

新时代新财富 50 号集合资产管理计划  
2019 年第二季度资产管理报告

管理人：新时代证券股份有限公司

托管人：中国银行股份有限公司广东省分行



# 1 重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》及其他有关规定制作。

本报告由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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

资产管理计划托管人中国银行股份有限公司广东省分行于2019年7月22日复核了本报告中的财务指标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。

资产管理计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。

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计划说明书。

本报告中相关财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

## 2 管理人履职报告

### 2.1 产品概况

资产管理计划名称:	新时代新财富 50 号集合资产管理计划
交易代码:	D22114
资产管理计划类型:	集合资产管理计划
成立日期:	2019 年 4 月 23 日
成立规模:	17,117,090.88 元
存续期:	5 年
管理人:	新时代证券股份有限公司
托管人:	中国银行股份有限公司广东省分行
证券账户信息:	D890175602、0899194822

## 2.2 投资主办人简介

柏圣书先生，数年金融行业从业经历，曾就职于天津信唐货币经纪有限责任公司，历任债券市场部利率债经纪人及信用债经纪人。2015年加入新时代证券资产管理总部投资管理部，历任债券研究员、投资顾问。具备良好的固定收益类产品知识基础，较强的债券交易能力，能及时准确洞察债券市场变化，寻求投资、交易机会。

常杨先生，西南财经大学会计硕士，会计师职称。数年证券投资从业经历，先后担任TMT行业研究员，投资经理助理等岗位，对于电子，通信，计算机，消费等多个行业有着长期深度研究和理解，擅长把握产业趋势和公司基本面投资，财务功底扎实，担任新时代证券资产管理总部投资经理。

## 2.3 投资主办人工作报告

二季度债券市场呈现先上后下的格局，3月份PMI重回荣枯线以上，经济出现短期企稳，同时货币政策收紧预期使得债券加速下跌，4月以来由于贸易摩擦升级叠加经济重新下行，收益率重回下行通道。5月份包商被接管，同业交易对手风险释放使得监管层向市场释放各类稳定信号。银行间市场形成“总量宽松+流动性梗阻和信用分层”的局面，低等级债券和质押融资回购较难的债务主体的再融资条件令人担忧，信用风险定价体系依然面临较高的分化压力。

策略和操作方面，本组合在二季度主要以票息策略为主，严格控制产品久期风险和持仓的评级分布，保证了产品的安全和流动性。未来本产品组合遵循稳健投资的原则，整体操作上呈中性。预计未来，将继续采取稳健的投资策略，优先考虑投资组合安全性。

二季度转债市场受到权益市场冲高回落影响，指数先上后下震荡，在中美贸易战不断反复叠加国内科创板进展等复杂影响下，权益市场和转债市场都呈现较大的波动性。转债的策略和操作方面，在基本面优先兼顾流动性的原则上，择机低位建仓，严格执行风控策略，建立转债投资白名单。未来操作仍将继续执行该策略，加大对止盈策略的执行。

## 2.4 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

报告期内本资产管理计划的运作符合相关法律、法规以及资产管理合同的约定，不存在损害持有人利益的行为。

### 3 主要财务指标和资产管理计划投资表现

#### 3.1 主要财务指标

	项目	2019年4月1日—2019年6月30日
1	本期利润(元)	123,297.70
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额(元)	99,752.57
3	期末资产管理计划份额(份)	17,117,090.88
4	期末资产管理计划资产净值(元)	17,240,388.58
5	期末单位资产管理计划资产净值(元)	1.0072
6	期末累计单位资产管理计划资产净值(元)	1.0072

#### 3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2019年第二季度	0.72%

#### 3.3 资产管理计划份额变动情况

期初总份额	期间参与份额	期间退出份额	期末总份额
17,117,090.88	17,117,090.88	0	17,117,090.88

### 4 资产管理计划投资组合报告

#### 4.1 资产组合情况

日期: 2019年6月30日

单位: 人民币元

	期末余额	占资产比例
银行存款、备付金及存出保证金	498,386.39	2.84%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	12,486,878.00	71.06%
基金投资	0.00	0.00%
买入返售金融资产	4,300,000.00	24.47%
其他资产	285891.08	1.63%
资产合计	17,571,155.47	100.00%

#### 4.2 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量	证券市值	市值占净值比例%
1	150461	18 即旅 01	40000	4,038,360.00	23.4238
2	031900411	19 豫能化 PPN004	40,000	3,999,600.00	23.1990
3	151010	19 邳经 01	20,000	2,000,000.00	11.6007
4	031763013	17 通泰控股 PPN001	10,000	1,005,100.00	5.8299
5	128059	视源转债	4000	459,508.00	2.6653

#### 4.3 报告期末按债券品种分类债券投资组合

序号	债券品种	市值（元）	市值占净值比例%
1	公司债	6,038,360.00	35.0245%
2	定向工具	5,004,700.00	29.0289%
3	可转债	1443818.00	8.38%

#### 4.4 投资组合报告附注

1、报告期内资产管理计划投资的前五名股票及债券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、资产管理计划投资的前十名股票及债券中，没有超出资产管理计划合同规定的投资范围。

## 5 资产管理计划收益分配情况

本资产管理计划本报告期未分红。

## 6 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

### 6.1 资产管理计划投资经理变更情况

本报告期内未发生投资经理变更情况。

### 6.2 重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

本报告期内未发生重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项。

## 7 备查文件目录

### 7.1 备查文件目录

1、中国证券投资基金业协会《关于新时代证券股份有限公司发起设立新时代新财富 50 号集合资产管理计划的备案确认函》；

2、《新时代新财富 50 号集合资产管理计划合同》；

3、《新时代新财富 50 号集合资产管理计划说明书》；

4、《新时代新财富 50 号集合资产管理计划风险揭示书》；

5、资产管理计划管理人业务资格批件、营业执照；

## 7.2 存放地点

文件存放地点：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

网址：<http://www.xsdzq.cn>

信息披露电话：95399

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人新时代证券股份有限公司。

