

新时代新财富 50 号集合资产管理计划  
2021 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 2021 年 10 月 14 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 7 月 1 日起至 2021 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

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：三季度宏观基本面受地产下行、内需偏弱等制约，经济增长动能减弱，7月份超预期降准引发市场交易经济下行和货币宽松预期，收益率快速下行，10年国债从7月初的3.1%附近一路下降到8月初2.8%的历史低位，随后围绕2.8%-2.9%范围窄幅震荡。展望后市短期来看在美债上行、工业品涨价以及供给压力影响下仍会形成一定的调整压力，债市更多表现为窄幅震荡，但年内不会出现大的流动性缺口和波动，流动性稳定有望构筑债市稳定的基础，长期看在基本面下行压力增大、宽货币和机构普遍欠配的背景下，整体仍支撑收益率下行。

债券策略和操作：本组合在三季度主要以票息策略为主，配置品种选择兼顾收益和安全的短久期城投债为主，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年三季度上证指数下跌0.64%，深圳成指下跌5.62%，沪深300下跌6.85%，创业板指下跌6.69%，指数整体低迷，热点板块的快速轮动。行业层面，前三季度煤炭、有色、化工等周期领涨，金融、消费领跌。核心资产整体依然走弱，处在杀估值阶段。整体市场依然呈现较高波动、较低收益率的特征。展望四季度，经济下行压力依然较大。缺电背景下，让很多制造业公司的生产面临一定的不确定性，从而让很多公司业绩难以判断。同时，恒大事件对地产相关产业链的风险传导也有待观察。流动性预计还是会在合理充裕的

范围运行，重点关注信用是否进一步发生紧缩。整体行情预期较为平淡，前期跌幅较大的行业可能会迎来反弹，市场演绎分化收敛的行情。

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，坚持配置具备明显安全边际的公司，重点配置了高端制造和部分估值合理的消费个股。

#### 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7月1日—2021年9月30日
1	本期利润（元）	-346,499.13
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	-33,348.33
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）	21,630,459.08
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.1126
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.2726

#### 3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2021年第三季度	-1.5747%

#### 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
19,442,205.54	0.00	0.00	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9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	210,965.36	0.97%
股票投资	2,126,106.00	9.77%
债券投资	16,294,824.00	74.90%
基金投资	390,650.00	1.80%
其他资产	2,732,170.80	12.56%
资产合计	21,754,716.16	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	151500.SH	19上投01	50,000	5,068,350.00	23.43
2	162331.SH	19渝合01	40,000	4,069,400.00	18.81
3	151127.SH	19柳控01	30,000	3,033,270.00	14.02
4	032000455.IB	20荆门高新PPN001	30,000	3,023,100.00	13.98
5	123099.SZ	普利转债	2,000	252,500.00	1.17

#### 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	600298.SH	安琪酵母	5,000	250,850.00	1.16
2	600461.SH	洪城环境	25,000	211,500.00	0.98
3	300747.SZ	锐科激光	3,000	173,730.00	0.80
4	600660.SH	福耀玻璃	4,000	169,000.00	0.78
5	300218.SZ	安利股份	10,000	163,300.00	0.75

#### 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	12,171,020.00	56.27
2	定向工具	3,023,100.00	13.98
3	可转债	1,100,704.00	5.09

#### 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末进行分红。

## 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10月29日

1101080754471

