

新时代新财富 50 号集合资产管理计划
2020 年年度资产管理报告

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2021年3月3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1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

2020 年债券市场呈 V 型走势，先牛后熊，波动较大。年初新冠疫情爆发、货币政策宽松加码，现券收益率大幅下行，10 年期国债收益率曲线在 4 月 7 日达到最低位置 2.48%。进入五月份，央行操作转向常态化宽松预期落空、国内疫情好转经济回暖、利率债供给压力冲击多重因素共同作用下收益率转为震荡上行，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，较最低点回升 87BP。后续监管表态、央行维稳，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，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%）。

权益市场：2020 年在新冠肺炎大爆发的背景下，全球主要经济体经历了经济不确定性，同时世界主要经济体又通过宽松的货币政策对冲经济下滑。权益市场整体上延续 2019 年的火热行情，资金持续流入，公募基金发行数据良好。

市场风格呈现出典型的抱团核心资产和高景气度行业的特点，医药，食品饮料，新能源，军工，顺周期，银行等行业成为市场追捧和抱团的热点。由于科技外部环境的恶化，TMT 板块全年波动较大。

市场存在短期流动性扰动，同时叠加临近春季市场避险的需求，近期市场呈现出极致分化的结构性行情。主要表现有 2 个方面，一个是行业上主要是大消费和大金融为主，包括休闲服务，食品饮料，家电，医药，农林牧渔和轻工，其次就是大金融的银行板块。因担忧拜登上台后贸易战和对华科技政策的不确定性，科技板块和军工板块成为下跌的重灾区。第二个特点就是行业内部标的严重分化，从普涨到一线再到目前的超一线，有时候一个细分行业只有一两个标的上涨。

债券策略和操作：组合在本年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。全年主要配置消费医药，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 1 月 1 日—2020 年 12 月 31 日
1	本期利润（元）	3,018,584.17
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	2,737,367.68
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 年度	18.0923%

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	16,399,714.67	13,827,879.67	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

	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
4	定向工具	3,001,800.00	13.82
5	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 集合资产管理计划会计报告

5.1 集合计划资产负债表

日期：2020-12-31

单位：元

资产	期末余额	年初余额	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资产：			负 债：		
银行存款	65,038.03	129,212.19	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	67,178.18	25,633.71	交易性金融 融负债	0.00	0.00
存出保证金	2,638.30	1,885.50	衍生金融 负债	0.00	0.00
交易性金融 资产	21,037,200.04	17,951,482.20	卖出回购 金融资产款	0.00	0.00
其中：股票 投资	3,486,077.00	2,762,506.00	应付证券 清算款	6,782.16	130,155.44
债券 投资	17,551,123.04	15,188,976.20	应付赎回 款	0.00	0.00
基金 投资	0.00	0.00	应付管理 人报酬	7,189.37	6,217.34
权证投资	0.00	0.00	应付托管 费	718.96	621.72
资产 支持证券投资	0.00	0.00	应付销售 服务费	0.00	0.00
衍生金融工 具	0.00	0.00	应付交易 费用	653.59	256.95
买入返售金 融资产	0.00	0.00	应交税费	42,659.12	34,298.74
应收证券清 算款	7,427.41	155,991.64	应付利息	0.00	0.00
应收利息	653,796.29	468,218.04	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	其他负债	50,000.00	50,000.00

应收申购款	0.00	0.00	负债合计	108,003.20	221,550.19
其他资产	1,090.88	1,090.88			
			所有者权益:		
			实收基金	19,688,925.88	17,117,090.88
			未分配利润	2,037,440.05	1,394,873.09
			所有者权益合计	21,726,365.93	18,511,963.97
资产合计	21,834,369.13	18,733,514.16	负债和所有者权益总计	21,834,369.13	18,733,514.16

5.2 集合资产管理计划损益表

日期: 2020年01月 - 2020年12月

单位: 元

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	3,291,446.63	1,527,571.17
2	1、利息收入	786,957.29	528,036.69
3	其中: 存款利息收入	3,563.81	5,240.09
4	债券利息收入	781,137.07	512,318.75
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	2,256.41	10,477.85
7	2、投资收益	2,223,272.85	638,330.35
8	其中: 股票投资收益	1,893,195.08	211,057.17
9	债券投资收益	380,971.88	408,312.91
10	基金投资收益	0.00	0.00
11	权证投资收益	0.00	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
13	衍生工具收益	0.00	0.00
14	股利收益	15,343.77	37,000.17
15	投资收益-差价收入增值税低减	-66237.88	-18039.9
16	3、公允价值变动收益	281,216.49	361,204.13
17	4、其他收入	0.00	0.00
18	二、费用	272,862.46	132,698.08
19	1、管理人报酬	71,835.82	48,536.81

20	2、托管费	7,183.56	4,853.66
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	88,867.00	9,816.25
23	5、利息支出	1,927.29	0.00
24	其中：卖出回购金融资产支出	1,927.29	0.00
25	6、其他费用	91,386.36	64,181.96
26	7、税金及附加	11,662.43	5,309.40
27	三、利润总和	3,018,584.17	1,394,873.09

6 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二次分红，分红日期分别为 2020 年 4 月 7 日和 2020 年 10 月 15 日，两次分红总金额为 2,572,110.77。

7 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

7.1 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。

7.2 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。

8 备查文件目录

8.1 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；

8.2 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。

