

德邦资管月月鑫 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 清算报告

集合计划管理人：德邦证券资产管理有限公司

集合计划托管人：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二五年七月二十九日

清算报告公告日：二〇二五年八月七日

目录

1、 重要提示	3
2、 集合计划概况	3
2.1 集合计划基本情况	3
2.2 集合计划产品说明	4
3、 集合计划运作情况说明	5
4、 财务报告	5
资产负债表	5
5、 清算情况	7
5.1 清算费用	7
5.2 最后运作日资产清算情况	7
5.3 负债清偿情况	8
5.4 清算期间的清算损益情况	8
5.5 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排	9
5.6 集合计划财产清算报告的告知安排	10
6、 备查文件目录	10
6.1 备查文件目录	10
6.2 存放地点	10
6.3 查阅方式	10

1、 重要提示

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”）由德邦证券资产管理有限公司担任管理人（以下简称“管理人”），由交通银行股份有限公司担任托管人（以下简称“托管人”）。

本集合计划由德邦心连心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。原集合计划为限定性集合资产管理计划，于2012年09月21日经中国证监会许可【2012】1261号文核准设立，自2012年10月15日起开始募集，于2012年11月09日结束募集工作，并于2012年11月19日正式成立。根据中国证监会于2018年11月28日发布的《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》（证监会公告〔2018〕39号）的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。经中国证监会批准，《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》（以下简称“《资产管理合同》”或“资产管理合同”）于2022年01月25日正式生效，且存续期限为自资产管理合同生效日起存续期不得超过3年，后于2025年01月03日经公告延长存续期限至2025年07月24日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《资产管理合同》等有关规定，本集合计划已于2025年07月24日到期并触发资产管理合同终止事由。本集合计划管理人根据法律法规、《资产管理合同》的约定履行了本集合计划财产清算程序，此事项不需召开集合计划份额持有人大会。本集合计划的最后运作日为2025年07月24日，并于2025年07月25日进入清算程序。

本集合计划的管理人、托管人、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于2025年07月25日成立本集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本集合计划进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、 集合计划概况

2.1 集合计划基本情况

集合计划名称	德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划
集合计划简称	德邦资管月月鑫30天滚动债
集合计划类型	债券型
集合计划主代码	970127
集合计划运作方式	契约型开放式，每天开放申购，每笔份额设置30天（自

	然日) 滚动运作期	
集合计划合同生效日	2022年01月25日	
集合计划管理人	德邦证券资产管理有限公司	
集合计划托管人	交通银行股份有限公司	
集合计划最后运作日(2025年07月24日) 份额总额	177, 143, 232. 43份	
集合计划最后运作日(2025年07月24日) 份额净值	1. 1516	
集合计划合同存续期	本集合计划自资产管理合同生效日起至2025年07月24日。	
注册登记机构	德邦证券资产管理有限公司	
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
集合计划最后运作日(2025年07月24日) 下属分级基金的份额总额	133, 164, 730. 52份	43, 978, 501. 91份

2.2 集合计划产品说明

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	(一) 资产配置策略 (二) 债券投资策略 1、期限结构策略 2、信用策略 3、互换策略 4、息差策略 5、个券挖掘策略 (三) 资产支持证券投资策略 (四) 可转债投资策略
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。

3、 集合计划运作情况说明

本集合计划由原集合计划变更而来，并于2022年01月25日正式生效。本集合计划合同生效日的集合计划份额总数为274,076,666.46份。

根据《资产管理合同》约定：“本集合计划自资产管理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。”本集合计划原定到期日为2025年01月24日。

根据本集合计划管理人于2025年01月03日发布《德邦证券资产管理有限公司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延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书、产品资料概要的公告》（以下简称“《延长存续期公告》”），本集合计划存续期限延长为“本集合计划自资产管理合同生效日起至2025年07月24日”。

自2022年01月25日至2025年07月24日期间，本集合计划按资产管理合同正常运作。

根据《资产管理合同》《延长存续期公告》以及本集合计划管理人于2025年07月25日发布的《德邦证券资产管理有限公司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资产管理合同终止及集合计划财产清算的公告》，本集合计划于2025年07月24日到期，已触发《资产管理合同》约定的终止事由，管理人根据相关法律法规、《资产管理合同》等规定对本集合计划进行清算并终止《资产管理合同》，该事项无须召开集合计划份额持有人大会。本集合计划的最后运作日为2025年07月24日，自2025年07月25日起进入清算程序。

4、 财务报告

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：2025年07月24日（集合计划最后运作日）

单位：人民币元

资 产	2025年07月24日 (集合计划最后运作日)
资 产：	

银行存款	338,290.42
结算备付金	2,122,622.27
存出保证金	28,226.05
交易性金融资产	182,438,280.00
其中：股票投资	—
基金投资	—
债券投资	182,438,280.00
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
其他投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
债权投资	—
其中：债券投资	—
资产支持证券投资	—
其他投资	—
其他债权投资	—
其他权益工具投资	—
应收清算款	20,873,726.96
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	205,801,145.70
负债和净资产	2025年07月24日 (集合计划最后运作日)
负 债：	
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	—
应付清算款	—
应付赎回款	1,667,724.32

应付管理人报酬	29,022.89
应付托管费	7,255.75
应付销售服务费	3,776.61
应付投资顾问费	—
应交税费	5,947.55
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	83,229.27
负债合计	1,796,956.39
净资产：	
实收基金	177,143,232.43
其他综合收益	—
未分配利润	26,860,956.88
净资产合计	204,004,189.31
负债和净资产总计	205,801,145.70

注：本集合计划最后运作日为2025年07月24日，集合计划份额净值204,004,189.31 元，集合计划份额总额177,143,232.43份，其中德邦资管月月鑫30天滚动债A类集合计划份额净值153,492,857.50元，A类集合计划份额总额133,164,730.52份；德邦资管月月鑫30天滚动债C类集合计划份额净值50,511,331.81元，C类集合计划份额总额43,978,501.91份。

5、 清算情况

自2025年07月25日至2025年07月29日止清算期间，本集合计划财产清算小组对本集合计划的资产、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：

5.1 清算费用

清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。其中包括：律师费10,000.00元，该项费用已于2025年07月28日支付；审计费5,000.00 元，该项费用已于2025年07月29日支付完成。

5.2 最后运作日资产清算情况

1、本集合计划最后运作日货币资金为人民币338,290.42元，其中包括活期存款为人民币334,341.44元，应计活期存款利息为人民币3,948.98元；

2、本集合计划最后运作日结算备付金为人民币2,122,622.27元，其中上海证券交易所结算备付金为人民币2,122,143.38元，其应计利息人民币478.89元；

3、本集合计划最后运作日存出保证金为人民币28,226.05元，其中上海、深圳证券交易所结算保证金分别为人民币26,760.07元、1,456.91元，其应计利息分别为人民币8.73元、0.34元；

4、本集合计划最后运作日应收清算款为20,873,726.96元，该款项已于清算期间划入集合计划托管账户；

5、本集合计划最后运作日持有的交易性金融资产-债券投资为182,438,280.00元，该资产已于2025年07月25日到期兑付，兑付金额为182,439,280.00元，已全部划入集合计划托管账户。

5.3 负债清偿情况

1、本集合计划最后运作日应付赎回款为人民币1,667,724.32元，清算期间应付赎回款为人民币914,425.40元，该两笔款项已于清算期间支付；

2、本集合计划最后运作日应付管理人报酬为人民币29,022.89元，该款项已于2025年07月28日支付；

3、本集合计划最后运作日应付托管费为人民币7,255.75元，该款项已于2025年07月28日支付；

4、本集合计划最后运作日应付销售服务费为人民币3,776.61元，该款项已于2025年07月28日支付；

5、本集合计划最后运作日应交税费为人民币5,947.55元，该款项已于2025年07月28日支付；

6、本集合计划最后运作日其他负债为人民币83,229.27元，其中，预提信息披露费为人民币67,397.85元，已于2025年07月25日支付；预提2025年审计费用人民币8,425.50元，由于集合计划到期无需年审，该款项无需支付已于清算期间红字冲销；预提银行间账户维护费为人民币6,925.92元，其中，上清账户费因季度付费，未满一个月按一个月付费，故于07月25日补计提费用347.92元，合计人民币1,600.00元，该笔费用已于2025年07月29日支付，剩余银行间账户费为中债账户费，因该账户已销户，故其预提费用在清算期间已红字冲销；应付交易费用为人民币480.00元，其中，应付银行间结算手续费为人民币420.00元，已于2025年07月29日支付，应付银行间交易手续费为人民币60.00元，该款项将于清算结束后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2025年07月25日 至 2025年07月29日 (清算期间)
一、清算收益	21,256.76
1. 利息收入(注1)	20,256.76
2. 投资收益(注2)	-18,718.00
3. 公允价值变动损益(损失以“-”填列)	19,718.00
5. 其他收入(损失以“-”填列)	-
二、清算费用	1,258.58
1. 交易费用	-
2. 其他费用(注3)	1,258.58
三、清算收益总额(损失以“-”填列)	19,998.18
减: 所得税费用	-
四、清算净收益(损失以“-”填列)	19,998.18

注:

- 1、利息收入系清算期间产生的银行存款、存出保证金及结算备付金的利息收入。
- 2、投资收益系清算期间持有债券资产变现的收益。
- 3、其他费用系清算期间调整的费用合计

5.5 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日(2025年07月24日)集合计划净资产	204,004,189.31
加: 自(2025年07月25日)至(2025年07月29日)止清算期间净收益(损失以“-”填列)	19,998.18
减: 清算期间确认的最后运作日净赎回金额(含费用)	914,425.40
二、清算结束日(2025年07月29日)集合计划净资产	203,109,762.09

注: 截至本次清算期结束日2025年07月29日, 本集合计划剩余财产203,109,762.09元。上述财产将根据本集合计划的《资产管理合同》约定, 依据集合计划财产清算的分配方案, 按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

2025 年07月29日次日至清算款划出日前一日的银行存款、最低结算备付金、存出保证金产生的利息亦属集合计划份额持有人所有。为保护集合计划份额持有人利益, 加

快清盘速度，集合计划管理人将先行垫付尚未收回的最低结算备付金、存出保证金、应计银行存款利息、应计最低结算备付金利息及应计存出保证金的利息供清盘分配使用。待回款后再返还给管理人，管理人垫付资金到账日起产生的孳息归管理人所有。

5.6 集合计划财产清算报告的告知安排

本清算报告已经集合计划托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向集合计划份额持有人公告。清算报告公告后，集合计划管理人将遵照法律法规、资产管理合同等规定及时进行剩余财产分配。

6、 备查文件目录

6.1 备查文件目录

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自2025年01月01日至2025年07月24日（最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

2、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清算报告》的法律意见书。

6.2 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

6.3 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

德邦资管月月鑫30天滚动持有债券型集合资产管理计划
集合计划财产清算小组
二〇二五年七月二十九日