

# 中金财富聚金利货币型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：中国中金财富证券有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事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。

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于 2023 年 10 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合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集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	中金财富聚金利
基金主代码	970180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 25 日
报告期末基金份额总额	4,633,043,665.71 份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争为集合计划份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本集合计划将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，通过以久期为核心的资产配置、品种与类属选择，充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，力争为集合计划份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。主要包含以下策略：1. 资产配置策略；2. 期限配置策略；3. 品种配置策略；4. 个券选择策略；5. 流动性管理策略。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本集合计划的类型为货币型集合资产管理计划，预期收益和预期风险低于债券型基金、债券型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。
基金管理人	中国中金财富证券有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资

产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	14,720,794.15
2. 本期利润	14,720,794.15
3. 期末基金资产净值	4,633,043,665.71

注：本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

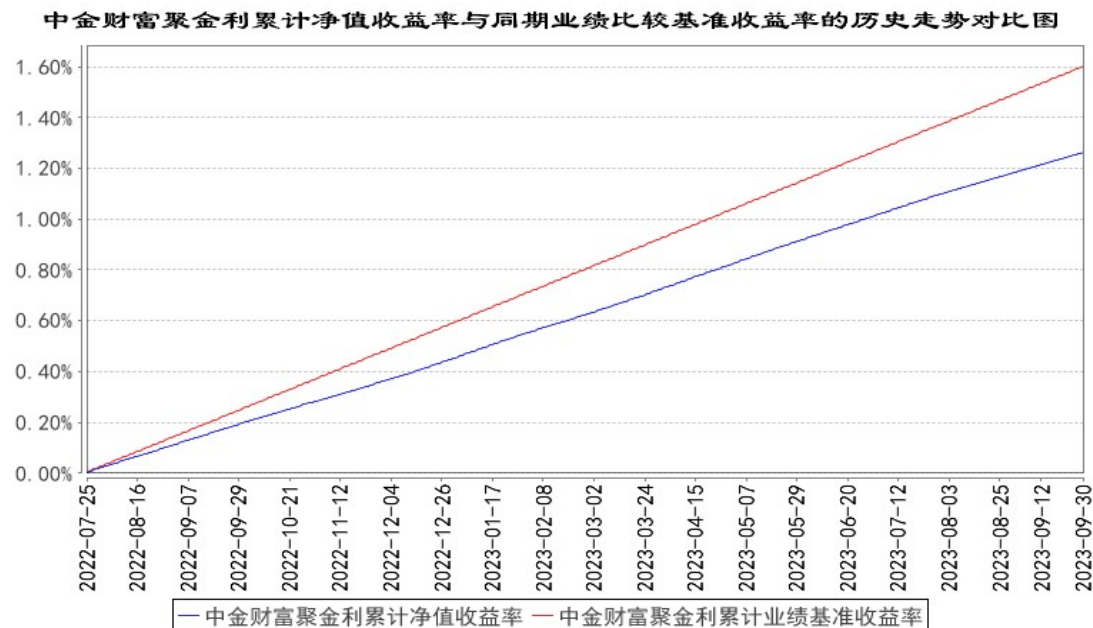
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.2536%	0.0002%	0.3360%	0.0000%	-0.0824%	0.0002%
过去六个月	0.5357%	0.0002%	0.6706%	0.0000%	-0.1349%	0.0002%
过去一年	1.0663%	0.0002%	1.3466%	0.0000%	-0.2803%	0.0002%
自基金合同 生效起至今	1.2640%	0.0002%	1.6015%	0.0000%	-0.3375%	0.0002%

注：本集合计划每日分配收益，按月结转份额。

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本集合计划业绩比较基准收益率=同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕文弢	本基金的基金经理	2022年7月25日	-	10年	吕文弢女士，乔治华盛顿大学金融硕士，已取得基金经理资格。曾任中国中投证券有限责任公司资产管理部固定收益研究员，投资经理助理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本集合计划管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及集合计划合同、招募说明书等有关集合计划法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，集合计划运作整体合法合规，没有损害集合计划份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易管理相关制度，规范投资和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本报告期内，本集合计划运作符合法律法规和公司公平交易管理制度的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发生超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本集合计划在 2023 年第三季度的收益主要来自银行活期、定期存款、同业存单、逆回购的利息收入。回顾三季度，经济复苏放缓，固定资产投资持续回落，仅制造业投资增速企稳。部分口径显示需求改善，8 月以来社零企稳回升，出口增速同比跌幅收窄。制造业 PMI 连续回升，9 月上行至荣枯线上。工业企业利润持续修复。通胀方面，CPI、PPI 连续上行。货币政策方面，央行维护资金面合理充裕，8 月非对称调降 MLF 利率 15bp、常备借贷利率和逆回购利率 10bp，9 月超预期降准 0.25%。流动性方面，资金面边际收紧，DR007 多数在政策利率之上波动。回顾市场，利率债先下后上，短端调整幅度大于长端，期限利差变平，1y 期国债上行至 2.17%，10y 期国债上行至 2.68%。各期限 Shibor 上行，3M Shibor 上行至 2.30%，6M Shibor 上行至 2.36%。2023 年三季度在流动性中性偏宽松的背景下，本集合计划着重资金面分析，预留充足流动性，适时配置久期较长的资产。

展望四季度，经济复苏压力有所缓解，出口预计温和修复，工业企业延续复苏。货币政策预计保持稳健，暂不具备快速收紧的条件，但由于受到汇率压力掣肘，转向大幅宽松的概率较小。本集合计划 2023 年四季度的策略是预留充足流动性的资产的比例，适时配置久期较长的资产。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本集合计划份额净值收益率为 0.2536%，同期业绩比较基准收益率为 0.336%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	1,785,026,917.71	38.47
	其中：债券	1,785,026,917.71	38.47
	资产支持证券	-	-
	券	-	-
2	买入返售金融资产	625,477,864.77	13.48
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	2,229,021,198.64	48.04
4	其他资产	-	-
5	合计	4,639,525,981.12	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

本集合计划本报告期内未进行债券正回购投资。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本集合计划本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	79
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本集合计划本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

#### 5.3.2 报告期末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（%）	各期限负债占基金资产净 值的比例（%）
1	30 天以内	32.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	20.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	12.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.69	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	24.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.88	-

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本集合计划本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,785,026,917.71	38.53
8	其他	-	-
9	合计	1,785,026,917.71	38.53
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112303053	23 农业银行 CD053	3,000,000	296,493,037.05	6.40
2	112302007	23 工商银行 CD007	1,400,000	139,722,282.39	3.02
3	112306033	23 交通银行 CD033	1,000,000	99,887,569.17	2.16
4	112210326	22 兴业银行 CD326	1,000,000	99,805,911.85	2.15
5	112306049	23 交通银行 CD049	1,000,000	99,739,444.98	2.15
6	112318042	23 华夏银行 CD042	1,000,000	99,680,552.44	2.15
7	112304009	23 中国银行 CD009	1,000,000	99,663,437.20	2.15
8	112303022	23 农业银行 CD022	1,000,000	99,623,031.34	2.15
9	112302026	23 工商银行	1,000,000	99,617,462.41	2.15

		CD026			
10	112205191	22 建设银行 CD191	1,000,000	99,616,533.39	2.15

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0222%
报告期内偏离度的最低值	-0.0284%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0163%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本集合计划本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本集合计划本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

本集合计划估值采用“摊余成本法”，并通过计算暂估收益率的方法每日确认各类金融工具的暂估收益，为了避免采用“摊余成本法”计算的集合计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，管理人于每一估值日，采用估值技术，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

#### 5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本集合计划本报告期投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司（23 农业银行 CD053、23 农业银行 CD022）、中国建设银行股份有限公司（22 建设银行 CD191）、中国银行股份有限公司（23 中国银行 CD009）、交通银行股份有限公司（23 交通银行 CD033、23 交通银行 CD049）、兴业银行股份有限公司（22 兴业银行 CD326）在本期内曾受到监管部门的处罚，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。除



上述主体外，本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 5.9.3 其他资产构成

本集合计划本报告期末无其他资产。

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	5,018,591,023.77
报告期期间基金总申购份额	35,290,584,854.00
报告期期间基金总赎回份额	35,676,132,212.06
报告期期末基金份额总额	4,633,043,665.71

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	2023-07-03	-52,911,615.00	-52,911,615.00	0.00
2	非交易过户转入	2023-07-03	38,221,029.00	38,221,029.00	0.00
3	赎回	2023-07-04	-38,221,029.00	-38,221,029.00	0.00
4	非交易过户转入	2023-07-04	56,379,990.00	56,379,990.00	0.00
5	赎回	2023-07-05	-56,379,990.00	-56,379,990.00	0.00
6	非交易过户转入	2023-07-05	47,406,492.00	47,406,492.00	0.00
7	赎回	2023-07-06	-47,406,492.00	-47,406,492.00	0.00
8	非交易过户转入	2023-07-06	47,640,049.00	47,640,049.00	0.00
9	赎回	2023-07-07	-47,640,049.00	-47,640,049.00	0.00
10	非交易过户转入	2023-07-07	44,950,857.00	44,950,857.00	0.00
11	赎回	2023-07-10	-44,950,857.00	-44,950,857.00	0.00
12	非交易过户转入	2023-07-10	37,123,122.00	37,123,122.00	0.00
13	赎回	2023-07-11	-37,123,122.00	-37,123,122.00	0.00
14	非交易过户转入	2023-07-11	37,597,938.00	37,597,938.00	0.00

15	赎回	2023-07-12	-37,597,938.00	-37,597,938.00	0.00
16	非交易过户转入	2023-07-12	33,463,255.00	33,463,255.00	0.00
17	赎回	2023-07-13	-33,463,255.00	-33,463,255.00	0.00
18	非交易过户转入	2023-07-13	28,076,395.00	28,076,395.00	0.00
19	赎回	2023-07-14	-28,076,395.00	-28,076,395.00	0.00
20	非交易过户转入	2023-07-14	42,619,794.00	42,619,794.00	0.00
21	赎回	2023-07-17	-42,619,794.00	-42,619,794.00	0.00
22	非交易过户转入	2023-07-17	32,439,812.00	32,439,812.00	0.00
23	赎回	2023-07-18	-32,439,812.00	-32,439,812.00	0.00
24	非交易过户转入	2023-07-18	41,698,391.00	41,698,391.00	0.00
25	赎回	2023-07-19	-41,698,391.00	-41,698,391.00	0.00
26	非交易过户转入	2023-07-19	31,769,503.00	31,769,503.00	0.00
27	赎回	2023-07-20	-31,769,503.00	-31,769,503.00	0.00
28	非交易过户转入	2023-07-20	44,519,212.00	44,519,212.00	0.00
29	赎回	2023-07-21	-44,519,212.00	-44,519,212.00	0.00
30	非交易过户转入	2023-07-21	30,347,339.00	30,347,339.00	0.00
31	赎回	2023-07-24	-30,347,339.00	-30,347,339.00	0.00
32	非交易过户转入	2023-07-24	34,112,529.00	34,112,529.00	0.00
33	赎回	2023-07-25	-34,112,529.00	-34,112,529.00	0.00
34	非交易过户转入	2023-07-25	32,662,922.00	32,662,922.00	0.00
35	赎回	2023-07-26	-32,662,922.00	-32,662,922.00	0.00
36	红利发放	2023-07-26	36,967.79	36,967.79	0.00
37	非交易过户转入	2023-07-26	40,522,410.00	40,522,410.00	0.00
38	赎回	2023-07-27	-40,522,410.00	-40,522,410.00	0.00
39	非交易过户转入	2023-07-27	33,694,684.00	33,694,684.00	0.00
40	赎回	2023-07-28	-33,731,651.79	-33,731,651.79	0.00
41	非交易过户转入	2023-07-28	44,102,799.00	44,102,799.00	0.00
42	赎回	2023-07-31	-44,102,799.00	-44,102,799.00	0.00

43	非交易过户转入	2023-07-31	53,760,443.00	53,760,443.00	0.00
44	赎回	2023-08-01	-53,760,443.00	-53,760,443.00	0.00
45	非交易过户转入	2023-08-01	45,954,217.00	45,954,217.00	0.00
46	赎回	2023-08-02	-45,954,217.00	-45,954,217.00	0.00
47	非交易过户转入	2023-08-02	34,159,861.00	34,159,861.00	0.00
48	赎回	2023-08-03	-34,159,861.00	-34,159,861.00	0.00
49	非交易过户转入	2023-08-03	28,478,151.00	28,478,151.00	0.00
50	赎回	2023-08-04	-28,478,151.00	-28,478,151.00	0.00
51	非交易过户转入	2023-08-04	42,605,756.00	42,605,756.00	0.00
52	赎回	2023-08-07	-42,605,756.00	-42,605,756.00	0.00
53	非交易过户转入	2023-08-07	41,291,770.00	41,291,770.00	0.00
54	赎回	2023-08-08	-41,291,770.00	-41,291,770.00	0.00
55	非交易过户转入	2023-08-08	33,035,372.00	33,035,372.00	0.00
56	赎回	2023-08-09	-33,035,372.00	-33,035,372.00	0.00
57	非交易过户转入	2023-08-09	32,616,692.00	32,616,692.00	0.00
58	赎回	2023-08-10	-32,616,692.00	-32,616,692.00	0.00
59	非交易过户转入	2023-08-10	32,495,165.00	32,495,165.00	0.00
60	赎回	2023-08-11	-32,495,165.00	-32,495,165.00	0.00
61	非交易过户转入	2023-08-11	38,459,905.00	38,459,905.00	0.00
62	赎回	2023-08-14	-38,459,905.00	-38,459,905.00	0.00
63	非交易过户转入	2023-08-14	35,117,012.00	35,117,012.00	0.00
64	赎回	2023-08-15	-35,117,012.00	-35,117,012.00	0.00
65	非交易过户转入	2023-08-15	36,417,492.00	36,417,492.00	0.00
66	赎回	2023-08-16	-36,394,492.00	-36,394,492.00	0.00
67	非交易过户转入	2023-08-16	24,472,363.00	24,472,363.00	0.00
68	赎回	2023-08-17	-24,495,363.00	-24,495,363.00	0.00
69	非交易过户转入	2023-08-17	23,938,027.00	23,938,027.00	0.00
70	赎回	2023-08-18	-23,938,027.00	-23,938,027.00	0.00

71	非交易过户转入	2023-08-18	39,085,183.00	39,085,183.00	0.00
72	赎回	2023-08-21	-39,085,183.00	-39,085,183.00	0.00
73	非交易过户转入	2023-08-21	36,203,064.00	36,203,064.00	0.00
74	赎回	2023-08-22	-36,203,064.00	-36,203,064.00	0.00
75	非交易过户转入	2023-08-22	33,248,627.00	33,248,627.00	0.00
76	赎回	2023-08-23	-33,248,627.00	-33,248,627.00	0.00
77	非交易过户转入	2023-08-23	32,502,820.00	32,502,820.00	0.00
78	赎回	2023-08-24	-32,502,820.00	-32,502,820.00	0.00
79	非交易过户转入	2023-08-24	29,117,707.00	29,117,707.00	0.00
80	赎回	2023-08-25	-29,117,707.00	-29,117,707.00	0.00
81	非交易过户转入	2023-08-25	37,488,141.00	37,488,141.00	0.00
82	赎回	2023-08-28	-37,488,141.00	-37,488,141.00	0.00
83	红利发放	2023-08-28	33,212.06	33,212.06	0.00
84	非交易过户转入	2023-08-28	31,218,888.00	31,218,888.00	0.00
85	赎回	2023-08-29	-31,218,888.00	-31,218,888.00	0.00
86	非交易过户转入	2023-08-29	42,332,321.00	42,332,321.00	0.00
87	赎回	2023-08-30	-42,365,533.06	-42,365,533.06	0.00
88	非交易过户转入	2023-08-30	59,312,021.00	59,312,021.00	0.00
89	赎回	2023-08-31	-59,312,021.00	-59,312,021.00	0.00
90	非交易过户转入	2023-08-31	38,250,795.00	38,250,795.00	0.00
91	赎回	2023-09-01	-38,250,795.00	-38,250,795.00	0.00
92	非交易过户转入	2023-09-01	35,709,842.00	35,709,842.00	0.00
93	赎回	2023-09-04	-35,708,842.00	-35,708,842.00	0.00
94	非交易过户转入	2023-09-04	38,728,065.00	38,728,065.00	0.00
95	赎回	2023-09-05	-38,729,065.00	-38,729,065.00	0.00
96	非交易过户转入	2023-09-05	40,962,175.00	40,962,175.00	0.00
97	赎回	2023-09-06	-40,962,175.00	-40,962,175.00	0.00
98	非交易过户转入	2023-09-06	34,965,786.00	34,965,786.00	0.00

99	赎回	2023-09-07	-34,965,786.00	-34,965,786.00	0.00
100	非交易过户转入	2023-09-07	35,928,836.00	35,928,836.00	0.00
101	赎回	2023-09-08	-35,928,836.00	-35,928,836.00	0.00
102	非交易过户转入	2023-09-08	30,051,387.00	30,051,387.00	0.00
103	赎回	2023-09-11	-30,051,387.00	-30,051,387.00	0.00
104	非交易过户转入	2023-09-11	38,951,479.00	38,951,479.00	0.00
105	赎回	2023-09-12	-38,951,479.00	-38,951,479.00	0.00
106	非交易过户转入	2023-09-12	30,028,489.00	30,028,489.00	0.00
107	赎回	2023-09-13	-30,028,489.00	-30,028,489.00	0.00
108	非交易过户转入	2023-09-13	26,081,415.00	26,081,415.00	0.00
109	赎回	2023-09-14	-26,081,415.00	-26,081,415.00	0.00
110	非交易过户转入	2023-09-14	27,957,876.00	27,957,876.00	0.00
111	赎回	2023-09-15	-27,957,876.00	-27,957,876.00	0.00
112	非交易过户转入	2023-09-15	30,522,548.00	30,522,548.00	0.00
113	赎回	2023-09-18	-30,522,548.00	-30,522,548.00	0.00
114	非交易过户转入	2023-09-18	35,297,519.00	35,297,519.00	0.00
115	赎回	2023-09-19	-35,297,519.00	-35,297,519.00	0.00
116	非交易过户转入	2023-09-19	31,502,239.00	31,502,239.00	0.00
117	赎回	2023-09-20	-31,502,239.00	-31,502,239.00	0.00
118	非交易过户转入	2023-09-20	26,700,438.00	26,700,438.00	0.00
119	赎回	2023-09-21	-26,700,438.00	-26,700,438.00	0.00
120	非交易过户转入	2023-09-21	28,626,515.00	28,626,515.00	0.00
121	赎回	2023-09-22	-28,626,515.00	-28,626,515.00	0.00
122	非交易过户转入	2023-09-22	44,908,237.00	44,908,237.00	0.00
123	赎回	2023-09-25	-44,908,237.00	-44,908,237.00	0.00
124	非交易过户转入	2023-09-25	39,154,968.00	39,154,968.00	0.00
125	赎回	2023-09-26	-39,154,968.00	-39,154,968.00	0.00
126	红利发放	2023-09-26	26,990.25	26,990.25	0.00

127	非交易过户转入	2023-09-26	41,979,187.00	41,979,187.00	0.00
128	赎回	2023-09-27	-41,979,187.00	-41,979,187.00	0.00
129	非交易过户转入	2023-09-27	49,399,416.00	49,399,416.00	0.00
130	赎回	2023-09-28	-49,426,406.25	-49,426,406.25	0.00
131	非交易过户转入	2023-09-28	60,000,000.00	60,000,000.00	0.00
合计			7,088,385.00	7,088,385.00	

注：非交易过户转入为管理人提供快速取现功能产生的份额。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本集合计划本报告期未发生单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金中投聚金利集合资产管理计划合同变更批复的文件；
- 2、中金财富聚金利货币型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、中金财富聚金利货币型集合资产管理计划托管协议；
- 4、中金财富聚金利货币型集合资产管理计划招募说明书；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、中金财富聚金利货币型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告。
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

备查文件存放在集合计划管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

### 9.3 查阅方式

部分备查文件可通过本集合计划管理人公司网站查询，也可咨询本管理人。客服电话：95532/4006008008；公司网址：<http://www.ciccwm.com/>。

中国中金财富证券有限公司  
2023 年 10 月 25 日