

中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划 2022 年中期报告

2022 年 6 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

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划资产管理合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 27 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 债券回购融资情况	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限	35
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	36

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	37
7.8 期末按实际利率计算的账面价值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.....	37
7.9 投资组合报告附注.....	37
§ 8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	41
§ 9 开放式基金份额变动.....	41
§ 10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	43
10.9 其他重大事件.....	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	43
11.1 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.....	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
§ 12 备查文件目录.....	44
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	44
12.3 查阅方式.....	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划
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
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
报告期末基金份额总额	14,041,461,560.39 份
基金合同存续期	不定期

注：本公告所述“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”。

2.2 基金产品说明

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。
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。

注：详见《中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划资产管理合同》第十二部分“集合计划的投资”。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投证券股份有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露	姓名	蒋月勤	陈晨

负责人	联系电话	400-888-8108	010-50938723
	电子邮箱	fund_zg@csc.com.cn	chenc@chinaclear.com.cn
客户服务电话		400-888-8108	400-805-8058
传真		010-84651186	-
注册地址		北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址		北京市东城区朝内大街 188 号	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码		100010	100033
法定代表人		王常青	于文强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csc108.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 4 月 27 日(基金合同生效日) - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	30,226,585.53
本期利润	30,226,585.53
本期净值收益率	0.2230%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	14,041,461,560.39
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	0.2230%

注：1、本基金基金合同于 2022 年 4 月 27 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满半年。

2、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

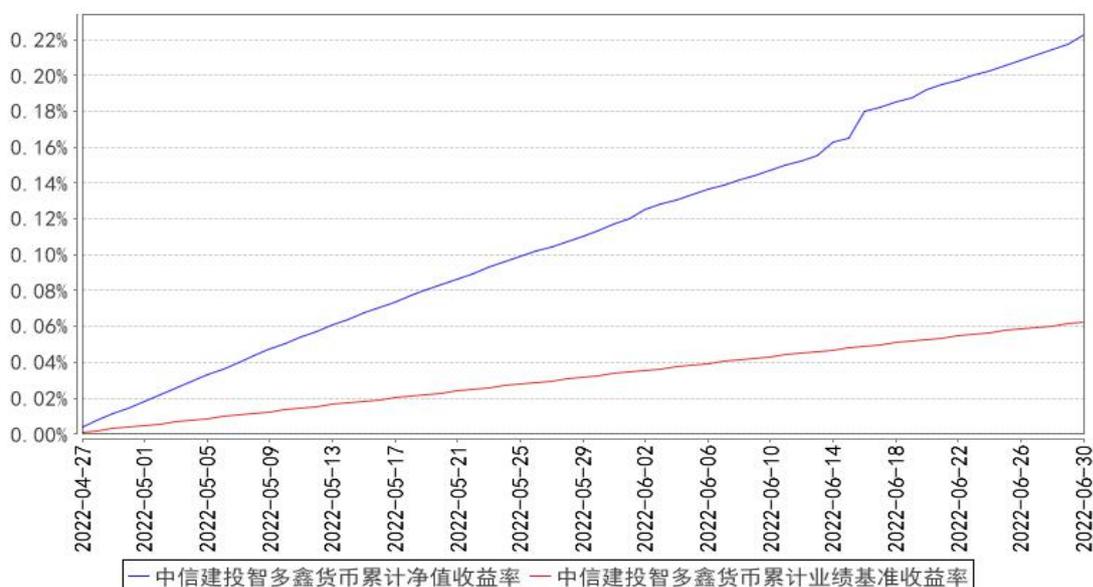
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收	份额净值收	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	益率①	益率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.1060%	0.0024%	0.0288%	0.0000%	0.0772%	0.0024%
自基金合同生效起 至今	0.2230%	0.0016%	0.0623%	0.0000%	0.1607%	0.0016%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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：本基金基金合同于 2022 年 4 月 27 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投证券股份有限公司（以下简称“中信建投证券”或“公司”）是经中国证监会批准设立的大型国有综合证券公司。中信建投证券成立于 2005 年 11 月 2 日，注册地为北京。2016 年 12 月 9 日，中信建投证券股份有限公司在香港联交所正式挂牌交易，股票代码为 6066.HK。2018 年 6 月 20 日，中信建投证券股份有限公司在上海证券交易所正式挂牌交易，股票代码为 601066.SH。

中信建投证券于 2009 年 6 月 29 日获得中国证监会批复的客户资产管理业务资格，并于 2013 年 5 月获得中国保监会批复的投资管理人受托管理保险资金资格。

中信建投证券根据《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“中信建投智多鑫集合资产管理计划”的规范验收并及合同变更，变更后的产品名称为“中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划”。

截至 2022 年 6 月 30 日，中信建投证券共管理 2 只大集合资产管理计划：中信建投价值增长混合型集合资产管理计划、中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2022 年 4 月 27 日	-	12 年	金融学硕士，具备基金从业资格。2010 年加入中信建投证券资产管理部，拥有 12 年证券行业工作经验、7 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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的前提下，为集合计划份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，集合计划运作合法合规，无损害集合计划份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待所管理的产品，制定并严格遵守相应的制度和流程。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流程控制，未发现存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年我国经济在多种因素影响下景气度下降，央行主动出台多项应对措施，债券供给前置发力，充分发挥货币政策总量工具与结构化工具的融资作用，因此货币市场处于较为宽松的环境。货币市场银行间质押式回购利率一季度围绕政策利率波动；进入二季度，在疫情多点爆发、居民消费下滑且地产出现压力的背景下，资金利率随着市场预期与资金供给抬升的变化大幅下滑，回购交易量持续抬升，机构投资者杠杆率抬升明显。今年上半年 M2 同比增速为 11.4%，较去年底上行了 2.4 个百分点。而同期的社融增速为 10.8%，较去年底仅上行 0.5 百分点。存款增量处于历史较高水平，但资金供给大于资金需求的宽松可能不会长久；固然上半年有留抵退税和地方债发行前置影响，但资金的使用效率仍然可以理解为不足。

资产端市场资产荒的趋势仍在延续，期限利差、信用利差出现不同程度地缩窄。尽管全球主要经济体进入加息周期，带动全球主要国债收益率上行明显，但我国利率债仍然保持了较强的独立性，上半年收益率整体呈下行走势。短端资产方面，同业存单上半年发行火爆，在货币类资产管理产品规模增加的背景下，同业存单净融资额超 7300 亿元。在宽松的货币环境下，同业存单收益率大幅下行，一年期国有股份制同业存单由年初 2.60% 下行至 2.25%。

上半年，产品紧跟货币市场变化，在资金利率大幅下滑的背景下注重策略交易：在保证高比例流动性资产的基础上，二季度小幅抬升投资组合的剩余期限。通过期限利差分析，债券期限配置逐步优化，配置方向集中在高等级同业存单。产品将继续秉承流动性至上的原则，优化投资组合结构，加大骑乘策略的贡献，并积极寻求跨市场盈利机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值收益率为 0.2230%，同期业绩比较基准收益率为 0.0623%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球主要经济体三季度的通胀压力仍然较大，全球流动性收缩的格局不会改变，部分经济体将会出现一定程度的衰退甚至危机。在此背景下，央行以我为主的政策执行效果持续向好；7 月前瞻经济数据有所向好，但经济复苏仍然是逐步实现的、较为缓慢的修复过程，因此下一阶段货币政策仍然处于较为宽松的预期。后续上半年资金的大幅供给是否可以转化为企业端复工生产的动力以及资金使用效率能否提升起到润滑实体经济的作用是我们需要跟踪观察的。房地产压力的

化解程度、失业率水平以及通胀压力将是影响下半年市场的重要国内因素；汇率、海外货币政策的超预期、各方面冲突的演化也将对中长期市场具有深层次的影响。

更微观层面来看，同业存单市场上半年净融资额完成情况较好，奠定了下半年融资需求减弱的格局；而银行间质押式回购价格仍较大概率运行在政策利率之下；但长端资产将可能在预期变化下有一定调整压力。

本产品将坚持长久以来科学管理的策略，以控制流动性风险作为首要目标，勤勉尽责、择优配置资产。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及集合计划合同约定，本集合计划按日计算并按季支付收益。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日计划份额持有人数量不满两百人或者计划资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合

报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	4,850,670,218.61
结算备付金		34,752,473.71
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	6,985,772,056.42
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		6,985,772,056.42
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,166,300,935.60
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		70,902,155.21
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		14,108,397,839.55
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-

应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		10,985,598.79
应付托管费		610,311.07
应付销售服务费		3,030,711.42
应付投资顾问费		-
应交税费		168,305.79
应付利润		50,628,881.30
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	1,512,470.79
负债合计		66,936,279.16
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	14,041,461,560.39
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-
净资产合计		14,041,461,560.39
负债和净资产总计		14,108,397,839.55

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，集合计划份额净值 1.0000 元，集合计划份额总额 14,041,461,560.39 份。本集合计划合同变更生效日为 2022 年 4 月 27 日，本财务报表的实际编制期间为 2022 年 4 月 27 日至 2022 年 6 月 30 日，因此无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		61,630,051.18
1. 利息收入		21,838,046.71
其中：存款利息收入	6.4.7.13	15,757,126.59
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		6,080,920.12
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		39,792,004.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	39,792,004.47
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	-
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.20	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-
减：二、营业总支出		31,403,465.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,656,595.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,203,144.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,994,877.28
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		2,447,698.63
其中：卖出回购金融资产支出		2,447,698.63
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		23,583.53
8. 其他费用	6.4.7.23	77,566.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		30,226,585.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,226,585.53
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		30,226,585.53

注：本集合计划合同变更生效日为 2022 年 4 月 27 日，本财务报表的实际编制期间为 2022 年 4 月 27 日至 2022 年 6 月 30 日，因此无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净资 产（基金 净值）	-	-	-	-
加：会计 政策变更	-	-	-	-
前期	-	-	-	-

差错更正				
其他	-	-	-	-
二、本 期初净 资产（基 金净 值）	11,173,523,306.08	-	-	11,173,523,306.08
三、本 期增 减变 动额 （减 少以 “-” 号 填列）	2,867,938,254.31	-	-	2,867,938,254.31
（一）、 综合收 益总 额	-	-	30,226,585.53	30,226,585.53
（二）、 本 期基 金份 额交 易产 生的 基金 净值 变动 数 （净 值减 少以 “-” 号 填列）	2,867,938,254.31	-	-	2,867,938,254.31
其中：1. 基金申 购款	63,319,239,290.27	-	-	63,319,239,290.27
2. 基金赎 回款	-60,451,301,035.96	-	-	-60,451,301,035.96
（三）、 本 期向 基金 份额 持有 人分 配利 润产 生的 基金 净值 变动 （净 值减 少以 “-” 号 填 列）	-	-	-30,226,585.53	-30,226,585.53
（四）、 其 他综 合收 益结 转留 存收 益	-	-	-	-
四、本 期	14,041,461,560.39	-	-	14,041,461,560.39

期末净资产（基金净值）				
-------------	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>蒋月勤</u>	<u>李志山</u>	<u>李志山</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)是由中信建投智多鑫集合资产管理计划转型而来。本集合计划的管理人中信建投证券股份有限公司于 2022 年 4 月 12 日发布《关于中信建投智多鑫集合资产管理计划变更的公告》。根据公告,中信建投智多鑫集合资产管理计划名称变更为“中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划”,中信建投智多鑫集合资产管理计划份额转换为中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划的份额。《中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划资产管理合同》及本集合计划的相关法律文件自 2022 年 4 月 27 日起生效。本集合计划的管理人为中信建投证券股份有限公司(以下简称“中信建投”),托管人为中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中证登”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定,本集合计划的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括:(1)现金;(2)期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、中央银行票据、同业存单;(3)期限在 1 个月以内的债券回购;(4)剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券;(5)中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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)。

本财务报表由本集合计划的管理人中信建投于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 4 月 27 日(集合计划合同变更生效日)至 2022 年 6 月 30 日期间的经营成果和集合计划净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 4 月 27 日(集合计划合同变更生效日)至 2022 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，金融资产于初始确认时分类为：(1)以摊余成本计量的金融资产；(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。本集合计划目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资。本集合计划目前持有的以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和应收清算款等。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；以摊余成本计量的金融资产和负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

管理人采用计算暂估收益率的方法每日对本集合计划进行估值，并按照下列方法确认各类金融工具的暂估收益：

(1)银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益，直至分红期末按累计收益除以累计份额确定实际分配的收益率；分红期内遇银行存款提前解付的，按调整后利率预提收益，同时冲减前期已经预提的收益；

(2)回购交易以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益；

(3)债券以“摊余成本法”进行估值，即以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余期限内平均摊销，每日预提收益；

(4)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”；当“影子定价”确定的集合计划资产净值与“摊余成本法”计算的集合计划资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内；当正偏离度绝对值达到 0.5%时，管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止集合计划合同进行财产清算等措施。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划 1) 具有抵销

已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入实收基金增加和转出实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于申购确认日或赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

日常经营活动中与交易相关的经济利益很可能流入本计划，相关的收入能够可靠计量且满足收入确认标准时，确认相关的收入。

存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。

债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款包含交易费用确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入，计入投资收益科目。

买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产款在持有期间按照实际利率法逐日计提利息支出。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一集合计划份额享有同等分配权。

本集合计划收益“每日分配、按季支付”，本集合计划收益支付方式为现金分红，分红金额计算要保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入本集合计划资产的损益。

本集合计划采用 1.00 元固定份额净值列示，自集合计划合同生效日起，本集合计划根据每日收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资者每日计算当日暂估收益，并在收益分配日根据实际净收益按季支付。

本集合计划根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资者账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资者不记收益。

收益季度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则为集合计划份额持有人支付相应的现金收益；如投资者的累计实际未结转收益等于零时，集合计划份额持有人的集合计划份额保持不变且不支付现金收益；如投资者的累计实际未结转收益为负，则为集合计划份额持有人缩减相应的集合计划份额，遇投资者剩余集合计划份额不足以缩减的情形，集合计划管理人和销售机构将根据内部应急机制保障集合计划平稳运行。

投资者赎回集合计划份额时，按本金支付，赎回份额当期对应的收益，于当期季度分红时支付。

投资者解约情形下，按照当期收益分配期间收益率与同期中国人民银行公布的活期存款利率孰低的原则计付收益。

T 日申购的集合计划份额不享有当日收益分配权益，自下一工作日起享有收益分配权益；T 日赎回的集合计划份额享有当日收益分配权益，自下一工作日起不享有收益分配权益。

6.4.4.12 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本集合计划的集合计划管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

财政部、国家税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36号)、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017]90号)对增值税做出相关规定。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,自2018年1月1日(含)起,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(1) 增值税

根据财税[2016]140号文件的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财税[2017]56号文件的规定,自2018年1月1日(含)起,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财税[2017]90号文件的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:(一)提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;(二)转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌

前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、集合计划份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本集合计划增值税的附加税费,包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等,按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算,由管理人申报缴纳。

(2) 印花税

根据《财政部、国家税务总局关于证券交易印花税改为单边征收问题的通知》(财税明电[2008]2号)文件的规定,对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据的出让方按千分之一的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。计划管理人运用资产管理计划买卖股票,卖出股票按1‰的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	4,850,670,218.61
等于: 本金	4,848,053,570.50
加: 应计利息	2,616,648.11
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
合计	4,850,670,218.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券 交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	6,985,772,056.42	6,995,098,437.26	9,326,380.84	0.0664
	合计	6,985,772,056.42	6,995,098,437.26	9,326,380.84	0.0664
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	6,985,772,056.42	6,995,098,437.26	9,326,380.84	0.0664

注：于 2022 年 6 月 30 日，本集合计划影子定价偏离度在 0.25% 以内。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本集合计划本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本集合计划本报告期末无期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本集合计划本报告期末无黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,166,300,935.60	-
银行间市场	-	-
合计	2,166,300,935.60	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本集合计划本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,363,130.29
其中：交易所市场	1,284,661.00

银行间市场	78,469.29
应付利息	-
预提费用	149,340.50
合计	1,512,470.79

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	11,173,523,306.08	11,173,523,306.08
本期申购	63,319,239,290.27	63,319,239,290.27
本期赎回（以“-”号填列）	-60,451,301,035.96	-60,451,301,035.96
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	14,041,461,560.39	14,041,461,560.39

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	30,226,585.53	-	30,226,585.53
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-30,226,585.53	-	-30,226,585.53
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年6月30日
活期存款利息收入	15,693,088.59
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	64,038.00
其他	-
合计	15,757,126.59

6.4.7.10 股票投资收益

注：本集合计划本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	35,713,496.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,078,507.91
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	39,792,004.47

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,308,551,190.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,302,276,518.47
减：应计利息总额	2,196,164.38
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	4,078,507.91

注：卖出债券、债转股及债券到期兑付成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

注：本集合计划本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

注：本集合计划本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

注：本集合计划本报告期无其他收入。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

审计费用	20,883.85
信息披露费	39,156.65
证券出借违约金	-
银行费用	8,225.72
账户维护费	9,300.00
合计	77,566.22

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本集合计划无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本集合计划本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信建投证券股份有限公司	集合计划管理人、集合计划销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	集合计划托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
中信建投证券股份有限公司	16,507,417,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信建投证券股份 有限公司	1,127,581.00	100.00	1,284,661.00	100.00

注：上述佣金参考市场价格经本集合计划的集合计划管理人与对方协商确定，以扣除由中证登收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,656,595.75
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：1、支付集合计划管理人中信建投的管理人报酬按前一日集合计划资产净值的0.90%年费率计提，每日计提，按月支付。日管理费=前一日的集合计划资产净值×0.90%/365。2、本集合计划管理人不收取业绩报酬。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,203,144.24

注：支付托管人中证登的托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%的年费率计提，每日计提，按月支付。日托管费=前一日的集合计划资产净值×0.05%/365。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	-
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	-

中信建投证券股份有限公司	5,994,877.28
合计	5,994,877.28

注：支付销售机构的销售服务费按前一日类集合计划资产净值的 0.25% 的年费率计提，每日计提。日销售服务费 = 前一日的集合计划资产净值 × 0.25% / 365。根据《关于中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划销售费率优惠活动的公告》，自 2022 年 6 月 30 日起至 2022 年 7 月 31 日，本集合计划的年费率下调至 0.2%。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本集合计划本报告期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金合同生效日（2022 年 4 月 27 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-	
报告期间申购/买入总份额	2,608,521,941.00	
报告期间因拆分变动份额	-	
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,528,521,941.00	
报告期末持有的基金份额	80,000,000.00	
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.5700%	

注：申购/买入总份额为管理人提供快速取现功能进行的非交易过户转入产生的份额，赎回/卖出总份额为赎回非交易过户转出的份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：报告期末除集合计划管理人之外的其他关联方未发生投资本集合计划的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	8,256,613.48	2,315,887.79

注：本集合计划的银行存款由托管人中证登保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本集合计划本报告期末在承销期内申购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
-	-	30,226,585.53	30,226,585.53	-

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本集合计划管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了由风险管理部、稽核审计部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、稽核审计部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日
A-1	101,457,260.27
A-1 以下	-
未评级	455,410,163.47
合计	556,867,423.74

注：未评级债券包括期限一年以内的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方机构评级的短期融资券和超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	6,428,904,632.68
合计	6,428,904,632.68

注：按信用评级列示的债券投资和同业存单合计金额在资产负债表中“交易性金融资产”——“债券投资”列示。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，集合计划管理人可能无法迅速、低成本地调整集合计划投资组合，从而对集合计划收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

(1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于集合计划持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本集合计划管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

(2) 现金流风险

现金流风险是指集合计划因现金流不足导致无法应对正常集合计划支付义务的风险。本集合计划管理人对集合计划每日和每周净赎回比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本集合计划管理人建立了现金头寸控制机制，以确保赎回款项的及时支付。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本集合计划的流动性安排能够与集合计划合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本集合计划主要投资于集合计划合同约定的具有良好流动性的金融工具。集合计划管理人持续监测本集合计划持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，集合计划管理人持续监测本集合计划开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持集合计划资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，集合计划管理人将采用本集合计划合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划的集合计划管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本集合计划投资于银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	4,850,670,218.61	-	-	-	4,850,670,218.61
结算备付金	34,752,473.71	-	-	-	34,752,473.71
交易性金融资产	2,303,659,509.62	4,682,112,546.80	-	-	6,985,772,056.42
买入返售金融资产	2,166,300,935.60	-	-	-	2,166,300,935.60
应收清算款	-	-	-	70,902,155.21	70,902,155.21
资产总计	9,355,383,137.54	4,682,112,546.80	-	70,902,155.21	14,108,397,839.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,985,598.79	10,985,598.79
应付托管费	-	-	-	610,311.07	610,311.07
应付销售服务费	-	-	-	3,030,711.42	3,030,711.42
应付利润	-	-	-	50,628,881.30	50,628,881.30
应交税费	-	-	-	168,305.79	168,305.79
其他负债	-	-	-	1,512,470.79	1,512,470.79
负债总计	-	-	-	66,936,279.16	66,936,279.16
利率敏感度缺口	9,355,383,137.54	4,682,112,546.80	-	3,965,876.05	14,041,461,560.39

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-
----	---

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2022年6月30日）
分析	市场利率下降 25 个基点	10,756,403.75
	市场利率上升 25 个基点	-10,717,180.74

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	6,985,772,056.42
第三层次	-
合计	6,985,772,056.42

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产主要包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和应收清算款，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	6,985,772,056.42	49.51
	其中：债券	6,985,772,056.42	49.51
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	2,166,300,935.60	15.35

	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	4,885,422,692.32	34.63
4	其他各项资产	70,902,155.21	0.50
5	合计	14,108,397,839.55	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	5.48	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	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

注：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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	113
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	66

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.2 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	51.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	3.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	3.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
4	90 天（含）—120 天	1.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	40.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	100.39	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	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	556,867,423.74	3.97
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,428,904,632.68	45.79
8	其他	-	-
9	合计	6,985,772,056.42	49.75
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资 明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	按实际利率计 算的账面价值 （元）	占基金资产净值比例（%）
1	112205094	22 建设银行 CD094	2,000,000	196,867,947. 44	1.40
2	112281447	22 上海农商银 行 CD043	2,000,000	196,790,724. 61	1.40
3	112281603	22 上海农商银	2,000,000	196,781,351.	1.40

		行 CD044		13	
4	112298893	22 宁波银行 CD120	2,000,000	196,090,846. 82	1.40
5	112280938	22 宁波银行 CD146	2,000,000	195,523,322. 09	1.39
6	042100383	21 电网 CP010	1,500,000	153,254,501. 72	1.09
7	112281582	22 宁波银行 CD160	1,500,000	147,572,266. 67	1.05
8	072110098	21 银河证券 CP016	1,000,000	101,457,260. 27	0.72
9	012105243	21 电网 SCP029	1,000,000	101,388,466. 23	0.72
10	112208011	22 中信银行 CD011	1,000,000	99,745,450.2 0	0.71

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1187%
报告期内偏离度的最低值	0.0474%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0809%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：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

注：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。

7.8 期末按实际利率计算的账面价值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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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

【中国建设银行股份有限公司】

2021 年 8 月 13 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、公开批评、警告并处罚款 388 万元：（一）违反账户管理相关规定；（二）占压财政存款或者资金。

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会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 470 万元：中国建设银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在：（一）贸易融资业务 EAST 数据存在偏差；（二）贷款核销业务 EAST 数据存在偏差；（三）漏报抵押物价值 EAST 数据；（四）漏报债券投资业务 EAST 数据；（五）未报送权益类投资业务 EAST 数据；（六）漏报公募基金投资业务 EAST 数据；（七）未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；（八）未报送跟单信用证业务 EAST 数据；（九）漏报保函业务 EAST 数据；（十）未报送其他担保类业务 EAST 数据；（十一）漏报委托贷款业务 EAST 数据；（十二）EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；（十三）EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；（十四）EAST 系统《表外授信业务》表错报；（十五）EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；（十六）EAST 系统《关联关系》表漏报；（十七）2018 年行政处罚问题依然存在。

【上海农村商业银行股份有限公司】

2021 年 8 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海农村商业银行股份有限公司的如下违法违规行为公开处罚、责令改正，并处罚款人民币 115 万元：（一）因 2019 年未按规定报送监管数据；（二）2018 年 9 月至 2019 年 12 月，理财业务未按规定进行信息披露；（三）2018 年 7 月至 2019 年 8 月，理财老产品投资到期日超过规定期限的新资产。

2021 年 8 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海农村商业银行股份有限公司的如下违法违规行为责令改正，并处罚没款共 130.572341 万元：（一）该行 2018 年年度报告部分信息披露不符合监管要求；（二）2019 年 6 月至 10 月，该行违规向部分关系人发放信用贷款；（三）2018 年 2 月，该行未按规定开展关联交易。

2021 年 9 月 2 日，中国人民银行上海分行对上海农村商业银行股份有限公司公开处罚、责令改正并处以人民币 740 万元罚款：（一）未按照规定履行客户身份识别义务；（二）未按照规定保存客户身份资料和交易记录；（三）未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告。

【中信银行股份有限公司】

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对中信银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款 290 万元：中信银行监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为，即（一）漏报抵押物价值 EAST 数据；（二）未报送权益类投资业务 EAST 数据；（三）漏报跟单信用证业务 EAST 数据；（四）漏报其他担保类业务 EAST 数据；（五）EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；（六）EAST 系统《关联关系》表漏报；（七）面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产；（八）2018 年行政处罚问题依然存在。

【宁波银行股份有限公司】

2021 年 7 月 14 日，中国人民银行宁波市中心支行对宁波银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，公开批评，给予警告，并处罚款 286.2 万元：（一）违规为存款人多头开立银行结算账户；（二）超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料；（三）占压财政存款；（四）未按照规定履行客户身份识别义务；（五）未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告；（六）与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户。

2021 年 7 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分：（一）贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储；（二）开发贷款支用审核不严；（三）房地产贷款放款和支用环节审核不严；（四）贷款资金违规流入房市；（五）房地产贷款资金回流借款人；（六）票据业务开展不审慎。

2021 年 12 月 29 日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款人民币 30 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分：信用卡业务管理不到位。

2022 年 4 月 11 日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款人民币 220 万元：信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位。

2022 年 4 月 11 日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款人民币 30 万元：代理保险销售不规范。

2022 年 4 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款人民币 270 万元：薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位、授信管理不审慎、资金用途管控不严、贷款风险分类不准确、票据业务管控不严、非现场统计数据差错。

2022 年 5 月 27 日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行股份有限公司因如

下违法违规行为公开处罚，罚款人民币 290 万元：非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位、违规办理衍生产品交易业务、信用证议付资金用于购买本行理财、违规办理委托贷款业务、非银融资业务开展不规范、内控管理不到位、数据治理存在欠缺。

本基金投资 22 建设银行 CD094、22 上海农商银行 CD043、22 上海农商银行 CD044、22 宁波银行 CD120、22 宁波银行 CD146、22 宁波银行 CD160、22 中信银行 CD011 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 22 建设银行 CD094、22 上海农商银行 CD043、22 上海农商银行 CD044、22 宁波银行 CD120、22 宁波银行 CD146、22 宁波银行 CD160、22 中信银行 CD011 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	70,902,155.21
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	70,902,155.21

7.9.4 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
211,698	66,327.80	1,344,402,328.93	9.57	12,697,059,231.46	90.43

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	其他机构	294,240,362.99	2.10

2	个人	154,287,895.46	1.10
3	其他机构	111,389,044.14	0.79
4	券商类机构	80,000,000.00	0.57
5	其他机构	72,177,950.67	0.51
6	其他机构	63,502,539.05	0.45
7	个人	57,664,185.82	0.41
8	个人	42,659,959.79	0.30
9	其他机构	37,603,298.90	0.27
10	其他机构	35,559,964.24	0.25

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	74,497,491.35	0.5300

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年4月27日） 基金份额总额	11,173,523,306.08
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	63,319,239,290.27
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	60,451,301,035.96
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,041,461,560.39

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2022 年 5 月 27 日，中国证监会出具《关于对中信建投证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（〔2022〕24 号），指出公司 1 笔场外期权合约股票指数挂钩标的超出规定范围，违反了《证券公司场外期权业务管理办法》第十七条的规定，决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

针对该处罚，公司整改措施如下：1. 相关交易已到期，公司不再开展挂钩超出监管机构规定范围的股票指数的场外衍生品业务；2. 进一步完善标的管理流程，在公司场外衍生品业务系统建立“可挂钩标的清单”，对纳入清单内的标的方可进行场外衍生品交易；3. 公司已对相关责任部门及人员进行合规问责。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	1,127,581.00	100.00	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信建投证券股份有限公司	-	-	16,507,417,000.00	100.00	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划资产管理合同及招募说明书提示性公告	上海证券报	2022 年 4 月 22 日
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	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 22 日
3	中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划招募说明书	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 22 日
4	中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划托管协议	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 22 日
5	中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划产品资料概要	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 22 日
6	中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 27 日
7	关于调整中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划单个投资人持有份额上限的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 27 日
8	关于中信建投智多鑫集合资产管理计划变更为中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划及法律文件变更生效的公告	上海证券报、管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 27 日
9	关于中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

注：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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站（www.csc108.com）查阅，或在营业时间内至集合计划管理人或集合计划托管人的办公场所免费查阅。

中信建投证券股份有限公司

2022 年 8 月 31 日