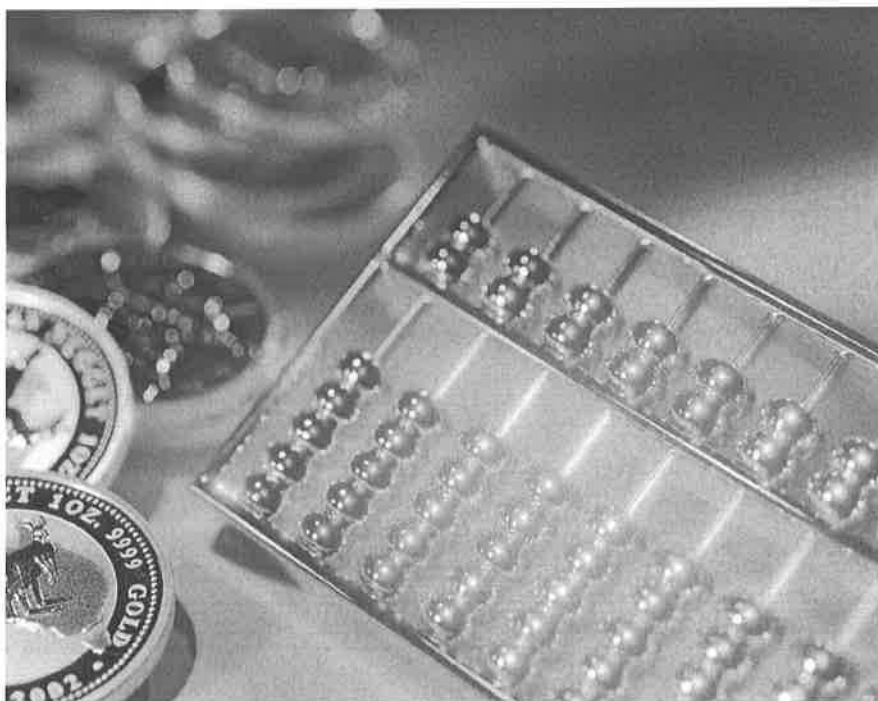


## 天平1号基金定期管理报告



基金名称： 中融鼎新-天平1号基金

基金经理： 齐冬妮

本报告由基金管理人编制。基金管理人承诺，管理基金财产将恪尽职守，履行诚实、信用、谨慎、有效管理的义务，但基金管理人在管理、运用或处分基金财产过程中可能面临多种风险，包括但不限于政策风险、市场风险、流动性风险、管理风险等，基金管理人承诺保本和最低收益。

## 尊敬的基金份额持有人:

感谢您投资于本公司设立的"中融鼎新-天平 1 号基金"。本基金自 2015 年 8 月 12 日成立以来,现已运作近 2 个月。本公司作为基金管理人,向您报告自 2015 年 8 月 12 日至 2015 年 9 月 30 日基金事务管理事宜。

### 一、 基金基本情况

1. 基金名称: 中融鼎新-天平 1 号基金
2. 基金管理人: 北京中融鼎新投资管理有限公司(以下简称"管理人")
3. 基金期限: 2015 年 8 月 12 日至 2025 年 8 月 12 日,如发生基金文件规定的基金终止或延期情形时,则基金提前终止或延期。
4. 基金实收资金: 1,611,500,000 元。
5. 基金目的: 通过实施本基金,基金份额持有人将合法自有资金投资于本基金,并委托基金管理人对基金财产进行集中管理、运用或处分,从而为基金份额持有人获取基金收益。
6. 基金托管人: 中信银行股份有限公司总行营业部
7. 基金财产专户:  
开户名: 中融鼎新-天平 1 号基金  
开户行: 中信银行北京首体南路支行  
账 号: 8110701013200092833

## 二、 基金资金运用情况

截至报告期末，本基金共运用资金 1,618,622,815.17 元。截至报告期末，本基金募集的资金已按照基金合同约定的范围运用资金占比 100%。

| 序号 | 项目      | 成本金额（元）          | 占总资产的比例（%） |
|----|---------|------------------|------------|
| 1  | 固定收益投资  |                  | 0%         |
|    | 其中：债券   |                  | 0%         |
|    | 回购      |                  | 0%         |
|    | 定期      |                  | 0%         |
|    | 基金      | 3,000,000.00     | 0.18%      |
|    | 理财      | 1,592,524,890.00 | 98.39%     |
| 2  | 货币基金    |                  | 0%         |
| 3  | 其他资产    | 8,424,640.38     | 0.52%      |
| 4  | 现金及银行存款 | 14,673,284.79    | 0.91%      |
|    | 合计      | 1,618,622,815.17 | 100%       |

## 三、 投资组合平均剩余期限

### 1. 投资组合平均剩余期限

| 项目              | 天数     |
|-----------------|--------|
| 报告期末投资组合平均剩余期限  | 140.18 |
| 报告期末投资组合剩余期限最高值 | 723    |
| 报告期末投资组合剩余期限最低值 | 1      |

### 2. 投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限        | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） |
|----|---------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内        | 42.91%             |
| 2  | 30 天(含)—60 天  | 0%                 |
| 3  | 60 天(含)—90 天  | 27.92%             |
| 4  | 90 天(含)—180 天 | 0%                 |



|    |                 |         |
|----|-----------------|---------|
| 5  | 180天(含)—365天(含) | 18.31%  |
| 6  | 365天(含)—3年      | 10.86%  |
| 合计 |                 | 100.00% |

#### 四、 基金资金运用及分配情况

截至2015年9月30日，基金资金的运用、分配情况如下：

1. 资金运用共计1,618,622,815.17元；（投向详见二基金资金运用情况）
2. 本基金将按照基金合同等基金文件的约定向受益人分配基金利益。截至报告期末，该基金尚未分配基金收益。

#### 五、 管理人尽职管理情况

本公司针对本基金的运作特点，通过定期和不定期的风险监控及风险预警机制，及时发现运作过程中可能出现的风险状况，并采取相应的风险规避措施，确保基金合法、合规、安全、正常运行。

本报告期内，本基金运作合法合规，未出现违反相关规定的状况，也未发生损害投资者利益的行为。

#### 六、 托管人报告

无。

#### 七、 重大事项报告

无。

为保证本基金安全稳健运行，今后本公司将继续严格按照相关法

律法规的规定和基金合同的约定，勤勉尽责，努力实现基金受益人利益的最大化。

您可以登录本公司网站 [www.zrtdx.com](http://www.zrtdx.com)，了解本基金运作情况和本公司将推出的其他基金产品信息。如您对本基金有疑问或对客户服务有任何要求，请联系本公司客服人员。

客服热线：4006-508-666



