

德邦心连心曦和 3 号固收增强集合资产管理计划

2023 年第三季度资产管理报告

报告期：2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日

管理人：德邦证券资产管理有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司

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兴业银行股份有限公司于 2023 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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 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：	德邦心连心曦和3号固收增强集合资产管理计划
2、计划类型：	固收类
3、计划交易代码	CE1321
4、计划成立日	2020-07-31
5、成立规模	29,151,714.60 份
6、报告期末计划份额总额	27,642,690.96 份
7、计划合同存续期	5 年

第2节 管理人报告

一、投资经理简介

刘迪，对外经济贸易大学金融学硕士。2012 年任职首创证券固定收益部，2014 年任职易方达基金固定收益部，2021 年 8 月加入德邦资管，现任固收投资部投资经理。

二、业绩表现

截止到 2023 年 09 月 30 日，集合计划单位净值为 1.0232。报告期内，产品季度净值增长率为-0.41%。

三、份额变动

报告期初份额总额为 33,834,223.10 份，报告期间申购份额为 301,000.10 份，报告期间赎回份额为 6,492,532.24 份，红利再投资份额为 0.00 份，报告期末份额总额为 27,642,690.96 份。

四、投资回顾与展望

三季度债市呈 N 型走势，经济修复放缓及央行超预期降息带动债券收益进一步下行创年内新低，7 月底起宏观刺激政策陆续出台，8 月底地产刺激政策出台引发债市快速回调，9 月资金面收紧使得债市调整持续至季度末。三季度权益市场在 7 月底政治局会议定调后小幅反弹，后受 7 月经济数据再次下滑、美

国加息预期再起等多重内外部因素影响持续下探。整季看价值风格跑赢成长，上证 50 上涨 0.60%，沪深 300 下跌 3.98%，中证 1000 下跌 7.92%。分行业看煤炭、非银、石油石化表现较好，新能源、计算机、传媒表现较差。

展望四季度，多重政策刺激下经济基本面有望持续改善，但受制于地产行业复苏缓慢经济增速复苏斜率难大幅提升，债券市场整体配置力量仍在，债券收益难以大幅上行。权益资产具有较高配置价值，看好经济复苏受益行业及产业政策持续扶持的半导体等领域。

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	28,283,111.57
期末单位净值	1.0232
期末累计净值	1.1280

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	238,424.47	0.67
清算备付金	517,046.23	1.46
存出保证金	50,159.64	0.14
以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资	17,655,869.76	49.80
以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资 资产支持证券	2,103,073.97	5.93
以公允价值计量且其变动计入当期损益的基金投资	14,890,114.71	42.00
资产类合计	35,454,688.78	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	22 国债 24	52,000.00	5,362,714.41	18.96
2	招商双债	3,246,254.00	4,862,888.49	17.19
3	20 华控 01	21,000.00	2,164,943.79	7.65
4	汴京 03 优	20,000.00	2,103,073.97	7.44
5	20 商铁 02	20,000.00	2,074,816.44	7.34

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

	本期（元）	上期（元）
当期应支付的管理费（报告期间计提金额）	48,428.84	53,078.88

本集合计划支付给管理人的管理费按委托财产前一日的资产净值计提。本集合计划年管理费率为【0.6】%。

管理人的管理费每日计提，按季支付，于次季度初依据管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日或现金资产不足以支付等，支付日期顺延。

二、托管人的托管费

	本期（元）	上期（元）
当期应支付的托管费（报告期间计提金额）	1,614.33	1,769.35

本集合计划支付给托管人的托管费按委托财产前一日的资产净值计提。本集合计划年托管费率为【0.02】%。

托管人的托管费每日计提，按季支付，于次季度初依据管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日或现金资产不足以支付等，支付日期顺延。

三、业绩报酬

	本期(元)	上期(元)
当期支付的业绩报酬（报告期间计提金额）	0.00	0.00

本集合计划在计划分红日、委托人退出日、业绩报酬计提基准调整日或本

集合计划终止日，根据委托人每笔份额的期间年化收益率（R），对期间年化收益率分段计提业绩报酬。业绩报酬计提基准，具体以管理人公告为准。

集合计划分红、委托人退出集合计划，或集合计划终止时，管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人复核后于收到指令后 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付至管理人的银行账户，若遇法定节假日、休息日，支付日顺延。

四、其他可列入资产管理业务费用的项目

按照法律法规及本合同、投资标的相关业务合同的约定可以在委托财产中列支的其他费用，包括增值税费、交易费用、账户费用等。

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、《德邦心连心曦和 3 号固收增强集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、管理人业务资格批件、营业执照；
- 3、报告期内德邦心连心曦和 3 号固收增强集合资产管理计划披露的各项公告；
- 4、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.tebonam.com.cn
2、计划报告置备地点：	上海市杨浦区荆州路 198 号 23 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资产管理有限公司。

德邦证券资产管理有限公司

2023年10月16日