

# 大同证券同丰 2 号集合资产管理计划 2018 年第四季度资产管理报告

## 一、重要提示

本报告依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称“《管理办法》”）《证券公司集合资产管理业务实施细则》（以下简称“《实施细则》”）及其他有关规定制作。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用大同证券同丰 2 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人已复核了本报告中本集合计划项下财务数据。本报告未经审计。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

## 二、集合计划产品概况

产品名称	大同证券同丰 2 号集合资产管理计划
成立日期	2016 年 11 月 9 日
成立规模	35,651,518.61
存续期	
管理人	大同证券有限责任公司
托管人	中国工商银行股份有限公司上海市分行

## 三、主要财务指标

主要财务指标		单位：人民币元
序号	主要财务指标	2018 年 10 月 01 日-2018 年 12 月 31 日
1	本期利润	3,770,431.33
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	3,770,431.33
3	期末集合计划资产净值	243,340,000.00
4	期末单位集合计划资产净值	1.0000







业 PMI 继续下滑至 49.4%，不仅降至荣枯线下，也创下 16 年 3 月以来新低、09 年以来同期新低，指向制造业景气明显转差。主要分项指标中，需求、生产、价格、库存全线下滑。预计 2019 年 PPI 走势有望延续回落，通胀走势仍将持续分化。

2018 年 4 月以来，财政、货币政策的主基调为稳健偏宽松，根据经济形势的差异，“紧”与“不松不紧”交叉进行。货币政策方面，2018 年来央行分别于 1 月、4 月、7 月、10 月实施了四次降准，所释放的流动性规模分别为 4500 亿元、4000 亿元、7000 亿元和 7500 亿元；前三季度累计开展中期借贷便利操作(MLF)40740 亿元；并且加大了对小微企业的再贷款、再贴现力度，同时创设民营企业债券融资支持工具。财政政策方面，整体而言，今年的财政政策较为积极，减税降费是重头戏。制造业等行业增值税税率从 17% 降至 16%；交通运输、建筑、基础电信服务等行业及农产品等货物的增值税税率从 11% 降至 10%；与此同时，工业企业和商业企业小规模纳税人的年销售额标准由 50 万元和 80 万元上调至 500 万元；此外，装备制造等先进制造业、研发等现代服务业符合条件的企业和电网企业在一定时期内未抵扣完的进项税额可以一次性退还。

今年以来，货币市场利率明显下行，流动性期限结构有所改善，但货币政策传导机制仍有待进一步疏通。从近期在京举行的中央经济工作会议的内容可以看出，明年政策稳字当头，包括货币、财政、地产、监管政策均有望宽松。货币政策在保持“稳健中性”基调的同时向宽松调整仍是趋势，

流动性从“合理稳定”向“合理充裕”，大概率还会降准 2-3 次，并定向“降息”。

## 五、集合计划财务报告

### (一) 集合计划会计报告

#### 1、集合计划资产负债表（单位：人民币元）

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
<b>资 产:</b>		<b>负 债:</b>	
银行存款	5,134,338.67	短期借款	0.00
结算备付金	22,727.27	交易性金融负债	0.00
存出保证金	4,572.38	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	229,398,217.75	卖出回购金融资产款	20,000,000.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	173,061,531.80	应付赎回款	5,000,000.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	2,820,921.55
权证投资	0.00	应付托管费	54,097.73
资产支持证券投资	56,336,685.95	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	19,375.68
买入返售金融资产	29,760,278.70	应交税费	197,346.84
应收证券清算款	0.00	应付利息	15,342.46
应收利息	7,250,922.61	应付利润	3,989,986.89
应收股利	0.00	其他负债	252,942.03
应收申购款	1,000,000.00	<b>负债合计</b>	<b>32,350,013.18</b>
其他资产	3,118,955.80		
		<b>所有者权益:</b>	
		实收基金	243,340,000.00
		未分配利润	0.00
		<b>所有者权益合计</b>	<b>243,340,000.00</b>
<b>资产合计</b>	<b>275,690,013.18</b>	<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>275,690,013.18</b>

#### 2、集合计划利润表（单位：人民币元）

序号	项目	本期数
1	一、收入	5,635,996.26
2	1、利息收入	4,440,100.60

3	其中：存款利息收入	14,279.17
4	债券利息收入	3,608,440.54
5	资产支持证券利息收入	749,374.72
6	买入返售证券收入	68,006.17
7	2、投资收益	1,195,895.66
8	其中：股票投资收益	0.00
9	债券投资收益	1,195,895.66
10	基金投资收益	0.00
11	权证投资收益	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00
13	衍生工具收益	0.00
14	股利收益	0.00
15	个股期权收益	0.00
16	3、公允价值变动收益	0.00
17	4、其他收入	0.00
18	二、费用	1,865,564.93
19	1、管理人报酬	1,758,554.37
20	2、托管费	54,097.73
21	3、销售服务费	0.00
22	4、交易费用	0.00
23	5、利息支出	26,355.91
24	其中：卖出回购金融资产支出	26,355.91
25	6、其他费用	26,556.92
26	三、利润总和	3,770,431.33

## （二）集合计划投资组合报告

### 1、资产组合情况

日期：2018 年 12 月 31 日（单位：人民币元）

资产类别	期末市值	占集合计划资产总值比例
银行存款	5,134,338.67	1.87%
股票	0.00	0.00%
债券	229,398,217.75	83.51%
基金	0.00	0.00%



买入返售金融资产	29,760,278.70	10.83%
其他资产	10,397,178.06	3.79%
合计	274,690,013.18	100.00%

2、报告期末按摊余成本占集合计划资产净值比例大小排序的前三名证券明细（单位：人民币元）

证券代码	证券名称	库存数量（万）	摊余成本	成本占净值
CI00TD	18 天易 PPN001	32.0000	31953030.32	13.13%
139179	融信优先	30.0000	30283270.36	12.44%
150186	18 大同 02	30.0000	30000000.00	12.33%
合计		92.0000	92236300.68	37.90%

### 3、投资组合报告附注

本集合计划本期投资的前三名证券中，无报告期内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

本集合计划投资的前三名证券中，没有投资于超出计划合同规定备选股票、基金库之外的证券。

集合计划其他资产的构成（单位：人民币元）：

应收证券清算款	0.00
应收利息	7,250,922.61
应收股利	0.00
结算备付金	22,727.27
存出保证金	4,572.38
其他应收款、理财产品等	3,118,955.80
合计	10,397,178.06

## 六、备查文件目录

- （一）关于大同证券有限责任公司发起设立大同证券同丰 2 号集合资产管理计划的备案确认函（备案编码 SP6049）
- （二）大同证券同丰 2 号集合资产管理计划成立公告
- （三）大同证券同丰 2 号集合资产管理计划说明书

(四) 大同证券同丰 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同

(五) 大同证券同丰 2 号集合资产管理计划资产托管协议

(六) 管理人业务资格批件、营业执照

文件存放地点：山西省太原市青年路 8 号

网址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

客户服务电话：4007121212

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人大同证券有限责任公司资产管理部。

大同证券有限责任公司  
2019 年 1 月 11 日