

德邦周期精选混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：德邦基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
清算报告出具日：二〇二五年一月十日
清算报告公告日：二〇二五年二月五日

一、重要提示

德邦周期精选混合型发起式证券投资基金（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，由交通银行股份有限公司担任基金托管人，本基金根据 2021 年 11 月 8 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予德邦周期精选混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]3540 号文）进行募集，《德邦周期精选混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于 2021 年 12 月 29 日生效。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中，“《基金合同》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产规模低于 2 亿元，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”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，根据《基金合同》有关规定，《基金合同》终止并依据《基金合同》的约定进入清算程序。

基金管理人已于 2024 年 12 月 30 日在《证券日报》、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《关于德邦周期精选混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自 2024 年 12 月 30 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：	德邦周期精选混合型发起式证券投资基金
基金简称：	德邦周期精选混合发起式
基金交易代码：	A 类：014321； C 类：014322
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2021 年 12 月 29 日
基金最后运作日	2024 年 12 月 29 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	本基金将把握经济周期波动特征，投资周期波动中的受益资产，通过精选行业及个股，在严格控制风险并保证流动性的前提下，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	经济在发展过程中反复出现的整体扩张与收缩的过程被称为经济周期。根据经济周期理论，经济发展可以被分为繁荣、衰退、萧条与复苏四个阶段。本基金从经济增长趋势、通货膨胀趋势两个维度来判断经济周期所处的阶段，结

	合各类资产与宏观经济的联动性，对权益类、固定收益类资产进行配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价指数收益率×15%+恒生指数收益率×10%
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理论上高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资于港股通标的股票，需面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

三、财务会计报告

资产负债表

会计主体：德邦周期精选混合型发起式证券投资基金

最后运作日：2024 年 12 月 29 日

单位：人民币元

资产	最后运作日	负债和净资产	最后运作日
	2024/12/29		2024/12/29
资产：		负债：	
银行存款	3,471,298.16	短期借款	
清算备付金	92,396.47	交易性金融负债	
存出保证金	18,362.92	衍生金融负债	
交易性金融资产	10,424,820.99	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	10,223,800.00	应付清算款	
基金投资		应付赎回款	1,140,639.06
债券投资	201,020.99	应付管理人报酬	19,157.11
资产支持证券投资		应付托管费	3,192.82
贵金属投资		应付销售服务费	602.57
其他投资		应付投资顾问费	
衍生金融资产		应交税费	
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	4,636.80	其他负债	56,652.46
应收申购款		负债合计	1,220,244.02
递延所得税资产		净资产：	
其他资产		实收基金	13,499,740.09
		未分配利润	-708,468.77
		净资产合计	12,791,271.32
资产总计：	14,011,515.34	负债与净资产总计：	14,011,515.34

四、清算报表附注

1、清算原因

根据《德邦周期精选混合型发起式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》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”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2024年12月29日日终，本基金的基金资产净值低于2亿元，已触发《基金合同》终止事由，将根据《基金合同》有关规定进入基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。

2、清算起始日

根据《关于德邦周期精选混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自2024年12月30日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为2024年12月30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》、《资产管理产品相关会计处理规定》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2024年12月30日起至2025年1月10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《德邦周期精选混合型发起式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）本基金最后运作日货币资金为人民币 3,471,298.16 元，其中托管账户存款为人民币 3,471,106.90 元，应计银行存款利息为人民币 191.26 元，由于银行尚未结息，应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

（2）本基金最后运作日清算备付金为人民币 92,396.47 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的清算备付金为人民币 69,695.91 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的清算备付金为人民币 22,233.26 元，应计清算备付金利息为人民币 467.30 元，其中深港通备付金利息为 430.04 元。由于尚未结息，该部分利息与尚未划回基金托管账户的清算备付金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

（3）本基金最后运作日出存保证金余额为人民币 18,362.92 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币 11,986.59 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币 6,368.86 元，应计存出保证金利息为人民币 7.47 元。由于尚未结息，该部分利息与尚未划回基金托管账户的存出保证金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产-股票投资为人民币 10,223,800.00 元。该资产已于 2025 年 1 月 2 日全部完成变现划入基金托管户。收回资金合计为人民币 10,373,426.90 元，并支付交易席位佣金 4,524.96 元，相关资金划付已于清算期间完成。最后运作日持有的交易性金融资产-债券投资为人民币 201,020.99 元。该资产已于 2024 年 12 月 31 日全部完成变现划入基金托管户。收回资金合计为人民币 201,008.27 元。

(5) 本基金最后运作日应收股利人民币 4,636.80 元，该款项为股票股利，该利息尚未到账，将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

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 1,140,639.06 元，该款项截至 2024 年 12 月 31 日已全部完成支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 19,157.11 元，该款项已于 2025 年 1 月 6 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,192.82 元，该款项已于 2025 年 1 月 6 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 602.57 元，该款项已于 2025 年 1 月 6 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 56,652.46 元。其中应付赎回费 454.98，截止 2024 年 12 月 31 日已全部完成支付。应付交易费用 56,197.48，系席位佣金费用，该款项已于 2025 年 1 月 8 日支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元
自2024年12月30日
至2025年1月10日
止清算期间

项目

一、收益

1、利息收入（注1）	1,201.55
2、交易性金融资产产生的净收益（注2）	145,089.22
3、其他收入	826.38
收益小计	147,117.15

二、费用

1、其他费用（注3）	15,000.00
费用小计	15,000.00

三、清算期间净损益	132,117.15
-----------	------------

注 1：利息收入系自 2024 年 12 月 30 日至 2025 年 1 月 10 日止清算期间计提的银行存款利息收入、清算备付金利息收入和存出保证金利息收入。

注 2：交易性金融资产产生的净收益系清算期间处置交易型股票投资和交易性债券投资产生的差价收入。

注 3：其他费用系自 2024 年 12 月 30 日至 2025 年 1 月 10 日止清算期间计提的律师费和审计费。其中，清算律师费为人民币 10,000.00 元，清算审计费为人民币 5,000.00 元。

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 2024 年 12 月 29 日基金净资产	12,791,271.32
加：清算期间净收益	132,117.15
减：赎回金额（含费用）	687,401.55
二、2025 年 1 月 10 日基金净资产	12,235,986.92

资产处置及负债清偿后，本基金截止 2025 年 1 月 10 日剩余财产为人民币 12,235,986.92 元，根据本基金的基金合同的约定，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 2024 年 12 月 30 日至清算款划出日前一日的银行存款利息、清算备付金利息以及存出保证金利息亦属份额持有人所有，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。

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）《德邦周期精选混合型发起式证券投资基金清算审计报告》；
- （2）《关于〈德邦周期精选混合型发起式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）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）查阅。

德邦周期精选混合型发起式证券投资基金
基金财产清算小组
二〇二五年一月十日