

定期管理报告



信托名称：中融-汇聚金1号货币基金
集合资金信托计划

信托经理：马晓旭

本报告由信托计划受托人编制。受托人承诺，管理信托财产将恪尽职守，履行诚实、信用、谨慎、有效管理的义务，但受托人在管理、运用或处分信托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，受托人不承诺保本和最低收益。

尊敬的委托人/受益人：

感谢您投资于我公司设立的“中融-汇聚金1号货币基金集合资金信托计划”。本信托自2012年5月3日成立以来，现已运作53个月。我公司作为受托人，向您报告自2016年7月1日至2016年9月30日信托事务管理事宜。

一、信托计划基本情况

1. 信托计划名称：中融-汇聚金1号货币基金集合资金信托计划
2. 信托计划受托人：中融国际信托有限公司（简称“受托人”）
3. 信托计划期限：2012年5月3日至2022年5月2日，如发生信托文件规定的信托计划终止或延期情形时，则信托计划提前终止或延期。
4. 信托计划实收信托：截至2016年9月30日，实收信托899.01亿元。
5. 信托目的：委托人基于对受托人的信任，自愿将其合法拥有或管理的资金委托给受托人管理。受托人充分利用其专业优势和金融同业资源，将信托计划资金投资于银行存款、货币市场基金、债券基金、交易所及银行间市场债券以及固定收益类产品（包括期限在1年以内的逆回购、信托产品或信托受益权、债权或附加回购的债权收益权、附加回购的股权收益权、固定收益类银行理财产品）等以及《信托合同》约定的其它用途，以获取投资收益。
6. 信托计划保管人：中国工商银行北京市分行营业部

7. 信托财产专户：

开户名：中融国际信托有限公司

开户行：中国工商银行北京市分行营业部

账 号：0200000329236002925

二、信托资金运用情况

截至报告期末，本信托计划募集的资金已按照信托合同约定的范围运用资金占比 100%。

序号	项目	市值金额（亿元）	占总资产的比例
1	现金及银行存款	2.97	0.32%
2	债券类	125.53	13.55%
	其中：债券	54.94	5.93%
	逆回购	70.59	7.62%
3	货币基金及理财产品	160.02	17.28%
4	其它标准化金融产品	569.44	61.47%
	其中：结构化投资类	327.17	35.32%
	标准化资产配置类	186.03	20.08%
	其他	56.24	6.07%
5	信托产品	41.89	4.52%
	其中：基础建设	1.81	0.19%
	商业物业	6.72	0.73%
	工商企业贷款	11.56	1.25%

	其他	21.80	2.35%
6	信托受益权	24.84	2.68%
7	其他	1.63	0.18%
	合计	926.32	100.00%

其中：1、“工商企业贷款”为受托人向具有良好财务状况和盈利能力的工商企业提供的最长期限不超过6个月的短期流动贷款；

2、“信托产品”中的“其他”为融资租赁、附回购的金融资产等；

3、“信托受益权”为受让委托人持有的已成立优质信托项目(到期期限不超过12个月)的信托受益权。

截至2016年9月30日，本信托计划直接或间接持有的债券包含但不限于：

序号	债券代码	债券名称	面额(元)	票面利率%	主体评级	债券评级
1	111695262.IB	16宁夏银行CD026	300,000,000.00	2.90	AA	
2	111695208.IB	16重庆农村商行CD076	300,000,000.00	2.85	AAA	
3	101660020.IB	16特变股份MTN001	100,000,000.00	5.8	AA+	AA+
4	1680039.IB	16通辽小微债	100,000,000.00	4.58	AA	AAA
5	1680092.IB	16铜建专项债	100,000,000.00	4.12	AA	AA
6	101675002.IB	16重庆地产MTN001	100,000,000.00	4.25	AAA	AAA
7	101662021.IB	16水利十四MTN001	100,000,000.00	4.5	AA+	AA+
8	101662012.IB	16经纬纺织MTN001	100,000,000.00	3.88	AA+	AA+
9	101663003.IB	16京电城投MTN001	70,000,000.00	4.03	AA	AA
10	101581004.IB	15新海连MTN001	60,000,000.00	4.64	AA	AA

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	154

2. 投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占资产总值的比
1	30 天以内	18.50%
2	30 天(含)—90 天	16.01%
3	90 天(含)—180 天	30.67%
4	180 天(含)—365 天	29.47%
5	365 天(含)—3 年	5.35%
6	合计	100.00%

其中，1、将所持有的债券归类为交易性金融资产，设定其平均剩余期限为 2 天，而非债券的到期期限；

2、所投资信托产品的到期期限以不超过 6 个月为主，且最多不超过 12 个月。同时超过 1 年以上的投资均设有提前终止条款。

四、信托资金运用及分配情况

截至 2016 年 9 月 30 日，信托资金的运用、分配情况如下：

1. 资金运用共计 926.32 亿元；（投向详见二信托资金运用情况）
2. 本信托计划按照资金信托合同等信托文件的约定向受益人分配信托收益。自本信托计划成立至今，已向受益人累计分配本金及信托收益 2984.96 亿元。

五、受托人尽职管理情况

本公司针对本信托计划的运作特点，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，确保信托计划合法、合规、安全、正常运行。

本报告期内，本信托计划运作合法合规，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。

管理团队主要成员如下：

王鹏辉，男，获北京大学学士学位。中国注册会计师，拥有期货业从业资格、基金业从业资格，通过特许金融分析师二级考试。曾于道琼斯指数（亚太区）担任分析员，追踪、分析亚太区主要股市上市公司财务及股票价格数据。专注于证券投资和跨市场混合型基金管理。现任中融国际信托有限公司直投业务部总经理。

马晓旭，女，伯明翰大学货币银行金融学专业硕士，具备证券从业资格，基金从业资格。擅长信托相关投资业务以及证券投资和基金相关业务。现任中融国际信托公司直投业务部基金运营主管。

黄路展，男，获马里兰大学金融专业硕士学位。具备证券从业资格、基金业从业资格。专注于证券投资及另类资产投资、跨市场混合型基金管理。现任中融国际信托有限公司直投业务部基金运营主管。

李书锐，女，内布拉斯加大学林肯分校金融专业学士，具备证券从业资格。擅长固定收益类产品投资、金融衍生产品投资、投资银行业务等。现任中融国际信托有限公司直投业务部基金运营主管。

六、保管人报告

本信托计划的保管人提交的保管报告表明，本报告期内，本公司在信托财产管理问题上，不存在任何损害本信托计划受益人利益的行为，遵守了《信托公司管理办法》、《信托公司集合资金信托计划管理办法》等有关法规的规定和本信托计划各项信托文件的约定。

七、重大事项报告

无。

为保证本信托计划安全稳健运行，今后我公司将继续严格按照信托合同的约定，勤勉尽责，努力实现信托受益人利益的最大化。

您可以登录我公司网站 www.zritc.com，了解本信托计划运作情况和我公司将推出的其他信托产品信息。如您对本信托计划有疑问或对客户服务有任何要求，请联系我公司客服人员。

客服热线：400-6508-666

报告专用章

