

新时代新财富 50 号集合资产管理计划
2021 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2022年3月1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1月1日起至2021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

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：回顾2021年债券市场，整体宽松平衡的流动性环境成为主线，同时受益于基本面下行压力，整年利率中枢下行，但在大宗商品价格上涨通胀担忧、地方债发行等因素的扰动下，债市并未走出一波趋势性行情，整体处于震荡慢牛行情，利率走势前高后低，全年中债-总财富(总值)指数增长5.69%。

债券策略和操作：本组合在今年主要以票息策略为主，配置品种选择兼顾收益和安全的久期城投债为主，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：回顾2021年大类资产表现，表现最好的是原油和天然气，分别上涨了50%和46%，股票指数表现最好的是标普500和纳斯达克，分别上涨了26.9%和21.4%。国内的指数创业板上涨12%，沪深300下跌5.2%。香港市场表现最差，恒生国企和恒生科技分别下跌23.7%和33.1%。21年整体投资思路与前几年大不相同，19、20年受追捧的核心资产，主要是一些商业模式较好，增速比较稳定的高质量增长公司，但由于估值高企且政策层面有所扰动，大多表现平平或者有所下跌。以宁组合为代表的的新能源行业，尽管商业模式并不占优，但在政策扶持及景气高企的带动下，成为最主线的行情。同时由于互联网、教培等行业遭遇了比较大的政策变化，这些过去十倍百倍的牛股，在政策的变化下，遭遇了估值和业绩的双杀。展望22年，面对宽货币弱经济的大环境，市场整体应该还是以结构性行情为主，市场的中位数PE在28倍左右，相比去年底基本持平，市场整体的估值并没有抬升。尽管总量层面的经济放缓，但制造业升级、关键核心材料的国产替代、双控带来的产业升级等结构性机会还是会不断涌现。

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，均衡配置估值较为合理的高端制造、军工、医药等标的。

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

		2021年1月1日—2021年12月31日
1	本期利润（元）	644,651.30
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	1,170,751.65
3	期末资产管理计划份额（份）	15,994,586.80
4	期末资产管理计划资产净值（元）	18,200,794.28
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.1379
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.2979

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2021年度	3.1174%

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	3,022,318.25	6,716,657.33	15,994,586.80

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	578,503.65	3.17%
股票投资	1,933,895.00	10.59%
债券投资	13,390,044.00	73.30%
基金投资	217,800.00	1.19%
其他资产	2,147,436.03	11.76%
资产合计	18,267,678.68	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	166199.SH	20 上投 02	40,000	4,007,600.00	22.02
2	151127.SH	19 柳控 01	30,000	3,033,270.00	16.67
3	032000455.IB	20 荆门高新 PPN001	30,000	3,014,400.00	16.56
4	162331.SH	19 渝合 01	20,000	2,022,720.00	11.11
5	123099.SZ	普利转债	2,000	289,286.00	1.59

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	600461.SH	洪城环境	25,000	203,750.00	1.12
2	300218.SZ	安利股份	10,000	173,100.00	0.95
3	300760.SZ	迈瑞医疗	400	152,320.00	0.84
4	300813.SZ	泰林生物	1,500	150,000.00	0.82
5	301029.SZ	怡合达	1,500	138,180.00	0.76

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	9,063,590.00	49.80
2	定向工具	3,014,400.00	16.56
3	可转债	1,312,054.00	7.21

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

单位：元

日期：2021-12-31

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	36,612.30	65,038.03	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	539,467.43	67,178.18	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	2,423.92	2,638.30	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	15,541,739.00	21,037,200.04	卖出回购金融资产款	0.00	0.00
其中：股票投资	1,933,895.00	3,486,077.00	应付证券清算款	0.00	6,782.16
债券投资	13,390,044.00	17,551,123.04	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	217,800.00	0.00	应付管理人报酬	6,150.48	7,189.37
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	615.06	718.96
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	119.64	653.59
买入返售金融资产	1,600,000.00	0.00	应交税费	9,999.22	42,659.12
应收证券清算款	101,437.15	7,427.41	应付利息	0.00	0.00
应收利息	444,908.00	653,796.29	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	66,884.40	108,003.20
其他资产	1,090.88	1,090.88			
			所有者权益：		
			实收基金	15,994,586.80	19,688,925.88
			未分配利润	2,206,207.48	2,037,440.05
			所有者权益合计	18,200,794.28	21,726,365.93
资产合计	18,267,678.68	21,834,369.13	负债和所有者权益总计	18,267,678.68	21,834,369.13

5.2 集合资产管理计划损益表

单位：元

日期：2021年01月 — 2021年12月

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	854,483.59	3,291,446.63
2	1、利息收入	880,345.27	786,957.29
3	其中：存款利息收入	3,987.23	3,563.81
4	债券利息收入	840,248.67	781,137.07
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	36,109.37	2,256.41
7	2、投资收益	500,238.67	2,223,272.85
8	其中：股票投资收益	-32,852.76	1,893,195.08
9	债券投资收益	518,500.68	380,971.88
10	基金投资收益	9,200.00	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	24,710.30	15,343.77
15	投资收益—差价收入增值税抵减	-19319.55	-66237.88
16	3、公允价值变动收益	-526,100.35	281,216.49
17	4、其他收入	0.00	0.00
18	二、费用	209,832.29	272,862.46
19	1、管理人报酬	86,193.66	71,835.82
20	2、托管费	8,619.35	7,183.56
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	21,389.29	88,867.00
23	5、利息支出	0.00	1,927.29
24	其中：卖出回购金融资产支出	0.00	1,927.29
25	6、其他费用	90,722.56	91,386.36
26	7、税金及附加	2,907.43	11,662.43
27	三、利润总和	644,651.30	3,018,584.17

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未进行分红。

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

2021年3月2日，经公司研究决定，常杨先生不再担任新时代新财富50号集合资产管理计划的投资主办，新增周鹤翔女士担任新时代新财富50号集合资产管理计划的投资主办，变更后的新时代新财富50号集合资产管理计划投资主办人为周鹤翔女士、柏圣书先生。

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；

8.1 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

2022年4月30日

1101080754471