

德邦弘利货币市场基金清算报告

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
清算报告公告日：2018年8月22日

一、重要提示

德邦弘利货币市场基金（以下简称“本基金”）由德邦基金管理有限公司担任基金管理人，由交通银行股份有限公司担任基金托管人，本基金根据 2016 年 11 月 24 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予德邦弘利货币市场基金注册的批复》（证监许可[2016]2840 号文）进行募集，基金合同于 2017 年 7 月 12 日生效。

根据《德邦弘利货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）“第五部分 基金备案”中，“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金合同终止并按照基金合同的约定进入清算程序，无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”的条款以及《基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的有关规定，截至 2018 年 6 月 20 日，本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已触发《基金合同》中约定的本基金终止条款。为维护基金份额持有人的利益，根据《基金合同》有关规定，本基金基金合同终止并按照基金合同的约定进入清算程序，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人已于 2018 年 6 月 21 日、2018 年 6 月 22 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告，详见《德邦弘利货币市场基金基金合同终止及基金财产清算的公告》、《德邦弘利货币市场基金基金合同终止及基金财产清算的提示性公告》。

本基金自 2018 年 6 月 21 日起进入清算期，由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、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和通力律师事务所组成基金财产清算小组进行基金财产清算，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称：	德邦弘利货币市场基金
基金简称：	德邦弘利货币
基金交易代码：	A 类：004515；B 类：004516
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2017 年 7 月 12 日
基金管理人名称：	德邦基金管理有限公司
基金托管人名称：	交通银行股份有限公司

2、基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产风险、保持基金资产高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，在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的基础上，科学预计未来利率走势，择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具，在控

制利率风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。

1、短期利率水平预期策略

通过对国内外宏观经济趋势、国家货币政策导向和短期资金供求情况的深入分析，对短期利率走势形成合理预期，并据此调整基金货币资产的配置策略。当预期短期利率呈下降趋势时，侧重配置期限稍长的短期金融工具；反之，则侧重配置期限较短的金融工具。

2、收益率曲线分析策略

收益曲线策略即在不同期限投资品种之间进行的配置，通过考察收益率曲线的动态变化及预期变化，寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系，反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。

3、组合剩余期限策略、期限配置策略

结合宏观经济和利率预期分析，动态确定并控制投资组合的平均剩余期限，以满足可能的、突发的现金需求，同时保持组合的稳定收益；特别在债券投资中，根据收益率曲线的情况，投资一定剩余期限的品种，稳定收益，锁定风险，满足组合目标期限。

4、类别品种配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具（国债、金融债、央行票据、回购等）的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

5、流动性管理策略

本基金将在动态测算基金投资者净赎回资金需求、季节性资金流动等因素的前提下，对基金资产进行合理配置，通过实时追踪基金资产的现金库存、资产变现能力等因素，合理配置和动态调整组合现金流，在保持基金财产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益，结合持续性投资的方法，将各类属资产的到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。

6、资产支持证券投资策略

本基金将本着谨慎性原则投资资产支持证券，深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，通过持续的信用评级分析和跟踪、量化模型评估、投资限额控制等方法对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制，并在此基础上提高组合收益。基金管理人将综合运用久期管理、个券选择、信用产品交易策略等各种策略，精选品种，为基金份额持有人获取长期稳定收益。

7、套利策略

不同交易市场或不同交易品种受参与群体、交易模式、环境冲击、流动性等因

	<p>素差异化影响而出现定价差异，从而产生套利机会。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上，适度进行跨市场或跨品种套利操作，提高资产收益率。如跨银行间和交易所的跨市场套利，期限收益结构偏移中的不同期限品种的互换操作（跨期限套利）。</p> <p>8、回购策略</p> <p>当预期市场利率下跌或者利率走势平稳时，通过将剩余期限相对较长的短期债券进行回购质押，融资后再购买短期债券。在融资成本低于短期债券收益率时，该投资策略的运用可实现正收益。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：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。

三、财务会计报告

资产负债表

会计主体：德邦弘利货币市场基金

最后运作日：2018年6月20日

单位：人民币元

资 产	最后运作日	负债和所有者权益	最后运作日
	2018/6/20		2018/6/20
资 产：		负债：	
银行存款	323,328.31	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产		卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付赎回费	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	11.00
基金投资		应付托管费	2.80
衍生金融资产		应付销售服务费	13.80
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	13,215.60	应付利息	
应收股利		应付利润	11.36
应收申购款		其他负债	225,800.00
其他资产		负债合计	225,838.96
		所有者权益：	
		实收基金	110,704.95
		未分配利润	
		所有者权益合计	110,704.95

资产合计:	336,543.91	负债与持有人权益总计:	336,543.91
-------	------------	-------------	------------

四、清算报表附注

1、清算原因

截至 2018 年 6 月 20 日,本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形,已触发《基金合同》中约定的本基金终止条款。

2、清算起始日

根据《德邦弘利货币市场基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,自 2018 年 6 月 21 日起,本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为 2018 年 6 月 21 日。

3、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起,资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致,本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自 2018 年 6 月 21 日起至 2018 年 7 月 9 日止的清算期间,基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算,全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下:

1、清算费用

按照《德邦弘利货币市场基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定,清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。但从保护基金份额持有人利益的角度出发,本基金清算期间的审计费、律师费由基金管理人承担。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 323,328.31 元,该款项由基金托管人负责保管;

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币 13,215.60 元,其中银行存款利息为人民币 11,641.20 元、应收结算备付金利息为人民币 1,574.40 元,共计人民币 13,215.60 元。该款项于 2018 年 6 月 21 日到帐。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 11.00 元,该款项于 2018 年 6 月 29 日支付。
(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2.80 元,该款项于 2018 年 6 月 29 日支付。
(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 13.80 元,该款项于 2018 年 6 月 29 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付利润为人民币 11.36 元,其中人民币 0.02 元已于 2018 年 6 月

21日从托管账户划出，人民币11.34元将于2018年7月19日结转为实收基金，并将在清算款划出日按基金份额持有人的持有比例进行划转。

(5) 本基金最后运作日其他应付款为人民币225,800.00元，其中人民币4,500.00元为应付中央国债登记结算有限责任公司账户维护费，已于2018年6月29日支付，人民币6,300元为应付银行间市场清算所股份有限公司账户维护费，已于2018年7月9日支付，应付中国证券报信息披露费用59,000.00元于2018年6月29日支付，应付上海证券报信息披露费用59,000.00元于2018年6月29日支付，应付证券时报信息披露费用59,000.00元于2018年6月29日支付，应付证券日报信息披露费用38,000.00元于2018年6月29日支付。

4、清算期间的损益情况

自2018年6月21日起至2018年7月9日止的清算期间

项目	金额（单位：人民币元）
一、清算收益	
利息收入（注1）	188.09
清算收入小计（1）	188.09
二、清算费用	
银行划款手续费	75.00
清算费用小计（2）	75.00
三、清算净收益（1）-（2）	113.09

注1：利息收入系计提的自2018年6月21日起至2018年7月9日止的清算期间的银行存款利息收入。

注2：本基金清算期间的审计费、律师费由基金管理人承担。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额（单位：人民币元）
一、最后运作日2018年6月20日基金净资产	110,704.95
加：清算期间净收益	113.09
减：2018年6月21日确认的净赎回款	132.62
加：2018年6月21日确认的净赎回款中应付利润变动部分	0.02
二、2018年7月9日基金净资产	110,685.44

资产处置及负债清偿后，2018年7月9日本基金剩余财产为人民币110,685.44元，根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、缴纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2018年7月9日至清算款划出日前一日的银行存款及存出保证金产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用，待结息日回款后再返还给基金管理人。

6、基金财产清算报告的告知安排

清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《德邦弘利货币市场基金清算审计报告》；
- (2) 《德邦弘利货币市场基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

上述备查文本存放在基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在基金管理人网站（www.dbfund.com.cn）查阅。

3、查阅方式

本报告存放在基金管理人及基金托管人住所，供公众查阅、复制。

德邦弘利货币市场基金
基金财产清算小组
2018年8月22日