管理平台,实行证券备选库和交易对手备选库制度,各受托资产之间实行防火墙制度,通过系统的投资决策方法和明确的投资授权制度,保证受托投资决策的客观性和独立性。

在交易执行方面,本基金管理人实行集中交易制度,并建立了公平的交易分配流程,保证投资指令得以公平对待。对以本基金管理人的名义参与债券一级市场申购、非公开发行股票申购等令得的,相关基金经理或投资经理应独立确定各受托资产拟申购的价格和数量,基金管理人在获配额度后,按照价格优先、比例分配的原则进行分配。对以各受托资产名义参与银行间交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的,交易部应充分询价,利用市场公认的第三方信息对交易价格的公允性进行审查,确保各受托资产获得公平的交易机会。

监察稽核部门对投资交易行为进行定期或不定期检查,重点关注公平交易的执行情况和异常交易行为的监控情况。严禁同一受托资产的同日反向交易及其他可能导致不公平或利益输送的交易行为,但完全按照有关指数构成比例进行证券投资的受托资产除外。严格控制不同受托资产间的同日反向交易,禁止可能导致不公平交易或利益输送的同日反向交易行为。监察稽核部门对不同受托资产,尤其是同一位基金经理或投资经理管理的不同受托资产同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同受托资产临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。发现异常交易情况的,可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。监察稽核部门对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,对于异常交易发生前后不同受托资产买卖该异常交易证券的情况进行分析。发现异常交易情况的,可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。监察稽核部门编制定期公平交易报告,重点分析本基金管理人管理的不同受托资产整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及同一期间、不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)不同受托资产同向交易的交易价差。公平交易报告由基金经理或投资经理确认后报督察长、总经理审阅。

4.3.2 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把制交易公平执行;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,并对连续四个季度期间内、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。

4.3.3 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

2016 全年债券及货币市场波动率加大。4 月中旬,受债券市场信用事件连续突发以及金融业营改增即将落地不确定性的影响,债券市场出现了一波踩踏下跌行情,信用利差急速扩大,尤以中高收益债券更为显著。后受权威人士经济 L 型发言、英国公投脱欧黑天鹅以及营改增两次补丁,引导了市场收益率一波可观的下行,下行至四季度初偏离紧张资金面。10 月中下旬随着央行表外理财纳入 MPA 考核测算的通知及资金面紧张程度加深影响,债券收益率迎转上行。11 月中下旬,同业存单发行价格高位上行,市场受货币基金赎回抛盘及银行理财委外流动性要求传言影响,短端收益率急速上行,收益率曲线呈现熊平形态。

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,在月末、季末、年末等时点,提前预备充足的流动性,做好基金的流动性管理,努力为投资人赚取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,德邦德利货币 A 基金份额净值收益率为 2.3953%,同期业绩比较基准收益率为 1.3537%。德邦德利货币 B 基金份额净值收益率为 2.6416%,同期业绩比较基准收益率为 1.3537%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从基本面来看,宏观层面全年经济呈现触底反弹态势,下半年经济数据先行指标明显好转,PMI 持续处于荣枯线之上已达 10 个月;微观层面,上市公司盈利能力回升,部分去产能明显的工业企业扭亏为盈,整体企业盈利能力好转,预计 2017 年经济短期仍有较强上升动力。通货膨胀角度,PPI 由负转正并持续快速上行,未来需进一步关注大宗商品上升力度,以及 PPI 持续上升对 CPI 反弹的影响。政策面上,10 月 28 日中央政治局月度会议,提出"要坚持稳健的货币政策,在保持流动性合理充裕的同时,注重抑制资产泡沫和防范经济金融风险",美国加息步伐继续,全球主要发达经济体正面临全球货币政策的转折点,央行明确维持稳健中性的货币政策。资金面,受外汇占款减少导致基础货币再生减少,银行超储率下降,央行公开市场放长缩短并上调公开市场逆回购利率,MPA 将银行表外理财纳入广义贷款测算影响资金从银行向非银流动成本变高等影响,杠杆资金成本抬升,2017 年资金面暂时未看到有改善的因素出现。

预期未来一段时间,资金成本下行较难,市场去杠杆行为仍将继续。本基金将控制产品的平均剩余期限,做好流动性管理,并抓取市场收益率走高机会,提高产品收益率。

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总经理、分管投资副总或投资总监、督察长、基金经理、金融工程与量化投资部、研究发展部、运作保障部负责人、基金会计及监察稽核部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及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,德邦德利货币市场基金 2016 年年度报告利货币 A 实施利润分配的金额为 4930487.93 元,德邦德利货币 B 实施利润分配的金额为 338650914.26 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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对德邦德利货币市场基金的托管过程中,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遵规守信、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,本托管人对本基金管理人 – 德邦基金管理有限公司在德邦德利货币市场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、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有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。本报告期内,德邦德利货币 A 实施利润分配的金额为 4930487.93 元,德邦德利货币 B 实施利润分配的金额为 338650914.26 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由德邦德利货币市场基金管理人 –– 德邦基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2017)审字第 60982868_B08 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	德邦德利货币市场基金全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的德邦德利货币市场基金财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人德邦基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。注册会计师的责任
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当地的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了德邦德利货币市场基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	陈 露 / 阎育化
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
审计报告日期	2017年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:德邦德利货币市场基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款		1,932,803,634.75	7,523,891,271.51
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		4,039,396,184.19	4,522,009,092.36
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,034,351,638.18	4,522,009,092.36
资产支持证券投资		5,044,546.01	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		2,901,572,192.36	4,014,400,042.59
应收证券清算款		-	-
应收利息		38,869,715.11	71,204,124.78
应收股利		-	-
应收申购款		24,308,018.41	17,894,780.84
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		8,936,949,744.82	16,149,399,312.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	299,999,350.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,684,918.01	3,078,820.92
应付托管费		813,611.49	932,976.04
应付销售服务费		122,251.27	138,862.21
应付交易费用		165,347.11	81,244.26
应交税费		-	-
应付利息		-	47,931.24
应付利润		6,780,507.14	14,205,249.53
递延所得税负债		-	-
其他负债		560,000.00	540,000.00
负债合计		11,126,635.02	319,024,434.20
所有者权益:			
实收基金		8,925,823,109.80	15,830,374,877.88
未分配利润		-	-
所有者权益合计		8,925,823,109.80	15,830,374,877.88
负债和所有者权益总计		8,936,949,744.82	16,149,399,312.08

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 8,925,823,109.80 份,其中 A 类份额 171,026,400.87 份;B 类份额 8,754,796,708.93 份。

7.2 利润表

会计主体:德邦德利货币市场基金

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		405,212,220.28	206,034,062.91
1.利息收入		404,988,699.04	192,353,474.58
其中:存款利息收入		101,291,821.87	68,700,698.85
债券利息收入		244,215,469.54	105,618,879.89
资产支持证券利息收入		21,297.44	-
买入返售金融资产收入		59,460,110.19	18,033,895.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-2,942,478.76	13,680,588.33
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-2,947,316.09	13,680,588.33
资产支持证券投资收益		4,837.33	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		3,166,000.00	-
减:二、费用		61,630,818.09	28,227,353.91
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	43,860,235.69	17,861,269.75
2. 托管费	7.4.8.2.2	13,290,980.46	5,412,505.89
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	1,828,912.42	1,335,063.11
4. 交易费用		-	4,500.00
5. 利息支出		2,206,954.52	3,130,112.55
其中:卖出回购金融资产支出		2,206,954.52	3,130,112.55
6. 其他费用		443,735.00	483,902.61
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		343,581,402.19	177,806,709.00
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		343,581,402.19	177,806,709.00

7.3 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:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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)	15,830,374,877.88	-	15,830,374,877.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	343,581,402.19	343,581,402.19
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-6,904,551,768.08	-	-6,904,551,768.08
其中:1.基金申购款	80,007,458,762.53	-	80,007,458,762.53
2.基金赎回款	-86,912,010,530.61	-	-86,912,010,530.61
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)	-	-343,581,402.19	-343,581,402.19
五、期末所有者权益(基金净值)	8,925,823,109.80	-	8,925,823,109.80

项目	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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)	3,820,213,902.86	-	3,820,213,902.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	177,806,709.00	177,806,709.00
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	12,010,160,975.02	-	12,010,160,975.02
其中:1.基金申购款	40,487,519,211.25	-	40,487,519,211.25
2.基金赎回款	-28,477,358,236.23	-	-28,477,358,236.23
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)	-	-177,806,709.00	-177,806,709.00
五、期末所有者权益(基金净值)	15,830,374,877.88	-	15,830,374,877.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

易强 刘为臻

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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他具有良好流动性的货币市场工具。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。

本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部颁布的《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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行(企业会计准则)估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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。

7.4.3 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 营业税、增值税

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,继续免征营业税;

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