

德邦心连心掘金 1 号集合资产管理计划

2020 年第二季度资产管理报告



报告期：2020 年 04 月 01 日-2020 年 06 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 2020 年 07 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。

本报告期由 2020 年 04 月 01 日起，至 2020 年 06 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主办，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2020年06月30日，集合计划单位净值为0.8601。报告期内，产品季度净值增长率为1.07%。

三、份额变动

报告期初份额总额为2,000,660.00份，报告期间申购份额为0份，报告期间赎回份额为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

二季度，市场走势整体处于宽幅震荡中，受全球范围疫情影响及对经济冲击的担忧，行情的发展略显谨慎，整个市场依旧是结构性行情轮动。消费和医药板块是市场的主旋律，市场资金的投资风格依旧以防御为主，医药制造、生物科技、食品饮料等行业估值持续提升。

展望三季度，进入7月份，市场对半年报业绩披露的关注度提升，消费医药等板块目前已运行至相对高位，关注市场风格向周期及金融类标的的轮动。深挖优质个股，优选行业龙头。

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	1,720,739.46
期末单位净值	0.8601
期末累计净值	0.8601

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	1,340,162.30	77.55
清算备付金	1,903.60	0.11
存出保证金	1,108.96	0.06
股票投资	384,750.00	22.26
应收利息	133.34	0.01
资产类合计	1,728,058.20	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	沪电股份	3,500	87,430.00	5.08
2	新大陆	5,000	79,900.00	4.64
3	招商银行	1,500	50,580.00	2.94
4	横店东磁	3,000	33,750.00	1.96
5	伊利股份	1,000	31,130.00	1.81

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【1.5】%，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：

$$G = E \times 【1.5】\% \div 365$$

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。

管理人的管理费按日计提，按季支付，于每季度结束后的下一个月的前 10 个工作日内由管理人向托管人出具管理费划付指令，托管人复核无误后一次性从集合资产支付给管理人。如遇法定节假日、休息日或集合计划资产中未有足额现金支付的，支付日期顺延。

二、托管人的托管费

托管费的年费率为【0.1】%，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：

$$H = E \times 【0.1】\% \div 365$$

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。

托管人的托管费按日计提，按季支付，于每季度结束后的下一个月的前 10 个工作日内由管理人向托管人出具托管费划付指令，托管人复核无误后一次性从集合资产支付给托管人。如遇法定节假日、休息日或集合计划资产中未有足额现金支付的，支付日期顺延。

三、业绩报酬

本集合计划根据年化收益率提取业绩报酬，规则如下：

R 为本集合计划的年化收益率， $R \leq 4\%$ 时，管理人不收取任何报酬； $4\% < R$ 时，管理人对收益超出 4% 的部分提取 20% 的报酬。

四、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。

五、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

六、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。

上述计划费用中第四至六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，本集合资产管理计划未发生投资经理变更，未发生关联交易等其它重大事项。

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资产管理合同》；
- 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：	http://www.tebon.com.cn
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。

