

中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划 2025 年第 3 季度报告

2025 年 9 月 30 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 10 月 28 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 10 月 24 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 2025 年 7 月 1 日起至 2025 年 9 月 30 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	26,957,506,734.86 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（2025 年 7 月 1 日-2025 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	52,638,705.38
2. 本期利润	52,638,705.38
3. 期末基金资产净值	26,957,506,734.86

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

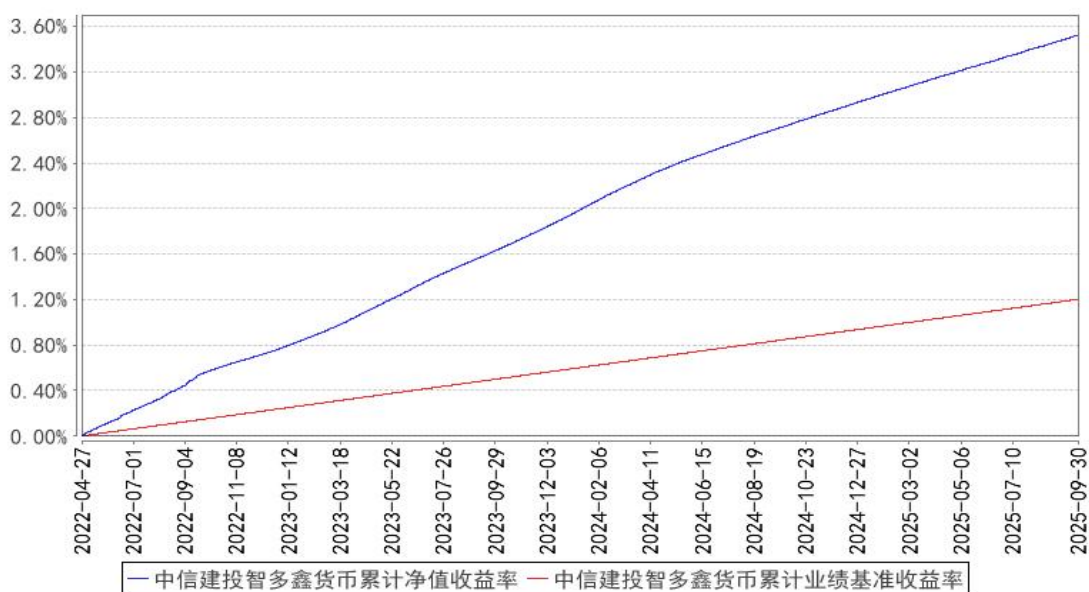
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.1887%	0.0008%	0.0872%	0.0000%	0.1015%	0.0008%
过去六个月	0.3738%	0.0007%	0.1737%	0.0000%	0.2001%	0.0007%
过去一年	0.7702%	0.0005%	0.3470%	0.0000%	0.4232%	0.0005%
过去三年	2.9451%	0.0007%	1.0494%	0.0000%	1.8957%	0.0007%
自基金合同 生效起至今	3.5223%	0.0009%	1.2015%	0.0000%	2.3208%	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	—	15 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 15 年证券行业工作经验、10 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部公平交易管理指引》。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

2025 年三季度，经济呈现温和修复态势，出口韧性较强，物价仍处于较低水平。在出口方面，我国对东盟和欧盟出口增速继续保持强劲，但投资、消费均出现一定程度的走弱。制造业 PMI（采购经理指数）持续处于荣枯线以下。同时，货币政策延续支持性立场，整体市场流动性保持宽松。债券市场收益率呈震荡上行的趋势。7 月，受反内卷交易的影响，中长期债券调整较多。8 月，权益市场转暖，看股做债行情又起。另外，受部分债券品种恢复征收增值税以及执行基金费率新规等影响，债券市场持续疲软，中长期债券进一步调整。宽松的资金环境下，以同业存单收益率为代表的短端收益率调整有限，期限利差扩大。

操作方面，报告期内本集合计划以同业存单、同业存款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，本集合计划在三季度保持了较好的流动性和较稳定的收益率。

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 0.1887%，同期业绩比较基准收益率为 0.0872%。

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	19,704,054,712.36	72.55
	其中：债券	19,704,054,712.36	72.55
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	5,275,945,471.55	19.43
	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	2,179,878,032.54	8.03
4	其他资产	—	—
5	合计	27,159,878,216.45	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	0.54	
	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	128,004,174.90	0.47
	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	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

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	35.43	0.47
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天（含）—60 天	11.07	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天（含）—90 天	24.93	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天（含）—120 天	2.96	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天（含）—397 天（含）	26.34	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
合计		100.73	0.47

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	1,794,060,116.61	6.66
6	中期票据	10,291,324.40	0.04
7	同业存单	17,899,703,271.35	66.40
8	其他	—	—
9	合计	19,704,054,712.36	73.09
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	112522046	25 邮储银行 CD046	5,000,000	498,392,717.66	1.85
2	112506197	25 交通银行 CD197	5,000,000	494,478,378.81	1.83
3	112505350	25 建设银行 CD350	4,000,000	395,615,792.72	1.47
4	072510206	25 银河证券 CP021	3,000,000	300,303,133.13	1.11
5	072510224	25 银河证券 CP023	3,000,000	300,196,435.99	1.11
6	112599545	25 长沙银行 CD157	3,000,000	299,817,590.25	1.11
7	112409249	24 浦发银行 CD249	3,000,000	299,778,680.41	1.11
8	112516076	25 上海银行 CD076	3,000,000	299,262,511.59	1.11
9	112517177	25 光大银行 CD177	3,000,000	299,174,545.50	1.11
10	112503305	25 农业银行 CD305	3,000,000	299,068,206.85	1.11

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	0.0177%
报告期内偏离度的最低值	-0.0080%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0072%

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

【中国邮政储蓄银行股份有限公司】

2024 年 12 月 2 日，国家外汇管理局北京市分局对中国邮政储蓄银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警告，罚款 4 万元：未按照规定进行国际收支统计申报。

2025 年 9 月 30 日，国家金融监督管理总局对中国邮政储蓄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 2791.67 万元：相关贷款业务、互联网贷款业务、绩效考核、合作业务等管理不审慎。

【中国建设银行股份有限公司】

2025 年 3 月 28 日，中国人民银行对中国建设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 230 万元：违反金融统计相关规定。

2025 年 9 月 12 日，国家金融监督管理总局对中国建设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 290 万元：个别信息系统开发测试不充分、信息科技外包管理存在不足等事项。

【中国银河证券股份有限公司】

2024 年 12 月 26 日，中国证券监督管理委员会北京监管局对中国银河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）衍生品业务投资者适当性管理和内控管理不完善，存在对个别客户交易目的、资金来源核查不足，部分交易对手未按期进行年度回访仍新增交易等情形；（二）经纪业务存在部分合规风控员工兼职从事营销及客户服务工作，佣金费率管理不到位等情形。

2025 年 7 月 11 日，中国银行间市场交易商协会对中国银河证券股份有限公司因如下违法违规行为进行立案调查：在广发银行 2025-2026 年度二级资本债券项目中，中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、兴业银行股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司等 6 家主承销商中标承销费引发市场关注。

【长沙银行股份有限公司】

2025 年 3 月 31 日，中国人民银行湖南省分行对长沙银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警告，罚款 25.5 万元：（一）集中支付退回资金退回零余额账户后，未按规定退回国库；（二）将经收的预算收入款项转入“待结算财政款项”以外其他科目或账户。

【上海银行股份有限公司】

2025 年 1 月 2 日，国家金融监督管理局上海金融监管局对上海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 200 万元：贷款管理严重违反审慎经营规则、代理销售业务严重违反审慎经营规则。

2025 年 3 月 28 日，中国人民银行对上海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 110 万元：违反金融统计相关规定。

2025 年 8 月 1 日，中国人民银行对上海银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警告，罚款 2874.8 万元，没收违法所得 46.95 万元：（一）违反账户管理规定；（二）违反清算管理规定；（三）违反反假货币业务管理规定；（四）占压财政存款或者资金；（五）违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；（六）未按规定履行客户身份识别义务；（七）未按规定保存客户身份资料和交易记录；（八）未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告。

【中国光大银行股份有限公司】

2025 年 1 月 27 日，中国人民银行对中国光大银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警告，罚款 1677.06 万元，没收违法所得 201.77 万元：（一）违反账户管理规定；（二）违反清算管理规定；（三）违反反假货币业务管理规定；（四）违反人民币流通管理规定；（五）占压财政存款或者资金；（六）违反国库科目设置和使用规定；（七）违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；（八）未按规定履行客户身份识别义务；（九）未按规定保存客户身份资料和交易记录；（十）未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；（十一）与身份不明的客户进行交易。

2025 年 9 月 12 日，国家金融监督管理总局对中国光大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 430 万元：信息科技外包管理存在不足、监管数据错报等事项。

【中国农业银行股份有限公司】

2025 年 1 月 27 日，中国人民银行对中国农业银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警告，罚款 4672.94 万元，没收违法所得 487.59 万元：（一）违反账户管理规定；（二）违反清算管理规定；（三）违反特约商户实名制管理规定；（四）违反反假货币业务管理规定；（五）违反人民币流通管理规定；（六）违反国库科目设置和使用规定；（七）占压财政存款或者资金；（八）违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；（九）未按规定履行客户身份识别义务；（十）未按规定保存客户身份资料和交易记录；（十一）未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；（十二）与身份不明的客户进行交易。

本基金投资 25 交通银行 CD197、25 邮储银行 CD046、25 建设银行 CD350、25 银河证券 CP021、

25 银河证券 CP023、25 农业银行 CD305、25 上海银行 CD076、25 光大银行 CD177、25 长沙银行 CD157 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 25 交通银行 CD197、25 邮储银行 CD046、25 建设银行 CD350、25 银河证券 CP021、25 银河证券 CP023、25 农业银行 CD305、25 上海银行 CD076、25 光大银行 CD177、25 长沙银行 CD157 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	23,807,942,052.55
报告期期间基金总申购份额	225,990,607,848.89
报告期期间基金总赎回份额	222,841,043,166.58
报告期期末基金份额总额	26,957,506,734.86

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	2025-07-01	-199,999,323.00	-199,999,323.00	-
2	非交易过户	2025-07-01	147,094,017.00	147,094,017.00	-
3	赎回	2025-07-02	-147,094,017.00	-147,094,017.00	-
4	非交易过户	2025-07-02	145,568,841.00	145,568,841.00	-
5	赎回	2025-07-03	-145,568,841.00	-145,568,841.00	-
6	非交易过户	2025-07-03	138,503,180.00	138,503,180.00	-
7	赎回	2025-07-04	-138,503,180.00	-138,503,180.00	-
8	非交易过户	2025-07-04	147,481,791.00	147,481,791.00	-
9	赎回	2025-07-07	-147,481,791.00	-147,481,791.00	-

10	非交易过户	2025-07-07	131,631,880.00	131,631,880.00	-
11	赎回	2025-07-08	-131,631,880.00	-131,631,880.00	-
12	非交易过户	2025-07-08	140,483,308.00	140,483,308.00	-
13	赎回	2025-07-09	-140,483,308.00	-140,483,308.00	-
14	非交易过户	2025-07-09	117,869,677.00	117,869,677.00	-
15	赎回	2025-07-10	-117,869,677.00	-117,869,677.00	-
16	非交易过户	2025-07-10	114,001,578.00	114,001,578.00	-
17	赎回	2025-07-11	-114,001,578.00	-114,001,578.00	-
18	非交易过户	2025-07-11	132,752,456.00	132,752,456.00	-
19	赎回	2025-07-14	-132,752,456.00	-132,752,456.00	-
20	非交易过户	2025-07-14	138,024,962.00	138,024,962.00	-
21	赎回	2025-07-15	-138,024,962.00	-138,024,962.00	-
22	非交易过户	2025-07-15	133,570,044.00	133,570,044.00	-
23	赎回	2025-07-16	-133,570,044.00	-133,570,044.00	-
24	非交易过户	2025-07-16	123,652,544.00	123,652,544.00	-
25	赎回	2025-07-17	-123,652,544.00	-123,652,544.00	-
26	非交易过户	2025-07-17	114,880,766.00	114,880,766.00	-
27	赎回	2025-07-18	-114,880,766.00	-114,880,766.00	-
28	非交易过户	2025-07-18	153,988,511.00	153,988,511.00	-
29	赎回	2025-07-21	-153,988,511.00	-153,988,511.00	-
30	非交易过户	2025-07-21	174,378,915.00	174,378,915.00	-
31	赎回	2025-07-22	-174,378,915.00	-174,378,915.00	-
32	非交易过户	2025-07-22	178,572,748.00	178,572,748.00	-
33	赎回	2025-07-23	-178,572,748.00	-178,572,748.00	-
34	非交易过户	2025-07-23	135,151,133.00	135,151,133.00	-
35	赎回	2025-07-24	-135,151,133.00	-135,151,133.00	-
36	非交易过户	2025-07-24	140,127,007.00	140,127,007.00	-
37	赎回	2025-07-25	-140,127,007.00	-140,127,007.00	-

38	非交易过户	2025-07-25	167,816,942.00	167,816,942.00	-
39	赎回	2025-07-28	-167,816,942.00	-167,816,942.00	-
40	非交易过户	2025-07-28	161,849,735.00	161,849,735.00	-
41	赎回	2025-07-29	-161,849,735.00	-161,849,735.00	-
42	非交易过户	2025-07-29	168,698,497.00	168,698,497.00	-
43	赎回	2025-07-30	-168,698,497.00	-168,698,497.00	-
44	非交易过户	2025-07-30	122,359,716.00	122,359,716.00	-
45	赎回	2025-07-31	-122,359,716.00	-122,359,716.00	-
46	非交易过户	2025-07-31	139,474,508.00	139,474,508.00	-
47	赎回	2025-08-01	-139,474,508.00	-139,474,508.00	-
48	非交易过户	2025-08-01	165,740,320.00	165,740,320.00	-
49	赎回	2025-08-04	-165,740,320.00	-165,740,320.00	-
50	非交易过户	2025-08-04	152,573,009.00	152,573,009.00	-
51	赎回	2025-08-05	-152,573,009.00	-152,573,009.00	-
52	非交易过户	2025-08-05	161,324,389.00	161,324,389.00	-
53	赎回	2025-08-06	-161,324,389.00	-161,324,389.00	-
54	非交易过户	2025-08-06	133,144,128.00	133,144,128.00	-
55	赎回	2025-08-07	-133,144,128.00	-133,144,128.00	-
56	非交易过户	2025-08-07	126,825,936.00	126,825,936.00	-
57	赎回	2025-08-08	-126,825,936.00	-126,825,936.00	-
58	非交易过户	2025-08-08	158,729,811.00	158,729,811.00	-
59	赎回	2025-08-11	-158,729,811.00	-158,729,811.00	-
60	非交易过户	2025-08-11	160,010,315.00	160,010,315.00	-
61	赎回	2025-08-12	-160,010,315.00	-160,010,315.00	-
62	非交易过户	2025-08-12	149,801,167.00	149,801,167.00	-
63	赎回	2025-08-13	-149,801,167.00	-149,801,167.00	-
64	非交易过户	2025-08-13	137,238,685.00	137,238,685.00	-
65	赎回	2025-08-14	-137,238,685.00	-137,238,685.00	-

66	非交易过户	2025-08-14	144,212,043.00	144,212,043.00	-
67	赎回	2025-08-15	-144,212,043.00	-144,212,043.00	-
68	非交易过户	2025-08-15	151,031,200.00	151,031,200.00	-
69	赎回	2025-08-18	-151,031,200.00	-151,031,200.00	-
70	非交易过户	2025-08-18	192,212,779.00	192,212,779.00	-
71	赎回	2025-08-19	-192,212,779.00	-192,212,779.00	-
72	非交易过户	2025-08-19	199,999,997.00	199,999,997.00	-
73	赎回	2025-08-20	-199,999,997.00	-199,999,997.00	-
74	非交易过户	2025-08-20	166,598,442.00	166,598,442.00	-
75	赎回	2025-08-21	-166,598,442.00	-166,598,442.00	-
76	非交易过户	2025-08-21	142,974,083.00	142,974,083.00	-
77	赎回	2025-08-22	-142,974,083.00	-142,974,083.00	-
78	非交易过户	2025-08-22	197,265,118.00	197,265,118.00	-
79	赎回	2025-08-25	-197,265,118.00	-197,265,118.00	-
80	非交易过户	2025-08-25	199,999,070.00	199,999,070.00	-
81	赎回	2025-08-26	-199,999,070.00	-199,999,070.00	-
82	非交易过户	2025-08-26	200,000,000.00	200,000,000.00	-
83	赎回	2025-08-27	-200,000,000.00	-200,000,000.00	-
84	非交易过户	2025-08-27	199,999,852.00	199,999,852.00	-
85	赎回	2025-08-28	-199,999,852.00	-199,999,852.00	-
86	非交易过户	2025-08-28	183,536,313.00	183,536,313.00	-
87	赎回	2025-08-29	-183,536,313.00	-183,536,313.00	-
88	非交易过户	2025-08-29	200,000,000.00	200,000,000.00	-
89	赎回	2025-09-01	-200,000,000.00	-200,000,000.00	-
90	非交易过户	2025-09-01	200,000,000.00	200,000,000.00	-
91	赎回	2025-09-02	-200,000,000.00	-200,000,000.00	-
92	非交易过户	2025-09-02	199,999,873.00	199,999,873.00	-
93	赎回	2025-09-03	-199,999,873.00	-199,999,873.00	-

94	非交易过户	2025-09-03	175,468,624.00	175,468,624.00	-
95	赎回	2025-09-04	-175,468,624.00	-175,468,624.00	-
96	非交易过户	2025-09-04	199,999,606.00	199,999,606.00	-
97	赎回	2025-09-05	-199,999,606.00	-199,999,606.00	-
98	非交易过户	2025-09-05	199,440,223.00	199,440,223.00	-
99	赎回	2025-09-08	-199,440,223.00	-199,440,223.00	-
100	非交易过户	2025-09-08	199,590,818.00	199,590,818.00	-
101	赎回	2025-09-09	-199,590,818.00	-199,590,818.00	-
102	非交易过户	2025-09-09	199,464,809.00	199,464,809.00	-
103	赎回	2025-09-10	-199,464,809.00	-199,464,809.00	-
104	非交易过户	2025-09-10	148,824,969.00	148,824,969.00	-
105	赎回	2025-09-11	-148,824,969.00	-148,824,969.00	-
106	非交易过户	2025-09-11	153,823,292.00	153,823,292.00	-
107	赎回	2025-09-12	-153,823,292.00	-153,823,292.00	-
108	非交易过户	2025-09-12	199,999,548.00	199,999,548.00	-
109	赎回	2025-09-15	-199,999,548.00	-199,999,548.00	-
110	非交易过户	2025-09-15	199,178,159.00	199,178,159.00	-
111	赎回	2025-09-16	-199,178,159.00	-199,178,159.00	-
112	非交易过户	2025-09-16	185,405,086.00	185,405,086.00	-
113	赎回	2025-09-17	-185,405,086.00	-185,405,086.00	-
114	非交易过户	2025-09-17	144,338,171.00	144,338,171.00	-
115	赎回	2025-09-18	-144,338,171.00	-144,338,171.00	-
116	非交易过户	2025-09-18	168,577,686.00	168,577,686.00	-
117	赎回	2025-09-19	-168,577,686.00	-168,577,686.00	-
118	非交易过户	2025-09-19	199,999,854.00	199,999,854.00	-
119	赎回	2025-09-22	-199,999,854.00	-199,999,854.00	-
120	非交易过户	2025-09-22	199,999,997.00	199,999,997.00	-
121	赎回	2025-09-23	-199,999,997.00	-199,999,997.00	-

122	非交易过户	2025-09-23	199,999,946.00	199,999,946.00	-
123	赎回	2025-09-24	-199,999,946.00	-199,999,946.00	-
124	非交易过户	2025-09-24	191,495,288.00	191,495,288.00	-
125	赎回	2025-09-25	-191,495,288.00	-191,495,288.00	-
126	非交易过户	2025-09-25	199,999,884.00	199,999,884.00	-
127	赎回	2025-09-26	-199,999,884.00	-199,999,884.00	-
128	非交易过户	2025-09-26	199,999,745.00	199,999,745.00	-
129	赎回	2025-09-29	-199,999,745.00	-199,999,745.00	-
130	非交易过户	2025-09-29	199,999,841.00	199,999,841.00	-
131	赎回	2025-09-30	-199,999,841.00	-199,999,841.00	-
132	非交易过户	2025-09-30	199,999,670.00	199,999,670.00	-
合计			347.00	347.00	

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 10 月 28 日