

# 德邦资管月月鑫 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:德邦证券资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。本中期报告已经董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月23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2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	53
§9 开放式基金份额变动 .....	54
§10 重大事件揭示 .....	54
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
§12 备查文件目录 .....	57
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划	
基金简称	德邦资管月月鑫30天滚动债	
基金主代码	970127	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年01月25日	
基金管理人	德邦证券资产管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	541,391,876.82份	
基金合同存续期	本集合计划自资产合同生效日起存续期不得超过3年，本集合计划自资产管理合同生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。	
下属分级基金的基金简称	德邦资管月月鑫30天滚动债A	德邦资管月月鑫30天滚动债C
下属分级基金的交易代码	970127	970128
报告期末下属分级基金的份额总额	334,704,011.42份	206,687,865.40份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在充分考虑集合计划投资安全的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>(二) 债券投资策略</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、期限结构策略</li> <li>2、信用策略</li> <li>3、互换策略</li> <li>4、息差策略</li> <li>5、个券挖掘策略</li> </ol> <p>(三) 资产支持证券投资策略</p> <p>(四) 可转债投资策略</p>
业绩比较基准	中债新综合全价（1年以下）指数收益率

风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金及股票型集合资产管理计划，高于货币市场基金和现金管理型集合计划。
--------	---

注：本报告所述的“基金”为按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### 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		德邦证券资产管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	姚鑫	陆志俊
	联系电话	021-68761616	95559
	电子邮箱	yaoxin01@tebonam.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-58588072	95559
传真		021-68765116	021-62701216
注册地址		上海市黄浦区丽园路700号5楼501室Q-130单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市杨浦区荆州路198号万硕大厦23层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		左畅	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tebonam.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市杨浦区荆州路198号万硕大厦23层

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	德邦证券资产管理有限公司	上海市杨浦区荆州路198号万硕大厦23层

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	德邦资管月月鑫30 天滚动债A	德邦资管月月鑫30 天滚动债C
本期已实现收益	7,363,570.47	4,365,295.40
本期利润	6,301,823.83	3,740,257.90
加权平均基金份额本期利润	0.0201	0.0196
本期加权平均净值利润率	1.79%	1.76%
本期基金份额净值增长率	1.83%	1.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	37,560,217.86	23,953,920.27
期末可供分配基金份额利润	0.1122	0.1159
期末基金资产净值	377,904,281.59	232,780,265.68
期末基金份额净值	1.1291	1.1262
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.05%	9.77%

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。  
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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
3.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 德邦资管月月鑫30天滚动债A

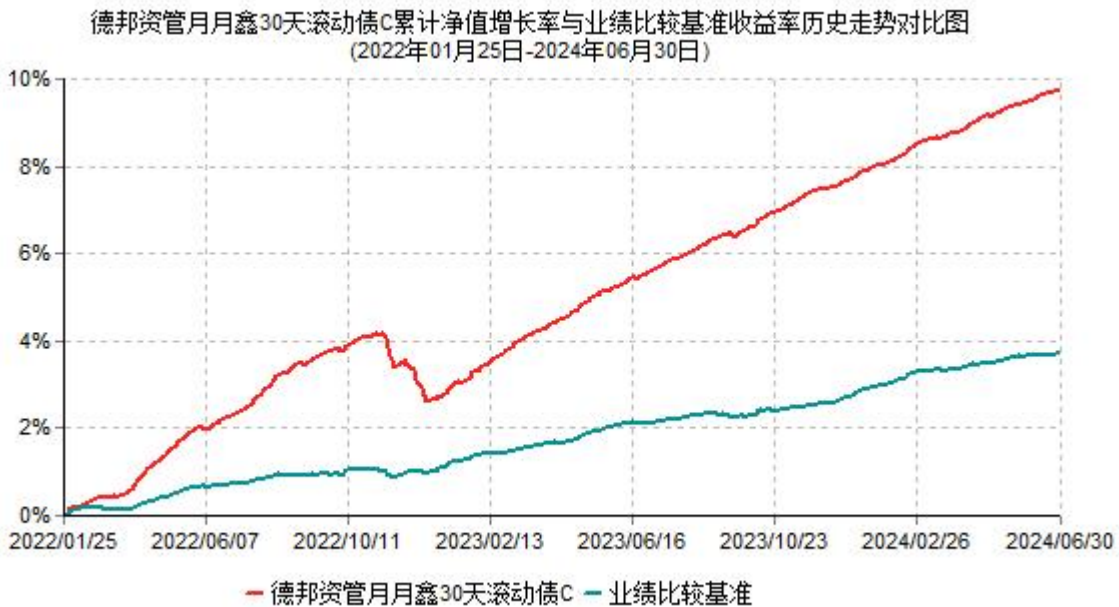
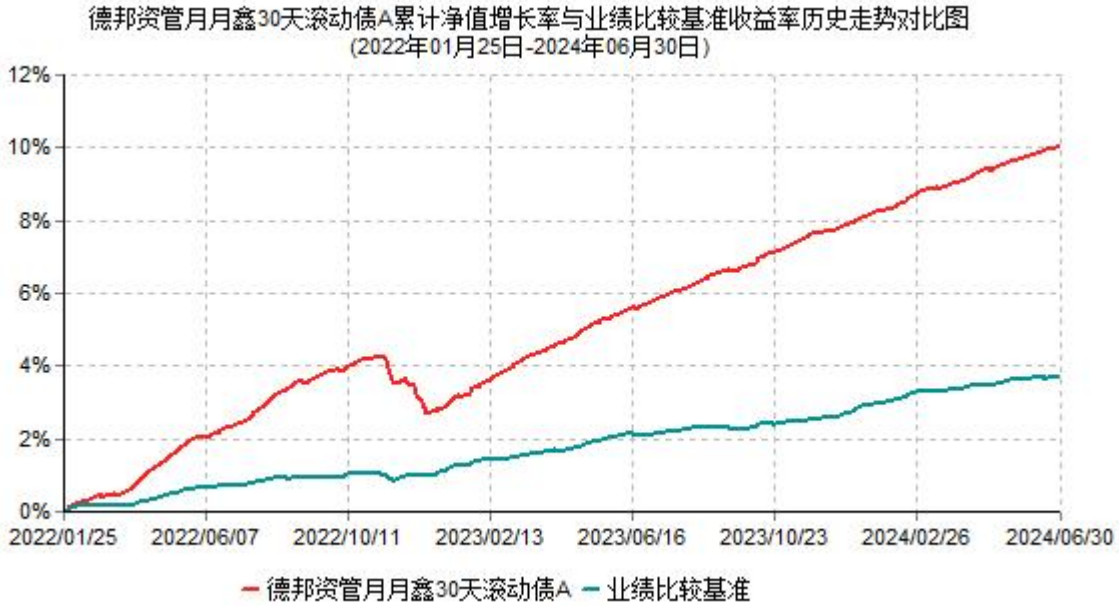
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.28%	0.01%	0.07%	0.01%	0.21%	0.00%
过去三个月	0.90%	0.01%	0.35%	0.01%	0.55%	0.00%
过去六个月	1.83%	0.01%	0.84%	0.01%	0.99%	0.00%
过去一年	4.10%	0.02%	1.60%	0.01%	2.50%	0.01%
自基金合同生效起至今	10.05%	0.03%	3.72%	0.01%	6.33%	0.02%

##### 德邦资管月月鑫30天滚动债C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.26%	0.01%	0.07%	0.01%	0.19%	0.00%
过去三个月	0.87%	0.01%	0.35%	0.01%	0.52%	0.00%
过去六个月	1.77%	0.01%	0.84%	0.01%	0.93%	0.00%
过去一年	4.00%	0.02%	1.60%	0.01%	2.40%	0.01%
自基金合同生效起至今	9.77%	0.03%	3.72%	0.01%	6.05%	0.02%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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





注：本基金由原德邦心连心2号债券精选集合资产管理计划于2022年01月25日变更而来。

## §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

德邦证券资产管理有限公司（以下简称“德邦资管”或“公司”）系德邦证券股份有限公司的全资子公司，于2020年12月取得证监会核发的经营证券期货业务许可，注册

资本10.5亿元，总部位于上海。德邦资管前身为德邦证券资产管理总部，自2010年开展资产管理业务以来，始终坚持以客户利益为导向、以创新发展为抓手、以风控合规为底线，在行业内保持较快的发展速度。随着大资管行业的发展创新，德邦资管坚持与时俱进，提出以金融科技赋能业务发展的理念，形成了“一体两核两翼”的发展模式，即以金融产品为载体，以投研管理和销售服务为两翼，重点打造投资管理和资产证券化两大核心业务板块，积极布局公募REITs等创新型业务，构建新的业务模式和盈利模式。

截止本报告期末，德邦证券资产管理有限公司共管理1只参公集合资产管理计划：德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划。

#### 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		
杨孝梅	本基金的投资经理	2020-11-18	-	8年	杨孝梅，2011年3月毕业于上海交通大学安泰经济与管理学院，管理学硕士，11年固定收益投资交易工作经验，在利率债、信用债、可转债等方面积累了丰富的投资经验。注重大类资产配置的分析框架，擅长绝对收益策略。曾任职于浙江泰隆商业银行，从事债券交易等相关工作。后任职于申万宏源证券资产管理事业部，担任定向产品和小集合产品投资经理。2020年10月加入德邦证券资产管理有限公司，担任月月鑫30天滚动持有债（前身为心连心2号）投资经理。
李博航	本基金的投资经理	2024-01-03	-	7年	李博航，2013年7月毕业于

					上海财经大学，经济学硕士，历任上海新世纪资信评估投资服务有限公司信用分析员；东证融汇证券资产管理有限公司信用研究员；江海证券有限公司部门副总裁；浙商证券股份有限公司业务副总监、立项委员及内核委员。
--	--	--	--	--	--

注：证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等法律法规、相关规定以及计划合同、招募说明书的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《德邦证券资产管理有限公司客户资产管理业务公平交易管理办法》，建立了《德邦证券资产管理有限公司新股网下申购业务合规风控管理办法》、《德邦证券资产管理有限公司债券投资交易业务风险管理办法》、《德邦证券资产管理有限公司集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了统一的可投标的库，投资经理基于所管理产品的投资策略从统一的可投标的库中选择标的进行投资，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司建立了“资产管理委员会-投资分管领导及部门负责人-投资经理”的三级投资决策授权体系，投资经理需在授权范围内进行投资决策。公司采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行本公司相关制度，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生违背公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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5%的情况。

### 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

2024年上半年国内经济实际增速高于名义增速、供给强于需求、外需强于内需的结构特征较为突出，上半年国内GDP同比增长5%，经济运行总体平稳，但4月以来消费低迷、地产投资下行以及基建投资修复偏缓对基本面修复造成拖累，二季度GDP同比增长降至4.7%。上半年海外经济增长维持偏强韧性，通胀缓慢回落但进展不及预期，地缘冲突升级。

年初央行从总量、结构、价格三方面发力强化逆周期调节，大型商业银行和股份行先后下调定期存款利率，1月24日央行宣布下调金融机构存款准备金率0.5个百分点，春节后LPR非对称降息释放强烈稳增长信号。年初以来权益市场调整幅度较大，市场避险情绪浓厚，部分偏股基金涌入债市，股债跷跷板效应明显。以30年国债为代表的超长期债券成交活跃度明显提升，三十年期国债期货和十年期国债期货表现亮眼，主力合约先后创下历史新高。4月份以来，市场利率定价机制叫停银行存款手工补息，导致存款搬家，非银流动性大幅改善，流动性分层情况基本消失。叠加二季度债市供给偏慢，特别国债和地方专项债发行力度不及预期，供需缺口的持续存在让债市牛市格局延续，十年期国债收益率在4月中下旬一度下行至2.23%低点，随后央行多次提示长端利率风险，并伴随着房地产政策的大幅放松，10年期国债收益率小幅回升后在2.3%的中枢窄幅波动。6月中旬公布的5月经济数据再度走弱，“金融挤水分”背景下信贷数据连续两个月偏弱，6月底债市再度走强，10年期国债创新低至2.21%。与中短端比较顺畅的下行相比，超长债二季度的走势更为纠结，一方面是机构欠配与拉久期的冲动，一方面是央行数十次喊话甚至直接下场借券卖国债的担忧，从最终结果来看，央行一定程度上维护了收益率曲线的斜率。截止到半年末，1年、3年、5年、10年及30年国债收益率到期收益率分别为1.54%、1.80%、1.98%、2.21%和2.43%，较去年底分别下行54BP、49BP、42BP、35BP和40BP。

信用债方面，今年各级政府及金融机构都参与到支持地方政府债务风险化解的工作，城投化债范围进一步扩大，在经历前两年的民企地产债危机后，高风险民企债和地

产债也基本出清。伴随信用风险的出清及城投债信用利差大幅压缩，高票息资产在债券市场逐步消失，信用债市场资产荒行情延续。截至6月末，1年期、3年期、5年期AAA、AA+、AA评级中债中短期票据到期收益率分别为2.02%、2.12%、2.17%；2.14%、2.24%、2.29%；2.26%、2.36%、2.41%，分别较去年年底下降51BP、51 BP、56 BP；58 BP、62 BP、81 BP和67 BP、81 BP、111 BP。

上半年，产品在追求收益的同时注重控制回撤，维持适度的组合久期和杠杆，并根据市场利率的波动情况进行阶段性调整，产品持仓结构较稳定，以AA+信用债和ABS提高收益，同时以AAA信用债和利率债来应对日常流动性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末德邦资管月月鑫30天滚动债A基金份额净值为1.1291元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.83%，同期业绩比较基准收益率为0.84%；截至报告期末德邦资管月月鑫30天滚动债C基金份额净值为1.1262元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.77%，同期业绩比较基准收益率为0.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球制造业PMI新订单指数2024年2月已重回荣枯线以上，此外周边经济体出口高增，亦可印证全球贸易链条的回暖，下半年国内出口预计不弱。下半年地方新增专项债剩余2.4万亿元的额度集中发行和使用，有望推动基建投资企稳，但城投净融资下降，限制项目配套资金，会造成一定拖累。下半年预计消费仍将维持弱势格局，一方面居民收入预期难以明显好转，另一方面政府消费到受财政收入低增长的限制。海外方面，美国核心通胀率走低，失业率抬头，具备降息基础，6月欧洲央行率先降息，下半年海外货币环境变化会缓解国内汇率压力，为我国央行进一步的降准降息政策提供外部条件。预计下半年国内GDP增速能完成5%的年度增长目标，但宏观经济弱复苏基调难有实质改善，央行货币政策在总量上会保持合理充裕。

债市供给方面，下半年政府债集中发行将给资金面和债市带来扰动，由于当前债券融资成本较低，企业会继续增加长债发行，长久期信用债增量会进一步提升。防范化解地方政府债务风险政策在下半年仍将严格执行，监管部门对城投债的发行审批会维持偏严的态势，城投债净融资会在低位。债市需求方面，银行贷款发放难度加大，资金持续向固收理财市场涌入，广义固收理财市场对债券需求继续增加。从基本面、资金面、供需角度来看，下半年较难看到市场出现趋势性反转，央行为加强逆周期调节力度，货币政策进一步宽松后，可为债市带来一定空间。但随着资产端收益率下行，银行净息差压力增大，为减少金融系统追求收益过度期限错配的久期敞口，二季度央行已多次提示长端利率风险，下半年央行或将在长端利率继续下探过程中适时干预，通过国债买卖等手段引导市场预期。

产品投资层面，将严格遵照产品投资策略，主要投资于中短期限信用债，严控组合久期，降低产品波动性。下半年本产品仍将主要投向AA+以上国企信用债，以信用债票息策略为主，考虑到当前已严重压缩的套息空间，将降低组合无效杠杆，保持操作的灵活性，适度换仓，挖掘品种利差、期限利差以及含权债等品种的投资机会，通过交易行为增厚组合收益。

#### 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《德邦证券资产管理有限公司基金会计核算基本制度》、《德邦证券资产管理有限公司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。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基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配。

#### 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满两百或者资产净值低于五千万元的情形。

## §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，基金托管人在德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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，德邦证券资产管理有限公司在德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由德邦证券资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	680,391.20	985,186.98
结算备付金		2,118,123.84	46,187.33
存出保证金		14,578.45	6,093.15
交易性金融资产	6.4.7.2	659,508,284.98	566,272,329.87
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		609,107,314.08	526,925,070.96
资产支持证券投资		50,400,970.90	39,347,258.91
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收清算款		997,350.25	-

应收股利		-	-
应收申购款		2,109,293.45	2,502,660.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.3	580,000.00	-
资产总计		666,008,022.17	569,812,457.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年06月30日</b>	<b>2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		51,813,754.76	7,502,450.59
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,954,137.29	1,345,520.11
应付管理人报酬		292,872.07	252,477.83
应付托管费		73,218.05	63,119.49
应付销售服务费		19,123.90	17,890.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		79,436.43	75,309.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.4	90,932.40	163,511.65
负债合计		55,323,474.90	9,420,279.40
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.5	541,391,876.82	505,760,844.70
未分配利润	6.4.7.6	69,292,670.45	54,631,333.88
净资产合计		610,684,547.27	560,392,178.58
负债和净资产总计		666,008,022.17	569,812,457.98

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额541,391,876.82份。本基金下属德邦资管月月鑫30天滚动债A基金份额净值1.1291元，基金份额总额334,704,011.42份；本基金下属德邦资管月月鑫30天滚动债C基金份额净值1.1262元，基金份额总额206,687,865.40份。



## 6.2 利润表

会计主体：德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		11,900,168.34	12,753,961.36
1.利息收入		24,838.46	105,461.42
其中：存款利息收入	6.4.7.7	22,273.61	22,903.76
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		2,564.85	82,557.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		13,562,114.02	9,772,937.66
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.8	12,515,135.32	8,535,217.68
资产支持证券投资 收益	6.4.7.9	1,046,978.70	1,237,719.98
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.10	-1,686,784.14	2,875,562.28
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,858,086.61	1,273,471.89
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	560,275.71	435,146.09
2.托管费	6.4.10.2.2	140,068.97	108,786.53
3.销售服务费	6.4.10.2.3	105,761.21	72,295.53
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		909,948.44	587,400.97
其中：卖出回购金融资产支出		909,948.44	587,400.97
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		52,767.50	34,298.48
8.其他费用	6.4.7.11	89,264.78	35,544.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,042,081.73	11,480,489.47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,042,081.73	11,480,489.47
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		10,042,081.73	11,480,489.47

### 6.3 净资产变动表

会计主体：德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	505,760,844.70	54,631,333.88	560,392,178.58
二、本期期初净资产	505,760,844.70	54,631,333.88	560,392,178.58

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	35,631,032.12	14,661,336.57	50,292,368.69
（一）、综合收益总额	-	10,042,081.73	10,042,081.73
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	35,631,032.12	4,619,254.84	40,250,286.96
其中：1.基金申购款	422,668,016.55	50,149,807.21	472,817,823.76
2.基金赎回款	-387,036,984.43	-45,530,552.37	-432,567,536.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	541,391,876.82	69,292,670.45	610,684,547.27
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	350,209,920.55	19,514,640.12	369,724,560.67
二、本期期初净资产	350,209,920.55	19,514,640.12	369,724,560.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	108,588,081.79	19,029,357.95	127,617,439.74
（一）、综合收益总额	-	11,480,489.47	11,480,489.47

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	108,588,081.79	7,548,868.48	116,136,950.27
其中：1.基金申购款	357,633,203.79	25,349,357.03	382,982,560.82
2.基金赎回款	-249,045,122.00	-17,800,488.55	-266,845,610.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	458,798,002.34	38,543,998.07	497,342,000.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

左畅

李海燕

左畅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“本基金”）由德邦心连心2号债券精选集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）“机构部函【2021】4241号文”《关于准予德邦心连心2号债券精选集合资产管理计划合同变更的回函》的批准，由管理人德邦证券资产管理有限公司于2022年1月17日至2022年1月24日进行合同变更征询，并于2022年1月25日起生效的参公改造集合资产管理计划。

本基金为契约型开放式，存续期限为自资产合同生效日起存续期不得超过3年。本基金的基金管理人和注册登记机构均为德邦证券资产管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本集合计划的投资范围主要包括国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可

转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本集合计划的业绩比较基准为：中债新综合全价（1年以下）指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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，对于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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《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 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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。

#### 6.4.3 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本集合计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本集合计划按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集合计划以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本集合计划计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必

要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本集合计划对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。



#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

(3) 债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(6) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(7) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(8) 公允价值变动收益系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

其他收入在本履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本集合计划接受相关服务的期间计入当期损益。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配；

(2) 本集合计划收益分配方式仅现金分红一种；

(3) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

- (4) 同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

无。

#### 6.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本集合计划的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的

通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于集合计划增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于集合计划增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

### 1、增值税

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，本集合计划运营过程中发生的增值税应税行为，以本集合计划的管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，集合计划管理人运营集合计划过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对集合计划在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从集合计划管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### 2、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 3、个人所得税

对集合计划取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向集合计划支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

## 4、城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	680,391.20
等于：本金	679,120.84
加：应计利息	1,270.36
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	680,391.20

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	208,113,766.76	4,315,999.56	211,927,047.56	-502,718.76
	银行间市场	388,940,663.00	9,020,166.52	397,180,266.52	-780,563.00
	合计	597,054,429.76	13,336,166.08	609,107,314.08	-1,283,281.76
资产支持证券		49,196,500.00	1,118,470.90	50,400,970.90	86,000.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		646,250,929.76	14,454,636.98	659,508,284.98	-1,197,281.76

#### 6.4.7.3 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应收利息	580,000.00
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	580,000.00

#### 6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	14,501.70
其中：交易所市场	-
银行间市场	14,501.70
应付利息	-
预提费用	67,130.70

预提费用-账户维护费	9,300.00
合计	90,932.40

### 6.4.7.5 实收基金

#### 6.4.7.5.1 德邦资管月月鑫30天滚动债A

金额单位：人民币元

项目 (德邦资管月月鑫30天滚动债 A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	319,618,062.94	319,618,062.94
本期申购	225,601,287.31	225,601,287.31
本期赎回（以“-”号填列）	-210,515,338.83	-210,515,338.83
本期末	334,704,011.42	334,704,011.42

#### 6.4.7.5.2 德邦资管月月鑫30天滚动债C

金额单位：人民币元

项目 (德邦资管月月鑫30天滚动债 C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	186,142,781.76	186,142,781.76
本期申购	197,066,729.24	197,066,729.24
本期赎回（以“-”号填列）	-176,521,645.60	-176,521,645.60
本期末	206,687,865.40	206,687,865.40

### 6.4.7.6 未分配利润

#### 6.4.7.6.1 德邦资管月月鑫30天滚动债A

单位：人民币元

项目 (德邦资管月月鑫30天 滚动债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,304,211.95	6,482,372.90	34,786,584.85
本期期初	28,304,211.95	6,482,372.90	34,786,584.85

本期利润	7,363,570.47	-1,061,746.64	6,301,823.83
本期基金份额交易产生的变动数	1,892,435.44	219,426.05	2,111,861.49
其中：基金申购款	22,988,539.53	4,107,269.80	27,095,809.33
基金赎回款	-21,096,104.09	-3,887,843.75	-24,983,947.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,560,217.86	5,640,052.31	43,200,270.17

#### 6.4.7.6.2 德邦资管月月鑫30天滚动债C

单位：人民币元

项目 (德邦资管月月鑫30天 滚动债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,281,862.89	2,562,886.14	19,844,749.03
本期期初	17,281,862.89	2,562,886.14	19,844,749.03
本期利润	4,365,295.40	-625,037.50	3,740,257.90
本期基金份额交易产生的变动数	2,306,761.98	200,631.37	2,507,393.35
其中：基金申购款	20,742,158.25	2,311,839.63	23,053,997.88
基金赎回款	-18,435,396.27	-2,111,208.26	-20,546,604.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,953,920.27	2,138,480.01	26,092,400.28

#### 6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	16,027.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,142.27
其他	104.02

合计	22,273.61
----	-----------

#### 6.4.7.8 债券投资收益

##### 6.4.7.8.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	13,324,430.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-809,294.85
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,515,135.32

##### 6.4.7.8.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	684,944,089.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	666,296,092.57
减：应计利息总额	19,446,069.35
减：交易费用	11,222.50
买卖债券差价收入	-809,294.85

#### 6.4.7.9 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.9.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2024年01月01日至2024年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	1,069,378.70
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-22,400.00
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,046,978.70

#### 6.4.7.9.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	37,954,617.81
减：卖出资产支持证券成本总额	36,741,500.00
减：应计利息总额	1,235,517.81
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-22,400.00

#### 6.4.7.10 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-1,694,019.44
——股票投资	-
——债券投资	-1,809,519.44
——资产支持证券投资	115,500.00
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-7,235.30
合计	-1,686,784.14

#### 6.4.7.11 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	7,458.36
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,534.08
帐户维护费	18,600.00
合计	89,264.78

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
德邦证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人
中州期货有限公司	基金管理人的控股股东、实际控制人所控制的企业,基金销售机构
德邦证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
德邦证券股份有限公司	264,188,192.00	100.00%	126,820,850.00	100.00%

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
-------	-------------------------------	------------------------------------

	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
德邦证券 股份有限 公司	1,425,828,000.00	100.00%	1,167,500,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	560,275.71	435,146.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	267,709.46	190,615.35
应支付基金管理人的净管理费	292,566.25	244,530.74

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$G = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

G为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日集合计划资产净值

集合计划的管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，于下月前5个工作日内从集合计划资产中一次性划付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管 费	140,068.97	108,786.53

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

T为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，于下月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦资管月月鑫30天滚动债 A	德邦资管月月鑫30天滚动债 C	合计
德邦证券 资产管理 有限公司	0.00	1,526.23	1,526.23
德邦证券 股份有限 公司	0.00	49,205.60	49,205.60
中州期货 有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	50,731.83	50,731.83
获得销售 服务费的	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦资管月月鑫30天滚动债 A	德邦资管月月鑫30天滚动债 C	合计
德邦证券资产管理 有限公司	0.00	132.42	132.42
德邦证券股份有限 公司	0.00	48,046.95	48,046.95
中州期货有限公司	0.00	697.59	697.59
合计	0.00	48,876.96	48,876.96

注：销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划A类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.10%。C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，于下月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

德邦资管月月鑫30天滚动债A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至 2024年06月30日	2023年01月01日至 2023年06月30日
基金合同生效日（2022年01月25日）持有的基金份额	13,886,932.57	13,886,932.57
报告期初持有的基金份额	1,882,164.72	15,769,097.29
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	13,886,932.57
报告期末持有的基金份额	1,882,164.72	1,882,164.72
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.56%	0.64%

注：1、基金管理人德邦证券资产管理有限公司投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	680,391.20	16,027.32	1,012,384.85	10,855.89

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额51,813,754.76元，于2024年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征



通过特定的风险量化指标、模型，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会承担全面风险管理的最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略。经营管理层负责落实董事会审议的风险管理策略，承担全面风险管理的主要责任。经营管理层下设风险管理委员会，协助经营管理层进行风险管理，负责定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，对于风险管理中存在的问题及解决方案进行评估审议。公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。首席风险官由董事会任命负责全面风险管理工作，组织推动公司全面风险管理体系的建设，指导监督各部门的风险管理工作。风险管理部对公司的全面风险管理进行独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门对于风险管理履行首要防范职责，并对其风险管理的有效性负责。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在托管行交通银行，信用风险相对可控。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。针对拟投标的结合内外部评级采取分级管理机制，设置投资决策逐级授权机制，单一主体持仓限额等措施，事前控制信用风险。拟投标的需满足内部评级及准入标准，由信用研究员撰写研究报告并发起入库审批流程，持仓主体进行每日跟踪，标的白名单定期梳理。对于债券质押式逆回购交易对手，基金管理人建立了交易对手白名单，进行分级限额管理，每年至少对于白名单进行一次梳理更新。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	15,592,584.70	21,056,295.08

A-1以下	-	-
未评级	97,152,941.54	173,108,587.44
合计	112,745,526.24	194,164,882.52

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	36,012,608.22	20,412,728.77
合计	36,012,608.22	20,412,728.77

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	214,307,748.50	228,049,960.24
AAA以下	100,831,982.16	41,889,069.68
未评级	181,222,057.18	62,821,158.52
合计	496,361,787.84	332,760,188.44

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	5,538,196.93	-
AAA以下	8,850,165.75	18,934,530.14
未评级	-	-
合计	14,388,362.68	18,934,530.14

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值、组合久期，以及定期流动性压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本报告期内，本基金各项流动性指标均满足监管要求及合同约定，未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
------------------------	------	------	------	-----	----

资产					
货币资金	680,391.20	-	-	-	680,391.20
结算备付金	2,118,123.84	-	-	-	2,118,123.84
存出保证金	14,578.45	-	-	-	14,578.45
交易性金融资产	569,741,364.05	89,766,920.93	-	-	659,508,284.98
应收清算款	-	-	-	997,350.25	997,350.25
应收申购款	-	-	-	2,109,293.45	2,109,293.45
其他资产	-	-	-	580,000.00	580,000.00
资产总计	572,554,457.54	89,766,920.93	-	3,686,643.70	666,008,022.17
负债					
卖出回购金融资产款	51,813,754.76	-	-	-	51,813,754.76
应付赎回款	-	-	-	2,954,137.29	2,954,137.29
应付管理人报酬	-	-	-	292,872.07	292,872.07
应付托管费	-	-	-	73,218.05	73,218.05
应付销售服务费	-	-	-	19,123.90	19,123.90
应交税费	-	-	-	79,436.43	79,436.43
其他负债	-	-	-	90,932.40	90,932.40
负债总计	51,813,754.76	-	-	3,509,720.14	55,323,474.90

计					
利率敏感度缺口	520,740,702.78	89,766,920.93	-	176,923.56	610,684,547.27
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	985,186.98	-	-	-	985,186.98
结算备付金	46,187.33	-	-	-	46,187.33
存出保证金	6,093.15	-	-	-	6,093.15
交易性金融资产	503,395,433.39	62,876,896.48	-	-	566,272,329.87
应收申购款	-	-	-	2,502,660.65	2,502,660.65
资产总计	504,432,900.85	62,876,896.48	-	2,502,660.65	569,812,457.98
负债					
卖出回购金融资产款	7,502,450.59	-	-	-	7,502,450.59
应付赎回款	-	-	-	1,345,520.11	1,345,520.11
应付管理人报酬	-	-	-	252,477.83	252,477.83
应付托管费	-	-	-	63,119.49	63,119.49
应付销售服务费	-	-	-	17,890.35	17,890.35

应交税费	-	-	-	75,309.38	75,309.38
其他负债	-	-	-	163,511.65	163,511.65
负债总计	7,502,450.59	-	-	1,917,828.81	9,420,279.40
利率敏感度缺口	496,930,450.26	62,876,896.48	-	584,831.84	560,392,178.58

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设：该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况，该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动25个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；本基金持有银行存款、结算备付金以及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	956,768.92	705,489.25
	市场利率上升25个基点	-953,730.00	-703,508.46

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
----	--------------------	---------------------

	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	659,508,284.98	107.99	566,272,329.87	101.05
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	659,508,284.98	107.99	566,272,329.87	101.05

注：本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一

层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	659,508,284.98	566,272,329.87
第三层次	-	-
合计	659,508,284.98	566,272,329.87

注：具体分层方式见7.4.14.1金融工具公允价值计量的方法。

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期末及上年度末均不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元



序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	659,508,284.98	99.02
	其中：债券	609,107,314.08	91.46
	资产支持证券	50,400,970.90	7.57
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,798,515.04	0.42
8	其他各项资产	3,701,222.15	0.56
9	合计	666,008,022.17	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,270,360.66	6.59
	其中：政策性金融债	40,270,360.66	6.59
4	企业债券	256,546,882.41	42.01
5	企业短期融资券	72,475,165.58	11.87
6	中期票据	239,814,905.43	39.27
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	609,107,314.08	99.74

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	240401	24农发01	400,000	40,270,360.66	6.59
2	102101715	21大足永晟MTN001	300,000	31,762,327.87	5.20
3	138852	23万开01	300,000	31,573,849.31	5.17
4	102280593	22西安浐灞MTN001	300,000	31,300,150.68	5.13
5	2080076	20兴发绿色债01	300,000	30,963,657.53	5.07

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	199070	周口02优	200,000	20,953,430.14	3.43
2	261770	陇原优A	100,000	10,056,958.90	1.65
3	260080	溧安置A2	150,000	7,592,967.12	1.24
4	260891	24海洋A	150,000	5,538,196.93	0.91
5	262511	24GTQR11	50,000	5,002,219.18	0.82
6	180460	G邵燃02	50,000	1,257,198.63	0.21

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资前十名证券的发行主体中的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金在本报告期内未投资股票。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,578.45
2	应收清算款	997,350.25
3	应收股利	-
4	应收利息	580,000.00
5	应收申购款	2,109,293.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,701,222.15

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未投资股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
德邦 资管 月月	6,578	50,882.34	6,528,878.79	1.95%	328,175,132.63	98.05%

鑫30 天滚 动债A						
德邦 资管 月月 鑫30 天滚 动债C	3,7 65	54,897.18	5,605,277.50	2.71%	201,082,587.90	97.29%
合计	10, 003	54,122.95	12,134,156.29	2.24%	529,257,720.53	97.76%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	德邦资管月月鑫30 天滚动债A	2,926,446.17	0.87%
	德邦资管月月鑫30 天滚动债C	252,811.19	0.12%
	合计	3,179,257.36	0.59%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	德邦资管月月鑫30 天滚动债A	0~10
	德邦资管月月鑫30 天滚动债C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	德邦资管月月鑫30 天滚动债A	0~10
	德邦资管月月鑫30 天滚动债C	0~10

	合计	0~10
--	----	------

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	德邦资管月月鑫30天滚动债A	德邦资管月月鑫30天滚动债C
基金合同生效日(2022年01月25日)基金份额总额	275,298,793.52	-
本报告期期初基金份额总额	319,618,062.94	186,142,781.76
本报告期基金总申购份额	225,601,287.31	197,066,729.24
减：本报告期基金总赎回份额	210,515,338.83	176,521,645.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	334,704,011.42	206,687,865.40

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2024年2月29日，公司董事会聘任池秋林担任首席风险官，江苏不再担任首席风险官。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

无。

**10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

无。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
德邦证券股份有限公司	264,188,192.00	100.00%	1,425,828,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：本报告期本基金使用基金管理人关联方德邦证券的交易单元进行其他证券投资交易。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划（A类份额）产品资料概要（更新）	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-01-03
2	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划（C类份额）产品资料概要（更新）	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-01-03
3	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-01-03
4	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划投资经理变更公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-01-03
5	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划投资经理变更更正公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-01-05
6	关于德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划调整大额申购、转换转入和定期定额投资限额的公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-01-05
7	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划2023年第四季度报告	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-01-19
8	德邦证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-03-01
9	关于德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划增加和讯信息科技有限公司	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-03-13



	公司为销售机构的公告		
10	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划2023年年度报告	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-03-27
11	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划2024年第一季度报告	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-04-17
12	关于德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划增加深圳众禄基金销售股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-05-14
13	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划（C类份额）产品资料概要（更新）	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-06-27
14	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划（A类份额）产品资料概要（更新）	中国证监会规定网站及规定报刊	2024-06-27

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

**11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**  
无。

**11.2 影响投资者决策的其他重要信息**  
无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予德邦心连心2号债券精选集合资产管理计划变更的文件；
- 2、《德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；

- 3、《德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

上述备查文件存放于管理人办公场所：上海市杨浦区荆州路198号万硕大厦23层

## 12.3 查阅方式

投资者可于管理人的办公场所免费查阅。

德邦证券资产管理有限公司官方网站：[www.tebonam.com.cn](http://www.tebonam.com.cn)

德邦证券资产管理有限公司

二〇二四年八月三十日