

中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划 2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：中信建投证券股份有限公司

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：2025 年 1 月 22 日

§ 1 重要提示

基金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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于 2025 年 1 月 20 日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中信建投智多鑫货币
基金主代码	970153
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 4 月 27 日
报告期末基金份额总额	21,999,898,543.05 份
投资目标	在严格控制流动性风险的前提下，自上而下精选资产，力争为投资者创造超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划将通过跟踪宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、PPI 走势、M2 变化、利率水平等）以及各项国家政策变化（包括财政、货币政策等）来判断当前宏观经济周期所处的位置以及未来发展的方向，在此基础上分析判断债券市场、货币市场的预期收益与风险，综合流动性预判，在相关投资比例限制内，适时动态地调整各资产投资比例。 主要策略有债券投资策略、银行存款及同业存单投资策略、回购投资策略、其他金融工具投资策略等。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率(税后)。
风险收益特征	本集合计划的类型为货币市场集合资产管理计划，预期收益和预期风险低于债券型集合资产管理计划、股票型集合资产管理计划、混合型集合资产管理计划。
基金管理人	中信建投证券股份有限公司
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“基金”系按照《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》的要求完成变更后的证券公司大集合产品，中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划在本报告简称“本基金”或“本集合计划”，《中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划资产管理合同》在本报告简称“本基金合同”或“本集合计划资产管理合同”。

§ 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（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	47,894,535.44
2. 本期利润	47,894,535.44
3. 期末基金资产净值	21,999,898,543.05

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、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

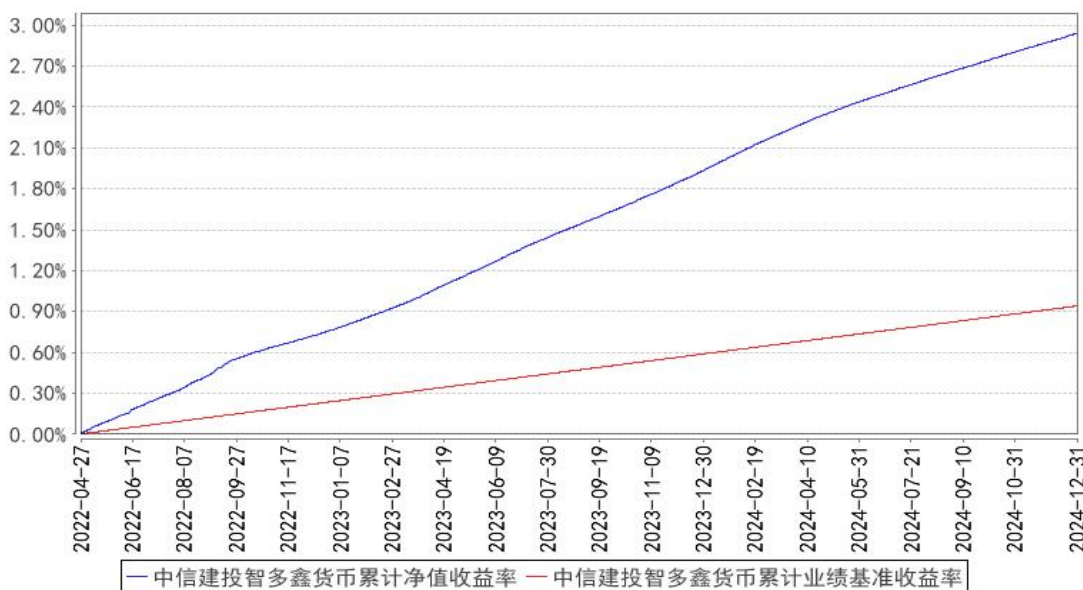
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.2047%	0.0003%	0.0875%	0.0000%	0.1172%	0.0003%
过去六个月	0.4182%	0.0002%	0.1751%	0.0000%	0.2431%	0.0002%
过去一年	0.9840%	0.0006%	0.3489%	0.0000%	0.6351%	0.0006%
自基金合同 生效起至今	2.9414%	0.0009%	0.9397%	0.0000%	2.0017%	0.0009%

注：本集合计划收益“每日分配、按季支付”，收益支付方式为现金分红。

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

中信建投智多鑫货币累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本集合计划资产管理合同生效日为 2022 年 4 月 27 日。根据资产管理合同的约定，管理人应当自集合计划资产管理合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。本集合计划在建仓期结束时各项资产配置比例符合资产管理合同的要求。

§ 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		
李腾飞	本基金的基金经理、中信建投证券资产管理部公募投资部负责人	2022 年 4 月 27 日	-	14 年	金融学硕士，具备基金从业资格。2010 年加入中信建投证券股份有限公司资产管理部，拥有 14 年证券行业工作经验、9 年投资管理经验，专注固定收益类领域研究。

注：1. 对集合计划的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期；

2. 证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金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

本集合计划管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投证券股份有限公司资产管理业务公平交易管理规定》。本集合计划管理人通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证对公平交易过程和结果的监督。

报告期内，本集合计划管理人严格执行了公平交易机制，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，交易执行环节对各类交易严格控制流程，确保了公平交易原则的实现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本集合计划的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年四季度国内经济复苏基础不牢，生产与出口表现相对较强，投资和消费偏弱。10 月、11 月规模以上工业增加值延续增长，以旧换新、置换、报废补贴等政策对汽车和家电行业的拉动作用显著。美国大选尘埃落定后，国内再度出现“抢出口”行为，导致出口延续增长。与此同时，内需不足，消费增速回落，进口增速连续五个月下滑。地方基建投资偏弱，民间投资累计增速为负。当前，提振市场微观主体预期，畅通经济循环预计仍是政策发力的主要方向。

四季度货币政策时隔十四年重回适度宽松基调。操作层面，央行通过将非银同业存款利率纳入自律管理等手段疏通政策利率，通过推出买断式逆回购补充商业银行流动性，通过将二级市场国债买卖纳入货币政策工具箱以增加基础货币投放渠道。四季度，债券市场仍然是牛市行情。10 月，活跃的权益市场分流了债券市场部分资金，“股债跷跷板”效应显著，“看股做债”带动债券收益率先下后上。11 月开始，虽然“置换债供给”带来一些冲击，但是经济基本面走弱叠加支持性的货币政策仍带动债券市场收益率震荡下行。后续随着同业存款纳入自律协议、中共中央政

治局会议提出“适度宽松”的货币政策以及中央经济工作会议提到“适时降准降息”，都给市场带来对 2025 年实施宽货币政策的较强预期。债市跨年行情抢跑明显，收益率加速下行。四季度，30 年和 10 年期国债到期收益率均下行 47BP 分别至 1.91%和 1.68%，下行幅度为 2020 年以来单季最大。一年期 AAA 同业存单到期收益率下行 36BP 至 1.57%。

操作方面，报告期内本集合计划以同业存单、同业存款、短期信用债及短期逆回购为主要配置资产，紧跟市场步伐灵活调整组合中各类资产的比例和久期。总体来看，本集合计划在四季度保持了较好的流动性和较稳定的收益率。本集合计划积极参与 10 月的市场调整，获得了较为不错的收益。下一阶段，本集合计划将继续密切关注货币、信用和财政政策的组合方式。防范风险之余，力争抓住市场波段机会以期增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.00 元，本报告期内，基金份额净值收益率为 0.2047%，同期业绩比较基准收益率为 0.0875%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满两百人或者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	13,826,514,194.46	62.64
	其中：债券	13,826,514,194.46	62.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,902,080,353.49	13.15
	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	5,344,858,177.76	24.21
4	其他资产	-	-
5	合计	22,073,452,725.71	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	7.50
	其中：买断式回购融资	-

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

在本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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	21.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	15.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	12.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	13.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	37.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.20	-

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

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	1,597,734,272.90	7.26
6	中期票据	20,758,240.64	0.09
7	同业存单	12,208,021,680.92	55.49
8	其他	-	-
9	合计	13,826,514,194.46	62.85
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	112408074	24 中信银行 CD074	3,500,000	348,926,868.12	1.59
2	112404009	24 中国银行 CD009	3,000,000	299,095,663.61	1.36
3	112404051	24 中国银行 CD051	3,000,000	299,067,230.21	1.36
4	112408130	24 中信银行 CD130	3,000,000	298,298,123.16	1.36
5	112404073	24 中国银行 CD073	3,000,000	297,686,326.32	1.35
6	112409299	24 浦发银行 CD299	3,000,000	295,365,501.42	1.34
7	072410162	24 国信证券 CP015	2,000,000	200,966,027.40	0.91
8	072410159	24 国泰君安 CP004	2,000,000	200,961,534.25	0.91
9	072410177	24 国泰君安 CP005	2,000,000	200,843,835.62	0.91
10	112405145	24 建设银行 CD145	2,000,000	199,468,597.67	0.91

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	0.0613%
报告期内偏离度的最低值	-0.0044%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0278%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在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

本基金本报告期内不存在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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。

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

【中国银行股份有限公司】

2024 年 4 月 3 日，国家外汇管理局北京市分局对中国银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以罚款 40 万元，没收违法所得 0.22 万元：办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查。

【国信证券股份有限公司】

2024 年 4 月 17 日，深圳证监局对国信证券股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警示：（一）股票质押式回购业务个别标的黑名单管理不到位、个别标的尽职调查不充分、在业务融入方出现风险后仍多次有条件延期造成大额损失；（二）纾困产品管理不足，部分纾困资管产品投向纾困用途的资金未达到规定比例；（三）私募子公司管理不到位，个别产品未经备案开展业务、个别基金部分投资款被合作方挪用；（四）存在为金融机构及其管理产品规避监管提供便利、为未备案的私募产品提供外包服务、信息隔离墙制度执行不到位等问题。

2024 年 4 月 18 日，广东证监局对国信证券股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警示：作为广东奥普特科技股份有限公司（以下简称奥普特）首发上市保荐机构，在持续督导过程中存在以下违规情形：（一）未及时督促奥普特履行募投计划变更审议及披露程序。你公司在持续督导期间，未能勤勉尽责，未及时发现奥普特存在超募计划发放员工薪酬的情况，也未按要求督促奥普特履行审议和披露程序。（二）未纠正奥普特使用其他募集专户发放薪酬问题。你公

司未能持续关注奥普特募集资金的存储使用情况，未及时发现奥普特使用营销中心募投资金向其他项目支付员工薪酬的问题，在发现该问题后也未要求奥普特及时整改。

2024 年 5 月 7 日，浙江证监局对国信证券股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警示并记入诚信档案：保荐的利尔达科技集团股份有限公司（以下简称利尔达）于 2023 年 2 月 17 日在北交所上市，根据利尔达 2024 年 4 月 26 日披露的《2023 年年度报告》，利尔达 2023 年归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润为-1,831.71 万元，上市当年即亏损，且该项目选取的上市标准含净利润标准。

2024 年 7 月 5 日，深圳证监局对国信证券股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，并责令改正：（一）部分产品具有通道业务特征，主动管理不足；（二）资管新规整改不实，存在规模较大的资产管理计划实质仍为非净值化通道类产品；（三）个别产品为其他金融机构违规运作资金池类理财业务提供便利；四是存在产品投资限额授权不审慎、债券评级方法客观性不足、投资者适当性管理不足等问题。

2024 年 10 月 12 日，深圳证监局对国信证券股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，并责令改正：（一）作为埃夫特智能装备股份有限公司首次公开发行股票并在科创板上市的保荐机构，在发行注册环节未核查持股平台中员工应持股数量，在持续督导期内存在未督促发行人完整披露相关信息的情况；（二）作为个别债券的联席主承销商，未能督促发行人规范发行行为；（三）对承销的个别债券尽职调查不到位；（四）对个别发行人募集资金使用持续督导不到位；（五）个别保荐业务人员于发行人报销费用不规范；（六）部分员工的投行工作底稿系统等权限变更不及时。

2024 年 12 月 26 日，深圳证监局对国信证券股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，并责令改正：（一）经纪业务方面，存在合规管理职责部门之间划分不清晰、部分账户实名制核查管控不充分、第三方合作风险管控防范不足等问题。（二）场外衍生品业务方面，存在为客户违规开展业务提供便利、适当性核查不完善、风险监测管控不完备、内控管理不足等问题。

【国泰君安证券股份有限公司】

2024 年 1 月 5 日，证监会对国泰君安证券股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警示：作为泰禾集团股份有限公司（以下简称发行人）公司债券受托管理人，在受托管理期间未严格遵守执业行为准则，存在未及时召集持有人会议、未对发行人未披露相关重大债务逾期及诉讼事项保持必要关注等情形。你公司在受托管理过程中存在履职尽责不到位的情况，未能督导发行人真实、准确、完整、及时披露相关信息，违反了《公司债券发行与交易管理办法（2015 年修订）》（证监会令第 113 号，以下简称《管理办法（2015）》）第七条、第四十九条、第五十五条，《公司债券发行与交易管理办法（2021 年修订）》（证监会令第 18 号，以下简称《管理办法（2021）》）

第六条、第五十八条的规定。

本基金投资 24 中国银行 CD009、24 中国银行 CD051、24 中国银行 CD073、24 国信证券 CP015、24 国泰君安 CP004、24 国泰君安 CP005 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 24 中国银行 CD009、24 中国银行 CD051、24 中国银行 CD073、24 国信证券 CP015、24 国泰君安 CP004、24 国泰君安 CP005 外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.9.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	15,630,892,766.19
报告期期间基金总申购份额	181,149,892,696.84
报告期期间基金总赎回份额	174,780,886,919.98
报告期期末基金份额总额	21,999,898,543.05

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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	2024-10-08	-119,999,551.00	-119,999,551.00	-
2	非交易过户	2024-10-08	120,000,000.00	120,000,000.00	-
3	赎回	2024-10-09	-120,000,000.00	-120,000,000.00	-
4	非交易过户	2024-10-09	120,000,000.00	120,000,000.00	-
5	赎回	2024-10-10	-120,000,000.00	-120,000,000.00	-
6	非交易过户	2024-10-10	119,999,312.00	119,999,312.00	-
7	赎回	2024-10-11	-119,999,312.00	-119,999,312.00	-
8	非交易过户	2024-10-11	119,999,746.00	119,999,746.00	-
9	赎回	2024-10-14	-119,999,746.00	-119,999,746.00	-

10	非交易过户	2024-10-14	119,999,753.00	119,999,753.00	-
11	赎回	2024-10-15	-119,999,753.00	-119,999,753.00	-
12	非交易过户	2024-10-15	120,000,000.00	120,000,000.00	-
13	赎回	2024-10-16	-120,000,000.00	-120,000,000.00	-
14	非交易过户	2024-10-16	120,000,000.00	120,000,000.00	-
15	赎回	2024-10-17	-120,000,000.00	-120,000,000.00	-
16	非交易过户	2024-10-17	119,999,527.00	119,999,527.00	-
17	赎回	2024-10-18	-119,999,527.00	-119,999,527.00	-
18	非交易过户	2024-10-18	120,000,000.00	120,000,000.00	-
19	赎回	2024-10-21	-120,000,000.00	-120,000,000.00	-
20	非交易过户	2024-10-21	119,999,941.00	119,999,941.00	-
21	赎回	2024-10-22	-119,999,941.00	-119,999,941.00	-
22	非交易过户	2024-10-22	120,000,000.00	120,000,000.00	-
23	赎回	2024-10-23	-120,000,000.00	-120,000,000.00	-
24	非交易过户	2024-10-23	119,999,609.00	119,999,609.00	-
25	赎回	2024-10-24	-119,999,609.00	-119,999,609.00	-
26	非交易过户	2024-10-24	150,940,220.00	150,940,220.00	-
27	赎回	2024-10-25	-150,940,220.00	-150,940,220.00	-
28	非交易过户	2024-10-25	156,962,829.00	156,962,829.00	-
29	赎回	2024-10-28	-156,962,829.00	-156,962,829.00	-
30	非交易过户	2024-10-28	189,252,640.00	189,252,640.00	-
31	赎回	2024-10-29	-189,252,640.00	-189,252,640.00	-
32	非交易过户	2024-10-29	159,009,696.00	159,009,696.00	-
33	赎回	2024-10-30	-159,009,696.00	-159,009,696.00	-
34	非交易过户	2024-10-30	159,946,799.00	159,946,799.00	-
35	赎回	2024-10-31	-159,946,799.00	-159,946,799.00	-
36	非交易过户	2024-10-31	161,314,443.00	161,314,443.00	-
37	赎回	2024-11-01	-161,314,443.00	-161,314,443.00	-

38	非交易过户	2024-11-01	148,683,489.00	148,683,489.00	-
39	赎回	2024-11-04	-148,683,489.00	-148,683,489.00	-
40	非交易过户	2024-11-04	164,833,059.00	164,833,059.00	-
41	赎回	2024-11-05	-164,833,059.00	-164,833,059.00	-
42	非交易过户	2024-11-05	184,168,164.00	184,168,164.00	-
43	赎回	2024-11-06	-184,168,164.00	-184,168,164.00	-
44	非交易过户	2024-11-06	178,400,004.00	178,400,004.00	-
45	赎回	2024-11-07	-178,400,004.00	-178,400,004.00	-
46	非交易过户	2024-11-07	159,442,105.00	159,442,105.00	-
47	赎回	2024-11-08	-159,442,105.00	-159,442,105.00	-
48	非交易过户	2024-11-08	199,999,653.00	199,999,653.00	-
49	赎回	2024-11-11	-199,999,653.00	-199,999,653.00	-
50	非交易过户	2024-11-11	186,393,080.00	186,393,080.00	-
51	赎回	2024-11-12	-186,393,080.00	-186,393,080.00	-
52	非交易过户	2024-11-12	170,583,199.00	170,583,199.00	-
53	赎回	2024-11-13	-170,583,199.00	-170,583,199.00	-
54	非交易过户	2024-11-13	156,428,382.00	156,428,382.00	-
55	赎回	2024-11-14	-156,428,382.00	-156,428,382.00	-
56	非交易过户	2024-11-14	158,393,300.00	158,393,300.00	-
57	赎回	2024-11-15	-158,393,300.00	-158,393,300.00	-
58	非交易过户	2024-11-15	150,608,007.00	150,608,007.00	-
59	赎回	2024-11-18	-150,608,007.00	-150,608,007.00	-
60	非交易过户	2024-11-18	166,219,826.00	166,219,826.00	-
61	赎回	2024-11-19	-166,219,826.00	-166,219,826.00	-
62	非交易过户	2024-11-19	158,214,278.00	158,214,278.00	-
63	赎回	2024-11-20	-158,214,278.00	-158,214,278.00	-
64	非交易过户	2024-11-20	126,412,375.00	126,412,375.00	-
65	赎回	2024-11-21	-126,412,375.00	-126,412,375.00	-

66	非交易过户	2024-11-21	118,646,015.00	118,646,015.00	-
67	赎回	2024-11-22	-118,646,015.00	-118,646,015.00	-
68	非交易过户	2024-11-22	131,793,749.00	131,793,749.00	-
69	赎回	2024-11-25	-131,793,749.00	-131,793,749.00	-
70	非交易过户	2024-11-25	153,635,795.00	153,635,795.00	-
71	赎回	2024-11-26	-153,635,795.00	-153,635,795.00	-
72	非交易过户	2024-11-26	143,538,500.00	143,538,500.00	-
73	赎回	2024-11-27	-143,538,500.00	-143,538,500.00	-
74	非交易过户	2024-11-27	117,351,235.00	117,351,235.00	-
75	赎回	2024-11-28	-117,351,235.00	-117,351,235.00	-
76	非交易过户	2024-11-28	125,584,382.00	125,584,382.00	-
77	赎回	2024-11-29	-125,584,382.00	-125,584,382.00	-
78	非交易过户	2024-11-29	170,877,516.00	170,877,516.00	-
79	赎回	2024-12-02	-170,877,516.00	-170,877,516.00	-
80	非交易过户	2024-12-02	156,822,248.00	156,822,248.00	-
81	赎回	2024-12-03	-156,822,248.00	-156,822,248.00	-
82	非交易过户	2024-12-03	148,676,685.00	148,676,685.00	-
83	赎回	2024-12-04	-148,676,685.00	-148,676,685.00	-
84	非交易过户	2024-12-04	122,765,174.00	122,765,174.00	-
85	赎回	2024-12-05	-122,765,174.00	-122,765,174.00	-
86	非交易过户	2024-12-05	141,159,375.00	141,159,375.00	-
87	赎回	2024-12-06	-141,159,375.00	-141,159,375.00	-
88	非交易过户	2024-12-06	155,965,347.00	155,965,347.00	-
89	赎回	2024-12-09	-155,965,347.00	-155,965,347.00	-
90	非交易过户	2024-12-09	165,362,295.00	165,362,295.00	-
91	赎回	2024-12-10	-165,362,295.00	-165,362,295.00	-
92	非交易过户	2024-12-10	146,734,558.00	146,734,558.00	-
93	赎回	2024-12-11	-146,734,558.00	-146,734,558.00	-

94	非交易过户	2024-12-11	164,003,327.00	164,003,327.00	-
95	赎回	2024-12-12	-164,003,327.00	-164,003,327.00	-
96	非交易过户	2024-12-12	153,082,690.00	153,082,690.00	-
97	赎回	2024-12-13	-153,082,690.00	-153,082,690.00	-
98	非交易过户	2024-12-13	160,962,186.00	160,962,186.00	-
99	赎回	2024-12-16	-160,962,186.00	-160,962,186.00	-
100	非交易过户	2024-12-16	156,411,801.00	156,411,801.00	-
101	赎回	2024-12-17	-156,411,801.00	-156,411,801.00	-
102	非交易过户	2024-12-17	149,207,629.00	149,207,629.00	-
103	赎回	2024-12-18	-149,207,629.00	-149,207,629.00	-
104	非交易过户	2024-12-18	144,801,440.00	144,801,440.00	-
105	赎回	2024-12-19	-144,801,440.00	-144,801,440.00	-
106	非交易过户	2024-12-19	134,481,226.00	134,481,226.00	-
107	赎回	2024-12-20	-134,481,226.00	-134,481,226.00	-
108	非交易过户	2024-12-20	149,477,936.00	149,477,936.00	-
109	赎回	2024-12-23	-149,477,936.00	-149,477,936.00	-
110	非交易过户	2024-12-23	172,546,664.00	172,546,664.00	-
111	赎回	2024-12-24	-172,546,664.00	-172,546,664.00	-
112	非交易过户	2024-12-24	153,568,438.00	153,568,438.00	-
113	赎回	2024-12-25	-153,568,438.00	-153,568,438.00	-
114	非交易过户	2024-12-25	152,829,636.00	152,829,636.00	-
115	赎回	2024-12-26	-152,829,636.00	-152,829,636.00	-
116	非交易过户	2024-12-26	135,281,434.00	135,281,434.00	-
117	赎回	2024-12-27	-135,281,434.00	-135,281,434.00	-
118	非交易过户	2024-12-27	172,804,621.00	172,804,621.00	-
119	赎回	2024-12-30	-172,804,621.00	-172,804,621.00	-
120	非交易过户	2024-12-30	200,000,000.00	200,000,000.00	-
121	赎回	2024-12-31	-200,000,000.00	-200,000,000.00	-

122	非交易过户	2024-12-31	199,999,625.00	199,999,625.00	-
合计			80,000,074.00	80,000,074.00	

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，赎回为赎回非交易过户转入份额。

非交易过户转入及赎回交易的适用费率为 0。

§ 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

报告期内无单一投资者持有基金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、证监会关于准予中信建投智多鑫集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、定期报告；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在集合计划管理人、集合计划托管人所在地，供公众查阅。

9.3 查阅方式

- 1、集合计划管理人互联网站：www.csc108.com
- 2、集合计划管理人或集合计划托管人的办公场所
- 3、中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

中信建投证券股份有限公司

2025 年 1 月 22 日