

新时代新财富 50 号集合资产管理计划
2021 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 2021 年 7 月 8 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 2021 年 4 月 1 日起至 2021 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

周鹤翔女士，北京大学药学经济学双学士，北京大学药剂学硕士，先后供职于新时代证券证券投资部、平安证券有限责任公司投资管理部、新时代证券证券资产管理总部，历任行业研究员、投资经理助理、投资主办人、资管权益投资负责人，11年投研经验，管理产品两度获得金牛理财产品称号，擅长从产业经济学角度分析不同企业的产业链地位和差异，注重企业安全边际的研究，投资奉行在有效控制回撤的基础上取得超越市场平均收益率。

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。

2.3 投资主办人工作报告

债券市场：二季度由于资金面整体超预期宽松，社融增速回落、经济复苏进程放缓，通胀等利空因素钝化，长端10年期国债收益率震荡下行11BP至3.08%。信用债方面信用风险总体可控，未出现超预期的风险事件，信用利差缩窄明显，信用债收益率整体下行，在机构普遍配置压力较大的情况下中低等级下行幅度更大，城投类债券区域分化明显。展望后市下半年经济复苏态势或将呈现放缓局面，政策以稳为主，利率债整体并不缺利好因素，但收益率预计延续区间震荡态势，利率整体波动空间不大，信用配置方面城投债相关政策边际收紧，在区域选择仍需慎重。

债券策略和操作：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，保证了产品的安全和流动性。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：2021年上半年上证指数上涨3.4%，深圳成指上涨4.78%，沪深300上涨0.24%，创业板指上涨17.22%，总体而言市场呈现出权重股较为低迷，成长股延续强势，题材股活跃的特征。行业层面，钢铁、采掘、电气设备、化工等周期性行业领涨，非银金融、家电、军工、农林牧渔领跌，主题层面新能源、生物医药、新科技依然火热。随着2月份权重股集体见顶，去年的核心资产经历了一轮大幅下跌后又逐步反弹的行情，核心资产整体呈现较高波动、较低收益率的特征。市场交易活跃，但整体赚钱效应并不强，个股大多快速上涨后

又快速下跌，整体趋势性不强。展望下半年，在海外即将收紧流动性的大背景下，市场估值依然承压，但对于国内来说，资本市场接替房地产市场成为信用扩张主体的趋势才刚刚开始，也很难面临较大规模的资金净流出，因此寻找业绩高质量增长的核心标的依然是大部分机构的核心策略。

权益策略和操作：报告期内，本产品组合遵循稳健投资的原则，坚持配置优秀的公司才是最大的安全边际，重点配置估值较为合理且处在上升期的高端制造、医疗服务、新能源等个股。

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	2021年4月1日—2021年6月30日
1	本期利润（元）	476,961.00
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	369,208.31
3	期末资产管理计划份额（份）	19,442,205.54
4	期末资产管理计划资产净值（元）	21,976,958.21
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.1304
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.2904

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2021年第二季度	2.2061%

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

19,688,925.88	2,845,295.77	3,092,016.11	19,442,205.54
---------------	--------------	--------------	---------------

4 资产管理计划投资组合报告

4.1 资产组合情况

日期：2021年6月30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	482,818.03	2.18%
股票投资	2,420,869.00	10.94%
债券投资	18,466,032.14	83.42%
基金投资	0.00	0.00%
其他资产	765,692.12	3.46%
资产合计	22,135,411.29	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	162331.SH	19 渝合 01	40,000	4,069,400.00	18.52
2	167270.SH	20 尧投 02	35,000	3,512,950.00	15.98
3	151127.SH	19 柳控 01	30,000	3,033,270.00	13.80
4	032000455.IB	20 荆门高新 PPN001	30,000	3,018,000.00	13.73
5	108604.SZ	国开 1805	15,540	1,558,211.34	7.09

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	300747.SZ	锐科激光	3,000	342,180.00	1.56
2	002508.SZ	老板电器	6,000	279,000.00	1.27
3	002415.SZ	海康威视	4,000	258,000.00	1.17
4	002706.SZ	良信股份	10,000	225,400.00	1.03
5	600660.SH	福耀玻璃	4,000	223,400.00	1.02

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	10,615,620.00	48.30
2	定向工具	3,018,000.00	13.73
3	可转债	3,274,200.80	14.90
4	政策银行债	1,558,211.34	7.09

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。

新时代证券股份有限公司

2021年7月30日

