

新时代新财富 50 号集合资产管理计划
2020 年第三季度资产管理报告

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 2020 年 10 月 23 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 2020 年 7 月 1 日起至 2020 年 9 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

债券市场：资金方面三季度货币政策已从应对疫情期间的超宽松状态回归至常态化水平，央行日常通过削峰填谷的方式来进行公开市场操作，货币市场在央行的合意区间保持稳定。宏观方面：全球经济受海外疫情反扑扰动，我国疫情防控领先全球，经济修复进度领先海外，经济持续向好格局不变；内需提速，十一假期期间经济活动恢复有明显提高，国内游客6.18亿人次，实现旅游收入4543.3亿元，分别同比恢复79%和70%。国内经济保持弱复苏态势，积极变化不断增多。9月份PMI显示本月新出口订单指数和进口指数，今年以来首次升至荣枯线以上。债券市场表现：三季度随着经济修复和利率债的大量供给，货币政策回归常态，流动性预期发生边际收紧的转向，现券收益率震荡向上，10年国债收益率曲线上行32.52bp至3.1482%，19年国开债收益率曲线上行61.94bp至3.7194%。

债券策略和操作：本组合在三季度主要以票息策略为主，严格控制产品久期风险，保证了产品的安全和流动性。鉴于银行今年压降结构性存款的压力，国股AAA存单发行利率目前在3.10%左右的高点，相对于十年国债3.18%的位置，对长端的收益率下行抑制比较明显，国内经济持续向好格局不变，未来本产品组合将继续采取稳健的投资策略，优先考虑投资组合安全性，信用债配置久期仍建议1-2年，不宜过长。城投系统性风险进一步降低，加强个券分析和选取工作，关注AA等级城投的配置价值。

权益市场：三季度权益市场在短期快速上涨后进入长时间的震荡调整期，按照季度来看主要指数均上涨，其中上证综指涨幅7.82%，深证成指涨幅7.63%，创业板指涨幅5.6%。行业方面，休闲服务，国防军工，电器设备，汽车，食品饮料等行业涨幅居前，通信，商贸，

计算机三个行业收跌。整体上看三季度权益市场依旧保持了宽松的流动性环境，新发权益基金总额不断攀升。随着国内疫情的完全控制，复工复产向更大面积更深广度覆盖，边际修复明显。尤其是消费数据持续节节攀升，工业生产全面恢复，个别行业由于一二季度挤压的需求拉动，三季度呈现出部分供不应求的情况。

权益方面策略和操作：新时代新财富 50 号产品坚持基本面投资为主的中长期投资理念，同时根据市场发展灵活调整应对，努力控制回撤，为客户提供稳健增值。三季度主要配置消费医药，军工，机械等内需板块的行业龙头，通过长期持有获取稳健绝对收益，同时根据市场情况动态布局科技，新能源等成长性板块有竞争力企业个股获取弹性收益，坚守龙头配置思路。

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 | 2020年7月1日—2020年9月30日 |
|---|-------------------------|----------------------|
| 1 | 本期利润（元） | 396,416.70 |
| 2 | 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元） | 542,992.84 |
| 3 | 期末资产管理计划份额（份） | 15,034,293.82 |
| 4 | 期末资产管理计划资产净值（元） | 17,025,132.19 |
| 5 | 期末单位资产管理计划资产净值（元） | 1.1324 |
| 6 | 期末累计单位资产管理计划资产净值（元） | 1.2124 |

3.2 产品净值表现

| 阶段 | 净值增长率 |
|-----------|---------|
| 2020年第三季度 | 2.3777% |

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 |
| 15,034,293.82 | 0.00 | 0.00 | 15,034,293.82 |

4 资产管理计划投资组合报告

4.1 资产组合情况

日期：2020年9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 | 542,686.09 | 3.15% |
| 股票投资 | 2,295,319.00 | 13.34% |
| 债券投资 | 14,084,008.40 | 81.85% |
| 基金投资 | 0.00 | 0.00% |
| 其他资产 | 285,546.01 | 1.66% |
| 资产合计 | 17,207,559.50 | 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 | 032000455 | 20 荆门高新 PPN001 | 30,000 | 3,002,700.00 | 17.64 |
| 2 | 166687 | 20 靖投 D2 | 30,000 | 3,000,000.00 | 17.62 |
| 3 | 166384 | 20 世纪 D1 | 20,000 | 2,000,000.00 | 11.75 |
| 4 | 166824 | 20 兴化 D3 | 20,000 | 2,000,000.00 | 11.75 |
| 5 | 167241 | 20 淮开 D1 | 10,000 | 1,000,000.00 | 5.87 |

4.3 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股票投资明细

| 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 | 601888 | 中国中免 | 1,300 | 289,822.00 | 1.70 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 3,700 | 277,537.00 | 1.63 |
| 3 | 600809 | 山西汾酒 | 700 | 138,733.00 | 0.81 |
| 4 | 300015 | 爱尔眼科 | 2,000 | 102,840.00 | 0.60 |
| 5 | 002475 | 立讯精密 | 1,500 | 85,695.00 | 0.50 |

4.4 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 | 8,999,500.00 | 52.86 |
| 2 | 国债 | 305,160.00 | 1.79 |

| | | | |
|---|------|--------------|-------|
| 3 | 金融债 | 403,568.00 | 2.37 |
| 4 | 定向工具 | 3,002,700.00 | 17.64 |
| 5 | 可转债 | 1,373,080.40 | 8.07 |

4.5 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进行分红。

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出具的关于新时代新财富 50 号集合资产管理计划《资产管理计划备案证明》；

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。

