

德邦基金羊皮卷 1 号 FOF 集合资产管理计划

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

资产管理人：德邦基金管理有限公司

资产托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

资产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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

资产托管人交通银行股份有限公司根据资产管理合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托财产，但不保证委托财产一定盈利。

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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划的资产管理合同。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

§ 2 产品概况

专户代码	SXK231
专户名称	德邦基金羊皮卷 1 号 FOF 集合资产管理计划
专户类型	集合
专户简称	德邦羊皮卷 1 号 FOF
资产管理人	德邦基金管理有限公司
资产托管人	交通银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标与净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)
期末投资组合资产净值	16,833,230.54
期末投资组合份额净值	0.9350
投资组合净值增长率	-9.88%

3.2 资产管理计划净值表现

阶段	份额净值增长率
过去三个月	-9.88%

§ 4 资产管理人履职报告

4.1 投资经理简介

王栋栋先生，硕士，毕业于北京大学经济学专业。曾任招银理财研究部总经理、委外投资部专户投资经理。2022 年 3 月加入德邦基金，现任德邦基金 FOF 投资部总经理。

丁涵怡女士，硕士。2011 年 7 月至 2012 年 8 月任职于中国太平洋财产保险股份有限公司温州分公司，从事人力资源工作；2014 年 7 月至 2014 年 10 月任职于联通数据股份有限公司，从事投资研究工作；2014 年 10 月至 2018 年 7 月任职于上海喜岳投资管理有限公司，从事风控工作；2018 年 7 月至 2021 年 4 月任职于平安科技（上海）有限公司 AI 投资团队部，担任资深投资经理；2021 年 4 月至 2021 年 6 月任职于德邦证券股份有限公司，担任产研中心高级研究经理。2021 年 6 月加入德邦基金管理有限公司，先后担任股票研究部高级经理、专户业务部投资经理。

4.2 资产管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，本资产管理人严格遵守有关法律法规、资产管理合同、计划说明书等有关法律文件的规定，以取信于市场、取信于本计划资产委托人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产。在本报告期内，本计划运作合法合规，未发生违反资产管理合同的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本资产管理人严格按照有关法律法规、中国证监会监管规定及公司内部相关制度规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本资产管理人对不同资产管理计划之间发生的同向交易和反向交易进行监控。同一交易日内，本计划不存在反向交易。

4.4 计划期内投资策略和运作分析

本报告期内，本资产管理人根据大类资产配置研究、基金产品研究、内部流程和风险控制进行投资。

§ 5 托管人履职报告

5.1 报告期内本资产托管人遵规守信情况声明

本报告期内，资产托管人在托管过程中，严格遵守了有关法律法规、中国证监会监管规定以及资产管理合同等有关法律文件的规定，尽职尽责地履行了资产托管人应尽的义务，不存在任何损害资产委托人利益的行为。

5.2 资产托管人对报告期内本计划投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，资产管理人在投资运作、计划资产净值的计算、计划资产费用开支等问题上，资产托管人未发现损害资产委托人利益的行为。本报告期内本资产管理计划未进行收益分配。

5.3 资产托管人对季度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由资产管理人编制并经资产托管人复核审查的有关资产管理计划的季度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 投资组合报告

6.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中： 股票	-	-
2	基金投资	16,822,124.31	99.09
3	固定收益投资	-	-
	其中： 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	71,513.95	0.42
8	其他资产	82,218.13	0.48
9	合计	16,975,856.39	100.00

6.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本资产管理计划本报告期末未投资股票。

6.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本资产管理计划本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本资产管理计划本报告期末未投资债券。

6.5 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	005064	广发中证全指家用电器指数 C	1,512,757.70	1,787,020.67	10.62
2	001857	易方达现代服务业混合	927,184.02	1,658,732.21	9.85
3	014320	德邦半导体产业混合发起式 C	1,628,341.98	1,454,597.89	8.64
4	014413	招商核心竞争力混合 C	1,316,572.89	1,365,812.72	8.11
5	005889	华夏新兴消费混合 C	490,099.84	1,076,357.27	6.39
6	013392	广发港股通优质增长混合 C	927,453.54	991,076.85	5.89
7	017773	大成消费主题混合 C	481,927.71	872,771.08	5.18
8	001412	德邦鑫星价值灵活配置混合 A	773,215.80	838,629.86	4.98
9	159869	游戏 ETF	740,800.00	805,990.40	4.79
10	004260	德邦稳盈增长灵活配置混合	827,208.39	787,915.99	4.68

§ 7 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

注：本报告期内本资产管理计划未进行收益分配。

§ 8 管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式

8.1 管理费计提基准、计提方式和支付方式

本计划委托财产的年管理费率为【1.0】%/年。计算方法如下：

资产管理计划的管理费 = 本资产管理计划前一日资产净值 × 【1.0】% × 资产管理计划实际存续天数 / 365

自本计划成立日起, 管理费每日计提并按季支付。资产管理人与资产托管人核对一致后, 由资产托管人自动于每自然季度首日起第三个工作日, 按照指定的账户路径进行资金支付, 资产管理人无需再出具资金划拨指令。如遇托管账户资金余额不足的, 托管人可待托管账户余额充足时再划扣。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的, 支付日期顺延。

8.2 托管费计提基准、计提方式和支付方式

本委托财产年托管费率为【0.05】%。计算方法如下:

资产管理计划的托管费 = 本资产管理计划前一日资产净值 × 【0.05】% / 当年天数

自本计划成立日起, 托管费每日计提并按季支付。资产管理人与资产托管人核对一致后, 由资产托管人自动于每自然季度首日起第三个工作日, 按照指定的账户路径进行资金支付, 资产管理人无需再出具资金划拨指令。如遇托管账户资金余额不足的, 托管人可待托管账户余额充足时再划扣。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的, 支付日期顺延。

8.3 业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

(1) 业绩报酬的计提原则

业绩报酬计提时间: 业绩报酬于本计划分红、委托人退出日和资产管理计划终止且财产最终清算时收取, 具体以管理人公告为准。在分红提取业绩报酬时, 若计算所得的业绩报酬金额大于该次分红金额, 则业绩报酬的实际计提数额以该次分红为限。

从分红资金中提取业绩报酬的计提频率不得超过每 6 个月一次。同一资产委托人不同时间多次参与的, 对资产委托人每笔参与份额分别计算年化收益率, 计提业绩报酬。

(2) 业绩报酬的计算方式

业绩报酬 = $Q \times P \times \left[\frac{(P1 - P0)}{P - R} \times T \div 365 \right] \times 15\%$

其中:

Q 为应计提业绩报酬的份额的数量。

P0 为在业绩报酬计提日应计提业绩报酬的份额所对应的认购或参与时的计划份额累计份额净值或上一业绩报酬计提日的累计份额净值, 首次提取时为 1.000。

P1 为业绩报酬计提日 (委托人退出时或收益分配时或终止清算时) 估值核对后的计划

份额累计份额净值。业绩报酬提取日为系统的实际计算日。

P 在某一业绩报酬计提日，如果该笔份额此前没有计提过业绩报酬，则 P 为在业绩报酬计提日应计提业绩报酬的份额所对应的认购或参与时的计划份额的份额净值；若该笔份额此前计提过业绩报酬，则为上一业绩报酬计提日的份额净值。

T 为截至业绩报酬计提日资产委托人持有应计提业绩报酬的份额的自然日天数（含认购/参与日不含退出日）。

R 为计提基准收益率，数值为 10%。

若上述公式的计算结果小于或等于 0，则管理人不计提业绩报酬。

如果应计提业绩报酬的份额涉及多笔认购或参与份额，则按“先进先出”的原则对每笔认购或参与份额分别计算并计提业绩报酬。

资产管理人的业绩报酬由注册登记机构计算，并于每个业绩报酬计提日起的 10 个工作日内支付，托管人不负责复核业绩报酬，管理人出具划款指令从计划财产专户中扣除并支付。资产托管人对业绩报酬不进行复核。

§ 9 关联方交易

根据《德邦基金管理有限公司关联交易管理办法》，本报告期本资产管理计划未持有关联方证券。

§ 10 重大事项

自 2023 年 7 月 10 日起增聘王栋栋先生担任德邦基金羊皮卷 1 号 FOF 集合资产管理计划投资经理，变更后该产品的投资经理为王栋栋先生、丁涵怡女士。

§ 11 风险状况

本资产管理计划资产目前主要投资于公募基金。

本资产管理计划投资中的风险包括：市场风险，信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规性风险、投资于其他资产管理产品的风险、其他风险等，具体风险详见资产管理合同。

德邦基金管理有限公司
2023 年 10 月 25 日