

德邦纯债9个月定期开放债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

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：2018年7月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书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2018年7月18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，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：德邦纯债9个月定期开放债券型证券投资基金

基金代码：002009

基金运作方式：契约型，定期开放式

基金合同生效日：2016年3月28日

报告期末基金份额总额：62,428,1244.24份

投资目标 在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的稳定收益，力争实现基金资产的保值增值。

投资策略 本基金将综合运用久期管理、利率预期、信用评价、资产配置等策略，在严格控制风险的前提下，通过主动管理，追求超越业绩比较基准的稳定收益，力争实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准 中证综合债指数收益率×80%+一年期银行定期存款利率（税后）×20%

风险收益特征 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期收益及预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金。

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：德邦纯债9个月定期开放债券型证券投资基金

下属分级基金的交易代码：002009

报告期末下属分级基金的份额总额：91,268,362.76份

报告期末下属分级基金的资产净值：1,369,893.40份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期：(2018年4月1日—2018年6月30日)

德邦纯债9个月定期开放债券型证券投资基金

1.本期已实现收益 476,214.41

2.本期利润 200,773.07

3.加权平均基金份额净值 1.0067

4.期末基金资产净值 631,057,992.02

5.期末基金份额净值 1.0008

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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.21 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 0.05% 0.03% 0.01% 0.00%

注：德邦纯债9个月定期开放C

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 0.44% 0.07% 0.01% 0.00%

注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数收益率×80%+一年期银行定期

存款利率(税后)×20%

3.22 本基金合同生效以来基金累计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

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.23 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.24 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.25 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.26 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.27 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.28 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.29 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.30 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.31 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响真实回报，用户应关注相应费用的影响。

3.基金净值表现

3.32 本基金合同生效以来基金累计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

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金合同生效以来基金累计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

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金合同生效以来基金累计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

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金合同生效以来基金累计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

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金合同生效以来基金累计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

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金合同生效以来基金累计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

德邦纯债9个月定期开放A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.30% -0.06%

注：1.本基金合同生效以来基金累计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