

新时代新财富 50 号集合资产管理计划  
2020 年第四季度资产管理报告

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1月21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10月1日起至2020年12月31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：进入四季度，央行公开市场操作相对中性，资金面出现节点性紧张，整体维持紧平衡状态。压降结构性存款使得银行负债压力加大，银行体系缺乏稳定的中长期资金来源，导致同业存单一路提价，债券收益率震荡上行，11月受信用风险事件冲击影响，10年国债收益率向上突破3.35%，到达年内高点，月末金融委会议明确打击“逃废债”，后续发改委、国资委、央行、银保监会、证监会均有所表态，债市止跌回升。同时央行出面维稳，通过MLF和OMO持续投放跨年资金，中央经济工作会议强调政策“不急转弯”，央行四季度例会重提“保持流动性合理充裕”，货币宽松预期再起，债市迎来了反弹行情，机构抢跑配置热情较高，行情提前启动，收益率回落至3.2%以下。截至12月31日，10年国债收益率报3.1429%，经历了一年的跌宕起伏，回到年初水平（1月2日3.1485%）。

债券策略和操作：本组合在四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，在本季度开放期顺利完成了产品的申购赎回和分红工作。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，关注核心职能属性和公益属性较强的平台投资机会。

权益市场：四季度权益市场整体上震荡上行，按照季度数据看主要的指数均实现上涨，其中上证综指涨幅7.92%，深证成指涨幅12.11%，创业板指数涨幅15.21%。市场风格分化较大，其中核心类资产，大盘股，景气度的行业成为市场抱团的主要方向。行业方面，有色金属，电气设备，食品饮料，家用电器，汽车涨幅居前，商业贸易，传媒，计算机，通信，建筑装饰跌幅居前。整体上看四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。新能源行业，顺周期行业在相关政策和需求的推动下，行业景气度加高，成为市场抱团的主要方向，核心资产涨幅较快，市场风格呈现强者恒强的局面。

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。四季度主要配置消费医药，新能源，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，军工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10月1日—2020年12月31日
1	本期利润（元）	1,005,126.61
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	483,932.50
3	期末资产管理计划份额（份）	19,688,925.88
4	期末资产管理计划资产净值（元）	21,726,365.93
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.1035
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.2635

#### 3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2020年第四季度	4.7426%

#### 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	9,767,824.82	5,113,192.76	19,688,925.88

## 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12月31日

单位：人民币元

项目	期末余额	占资产比例
银行存款、备付金及存出保证金	134,854.51	0.62%
股票投资	3,486,077.00	15.97%
债券投资	17,551,123.04	80.38%
基金投资	0.00	0.00%
其他资产	662,314.58	3.03%
资产合计	21,834,369.13	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	167270	20 兖投 02	35,000	3,512,950.00	16.17
2	151127	19 柳控 01	30,000	3,033,270.00	13.96
3	032000455	20 荆门高新 PPN001	30,000	3,001,800.00	13.82
4	166687	20 靖投 D2	30,000	3,000,000.00	13.81
5	166384	20 世纪 D1	20,000	2,000,000.00	9.21

### 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	600519	贵州茅台	200	399,600.00	1.84
2	000858	五粮液	900	262,665.00	1.21
3	000568	泸州老窖	1,100	248,776.00	1.15
4	300014	亿纬锂能	2,300	187,450.00	0.86
5	300750	宁德时代	500	175,555.00	0.81

### 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	12,545,720.00	57.74
2	定向工具	3,001,800.00	13.82
3	可转债	2,003,603.04	9.22

#### 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共进行一次分红，分红日期为 2020 年 10 月 15 日，分红金额为 1,202,743.53。

### 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。

