

财通证券资产管理有限公司
财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计
划
季度资产管理报告
(2018 年四季度)

计划管理人：财通证券资产管理有限公司

计划托管人：中国工商银行股份有限公司

报告期间：2018 年 10 月 1 日-2018 年 12 月 31 日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人财通证券资产管理有限公司依据相关法律法规、监管规定及其他有关规则制作。

中国证监会2011年6月21日对金色钱塘一基金优选集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）出具了批准文件《关于核准财通证券有限责任公司设立金色钱塘一基金优选集合资产管理计划的批复》（证监许可〔2011〕986号），但中国证监会对本集合计划做出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明客户参与本集合计划没有风险。

托管人已对本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

本报告涉及《财通证券资管财慧道2号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）及《财通证券资管财慧道2号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）的相关内容若与《管理合同》及《说明书》中的相关内容不一致，以最新的《管理合同》及《说明书》为准。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2018 年 10 月 1 日-2018 年 12 月 31 日

一、集合计划简介

(一) 基本资料

名称：财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2011 年 09 月 22 日

成立份额：230,995,100.10 份

存续期：不设固定管理期限

管理人：财通证券资产管理有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

(二) 集合计划管理人

名称：财通证券资产管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市上城区白云路 26 号 143 室

办公地址：浙江省杭州市四宜路22号

法定代表人：马晓立

公司网址：www.ctzg.com

(三) 集合计划托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人： 赵会军

联系电话： 010-66105799

二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

(一) 主要财务指标:

单位: 元

	主要财务指标	2018 年 12 月 31 日
1	期末单位集合计划资产净值	1.0000
2	期末集合计划资产净值	21,967,650,476.72
3	本期集合计划利润	284,313,932.18

(二) 收益分配情况

集合计划成立以来, 本集合计划收益分配具体分红收益情况详见管理人网站。

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截止到 2018 年 12 月 31 日 :

基金资产净值:	21,967,650,476.72
基金资产净值:C40002 财慧道 2 号 A1	0.00
基金资产净值:C40048 财慧道 2 号 A2	0.00
基金资产净值:C40049 财慧道 2 号 A3	0.00
基金资产净值:C40050 财慧道 2 号 A4	0.00
基金资产净值:C40051 财慧道 2 号 A5	0.00
基金资产净值:C40052 财慧道 2 号 A6	1,000,000.00
基金资产净值:C40053 财慧道 2 号 A7	0.00
基金资产净值:C40054 财慧道 2 号 A8	0.00
基金资产净值:C40055 财慧道 2 号 A9	750,000.00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金资产净值:C40056 财慧道 2 号 A10	1,000,000.00
基金资产净值:C40057 财慧道 2 号 A11	0.00
基金资产净值:C40058 财慧道 2 号 A12	0.00
基金资产净值:C40059 财慧道 2 号 A13	0.00
基金资产净值:C40060 财慧道 2 号 A14	96,421,000.00
基金资产净值:C40061 财慧道 2 号 A15	10,000,000.00
基金资产净值:C40063 财慧道 2 号 A17	0.00
基金资产净值:C40064 财慧道 2 号 A18	0.00
基金资产净值:C40065 财慧道 2 号 A19	0.00
基金资产净值:C40066 财慧道 2 号 A20	499,051,000.00
基金资产净值:C40067 财慧道 2 号 A21	199,989,000.00
基金资产净值:C40068 财慧道 2 号 A22	0.00
基金资产净值:C40069 财慧道 2 号 A23	0.00
基金资产净值:C40070 财慧道 2 号 A24	0.00
基金资产净值:C40071 财慧道 2 号 A25	0.00
基金资产净值:C40072 财慧道 2 号 A26	700,000.00
基金资产净值:C40073 财慧道 2 号 A27	200,000,000.00
基金资产净值:C40074 财慧道 2 号 A28	0.00
基金资产净值:C40075 财慧道 2 号 A29	0.00
基金资产净值:C40076 财慧道 2 号 A30	240,434,000.00
基金资产净值:C40077 财慧道 2 号 A31	109,664,000.00
基金资产净值:C40078 财慧道 2 号 A32	134,754,000.00
基金资产净值:C40079 财慧道 2 号 A33	239,234,000.00
基金资产净值:C40080 财慧道 2 号 A34	0.00
基金资产净值:C40081 财慧道 2 号 A35	399,998,000.00
基金资产净值:C40082 财慧道 2 号 A36	203,299,000.00
基金资产净值:C40083 财慧道 2 号 A37	158,989,000.00
基金资产净值:C40084 财慧道 2 号 A38	154,539,000.00
基金资产净值:C40085 财慧道 2 号 A39	88,500,000.00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金资产净值:C40086 财慧道 2 号 A40	110,605,000.00
基金资产净值:C40087 财慧道 2 号 A41	0.00
基金资产净值:C40088 财慧道 2 号 A42	0.00
基金资产净值:C40089 财慧道 2 号 A43	839,554,000.00
基金资产净值:C40090 财慧道 2 号 A44	52,632,000.00
基金资产净值:C40091 财慧道 2 号 A45	299,479,000.00
基金资产净值:C40092 财慧道 2 号 A46	0.00
基金资产净值:C40093 财慧道 2 号 A47	33,144,000.00
基金资产净值:C40094 财慧道 2 号 A48	0.00
基金资产净值:C40095 财慧道 2 号 A49	0.00
基金资产净值:C40096 财慧道 2 号 A50	0.00
基金资产净值:C40097 财慧道 2 号 A51	0.00
基金资产净值:C40098 财慧道 2 号 A52	0.00
基金资产净值:C40099 财慧道 2 号 A53	0.00
基金资产净值:C40100 财慧道 2 号 A54	0.00
基金资产净值:C40101 财慧道 2 号 A55	0.00
基金资产净值:C40102 财慧道 2 号 A56	599,990,000.00
基金资产净值:C40103 财慧道 2 号 A57	0.00
基金资产净值:C40104 财慧道 2 号 A58	0.00
基金资产净值:C40105 财慧道 2 号 A59	999,930,000.00
基金资产净值:C40106 财慧道 2 号 A60	0.00
基金资产净值:C40107 财慧道 2 号 A61	995,973,000.00
基金资产净值:C40108 财慧道 2 号 A62	839,448,000.00
基金资产净值:C40109 财慧道 2 号 A63	0.00
基金资产净值:C40110 财慧道 2 号 A64	0.00
基金资产净值:C40111 财慧道 2 号 A65	0.00
基金资产净值:C40112 财慧道 2 号 A66	0.00
基金资产净值:C40113 财慧道 2 号 A67	0.00
基金资产净值:C40114 财慧道 2 号 A68	499,919,471.00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告 (四季度)

基金资产净值:C40115 财慧道 2 号 A69	395,033,000.00
基金资产净值:C40116 财慧道 2 号 A70	399,873,146.00
基金资产净值:C40117 财慧道 2 号 A71	0.00
基金资产净值:C40118 财慧道 2 号 A72	228,396,000.00
基金资产净值:C40119 财慧道 2 号 A73	0.00
基金资产净值:C40120 财慧道 2 号 A74	0.00
基金资产净值:C40121 财慧道 2 号 A75	0.00
基金资产净值:C40122 财慧道 2 号 A76	0.00
基金资产净值:C40123 财慧道 2 号 A77	0.00
基金资产净值:C40124 财慧道 2 号 A78	561,954,000.00
基金资产净值:C40125 财慧道 2 号 A79	0.00
基金资产净值:C40126 财慧道 2 号 A80	108,691,000.00
基金资产净值:C40127 财慧道 2 号 A81	0.00
基金资产净值:C40128 财慧道 2 号 A82	0.00
基金资产净值:C40129 财慧道 2 号 A83	0.00
基金资产净值:C40130 财慧道 2 号 A84	0.00
基金资产净值:C40131 财慧道 2 号 A85	0.00
基金资产净值:C40132 财慧道 2 号 A86	100,000,000.00
基金资产净值:C40133 财慧道 2 号 A87	42,977,000.00
基金资产净值:C40134 财慧道 2 号 A88	0.00
基金资产净值:C40135 财慧道 2 号 A89	0.00
基金资产净值:C40136 财慧道 2 号 A90	0.00
基金资产净值:C40137 财慧道 2 号 A91	71,016,000.00
基金资产净值:C40138 财慧道 2 号 A92	0.00
基金资产净值:C40139 财慧道 2 号 A93	26,647,400.00
基金资产净值:C40140 财慧道 2 号 A94	165,326,000.00
基金资产净值:C40141 财慧道 2 号 A95	102,543,000.00
基金资产净值:C40142 财慧道 2 号 A96	0.00
基金资产净值:C40143 财慧道 2 号 A97	0.00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告 (四季度)

基金资产净值:C40144 财慧道 2 号 A98	0.00
基金资产净值:C40145 财慧道 2 号 A99	199,476,000.00
基金资产净值:C40146 财慧道 2 号 A100	99,138,000.00
基金资产净值:C40195 财慧道 2 号 A101	289,321,000.00
基金资产净值:C40196 财慧道 2 号 A102	0.00
基金资产净值:C40197 财慧道 2 号 A103	0.00
基金资产净值:C40198 财慧道 2 号 A104	0.00
基金资产净值:C40199 财慧道 2 号 A105	0.00
基金资产净值:C40200 财慧道 2 号 A106	0.00
基金资产净值:C40201 财慧道 2 号 A107	0.00
基金资产净值:C40202 财慧道 2 号 A108	0.00
基金资产净值:C40203 财慧道 2 号 A109	0.00
基金资产净值:C40204 财慧道 2 号 A110	0.00
基金资产净值:C40205 财慧道 2 号 A111	16,848,000.00
基金资产净值:C40206 财慧道 2 号 A112	0.00
基金资产净值:C40207 财慧道 2 号 A113	115,051,000.00
基金资产净值:C40208 财慧道 2 号 A114	0.00
基金资产净值:C40209 财慧道 2 号 A115	0.00
基金资产净值:C40210 财慧道 2 号 A116	599,924,000.00
基金资产净值:C40211 财慧道 2 号 A117	0.00
基金资产净值:C40212 财慧道 2 号 A118	403,920,000.00
基金资产净值:C40213 财慧道 2 号 A119	0.00
基金资产净值:C40214 财慧道 2 号 A120	0.00
基金资产净值:C40215 财慧道 2 号 A121	49,998,000.00
基金资产净值:C40216 财慧道 2 号 A122	50,000,000.00
基金资产净值:C40220 财慧道 2 号 A126	48,009,000.00
基金资产净值:C40221 财慧道 2 号 A127	0.00
基金资产净值:C40222 财慧道 2 号 A128	0.00
基金资产净值:C40223 财慧道 2 号 A129	0.00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金资产净值:C40224 财慧道 2 号 A130	0.00
基金资产净值:C40225 财慧道 2 号 A131	0.00
基金资产净值:C40226 财慧道 2 号 A132	0.00
基金资产净值:C40227 财慧道 2 号 A133	99,914,000.00
基金资产净值:C40230 财慧道 2 号 A136	0.00
基金资产净值:C40231 财慧道 2 号 A137	0.00
基金资产净值:C40232 财慧道 2 号 A138	0.00
基金资产净值:C40233 财慧道 2 号 A139	0.00
基金资产净值:C40234 财慧道 2 号 A140	0.00
基金资产净值:C40240 财慧道 2 号 A146	0.00
基金资产净值:C40241 财慧道 2 号 A147	0.00
基金资产净值:C40242 财慧道 2 号 A148	0.00
基金资产净值:C40243 财慧道 2 号 A149	155,061,200.00
基金资产净值:C40245 财慧道 2 号 A151	0.00
基金资产净值:C40246 财慧道 2 号 A152	0.00
基金资产净值:C40247 财慧道 2 号 A153	0.00
基金资产净值:C40248 财慧道 2 号 A154	0.00
基金资产净值:C40249 财慧道 2 号 A155	0.00
基金资产净值:C40250 财慧道 2 号 A156	0.00
基金资产净值:C40251 财慧道 2 号 A157	0.00
基金资产净值:C40252 财慧道 2 号 A158	0.00
基金资产净值:C40253 财慧道 2 号 A159	0.00
基金资产净值:C40254 财慧道 2 号 A160	0.00
基金资产净值:C40255 财慧道 2 号 A161	515,186,000.00
基金资产净值:C40256 财慧道 2 号 A162	247,841,000.00
基金资产净值:C40257 财慧道 2 号 A163	158,938,000.00
基金资产净值:C40258 财慧道 2 号 A164	267,514,000.00
基金资产净值:C40259 财慧道 2 号 A165	0.00
基金资产净值:C40260 财慧道 2 号 A166	922,851,000.00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金资产净值:C40261 财慧道 2 号 A167	746, 737, 000. 00
基金资产净值:C40262 财慧道 2 号 A168	0. 00
基金资产净值:C40263 财慧道 2 号 A169	0. 00
基金资产净值:C40264 财慧道 2 号 A170	263, 551, 000. 00
基金资产净值:C40265 财慧道 2 号 A171	149, 524, 000. 00
基金资产净值:C40266 财慧道 2 号 A172	199, 536, 000. 00
基金资产净值:C40267 财慧道 2 号 A173	249, 515, 000. 00
基金资产净值:C40268 财慧道 2 号 A174	199, 163, 000. 00
基金资产净值:C40269 财慧道 2 号 A175	249, 463, 000. 00
基金资产净值:C40270 财慧道 2 号 A176	0. 00
基金资产净值:C40271 财慧道 2 号 A177	0. 00
基金资产净值:C40272 财慧道 2 号 A178	0. 00
基金资产净值:C40273 财慧道 2 号 A179	0. 00
基金资产净值:C40274 财慧道 2 号 A180	0. 00
基金资产净值:C40275 财慧道 2 号 A181	0. 00
基金资产净值:C40276 财慧道 2 号 A182	0. 00
基金资产净值:C40280 财慧道 2 号 A186	0. 00
基金资产净值:C40281 财慧道 2 号 A187	0. 00
基金资产净值:C40282 财慧道 2 号 A188	0. 00
基金资产净值:C40283 财慧道 2 号 A189	0. 00
基金资产净值:C40284 财慧道 2 号 A190	0. 00
基金资产净值:C40285 财慧道 2 号 A191	50, 000, 000. 00
基金资产净值:C40286 财慧道 2 号 A192	0. 00
基金资产净值:C40287 财慧道 2 号 A193	0. 00
基金资产净值:C40288 财慧道 2 号 A194	0. 00
基金资产净值:C40289 财慧道 2 号 A195	0. 00
基金资产净值:C40290 财慧道 2 号 A196	0. 00
基金资产净值:C40291 财慧道 2 号 A197	0. 00
基金资产净值:C40292 财慧道 2 号 A198	0. 00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金资产净值:C40293 财慧道 2 号 A199	0.00
基金资产净值:C40294 财慧道 2 号 A200	0.00
基金资产净值:C40345 财慧道 2 号 A201	249,197,000.00
基金资产净值:C40346 财慧道 2 号 A202	99,455,000.00
基金资产净值:C40347 财慧道 2 号 A203	49,265,000.00
基金资产净值:C40348 财慧道 2 号 A204	49,443,000.00
基金资产净值:C40349 财慧道 2 号 A205	0.00
基金资产净值:C40350 财慧道 2 号 A206	0.00
基金资产净值:C40351 财慧道 2 号 A207	249,486,000.00
基金资产净值:C40352 财慧道 2 号 A208	0.00
基金资产净值:C40353 财慧道 2 号 A209	249,439,000.00
基金资产净值:C40354 财慧道 2 号 A210	0.00
基金资产净值:C40355 财慧道 2 号 A211	199,800,000.00
基金资产净值:C40356 财慧道 2 号 A212	309,824,200.00
基金资产净值:C40357 财慧道 2 号 A213	31,250,000.00
基金资产净值:C40358 财慧道 2 号 A214	22,809,000.00
基金资产净值:C40360 财慧道 2 号 A216	62,990,718.00
基金资产净值:C40361 财慧道 2 号 A217	0.00
基金资产净值:C40365 财慧道 2 号 A221	0.00
基金资产净值:C40366 财慧道 2 号 A222	0.00
基金资产净值:C40367 财慧道 2 号 A223	0.00
基金资产净值:C40368 财慧道 2 号 A224	0.00
基金资产净值:C40369 财慧道 2 号 A225	0.00
基金资产净值:C40370 财慧道 2 号 A226	50,000,000.00
基金资产净值:C40371 财慧道 2 号 A227	0.00
基金资产净值:C40372 财慧道 2 号 A228	0.00
基金资产净值:C40373 财慧道 2 号 A229	0.00
基金资产净值:C40374 财慧道 2 号 A230	0.00
基金资产净值:C40375 财慧道 2 号 A231	50,000.00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金资产净值:C40376 财慧道 2 号 A232	0.00
基金资产净值:C40377 财慧道 2 号 A233	0.00
基金资产净值:C40378 财慧道 2 号 A234	0.00
基金资产净值:C40379 财慧道 2 号 A235	15,689,897.00
基金资产净值:C40380 财慧道 2 号 A236	19,989,104.00
基金资产净值:C40381 财慧道 2 号 A237	43,809,734.35
基金资产净值:C40382 财慧道 2 号 A238	11,877,300.10
基金资产净值:C40383 财慧道 2 号 A239	1,736,000.00
基金资产净值:C40384 财慧道 2 号 A240	4,026,000.00
基金资产净值:C40385 财慧道 2 号 A241	6,056,000.00
基金资产净值:C40386 财慧道 2 号 A242	7,464,000.00
基金资产净值:C40387 财慧道 2 号 A243	15,562,227.24
基金资产净值:C40388 财慧道 2 号 A244	9,393,000.00
基金资产净值:C40389 财慧道 2 号 A245	9,974,000.00
基金资产净值:C40390 财慧道 2 号 A246	25,925,669.00
基金资产净值:C40391 财慧道 2 号 A247	0.00
基金资产净值:C40392 财慧道 2 号 A248	0.00
基金资产净值:C40393 财慧道 2 号 A249	989,450.00
基金资产净值:C40394 财慧道 2 号 A250	1,165,000.00
基金资产净值:C40395 财慧道 2 号 A251	0.00
基金资产净值:C40396 财慧道 2 号 A252	0.00
基金资产净值:C40397 财慧道 2 号 A253	84,704,000.00
基金资产净值:C40398 财慧道 2 号 A254	114,996,000.00
基金资产净值:C40399 财慧道 2 号 A255	100,000,000.00
基金资产净值:C40400 财慧道 2 号 A256	179,879,000.00
基金资产净值:C40401 财慧道 2 号 A257	17,062,000.00
基金资产净值:C40402 财慧道 2 号 A258	121,241,000.00
基金资产净值:C40403 财慧道 2 号 A259	18,772,000.00
基金资产净值:C40404 财慧道 2 号 A260	38,843,000.00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告 (四季度)

基金资产净值:C40405 财慧道 2 号 A261	0.00
基金资产净值:C40406 财慧道 2 号 A262	249,369,000.00
基金资产净值:C40407 财慧道 2 号 A263	240,581,000.00
基金资产净值:C40408 财慧道 2 号 A264	99,453,000.00
基金资产净值:C40409 财慧道 2 号 A265	99,219,000.00
基金资产净值:C40410 财慧道 2 号 A266	0.00
基金资产净值:C40411 财慧道 2 号 A267	0.00
基金资产净值:C40412 财慧道 2 号 A268	299,067,000.00
基金资产净值:C40413 财慧道 2 号 A269	49,061,000.00
基金资产净值:C40414 财慧道 2 号 A270	39,444,000.00
基金资产净值:C40415 财慧道 2 号 A271	0.00
基金资产净值:C40416 财慧道 2 号 A272	12,648,000.00
基金资产净值:C40417 财慧道 2 号 A273	0.00
基金资产净值:C40418 财慧道 2 号 A274	50,000.00
基金资产净值:C40419 财慧道 2 号 A275	2,486,200.00
基金资产净值:C40420 财慧道 2 号 A276	0.00
基金资产净值:C40421 财慧道 2 号 A277	3,498,307.97
基金资产净值:C40422 财慧道 2 号 A278	0.00
基金资产净值:C40423 财慧道 2 号 A279	9,215,000.00
基金资产净值:C40424 财慧道 2 号 A280	0.00
基金资产净值:C40425 财慧道 2 号 A281	129,218,162.24
基金资产净值:C40426 财慧道 2 号 A282	0.00
基金资产净值:C40427 财慧道 2 号 A283	0.00
基金资产净值:C40428 财慧道 2 号 A284	0.00
基金资产净值:C40429 财慧道 2 号 A285	1,100,122.30
基金资产净值:C40430 财慧道 2 号 A286	100,006,000.00
基金资产净值:C40431 财慧道 2 号 A287	263,000.00
基金资产净值:C40432 财慧道 2 号 A288	565,000.00
基金资产净值:C40433 财慧道 2 号 A289	360,000.00

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金资产净值:C40434 财慧道 2 号 A290	9, 530, 000. 00
基金资产净值:C40435 财慧道 2 号 A291	0. 00
基金资产净值:C40436 财慧道 2 号 A292	146, 734, 400. 00
基金资产净值:C40437 财慧道 2 号 A293	0. 00
基金资产净值:C40438 财慧道 2 号 A294	157, 283, 000. 00
基金资产净值:C40439 财慧道 2 号 A295	203, 864, 000. 00
基金资产净值:C40440 财慧道 2 号 A296	346, 146, 856. 00
基金资产净值:C40441 财慧道 2 号 A297	340, 210, 111. 52
基金资产净值:C40442 财慧道 2 号 A298	199, 954, 800. 00
基金资产净值:C40443 财慧道 2 号 A299	99, 206, 000. 00
基金资产净值:C40444 财慧道 2 号 A300	99, 022, 000. 00
基金资产净值:C400XX 虚拟劣后级	0. 00
基金单位净值:	1. 0000
基金单位净值: C40002 财慧道 2 号 A1	1. 0000
基金单位净值: C40048 财慧道 2 号 A2	1. 0000
基金单位净值: C40049 财慧道 2 号 A3	1. 0000
基金单位净值: C40050 财慧道 2 号 A4	1. 0000
基金单位净值: C40051 财慧道 2 号 A5	1. 0000
基金单位净值: C40052 财慧道 2 号 A6	1. 0000
基金单位净值: C40053 财慧道 2 号 A7	1. 0000
基金单位净值: C40054 财慧道 2 号 A8	1. 0000
基金单位净值: C40055 财慧道 2 号 A9	1. 0000
基金单位净值: C40056 财慧道 2 号 A10	1. 0000
基金单位净值: C40057 财慧道 2 号 A11	1. 0000
基金单位净值: C40058 财慧道 2 号 A12	1. 0000
基金单位净值: C40059 财慧道 2 号 A13	1. 0000
基金单位净值: C40060 财慧道 2 号 A14	1. 0000
基金单位净值: C40061 财慧道 2 号 A15	1. 0000
基金单位净值: C40063 财慧道 2 号 A17	1. 0000

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金单位净值：C40064 财慧道 2 号 A18	1.0000
基金单位净值：C40065 财慧道 2 号 A19	1.0000
基金单位净值：C40066 财慧道 2 号 A20	1.0000
基金单位净值：C40067 财慧道 2 号 A21	1.0000
基金单位净值：C40068 财慧道 2 号 A22	1.0000
基金单位净值：C40069 财慧道 2 号 A23	1.0000
基金单位净值：C40070 财慧道 2 号 A24	1.0000
基金单位净值：C40071 财慧道 2 号 A25	1.0000
基金单位净值：C40072 财慧道 2 号 A26	1.0000
基金单位净值：C40073 财慧道 2 号 A27	1.0000
基金单位净值：C40074 财慧道 2 号 A28	1.0000
基金单位净值：C40075 财慧道 2 号 A29	1.0000
基金单位净值：C40076 财慧道 2 号 A30	1.0000
基金单位净值：C40077 财慧道 2 号 A31	1.0000
基金单位净值：C40078 财慧道 2 号 A32	1.0000
基金单位净值：C40079 财慧道 2 号 A33	1.0000
基金单位净值：C40080 财慧道 2 号 A34	1.0000
基金单位净值：C40081 财慧道 2 号 A35	1.0000
基金单位净值：C40082 财慧道 2 号 A36	1.0000
基金单位净值：C40083 财慧道 2 号 A37	1.0000
基金单位净值：C40084 财慧道 2 号 A38	1.0000
基金单位净值：C40085 财慧道 2 号 A39	1.0000
基金单位净值：C40086 财慧道 2 号 A40	1.0000
基金单位净值：C40087 财慧道 2 号 A41	1.0000
基金单位净值：C40088 财慧道 2 号 A42	1.0000
基金单位净值：C40089 财慧道 2 号 A43	1.0000
基金单位净值：C40090 财慧道 2 号 A44	1.0000
基金单位净值：C40091 财慧道 2 号 A45	1.0000
基金单位净值：C40092 财慧道 2 号 A46	1.0000

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金单位净值：C40093 财慧道 2 号 A47	1.0000
基金单位净值：C40094 财慧道 2 号 A48	1.0000
基金单位净值：C40095 财慧道 2 号 A49	1.0000
基金单位净值：C40096 财慧道 2 号 A50	1.0000
基金单位净值：C40097 财慧道 2 号 A51	1.0000
基金单位净值：C40098 财慧道 2 号 A52	1.0000
基金单位净值：C40099 财慧道 2 号 A53	1.0000
基金单位净值：C40100 财慧道 2 号 A54	1.0000
基金单位净值：C40101 财慧道 2 号 A55	1.0000
基金单位净值：C40102 财慧道 2 号 A56	1.0000
基金单位净值：C40103 财慧道 2 号 A57	1.0000
基金单位净值：C40104 财慧道 2 号 A58	1.0000
基金单位净值：C40105 财慧道 2 号 A59	1.0000
基金单位净值：C40106 财慧道 2 号 A60	1.0000
基金单位净值：C40107 财慧道 2 号 A61	1.0000
基金单位净值：C40108 财慧道 2 号 A62	1.0000
基金单位净值：C40109 财慧道 2 号 A63	1.0000
基金单位净值：C40110 财慧道 2 号 A64	1.0000
基金单位净值：C40111 财慧道 2 号 A65	1.0000
基金单位净值：C40112 财慧道 2 号 A66	1.0000
基金单位净值：C40113 财慧道 2 号 A67	1.0000
基金单位净值：C40114 财慧道 2 号 A68	1.0000
基金单位净值：C40115 财慧道 2 号 A69	1.0000
基金单位净值：C40116 财慧道 2 号 A70	1.0000
基金单位净值：C40117 财慧道 2 号 A71	1.0000
基金单位净值：C40118 财慧道 2 号 A72	1.0000
基金单位净值：C40119 财慧道 2 号 A73	1.0000
基金单位净值：C40120 财慧道 2 号 A74	1.0000
基金单位净值：C40121 财慧道 2 号 A75	1.0000

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金单位净值：C40122 财慧道 2 号 A76	1.0000
基金单位净值：C40123 财慧道 2 号 A77	1.0000
基金单位净值：C40124 财慧道 2 号 A78	1.0000
基金单位净值：C40125 财慧道 2 号 A79	1.0000
基金单位净值：C40126 财慧道 2 号 A80	1.0000
基金单位净值：C40127 财慧道 2 号 A81	1.0000
基金单位净值：C40128 财慧道 2 号 A82	1.0000
基金单位净值：C40129 财慧道 2 号 A83	1.0000
基金单位净值：C40130 财慧道 2 号 A84	1.0000
基金单位净值：C40131 财慧道 2 号 A85	1.0000
基金单位净值：C40132 财慧道 2 号 A86	1.0000
基金单位净值：C40133 财慧道 2 号 A87	1.0000
基金单位净值：C40134 财慧道 2 号 A88	1.0000
基金单位净值：C40135 财慧道 2 号 A89	1.0000
基金单位净值：C40136 财慧道 2 号 A90	1.0000
基金单位净值：C40137 财慧道 2 号 A91	1.0000
基金单位净值：C40138 财慧道 2 号 A92	1.0000
基金单位净值：C40139 财慧道 2 号 A93	1.0000
基金单位净值：C40140 财慧道 2 号 A94	1.0000
基金单位净值：C40141 财慧道 2 号 A95	1.0000
基金单位净值：C40142 财慧道 2 号 A96	1.0000
基金单位净值：C40143 财慧道 2 号 A97	1.0000
基金单位净值：C40144 财慧道 2 号 A98	1.0000
基金单位净值：C40145 财慧道 2 号 A99	1.0000
基金单位净值：C40146 财慧道 2 号 A100	1.0000
基金单位净值：C40195 财慧道 2 号 A101	1.0000
基金单位净值：C40196 财慧道 2 号 A102	1.0000
基金单位净值：C40197 财慧道 2 号 A103	1.0000
基金单位净值：C40198 财慧道 2 号 A104	1.0000

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金单位净值：C40199 财慧道 2 号 A105	1.0000
基金单位净值：C40200 财慧道 2 号 A106	1.0000
基金单位净值：C40201 财慧道 2 号 A107	1.0000
基金单位净值：C40202 财慧道 2 号 A108	1.0000
基金单位净值：C40203 财慧道 2 号 A109	1.0000
基金单位净值：C40204 财慧道 2 号 A110	1.0000
基金单位净值：C40205 财慧道 2 号 A111	1.0000
基金单位净值：C40206 财慧道 2 号 A112	1.0000
基金单位净值：C40207 财慧道 2 号 A113	1.0000
基金单位净值：C40208 财慧道 2 号 A114	1.0000
基金单位净值：C40209 财慧道 2 号 A115	1.0000
基金单位净值：C40210 财慧道 2 号 A116	1.0000
基金单位净值：C40211 财慧道 2 号 A117	1.0000
基金单位净值：C40212 财慧道 2 号 A118	1.0000
基金单位净值：C40213 财慧道 2 号 A119	1.0000
基金单位净值：C40214 财慧道 2 号 A120	1.0000
基金单位净值：C40215 财慧道 2 号 A121	1.0000
基金单位净值：C40216 财慧道 2 号 A122	1.0000
基金单位净值：C40220 财慧道 2 号 A126	1.0000
基金单位净值：C40221 财慧道 2 号 A127	1.0000
基金单位净值：C40222 财慧道 2 号 A128	1.0000
基金单位净值：C40223 财慧道 2 号 A129	1.0000
基金单位净值：C40224 财慧道 2 号 A130	1.0000
基金单位净值：C40225 财慧道 2 号 A131	1.0000
基金单位净值：C40226 财慧道 2 号 A132	1.0000
基金单位净值：C40227 财慧道 2 号 A133	1.0000
基金单位净值：C40230 财慧道 2 号 A136	1.0000
基金单位净值：C40231 财慧道 2 号 A137	1.0000
基金单位净值：C40232 财慧道 2 号 A138	1.0000

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金单位净值：C40233 财慧道 2 号 A139	1.0000
基金单位净值：C40234 财慧道 2 号 A140	1.0000
基金单位净值：C40240 财慧道 2 号 A146	1.0000
基金单位净值：C40241 财慧道 2 号 A147	1.0000
基金单位净值：C40242 财慧道 2 号 A148	1.0000
基金单位净值：C40243 财慧道 2 号 A149	1.0000
基金单位净值：C40245 财慧道 2 号 A151	1.0000
基金单位净值：C40246 财慧道 2 号 A152	1.0000
基金单位净值：C40247 财慧道 2 号 A153	1.0000
基金单位净值：C40248 财慧道 2 号 A154	1.0000
基金单位净值：C40249 财慧道 2 号 A155	1.0000
基金单位净值：C40250 财慧道 2 号 A156	1.0000
基金单位净值：C40251 财慧道 2 号 A157	1.0000
基金单位净值：C40252 财慧道 2 号 A158	1.0000
基金单位净值：C40253 财慧道 2 号 A159	1.0000
基金单位净值：C40254 财慧道 2 号 A160	1.0000
基金单位净值：C40255 财慧道 2 号 A161	1.0000
基金单位净值：C40256 财慧道 2 号 A162	1.0000
基金单位净值：C40257 财慧道 2 号 A163	1.0000
基金单位净值：C40258 财慧道 2 号 A164	1.0000
基金单位净值：C40259 财慧道 2 号 A165	1.0000
基金单位净值：C40260 财慧道 2 号 A166	1.0000
基金单位净值：C40261 财慧道 2 号 A167	1.0000
基金单位净值：C40262 财慧道 2 号 A168	1.0000
基金单位净值：C40263 财慧道 2 号 A169	1.0000
基金单位净值：C40264 财慧道 2 号 A170	1.0000
基金单位净值：C40265 财慧道 2 号 A171	1.0000
基金单位净值：C40266 财慧道 2 号 A172	1.0000
基金单位净值：C40267 财慧道 2 号 A173	1.0000

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金单位净值：C40268 财慧道 2 号 A174	1.0000
基金单位净值：C40269 财慧道 2 号 A175	1.0000
基金单位净值：C40270 财慧道 2 号 A176	1.0000
基金单位净值：C40271 财慧道 2 号 A177	1.0000
基金单位净值：C40272 财慧道 2 号 A178	1.0000
基金单位净值：C40273 财慧道 2 号 A179	1.0000
基金单位净值：C40274 财慧道 2 号 A180	1.0000
基金单位净值：C40275 财慧道 2 号 A181	1.0000
基金单位净值：C40276 财慧道 2 号 A182	1.0000
基金单位净值：C40280 财慧道 2 号 A186	1.0000
基金单位净值：C40281 财慧道 2 号 A187	1.0000
基金单位净值：C40282 财慧道 2 号 A188	1.0000
基金单位净值：C40283 财慧道 2 号 A189	1.0000
基金单位净值：C40284 财慧道 2 号 A190	1.0000
基金单位净值：C40285 财慧道 2 号 A191	1.0000
基金单位净值：C40286 财慧道 2 号 A192	1.0000
基金单位净值：C40287 财慧道 2 号 A193	1.0000
基金单位净值：C40288 财慧道 2 号 A194	1.0000
基金单位净值：C40289 财慧道 2 号 A195	1.0000
基金单位净值：C40290 财慧道 2 号 A196	1.0000
基金单位净值：C40291 财慧道 2 号 A197	1.0000
基金单位净值：C40292 财慧道 2 号 A198	1.0000
基金单位净值：C40293 财慧道 2 号 A199	1.0000
基金单位净值：C40294 财慧道 2 号 A200	1.0000
基金单位净值：C40345 财慧道 2 号 A201	1.0000
基金单位净值：C40346 财慧道 2 号 A202	1.0000
基金单位净值：C40347 财慧道 2 号 A203	1.0000
基金单位净值：C40348 财慧道 2 号 A204	1.0000
基金单位净值：C40349 财慧道 2 号 A205	1.0000

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金单位净值：C40350 财慧道 2 号 A206	1.0000
基金单位净值：C40351 财慧道 2 号 A207	1.0000
基金单位净值：C40352 财慧道 2 号 A208	1.0000
基金单位净值：C40353 财慧道 2 号 A209	1.0000
基金单位净值：C40354 财慧道 2 号 A210	1.0000
基金单位净值：C40355 财慧道 2 号 A211	1.0000
基金单位净值：C40356 财慧道 2 号 A212	1.0000
基金单位净值：C40357 财慧道 2 号 A213	1.0000
基金单位净值：C40358 财慧道 2 号 A214	1.0000
基金单位净值：C40360 财慧道 2 号 A216	1.0000
基金单位净值：C40361 财慧道 2 号 A217	1.0000
基金单位净值：C40365 财慧道 2 号 A221	1.0000
基金单位净值：C40366 财慧道 2 号 A222	1.0000
基金单位净值：C40367 财慧道 2 号 A223	1.0000
基金单位净值：C40368 财慧道 2 号 A224	1.0000
基金单位净值：C40369 财慧道 2 号 A225	1.0000
基金单位净值：C40370 财慧道 2 号 A226	1.0000
基金单位净值：C40371 财慧道 2 号 A227	1.0000
基金单位净值：C40372 财慧道 2 号 A228	1.0000
基金单位净值：C40373 财慧道 2 号 A229	1.0000
基金单位净值：C40374 财慧道 2 号 A230	1.0000
基金单位净值：C40375 财慧道 2 号 A231	1.0000
基金单位净值：C40376 财慧道 2 号 A232	1.0000
基金单位净值：C40377 财慧道 2 号 A233	1.0000
基金单位净值：C40378 财慧道 2 号 A234	1.0000
基金单位净值：C40379 财慧道 2 号 A235	1.0000
基金单位净值：C40380 财慧道 2 号 A236	1.0000
基金单位净值：C40381 财慧道 2 号 A237	1.0000
基金单位净值：C40382 财慧道 2 号 A238	1.0000

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金单位净值：C40383 财慧道 2 号 A239	1.0000
基金单位净值：C40384 财慧道 2 号 A240	1.0000
基金单位净值：C40385 财慧道 2 号 A241	1.0000
基金单位净值：C40386 财慧道 2 号 A242	1.0000
基金单位净值：C40387 财慧道 2 号 A243	1.0000
基金单位净值：C40388 财慧道 2 号 A244	1.0000
基金单位净值：C40389 财慧道 2 号 A245	1.0000
基金单位净值：C40390 财慧道 2 号 A246	1.0000
基金单位净值：C40391 财慧道 2 号 A247	1.0000
基金单位净值：C40392 财慧道 2 号 A248	1.0000
基金单位净值：C40393 财慧道 2 号 A249	1.0000
基金单位净值：C40394 财慧道 2 号 A250	1.0000
基金单位净值：C40395 财慧道 2 号 A251	1.0000
基金单位净值：C40396 财慧道 2 号 A252	1.0000
基金单位净值：C40397 财慧道 2 号 A253	1.0000
基金单位净值：C40398 财慧道 2 号 A254	1.0000
基金单位净值：C40399 财慧道 2 号 A255	1.0000
基金单位净值：C40400 财慧道 2 号 A256	1.0000
基金单位净值：C40401 财慧道 2 号 A257	1.0000
基金单位净值：C40402 财慧道 2 号 A258	1.0000
基金单位净值：C40403 财慧道 2 号 A259	1.0000
基金单位净值：C40404 财慧道 2 号 A260	1.0000
基金单位净值：C40405 财慧道 2 号 A261	1.0000
基金单位净值：C40406 财慧道 2 号 A262	1.0000
基金单位净值：C40407 财慧道 2 号 A263	1.0000
基金单位净值：C40408 财慧道 2 号 A264	1.0000
基金单位净值：C40409 财慧道 2 号 A265	1.0000
基金单位净值：C40410 财慧道 2 号 A266	1.0000
基金单位净值：C40411 财慧道 2 号 A267	1.0000

财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划 2018 年季度管理报告(四季度)

基金单位净值：C40412 财慧道 2 号 A268	1.0000
基金单位净值：C40413 财慧道 2 号 A269	1.0000
基金单位净值：C40414 财慧道 2 号 A270	1.0000
基金单位净值：C40415 财慧道 2 号 A271	1.0000
基金单位净值：C40416 财慧道 2 号 A272	1.0000
基金单位净值：C40417 财慧道 2 号 A273	1.0000
基金单位净值：C40418 财慧道 2 号 A274	1.0000
基金单位净值：C40419 财慧道 2 号 A275	1.0000
基金单位净值：C40420 财慧道 2 号 A276	1.0000
基金单位净值：C40421 财慧道 2 号 A277	1.0000
基金单位净值：C40422 财慧道 2 号 A278	1.0000
基金单位净值：C40423 财慧道 2 号 A279	1.0000
基金单位净值：C40424 财慧道 2 号 A280	1.0000
基金单位净值：C40425 财慧道 2 号 A281	1.0000
基金单位净值：C40426 财慧道 2 号 A282	1.0000
基金单位净值：C40427 财慧道 2 号 A283	1.0000
基金单位净值：C40428 财慧道 2 号 A284	1.0000
基金单位净值：C40429 财慧道 2 号 A285	1.0000
基金单位净值：C40430 财慧道 2 号 A286	1.0000
基金单位净值：C40431 财慧道 2 号 A287	1.0000
基金单位净值：C40432 财慧道 2 号 A288	1.0000
基金单位净值：C40433 财慧道 2 号 A289	1.0000
基金单位净值：C40434 财慧道 2 号 A290	1.0000
基金单位净值：C40435 财慧道 2 号 A291	1.0000
基金单位净值：C40436 财慧道 2 号 A292	1.0000
基金单位净值：C40437 财慧道 2 号 A293	1.0000
基金单位净值：C40438 财慧道 2 号 A294	1.0000
基金单位净值：C40439 财慧道 2 号 A295	1.0000
基金单位净值：C40440 财慧道 2 号 A296	1.0000

基金单位净值：C40441 财慧道 2 号 A297	1.0000
基金单位净值：C40442 财慧道 2 号 A298	1.0000
基金单位净值：C40443 财慧道 2 号 A299	1.0000
基金单位净值：C40444 财慧道 2 号 A300	1.0000
基金单位净值：C400XX 虚拟劣后级	1.0000

（二）投资主办简介

陈水祥先生，中国人民大学经济学学士、金融学硕士，通过 CFA 三级考试，2004 年—2010 年在商业银行与证券公司从事信用分析与行业研究工作，2010 年 4 月至今在财通证券资产管理公司（其前身为财通证券资产管理部）从事投资和研究工作。

余冠蓉女士，兰州大学经济学学士，美国佩斯大学投资管理专业硕士，2013 年在美国 Altfest Personal Wealth Management 任基金投资部分析师，2014 年 6 月加入财通证券资管部任结构融资部研究员，2014 年 12 月加入财通证券资管，历任固收私募投资部交易员、投资经理助理。

（三）投资主办工作报告

四季度宏观经济数据整体有所下行。从 11 月统计局公布的制造业 PMI 来看，官方制造业 PMI 为 50%，低于上月和预期 0.2 个百分点，处于临界点，表明制造业生产放缓；新订单指数为 50.4%，比上月回落 0.4 个百分点，高于临界点，表明制造业市场需求增速略有下滑；而生产端和需求端的缺口实际在扩大。固定资产投资方面，增速有所下滑，1-11 月固定资产投资累计同比 5.9%，前值 5.7%，趋势上来看，房地产

投资受调控政策影响，市场预期悲观，未来地产实际投资偏弱；而基建投资受前期融资约束影响，近几个月增速下滑明显。进出口方面，11 月份增速回落，出口增速同比（按美元计）5.4%，进口增速同比（按美元计）3%，显示内需和外需均走弱；出口一方面受到新兴经济体危机影响需求，出口大幅回落，另一方面受到贸易摩擦影响，对发达国家经济体的出口同比回落较快。物价方面，最新公布的 11 月份物价指数，CPI 同比上涨 2.2%，低于前值和预期，核心 CPI 同比上涨 1.8%；从环比看，CPI 下行 0.3%，主要受食品价格和能源价格下跌影响较多。短期来看，央行提出保持流动性的合理充沛，整体资金面合理充裕可预期；中长期来看，回归经济周期的逻辑，基本面仍然是利好债券市场，但需关注政策层面如何发力及中美贸易摩擦进展。

海外因素来看，美联储近日宣布本年度第四次加息，国内未跟随；美联储声明表示进一步加息将是适合的，维持每个月的资产负债表缩减幅度在 500 亿美元不变，但不排除明年政策转向的可能性。与此同时，欧洲央行的货币政策正常化也已经列入日程，新兴市场遭受的压力并未缓解。目前国内经济仍存在一些深层次问题和突出矛盾，国际经济金融形势更加错综复杂，面临一些严峻挑战和不确定性。

信用债方面，仍以城投债作为组合的配置重点。当下可选的优质品种主要有融资平台旧有债务（尤其是已被纳入政府性债务或政府或有债务的）和募集资金用途为棚户区改造、地下管廊建设等公益性项目的城投债。行业方面，有色金属、粗钢、水泥的生产和供应等行业景气度较高；强周期行业中，钢铁、煤炭产销量均在弱回升趋势，但调整压力初现，仅行业龙头企业相对有配置价值。加之 2018 年以来民企信用事

件频发，市场投资风险偏好有所下降。2018 年中，随着大规模债券陆续到期、债券市场融资放缓，部分企业再融资压力攀升，预计信用事件仍将持续暴露。甄别个券、防范风险仍然是各家机构的工作重点。

产品投资策略方面，目前以配置城投债、城投担保债为主，适当维持一定杠杆。未来我们仍会计划进一步配置较为稀缺的城投品种，以及部分期限适中收益较高的非公开公司债，在保证组合稳定健康的前提下积极贡献收益。此外，也会关注低评级债券中的错杀机会，以增强票息收入。杠杆方面，在货币当局积极去杠杆防风险的政策背景下，将适度控制杠杆。最后也将对利率品种和转债品种进行一些波段操作，同时加大可交换债、项目收益债、ABS 等创新资产的研究，争取为组合贡献一定的超额收益。

（四）内部性声明

1. 集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《管理办法》、《实施细则》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

2. 风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过设立独立的风险控制部门，对集合理财业务进行事前审核、事中监控，日常对集合资产管理业务的重大

事项进行风险评估，并提出风险控制措施。风险管理部还对业务授权、投资交易的执行情况进行监控，控制业务运作过程中存在的风险。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险管理部日常监控、重点检查的结果。

我们认为，在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和《管理合同》及《说明书》的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

四、集合计划财务报表

(一) 资产负债表

日期：2018年12月31日

单位：

元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
资 产：		负 债：	
银行存款	122,356,545.97	短期借款	0.00
结算备付金	18,459,211.48	交易性金融负债	0.00
存出保证金	217,741.97	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	20,384,860,648.56	卖出回购金融资产款	2,436,205,517.54
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	16,419,692.45
债券投资	20,312,532,521.72	应付赎回款	0.00
基金投资	328,126.84	应付管理人报酬	88,201,542.22
权证投资	0.00	应付托管费	664,373.71
资产支持证券投资	72,000,000.00	应付销售服务费	0.00

财通证券资管财慧道2号集合资产管理计划2018年季度管理报告(四季度)

衍生金融工具	0.00	应付交易费用	533,114.81
买入返售金融资产	3,857,049,863.44	应交税费	3,247,764.48
应收证券清算款	0.00	应付利息	4,758,349.97
应收利息	609,001,655.70	应付利润	491,906,229.23
应收股利	2,370.36	其他负债	23,000.00
应收申购款	0.00	负债合计	3,041,959,584.41
其他资产	17,662,023.65		
		所有者权益:	
		实收基金	21,967,650,476.72
		未分配利润	0.00
		所有者权益合计	21,967,650,476.72
资产合计	25,009,610,061.13	负债和所有者权益总计	25,009,610,061.13

(二) 损益表

日期: 2018年10月1日-2018年12月31日

单位: 元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	328,501,986.37	1,307,589,773.68
1、利息收入	333,930,945.13	1,325,564,051.07
其中: 存款利息收入	365,443.29	2,325,689.54
债券利息收入	298,011,594.50	1,224,467,701.00
资产支持证券利息收入	219,156.16	219,156.16
买入返售证券收入	43,694,111.14	133,006,935.49
增值税利息收入抵减	-8,359,359.96	-34,455,431.12
2、投资收益	-5,428,958.76	-17,974,277.39
其中: 股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	-2,771,781.52	-25,409,653.22
基金投资收益	-3,066,741.30	-3,066,741.30
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	409,564.06	10,521,850.55
增值税投资收益抵减	0.00	-19,733.42
3、公允价值变动收益	0.00	0.00

4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	44,188,054.19	177,908,062.36
1、管理人报酬	22,366,424.89	90,346,051.44
2、托管费	5,591,606.17	22,586,512.81
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	6,430.00	6,739.91
5、利息支出	15,188,711.79	59,626,062.36
其中：卖出回购金融资产支出	15,188,711.79	59,626,062.36
6、其他费用	1,034,881.34	5,342,695.84
三、利润总和	284,313,932.18	1,129,681,711.32

(三) 所有者权益(净值)变动表

日期：2018年10月1日-2018年12月31日

单位：元

项目	本期金额			上期金额		
	实收基金	未分配利润	所有者权益	实收基金	未分配利润	所有者权益
一、期初所有者权益(基金净值)	22,133,021,683.85	0.00	22,133,021,683.85	22,233,464,098.28	0.00	22,233,464,098.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	0.00	284,313,932.18	284,313,932.18	0.00	263,672,423.56	263,672,423.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以“-”)	-165,371,207.13	0.00	-165,371,207.13	-100,442,414.43	0.00	-100,442,414.43

号填列)						
其中: 1. 基金申购款	8,054,964.92 0.97	0.00	8,054,964.92 0.97	8,893,840.14 2.43	0.00	8,893,840.14 2.43
2. 基金赎回款	- 8,220,336.12 8.10	0.00	- 8,220,336.12 8.10	- 8,994,282.55 6.86	0.00	- 8,994,282.55 6.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	- 284,313,932.18	- 284,313,932.18	0.00	- 263,672,423.56	- 263,672,423.56
五、期末所有者权益(基金净值)	21,967,650.4 76.72	0.00	21,967,650.4 76.72	22,133,021.6 83.85	0.00	22,133,021.6 83.85

五、集合计划投资组合报告

(一) 资产组合情况

日期: 2018年12月31日

单位:

元

项目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	122,356,545.97	0.49%
清算备付金	18,459,211.48	0.07%
存出保证金	217,741.97	0.00%
股票投资	0	0
债券投资	20,312,532,521.72	81.22%
资产支持证券投资	72,000,000.00	0.29%
基金投资	328,126.84	0.00%

理财产品投资	0	0
买入返售金额资产	3,857,049,863.44	15.42%
应收股利	2,370.36	0.00%
应收利息	609,001,655.70	2.44%
其他应收款	17,662,023.65	0.07%
证券清算款	0	0
资产合计	25,009,610,061.13	100%

注：由于四舍五入的原因，期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

（二）报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券 明细

证券代码	证券名称	数量	市值	市值占净值比
180210	18 国开 10	2,100,000.00	214,697,357.93	0.98%
136915	18 中大 Y1	2,000,000.00	200,000,000.00	0.91%
111881619	18 包商银行 CD185	2,000,000.00	199,410,107.76	0.91%
1680285	16 苏南通一带债	1,900,000.00	184,895,894.62	0.84%
135450	16 巴中 01	1,500,000.00	150,005,366.69	0.68%
118672	16 东建债	1,500,000.00	149,997,348.07	0.68%
031672017	16 海城金财 PPN001B	1,400,000.00	140,920,375.34	0.64%
041800423	18 曲文投 CP002	1,300,000.00	130,000,569.60	0.59%
125608	15 津港债	1,300,000.00	130,000,000.00	0.59%
143109	18 国证债	1,270,000.00	127,000,000.00	0.58%

六、集合计划份额变动情况

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
22,133,021,683.85	8,054,964,920.97	-8,220,336,128.10	21,967,650,476.72

七、重要事项揭示

(一) 本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理、财产、托管业务的诉讼事项。

(二) 本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

(三) 未例明事项见公司网站公告。

八、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

1. 《财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划说明书》
2. 《财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划合同》
3. 《财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划托管协议》
4. 《财通证券资管财慧道 2 号集合资产管理计划验资报告》
5. 管理人业务资格批件、营业执照

(二) 查阅方式

财通证券资管网址：www.ctzg.com

客服电话：95336

投资者对本报告如有任何疑问，可咨询管理人财通证券资产管理有限公司。

财通证券资产管理有限公司

二〇一九年一月二十三日