

## 德邦德利货币市场基金

### 2015 第四季度 报告

2015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  
报告送出日期:2016年01月20日

#### 1.1 重要提示

基金管理人、德邦基金管理有限公司和中国民生银行股份有限公司承诺: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责任。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2016年01月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。基金管理人保证上述资料的真实性、准确性和完整性。本基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。本报告自2015年10月10日起至12月31日止。

#### 8.2 基金产品概况

基金名称	德利货币市场基金
基金代码	100000
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日期	2013年04月25日
报告期末基金份额总额	15,430,274,877.60份
投资目标	在控制风险的前提下,力求实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在保持投资组合高度流动性的前提下,结合国内外宏观经济环境、金融货币政策、货币市场利率、信用评级等因素,合理配置资产,选择流动性好、信用等级高、期限适宜的债券品种,分散投资于国债、央行票据、政策性金融债、商业银行金融债、企业债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、货币市场基金、债券回购、银行存款、同业拆借、信托计划、权证、股指期货、国债期货、股指期货、股指期货等金融工具,追求组合的长期稳定和持续增值,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,本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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
下属分级基金的基金简称	德利货币(A)
下属分级基金的交易币种	人民币
报告期末下属分级基金的规模	200,607,481.72份

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2015年10月10日至2015年12月31日	德利货币(A)	德利货币(B)
1.本期利润总额	1,715,158.54	85,679,768.18	-
2.本期费用	1,715,158.54	85,679,768.18	-
3.期末未分配利润	230,607,481.72	15,599,767,396.11	-

注:1.本基金的投资收益包含基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和所得税后的余额,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计量,因此公允价值变动收益为零,本基金收益除利息收入外,其他收益均不体现持有人的交易成本,计入费用后实际收益低于无列示数字。  
2.本基金净值增长率不受持有人的交易成本的影响。  
3.2.1 本期所有基金份额净值增长率及与其同期业绩比较基准收益率的比较  
1.德利货币(A)

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	净值增长率①-②	①-②	②-①
过去三个月	0.6828%	0.0006%	0.3499%	0.0006%	0.0009%

注:本基金净值增长率以七天通知存款利率为基准,本基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较  
3.2.2 本基金净值增长率以七天通知存款利率为基准,本基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	净值增长率①-②	①-②	②-①
过去三个月	0.7459%	0.0006%	0.3499%	0.0006%	0.0009%

注:本基金净值增长率以七天通知存款利率为基准,本基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较  
3.2.2 本基金净值增长率以七天通知存款利率为基准,本基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

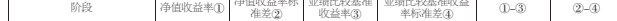


图1:本基金资产规模(单位:亿元人民币)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

## 德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金

### 2015 第四季度 报告

2015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:交通银行股份有限公司  
报告送出日期:2016年01月20日

#### 1.1 重要提示

基金管理人、德邦基金管理有限公司和中国民生银行股份有限公司承诺: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责任。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2016年01月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。基金管理人保证上述资料的真实性、准确性和完整性。本基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。本报告自2015年10月10日起至12月31日止。

#### 8.2 基金产品概况

基金名称	德邦德信中证中高收益企债指数基金
基金代码	107701
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日期	2013年04月25日
报告期末基金份额总额	110,423,018.24份
投资目标	本基金为债券型证券投资基金,通过量化的投资策略跟踪中证中高收益企债指数的表现,力求实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要采取复制策略构建债券投资组合,并跟踪标的指数的成分及其权重对投资组合进行动态调整。在正常市场情况下,力争使基金的净值增长率与业绩比较基准的跟踪偏离度控制在每年不超过1.0%,跟踪误差控制在每年不超过1.5%。本基金管理人追求基金投资收益的长期稳定增长。
业绩比较基准	中证1-3年中期收益企债指数收益率*90%+银行活期存款利率*10%
风险收益特征	从整体运作来看,本基金预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	德邦基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	德信A
下属分级基金的代码	150133
报告期末下属分级基金的份额总额	14,254,138.00份

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2015年10月10日至2015年12月31日	德利货币(A)	德利货币(B)
1.本期利润总额	1,530,633.44	-	-
2.本期费用	1,530,633.44	-	-
3.期末未分配利润	1,530,633.44	-	-
4.期末未分配利润占基金资产净值的比例	0.0105	-	-
5.期末未分配利润占基金资产净值的比例	117,308,384.19	-	-

注:1.本基金的投资收益包含基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和所得税后的余额,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计量,因此公允价值变动收益为零,本基金收益除利息收入外,其他收益均不体现持有人的交易成本,计入费用后实际收益低于无列示数字。  
2.本基金净值增长率不受持有人的交易成本的影响。  
3.2.1 本期所有基金份额净值增长率及与其同期业绩比较基准收益率的比较  
1.德利货币(A)

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	净值增长率①-②	①-②	②-①
过去三个月	1.05%	0.04%	0.46%	0.05%	0.59%

注:本基金净值增长率以中证中高收益企债指数\*90%+银行活期存款利率\*10%为基准,本基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较  
3.2.2 本基金净值增长率以中证中高收益企债指数\*90%+银行活期存款利率\*10%为基准,本基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



图1:本基金资产规模(单位:亿元人民币)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)

图例:德利货币(A);德利货币(B);德利货币(C)