

# 德邦心连心掘金1号集合资产管理计划

## 2019年第三季度资产管理报告



报告期：2019年07月01日-2019年09月30日

管理人：德邦证券股份有限公司

托管人：中国民生银行股份有限公司



## 重要提示

本报告依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其他有关规定制作。

本报告由集合资产管理计划管理人编制。管理人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。

集合资产管理计划托管人中国民生银行股份有限公司于2019年10月复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告和投资收益分配情况等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划合同和说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期由2019年07月01日起，至2019年09月30日止。

本报告中的内容由管理人负责解释。



## 第1节 集合资产管理计划概况

1、计划名称：	德邦心连心掘金1号集合资产管理计划
2、计划类型：	混合类集合资产管理计划
3、计划交易代码	CE1058
4、计划成立日	2016-04-06
5、成立规模	30,007,648.00 份
6、报告期末计划份额总额	2,000,660.00 份
7、计划合同存续期	无固定期限

## 第2节 管理人报告

### 一、投资经理简介

崔明龙 资产管理总部投资部；投资经理

浙江工商大学金融学硕士，多年证券从业经历，长期从事股票投资交易相关研究等事务，现任德邦证券资产管理总部投资经理，负责股票量化投资工作，擅长股票数据的规律挖掘与建模，涉及多因子策略，模式识别，股指期货套利等策略的研发。

### 二、业绩表现

截止到2019年09月30日，集合计划单位净值为0.8692。报告期内，产品季度净值增长率为-0.38%。

### 三、份额变动

报告期初份额总额为2,000,660.00份，报告期内申购份额为0份，报告期内赎回份额为0份，红利再投资份额为0.00份，报告期末份额总额为2,000,660.00份。

### 四、投资回顾与展望

投资回顾：三季度，市场整体处于一个宽幅震荡的区间内，经历过6月份的大幅上涨后，在7月开始了接近一个月的深度调整，进入8月份以后受贸易摩擦缓和影响，市场情绪好转，9月下旬再次出现回撤调整迹象，整体来看上证

跌幅 2.48%，深证涨幅 2.92%，创业板涨幅 7.68%，创业板走势相对强势。

四季度展望：1、贸易摩擦影响会趋于缓和，对提振市场情绪有一定的促进作用。2、A 股总体估值仍然处于底部，无论是纵向对比还是横向暂未出现估值过高的问题。3、全球经济下行承压的大背景下，各国利率处于下行周期，为货币政策留出了操作空间。4、进入 10 月份以后，市场对三季度季报期关注度开始上升，从 7、8 月份的宏观数据来看，上市公司业绩不排除会出现继续下行的态势，需谨慎对待。四季度布局采取以下几个思路：1、低估值偏防御属性的板块预计会有一定的超额收益，金融、地产等板块；2、深入挖掘细分行业龙头。优先挑选具有业绩支撑、政策导向等因素的标的。

### 第 3 节 集合资产管理计划净值表现

单位：人民币元

期末资产总净值	1,738,983.37
期末单位净值	0.8692
期末累计净值	0.8692

### 第 4 节 投资组合报告

#### 一、期末资产组合情况

项目名称	项目市值 (元)	占资产比例 (%)
银行存款	211,602.73	12.07
清算备付金	93,306.31	5.32
存出保证金	1,351.65	0.08
股票投资	412,961.00	23.56
债券投资	33,609.90	1.92
买入返售金融资产	1,000,010.00	57.04
应收利息	-357.76	-0.02
证券清算款	637.81	0.04
资产类合计	1,753,121.64	100.00

#### 二、期末市值占集合计划资产净值前五名证券明细

序号	名称	份额	市值 (元)	占净值比例 (%)

1	乐普医疗	5,600	140,336.00	8.07
2	交通银行	5,000	27,250.00	1.57
3	上海机场	300	23,934.00	1.38
4	申通快递	1,000	22,990.00	1.32
5	洋河股份	200	20,800.00	1.20

### 三、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前五名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未到受到公开谴责、处罚。

## 第5节 集合计划费用计提基准、计提方式和支付方式

### 一、管理人的管理费

管理费的年费率为【0.10】%，管理费以前一日资产净值为基础，每日应计提的管理费的计算公式为：

$$G = E \times [0.10] \% \div 365$$

G为每日应计提的管理费；

E为前一日集合资产管理计划资产净值。

集合计划的管理费每日计提，按季支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在季初的第【6】个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。产品终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

### 二、托管人的托管费

托管费的年费率为【0.04】%，托管费以前一日资产净值为基础，每日应计提的托管费的计算公式为：

$$H = E \times [0.04] \% \div 365$$

H为每日应计提的托管费；



E 为前一日集合资产管理计划资产净值。

集合计划的托管费每日计提，按季支付。

由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在季初的第【6】个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。产品终止后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。

三、为维护集合计划资产的权利而发生的解决纠纷费用，包括但不限于诉讼费、律师费、仲裁费等。

四、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

五、银行结算费用、开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费、注册登记机构收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用，在发生时一次性计入集合计划费用；

开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；

与集合计划运营有关的其他费用，在发生时一次进入集合计划费用。

上述计划费用中第三至五项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额向托管行出具资金划拨指令支付。

## 第6节 收益分配情况

本报告期内，本集合资产管理计划未进行收益分配

## 第7节 重大事项情况

本报告期内，本集合计划未变更投资经理，未发生关联交易

## 第8节 信息披露的查阅方式

### 一、备查文件

- 1、《德邦心连心掘金1号集合资产管理计划合同》；
- 2、《德邦心连心掘金1号集合资产管理计划托管协议》；
- 3、管理人业务资格批件、营业执照；
- 4、报告期内德邦心连心掘金1号集合资产管理计划披露的各项公告；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 二、查询方式

1、登载报告正文的管理人互联网网址：	<a href="http://www.tebon.com.cn">http://www.tebon.com.cn</a>
2、计划报告置备地点：	上海市福山路500号17楼

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人德邦证券股份有限公司。

