

# 德邦安鑫混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：德邦基金管理有限公司  
基金托管人：中国民生银行股份有限公司  
清算报告出具日：2022年12月5日  
清算报告公告日：2022年12月6日

## 一、重要提示

德邦安鑫混合型证券投资基金（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，由中国民生银行股份有限公司担任基金托管人，本基金根据 2020 年 2 月 7 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予德邦安鑫混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2020]228 号文）进行募集，《德邦安鑫混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于 2020 年 3 月 18 日生效。

根据《德邦安鑫混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《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，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。”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，为维护基金份额持有人的利益，德邦安鑫混合型证券投资基金的基金管理人德邦基金管理有限公司经与本基金的基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于终止德邦安鑫混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称《本议案》）。《本议案》于 2022 年 10 月 11 日获表决通过并于该日起生效。

基金管理人已于 2022 年 10 月 12 日在《证券时报》、中国证监会规定网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）及基金管理人公司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《德邦基金管理有限公司关于德邦安鑫混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金自 2022 年 10 月 13 日起进入清算程序，由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、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市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，上海市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：	德邦安鑫混合型证券投资基金
基金简称：	德邦安鑫混合
基金交易代码：	A 类：009071； C 类：009072
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2020 年 3 月 18 日
基金最后运作日	2022 年 10 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：	中国民生银行股份有限公司

### 2、基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求基金资产的稳定增值。
------	-----------------------------

## 投资策略

## 1、资产配置策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，确定信用债、金融债、国债和债券回购等的投资比例。

## 2、股票投资策略

本基金将在行业配置的基础上，“自下而上”地精选出具有持续成长性、竞争优势、估值水平合理的优质个股。

（1）基本面定性分析：本基金将重点考察分析包括公司投资价值、核心竞争力、公司治理结构、市场开发能力、商业模式优势、资源优势等方面的综合竞争实力，挖掘具有较大成长潜力的公司。

（2）价值定量分析：本基金通过对上市公司的成长能力、收益质量、财务品质、估值水平进行价值量化评估，选择价值被低估、未来具有相对成长空间的上市公司股票，形成优化的股票池。

## 3、债券投资策略

债券投资方面，本基金亦采取“自上而下”的投资策略，通过深入分析宏观经济、货币政策和利率变化等趋势，从而确定债券的配置策略。同时，通过考察不同券种的收益率水平、流动性、信用风险等因素认识债券的核心内在价值，运用久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等投资策略进行债券组合的灵活配置。

本基金在对可转换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换债券定价模型进行估值，并结合市场流动性，投资具有较高预期投资价值的可转换债券。

## 4、衍生品投资策略

## （1）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。

## （2）股票期权的投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，通过对宏观经济、政策及法规因素和资本市场因素等的研究，结合定性和定量方法，选择流动性好、交易活跃、估值合理的期权合约进行投资。

基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。

## （3）国债期货的投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

	<p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>资产支持证券是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产，通过一定的结构性安排，对资产中的风险与收益进行分离组合，进而转换成可以出售、流通，并带有固定收入的证券的过程。资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等评估后进行投资。</p> <p>6、存托凭证投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照境内上市交易的股票投资策略执行。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 三、财务会计报告

#### 资产负债表

会计主体：德邦安鑫混合型证券投资基金

最后运作日：2022 年 10 月 12 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
	2022/10/12		2022/10/12
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	14,810,898.36	短期借款	
结算备付金	51,178.85	交易性金融负债	
存出保证金	6,357.18	衍生金融负债	
交易性金融资产	19,426,723.42	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	3,402,657.00	应付清算款	
基金投资		应付赎回款	178,540.66
债券投资	16,024,066.42	应付管理人报酬	8,504.75
资产支持证券投资		应付托管费	1,822.46
贵金属投资		应付销售服务费	3,747.69
其他投资		应付投资顾问费	
衍生金融资产		应交税费	380.21
买入返售金融资产		应付利润	
应收清算款		递延所得税负债	
应收股利		其他负债	157,722.93
应收申购款		<b>负债合计</b>	<b>350,718.70</b>
递延所得税资产		<b>净资产：</b>	
其他资产	8,333.34	实收基金	33,093,112.26
		未分配利润	859,660.19
		<b>净资产合计</b>	<b>33,952,772.45</b>
<b>资产总计：</b>	<b>34,303,491.15</b>	<b>负债与净资产总计：</b>	<b>34,303,491.15</b>

## 四、清算报表附注

### 1、清算原因

根据《德邦安鑫混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《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，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。”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，为维护基金份额持有人的利益，德邦安鑫混合型证券投资基金的基金管理人德邦基金管理有限公司经与本基金的基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于终止德邦安鑫混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称《本议案》）。《本议案》于 2022 年 10 月 11 日获表决通过并于该日起生效。

### 2、清算起始日

根据《德邦基金管理有限公司关于德邦安鑫混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2022 年 10 月 13 日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为 2022 年 10 月 13 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 2022 年 10 月 13 日起至 2022 年 11 月 21 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《德邦安鑫混合型证券投资基金基金合同》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。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 51,178.85 元，清算期间结算备付金利息收入为人民币 46.00 元，该款项中人民币 51,160.25 元已于 2022 年 11 月 2 日支付，剩余人民币 64.60 元为应收结算备付金利息，该款项将于 2022 年 12 月 21 日结息到账，到账以实际金额为准，该笔资金已由基金管理人于清算款支付日先行垫付。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 6,357.18 元，清算期间存出保证金利息收入为人民币

10.00元，该款项中人民币1,726.37元已于2022年11月2日支付，剩余人民币4,640.81元为应收结算保证金利息，该款项将于2022年12月21日结息到账，到账以实际金额为准，该笔资金已由基金管理人于清算款支付日先行垫付。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 19,426,723.42 元，其中，股票投资为人民币 3,402,657.00 元，该资产已于 2022 年 10 月 13 日全部完成处置变现，实际变现金额合计为人民币 3,347,045.22 元，已全部划入基金托管户。债券投资为人民币 16,024,066.42 元，该资产已于 2022 年 11 月 18 日全部完成处置变现，实际变现金额合计为人民币 16,066,138.66 元，已全部划入基金托管户。

(4) 本基金最后运作日持有的其他资产为人民币 8,333.34 元，为剩余未摊销完成的持有人大会公证费用，该款项已于清算期间摊销完毕。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币178,540.66元，该款项已分别于2022年10月13日和2022年10月14日全部支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币8,504.75元，该款项已于2022年11月3日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为 1,822.46 元，该款项已于 2022 年 11 月 3 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为 3,747.69 元，该款项已于 2022 年 11 月 3 日支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 380.21 元，该款项已于 2022 年 11 月 3 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 157,722.93 元，其中预提证券时报信息披露费为人民币 93,699.45 元，清算期间，对信息披露费用进行了部分减免，最终支付的 2022 年证券时报信息披露费为人民币 57,561.64 元，已于 2022 年 11 月 3 日支付；预提审计费人民币 46,848.30 元，清算期间，对审计费进行了部分减免，最终支付的清算审计费为人民币 20,000.00 元，已于 2022 年 11 月 18 日支付；预提银行间账户维护费为人民币 10,173.84 元，已于 2022 年 10 月 21 日支付人民币 9,000.00 元，剩余金额将于销户时支付。应付交易费用人民币 7,001.34 元，其中应付席位佣金费用人民币 6,476.34 元，已于 2022 年 10 月 14 日支付；应付银行间交易费用为人民币 525.00 元，已于 2022 年 10 月 21 日和 2022 年 10 月 24 日全部支付。

### 4、清算期间的损益情况-

自 2022 年 10 月 13 日起至 2022 年 11 月 21 日止的计息期间

项目	本期金额
一、收入	-4,997.29
1、利息收入	18,533.78
其中：存款利息收入	18,533.78
债券利息收入	
资产支持证券利息收入	
买入返售金融资产收入	
其他利息收入	
2、投资收益（损失以“-”填列）	-229,721.07
其中：股票投资收益	-236,807.09
债券投资收益	12,054.76
资产支持证券投资收益	
基金投资收益	
贵金属投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	-4,968.74

3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	206,189.73
4、其他收入（损失以“-”填列）	0.27
<b>二、费用</b>	<b>-10,047.21</b>
1、管理人报酬	
2、托管费	
3、销售服务费	
4、交易费用	
5、利息支出	
其中：卖出回购金融资产支出	
6、税金及附加	287.76
7、其他费用	-10,334.97
8、资产减值损失	
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”填列）</b>	<b>5,049.92</b>
减：所得税费用	
<b>四、净利润</b>	<b>5,049.92</b>

注1：利息收入系计提的自2022年10月13日起至2022年11月21日止清算期间的银行存款利息，存出保证金利息及结算备付金利息。

#### 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 2022 年 10 月 12 日基金净资产	<b>33,952,772.45</b>
加：清算期间净收益	5,049.92
减：赎回金额（含费用）	276,785.66
二、2022 年 11 月 21 日基金净资产	<b>33,681,036.71</b>

资产处置及负债清偿后，本基金于 2022 年 11 月 21 日剩余财产为人民币 33,681,036.71 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、交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。

清算起始日 2022 年 10 月 13 日至清算款划出日前一日的银行存款利息、存出保证金利息和结算备付金利息均属基金份额持有人所有，由基金管理人以自有资金垫付。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。托管账户销户结息时，基金管理人将收回垫付资金，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

本基金于 2022 年 11 月 21 日的预提银行间账户维护费余额为人民币 5,086.64 元，应付交易费用余额为人民币 175.00 元，均将于本次清算结束后支付。

#### 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) 《德邦安鑫混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《关于〈德邦安鑫混合型证券投资基金清算报告〉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](http://www.dbfund.com.cn)）查阅。

### 3、查阅方式

- (1) 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。
- (2) 投资者可访问基金管理人公司网站（[www.dbfund.com.cn](http://www.dbfund.com.cn)）查阅。

德邦安鑫混合型证券投资基金  
基金财产清算小组  
2022年12月5日