

新沃基金-乾元 2 号资产管理计划

2021 年第二季度报告

2021 年 6 月 30 日



资产管理人：新沃基金管理有限公司

资产托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：二〇二一年七月三十日

§ 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。

本报告期自2021年4月1日起至2021年6月30日。

资产托管人中信证券股份有限公司依照相关法律法规及《资产管理合同》对本计划管理人的投资运作进行了必要的监督；本计划2021年4月1日起至2021年6月30日的相关财务数据经核实无误。

§ 2 资产管理计划概况

2.1 资产管理计划简介

专户代码	ZH0046
专户名称	新沃基金-乾元2号资产管理计划
专户类型	一对一
专户简称	新沃基金-乾元2号
运作方式	开放式
存续年限	无固定期限
合同成立日	2016年9月23日
资产管理人	新沃基金管理有限公司
资产托管人	中信证券股份有限公司

2.2 资产管理人简介

新沃基金管理有限公司是由中国证券监督管理委员会批准设立的全国性基金管理公司。公司由新沃资本控股集团有限公司(以下简称“新沃集团”)和新沃联合资产管理有限公司(以下简称“新沃联合”)共同发起,并于2015年8月19日取得营业执照。公司注册资本为人民币1.35亿元,其中新沃集团、新沃联合的出资比例分别为70%、30%。

公司实际经营的业务包括证券投资基金的募集和管理,特定客户资产管理计划的销售和管理,投资管理和投资咨询等。

§ 3 投资运作报告

3.1 投资经理简介

姓名	职务	任本计划的投资经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘岫	投资经理	2017 年 3 月 14 日	-	6 年	刘岫先生，乔治华盛顿大学金融专业硕士学历，6 年证券从业经历。2016 年 1 月起加入新沃基金管理有限公司，历任研究员、投资经理助理，投资经理。2017 年 3 月 14 日起任本产品投资经理。

3.2 投资经理变更

无。

3.3 报告期内本计划投资运作及市场展望

3.3.1 宏观经济分析

上半年，我国市场主体预期向好，主要宏观指标处于合理区间，经济发展呈现稳中加固、稳中向好态势。初步核算，上半年国内生产总值 532167 亿元，按可比价格计算，同比增长 12.7%，比一季度回落 5.6 个百分点；两年平均增长 5.3%，两年平均增速比一季度加快 0.3 个百分点。分产业看，上半年第一产业增加值 28402 亿元，同比增长 7.8%，两年平均增长 4.3%；第二产业增加值 207154 亿元，同比增长 14.8%，两年平均增长 6.1%；第三产业增加值 296611 亿元，同比增长 11.8%，两年平均增长 4.9%。全国城镇新增就业 698 万人，完成全年目标的 63.5%。6 月份，全国城镇调查失业率为 5.0%，与 5 月份持平，比上年同期下降 0.7 个百分点。16-24 岁人口、25-59 岁人口调查失业率分别为 15.4%、4.2%。31 个大城市城镇调查失业率为 5.2%，与 5 月份持平。全国企业就业人员周平均工作时间为 47.6 小时，比 5 月份增加 0.3 小时。

3.3.2 行情回顾及本计划运行情况分析

二季度指数震荡上行，创业板强于主板，同时行业景气分化导致不同板块走势同样出现明显分化。以新能源、智能驾驶、电子、医药为代表的高景气行业表现突出，受益全球经济复苏的化工、有色板块同样涨幅较高。二季度上证综指涨 4.34%、深成指涨 10.04%、创业板指涨 26.05%。中信一级行业中电力设备新能源、电子、综合、汽车、基础化工涨幅靠前，农林牧渔、房地产、家电、消费者服务、非银金融跌幅较大。

报告期内，基金管理人深入研究市场行情，密切跟踪市场动态变化，实施积极主动的组合投资，选择合适的介入机会，灵活调整资产配置及久期分布，加强组合的流动性及信用风险管理。在有效控制投资风险的前提下，力争为委托人实现稳定的投资回报。

3.3.3 市场展望和投资策略

产业周期和景气度决定板块的中期趋势和方向，追逐高景气是A股市场不变的“哲学”。但短期来看，流动性等宏观外部冲击决定了成长板块的节奏。国内全面降准后MLF缩量续作且利率维持不变，外部冲击是接下来的焦点，预计会对A股市场造成较大影响。对于TGA压降节奏、QE缩量时点这两个关键因素，前者可能在8月之后见到流动性释放的拐点，后者可能在三季度中后期进入预期发酵窗口期、明年一季度进入正式减量窗口。在外部冲击过后，市场大概率依旧会选择产业周期与景气度持续向好的方向。

本资产管理计划将在合法合规的前提下，根据合同所约定的投资范围和市场环境构建投资策略，以获取稳定回报。

§ 4 主要财务指标及投资业绩表现

4.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

期间数据和指标	报告期（2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-5,266,517.40
本期利润	-5,266,517.40
期末基金资产净值	-155,797,968.20

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4.2 利润分配情况

本计划在本报告期内未进行利润分配。

4.3 投资业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为-2.651 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.474%。

§ 5 管理人报告

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、资产管理合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理本资产管理计划。本报告期内，本资产管理计划运作符合有关法律法规和资产管理合同的规定，没有损害资产委托人利益的行为。

§ 6 托管人履职报告

本托管人依据“新沃基金管理有限公司与我司签署的《新沃基金-乾元 2 号资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）”及相关法律法规履行托管责任，现将本报告期间托管情况报告如下：

一、本托管人在报告期间，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在损害资产委托人利益的行为。

（一）本托管人以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管托管专户内委托资产；非依法律规定、行政法规或管理合同约定，不得擅自动用或处分托管资产；

（二）根据《管理合同》约定，执行管理人划款指令，办理托管账户项下资金往来；

（三）妥善保管与委托资产有关的会计账册、凭证、合同等资料；

(四)根据《管理合同》规定,对资产管理人运用投资组合资产进行投资的行为进行了监督;

(五)为投资组合单独设立托管专户,与自有账户以及所托管的其他非本投资组合的托管专户分别保管,实行了严格的分账管理,维护投资组合资产的独立性。

二、本计划托管人复核了管理人的2021年2季度报告中财务数据,该数据与托管人数据一致。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占总资产的比例 (%)
1	权益投资		
	其中:股票		
2	基金投资		
3	固定收益投资	188,825,000.00	91.65
	其中:债券	188,825,000.00	91.65
	资产支持证券		
4	金融衍生品投资		
5	买入返售金融资产		
	其中:买断式回购的买入返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	1,672,972.47	0.81
7	其他资产	15,534,409.28	7.54
8	合计	206,032,381.75	100.00

7.2 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本计划本存续期末持有股票投资。

7.3 期末按公允价值占资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	011698689	16大机床 SCP003	3,500,000	188,825,000.00	-121.20

注:本计划本报告期末只持有一只债券

由于16大机床SCP003于到期日2017年7月24日未如期兑付。为防止虚增资产故经咨询同业以

及与托管行协商到期日之后估值依然采取停牌价格估值。故此债券依然有持仓。

7.4 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名金融衍生品投资明细

本计划本报告期末未持有金融衍生品。

7.5 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本计划本报告期末未持有基金。

7.6 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 8 重大事项揭示

本报告期内，本资产管理计划无关联交易事项。

2019 年度，根据《大连机床系列企业重整计划》的要求，全体金融类转股债权人根据重整计划规定所应取得的股权设立合伙企业，由合伙企业持有新大连机床股权，金融类转股债权人间接持有新大连机床的股权。目前该有限合伙企业已于 2019 年 12 月 17 日登记成立，乾元 2 号资产管理计划所持债权转为 1 元新大连机床出资情况如下：

序号	有限合伙人名称	实际转股的债权 金额(元)	合伙企业实缴 出资额(元)	新大连机床 权益比例(%)
1	新沃基金管理有限公司（新沃基金-乾元 2 号资产管理计划）	376,274,597.29	18,310,199.38	2.40

§ 9 公平交易制度的执行情况及异常交易行为专项说明

公司私募资产管理业务与证券投资基金业务之间严格隔离，严格遵守公司公平交易管理办法，未发生异常交易及不公平交易的情况。

新沃基金管理有限公司

二〇二一年七月三十日