

# 中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告

2022 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：2023 年 1 月 20 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 2023 年 1 月 19 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 2022 年 10 月 1 日起至 2022 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	13,481,016,573.11 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。
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（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	32,895,228.08
2. 本期利润	32,895,228.08
3. 期末基金资产净值	13,481,016,573.11

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一年。

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。

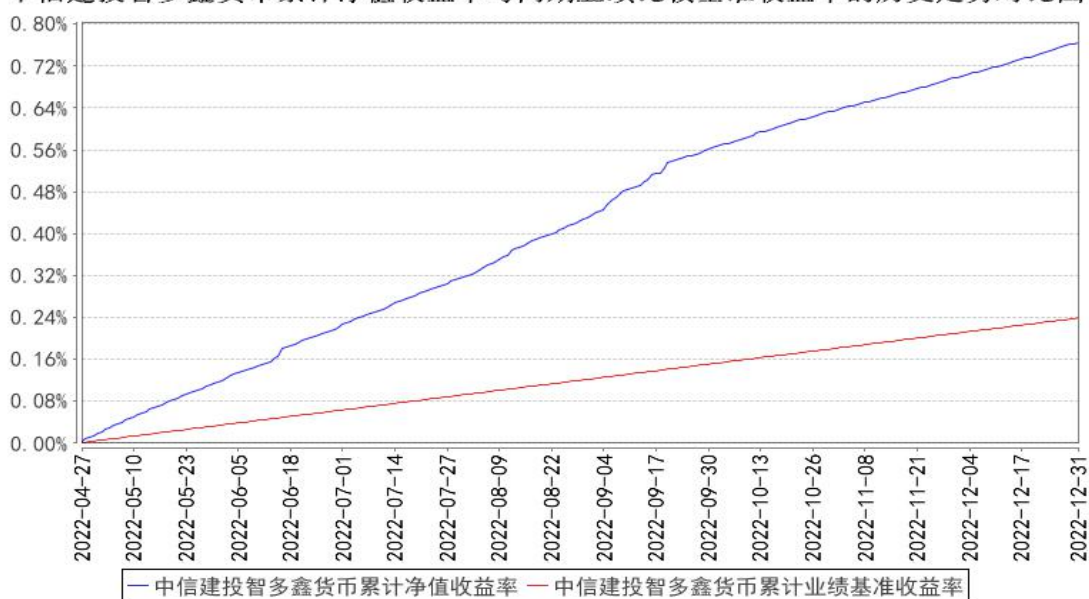
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	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	0.2035%	0.0003%	0.0881%	0.0000%	0.1154%	0.0003%
过去六个月	0.5412%	0.0015%	0.1763%	0.0000%	0.3649%	0.0015%
自基金合同 生效起至今	0.7654%	0.0016%	0.2388%	0.0000%	0.5266%	0.0016%

##### 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。

## § 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	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：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。

### 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

本报告期内，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

三季度，债券市场受经济下行预期影响，同时叠加了货币市场流动性充裕的背景下，延续了牛市格局，一年期同业存单收益率下探至 1.9%以内，短期债券下行超过 70BP。四季度，党的二十大胜利召开为下一阶段的经济复苏预期增强。11 月，我国防疫政策优化后市场对经济走强的信心大增，叠加当月同业存单到期压力加大，债市经历了一波收益率的快速上行，一年期股份制银行同业存单半月内上行了 60BP。12 月，伴随着房地产市场的政策调整，叠加理财被赎回，债市再度调整，此轮调整对信用债持仓占比较大的产品带来较大的估值压力，同期一年期存单收益率达到 2.75%的年度新高。

本报告期，产品以控制利率风险、调整资产结构为首要目标，提高流动性资产占比的同时，果断地调整持仓结构，精选了一部分预期收益可观的银行存款，报告期内运作平稳，无风险事件发生。随着全国复产复工提速，疫情的影响逐渐弱化，经济将具备复苏条件。企业、居民的资产负债表修复亟需宏观政策层面的支持，产品将密切关注货币、信用和财政的组合方式，以及经济复苏的整体进度。下一阶段，产品投资策略上仍将以防范风险作为首要目标，同时密切关注宏观经济复苏走势，抓住市场波段机会增厚收益。

## 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 1.000 元，本报告期内，基金份额净值收益率为 0.2035%，同期业绩比较基准收益率为 0.0881%。

#### 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 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	9,548,342,836.26	58.88
	其中：债券	9,548,342,836.26	58.88
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	900,021,000.00	5.55
	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	5,768,500,752.27	35.57
4	其他资产	-	-
5	合计	16,216,864,588.53	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	9.14	
	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	1,781,315,477.44	13.21
	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%。

#### 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	95
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	77
-------------------	----

### 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。

#### 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	40.51	19.89
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	9.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	22.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	44.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	120.11	19.89

#### 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

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。

#### 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	1,109,192,635.28	8.23
	其中：政策性金融债	1,109,192,635.28	8.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	120,854,861.46	0.90
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,318,295,339.52	61.70
8	其他	-	-
9	合计	9,548,342,836.26	70.83
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	220404	22 农发 04	4,500,000	454,618,232.12	3.37
2	112203060	22 农业银行 CD060	4,000,000	396,510,745.79	2.94
3	112220170	22 广发银行 CD170	3,000,000	299,047,955.27	2.22
4	112206093	22 交通银行 CD093	3,000,000	298,754,434.33	2.22
5	112211025	22 平安银行 CD025	2,000,000	199,488,363.60	1.48
6	112299632	22 宁波银行 CD128	2,000,000	199,467,060.50	1.48
7	112210085	22 兴业银行 CD085	2,000,000	199,285,290.25	1.48
8	112220173	22 广发银行 CD173	2,000,000	199,274,939.77	1.48
9	112281603	22 上海农商银行 CD044	2,000,000	199,036,311.26	1.48
10	112203083	22 农业银行 CD083	2,000,000	198,473,984.52	1.47

### 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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0186%
报告期内偏离度的最低值	-0.1697%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0735%

#### 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。

### 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

注：本基金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

#### 【中国农业发展银行】

2022 年 3 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业发展银行因如下违法违规行为公开处罚，罚款 480 万元：中国农业发展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）漏报不良贷款余额 EAST 数据；（二）逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；（三）漏报贷款核销业务 EAST 数据；（四）漏报抵押物价值 EAST 数据；（五）错报信贷资产转让业务 EAST 数据；（六）未报送债券投资业务 EAST 数据；（七）未报送权益类投资业务 EAST 数据；（八）银行承兑汇票业务 EAST 数据存在偏差；（九）漏报跟单信用证业务 EAST 数据；（十）未报送贷款承诺业务 EAST 数据；（十一）未报送委托贷款业务 EAST 数据；（十二）EAST 系统分户账与总账比对不一致；（十三）漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；（十四）未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；（十五）EAST 系统《表外授信业务》表错报；（十六）EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；（十七）EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报。

#### 【中国农业银行股份有限公司】

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款 420 万元：广发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）漏报贷款核销业务 EAST 数据；（二）未报送权益类投资业务 EAST 数据；（三）未报送公募基金投资业务 EAST 数据；（四）未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；（五）其他担保类业务 EAST 数据存在偏差；（六）EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；（七）EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；（八）EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；（九）漏报分户账 EAST 数据；（十）未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；（十一）EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；（十二）EAST 系统《表外授信业务》表错报；（十三）EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；（十四）EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；（十五）EAST 系统《关联关系》表漏报；（十六）理财产品登记不规范；（十七）2018 年行政处罚问题依然存在。

2022 年 9 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会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，罚款 150 万元：（一）作为托管机构，存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况；（二）理财托管业务违反资产独立性原则要求，操作管理不到位。

#### 【广发银行股份有限公司】

2022 年 3 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会对广发银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款 420 万元：广发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）逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；（二）漏报贷款核销业务 EAST 数据；（三）漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；（四）债券投资业务 EAST 数据存在偏差；（五）漏报公募基金投资业务 EAST 数据；（六）投资资产管理产品业务 EAST 数据存在偏差；（七）EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；（八）EAST 系统分户账与总账比对不一致；（九）漏报分户账 EAST 数据；（十）漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；（十一）未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；（十二）EAST 系统《表外授信业务》表错报；（十三）EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；（十四）EAST 系统《关联关系》表漏报；（十五）EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；（十六）EAST 系统《总账会计全科目表》漏报币种信息。

2022 年 8 月 31 日，中国银行保险监督管理委员会对广发银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款 3484.80 万元：（一）违反人民币反假有关规定；（二）违反人民币管理规定；（三）占压财政存款或者资金；（四）违反国库管理其他规定；（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；（九）与身份不明的客户进行交易。

**【交通银行股份有限公司】**

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款 420 万元：交通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）漏报不良贷款余额 EAST 数据；（二）贸易融资业务 EAST 数据存在偏差；（三）漏报贷款核销业务 EAST 数据；（四）漏报抵押物价值 EAST 数据；（五）未报送权益类投资业务 EAST 数据；（六）未报送其他担保类业务 EAST 数据；（七）EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；（八）EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；（九）EAST 系统分户账与总账比对不一致；（十）EAST 系统《表外授信业务》表错报；（十一）EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；（十二）EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；（十三）EAST 系统《关联关系》表漏报；（十四）理财产品登记不规范；（十五）2018 年行政处罚问题依然存在。

2022 年 9 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款 500 万元：（一）个人经营贷款挪用至房地产市场；（二）个人经营贷款“三查”不到位；（三）总行对分支机构管控不力承担管理责任。

**【平安银行股份有限公司】**

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对平安银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款 420 万元：平安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）不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；（二）逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；（三）漏报贸易融资业务 EAST 数据；（四）漏报抵押物价值 EAST 数据；（五）未报送权益类投资业务 EAST 数据；（六）漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；（七）漏报委托贷款业务 EAST 数据；（八）EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；（九）EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；（十）EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；（十一）漏报分户账 EAST 数据；（十二）EAST 系统《表外授信业务》表错报；（十三）EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；（十四）EAST 系统《关联关系》表漏报；（十五）EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报。

**【宁波银行股份有限公司】**

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。

2022 年 9 月 8 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 25 万元：柜面业务内控管理不到位。

**【兴业银行股份有限公司】**

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，罚款 350 万元：兴业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）漏报贸易融资业务 EAST 数据；（二）漏报贷款核销业务 EAST 数据；（三）

漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；（四）漏报权益类投资业务 EAST 数据；（五）漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；（六）未报送跟单信用证业务 EAST 数据；（七）漏报贷款承诺业务 EAST 数据；（八）未报送委托贷款业务 EAST 数据；（九）EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；（十）EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；（十一）EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；（十二）漏报分户账 EAST 数据；（十三）EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；（十四）EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报。

2022 年 9 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行股份有限公司因如下违法违规行为为公开处罚，罚款 150 万元：债券承销业务严重违反审慎经营规则。

2022 年 9 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行股份有限公司因如下违法违规行为为公开处罚，罚款 450 万元：《中华人民共和国银行业监督管理法》第 21 条和第 46 条。

本基金投资 22 农发 04、22 农业银行 CD060、22 农业银行 CD083、22 广发银行 CD170、22 广发银行 CD173、22 交通银行 CD093、22 平安银行 CD025、22 宁波银行 CD128、22 兴业银行 CD085 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 22 农发 04、22 农业银行 CD060、22 农业银行 CD083、22 广发银行 CD170、22 广发银行 CD173、22 交通银行 CD093、22 平安银行 CD025、22 宁波银行 CD128、22 兴业银行 CD085 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

注：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

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	13,474,378,560.55
报告期期间基金总申购份额	80,172,094,284.03
报告期期间基金总赎回份额	80,165,456,271.47
报告期期末基金份额总额	13,481,016,573.11

## § 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	非交易过户	2022-10-10	99,999,012.00	99,999,012.00	0.0000
2	赎回	2022-10-10	-99,999,012.00	-99,999,012.00	0.0000
3	非交易过户	2022-10-11	99,999,195.00	99,999,195.00	0.0000
4	赎回	2022-10-11	-99,999,195.00	-99,999,195.00	0.0000
5	非交易过户	2022-10-12	100,000,000.00	100,000,000.00	0.0000
6	赎回	2022-10-12	-100,000,000.00	-100,000,000.00	0.0000
7	非交易过户	2022-10-13	90,132,011.00	90,132,011.00	0.0000
8	赎回	2022-10-13	-90,132,011.00	-90,132,011.00	0.0000
9	非交易过户	2022-10-14	94,977,148.00	94,977,148.00	0.0000
10	赎回	2022-10-14	-94,977,148.00	-94,977,148.00	0.0000
11	非交易过户	2022-10-17	100,000,000.00	100,000,000.00	0.0000
12	赎回	2022-10-17	-100,000,000.00	-100,000,000.00	0.0000
13	非交易过户	2022-10-18	90,629,343.00	90,629,343.00	0.0000
14	赎回	2022-10-18	-90,629,343.00	-90,629,343.00	0.0000
15	非交易过户	2022-10-19	83,549,645.00	83,549,645.00	0.0000
16	赎回	2022-10-19	-83,549,645.00	-83,549,645.00	0.0000
17	非交易过户	2022-10-20	69,453,590.00	69,453,590.00	0.0000
18	赎回	2022-10-20	-69,453,590.00	-69,453,590.00	0.0000
19	非交易过户	2022-10-21	72,524,479.00	72,524,479.00	0.0000
20	赎回	2022-10-21	-72,524,479.00	-72,524,479.00	0.0000
21	非交易过户	2022-10-24	86,900,563.00	86,900,563.00	0.0000
22	赎回	2022-10-24	-86,900,563.00	-86,900,563.00	0.0000
23	非交易过户	2022-10-25	85,228,432.00	85,228,432.00	0.0000
24	赎回	2022-10-25	-85,228,432.00	-85,228,432.00	0.0000
25	非交易过户	2022-10-26	73,312,742.00	73,312,742.00	0.0000
26	赎回	2022-10-26	-73,312,742.00	-73,312,742.00	0.0000
27	非交易过户	2022-10-27	73,746,408.00	73,746,408.00	0.0000

28	赎回	2022-10-27	-73,746,408.00	-73,746,408.00	0.0000
29	非交易过户	2022-10-28	84,274,523.00	84,274,523.00	0.0000
30	赎回	2022-10-28	-84,274,523.00	-84,274,523.00	0.0000
31	非交易过户	2022-10-31	84,571,253.00	84,571,253.00	0.0000
32	赎回	2022-10-31	-84,571,253.00	-84,571,253.00	0.0000
33	非交易过户	2022-11-1	75,940,913.00	75,940,913.00	0.0000
34	赎回	2022-11-1	-75,940,913.00	-75,940,913.00	0.0000
35	非交易过户	2022-11-2	83,335,327.00	83,335,327.00	0.0000
36	赎回	2022-11-2	-83,335,327.00	-83,335,327.00	0.0000
37	非交易过户	2022-11-3	85,127,426.00	85,127,426.00	0.0000
38	赎回	2022-11-3	-85,127,426.00	-85,127,426.00	0.0000
39	非交易过户	2022-11-4	90,410,822.00	90,410,822.00	0.0000
40	赎回	2022-11-4	-90,410,822.00	-90,410,822.00	0.0000
41	非交易过户	2022-11-7	89,508,416.00	89,508,416.00	0.0000
42	赎回	2022-11-7	-89,508,416.00	-89,508,416.00	0.0000
43	非交易过户	2022-11-8	85,850,400.00	85,850,400.00	0.0000
44	赎回	2022-11-8	-85,850,400.00	-85,850,400.00	0.0000
45	非交易过户	2022-11-9	68,903,457.00	68,903,457.00	0.0000
46	赎回	2022-11-9	-68,903,457.00	-68,903,457.00	0.0000
47	非交易过户	2022-11-10	69,721,525.00	69,721,525.00	0.0000
48	赎回	2022-11-10	-69,721,525.00	-69,721,525.00	0.0000
49	非交易过户	2022-11-11	83,993,305.00	83,993,305.00	0.0000
50	赎回	2022-11-11	-83,993,305.00	-83,993,305.00	0.0000
51	非交易过户	2022-11-14	100,000,000.00	100,000,000.00	0.0000
52	赎回	2022-11-14	-100,000,000.00	-100,000,000.00	0.0000
53	非交易过户	2022-11-15	92,465,796.00	92,465,796.00	0.0000
54	赎回	2022-11-15	-92,465,796.00	-92,465,796.00	0.0000
55	非交易过户	2022-11-16	84,120,143.00	84,120,143.00	0.0000

56	赎回	2022-11-16	-84,120,143.00	-84,120,143.00	0.0000
57	非交易过户	2022-11-17	67,251,170.00	67,251,170.00	0.0000
58	赎回	2022-11-17	-67,251,170.00	-67,251,170.00	0.0000
59	非交易过户	2022-11-18	81,705,108.00	81,705,108.00	0.0000
60	赎回	2022-11-18	-81,705,108.00	-81,705,108.00	0.0000
61	非交易过户	2022-11-21	84,893,121.00	84,893,121.00	0.0000
62	赎回	2022-11-21	-84,893,121.00	-84,893,121.00	0.0000
63	非交易过户	2022-11-22	77,944,457.00	77,944,457.00	0.0000
64	赎回	2022-11-22	-77,944,457.00	-77,944,457.00	0.0000
65	非交易过户	2022-11-23	73,361,357.00	73,361,357.00	0.0000
66	赎回	2022-11-23	-73,361,357.00	-73,361,357.00	0.0000
67	非交易过户	2022-11-24	65,417,998.00	65,417,998.00	0.0000
68	赎回	2022-11-24	-65,417,998.00	-65,417,998.00	0.0000
69	非交易过户	2022-11-25	76,640,269.00	76,640,269.00	0.0000
70	赎回	2022-11-25	-76,640,269.00	-76,640,269.00	0.0000
71	非交易过户	2022-11-28	85,903,530.00	85,903,530.00	0.0000
72	赎回	2022-11-28	-85,903,530.00	-85,903,530.00	0.0000
73	非交易过户	2022-11-29	71,471,076.00	71,471,076.00	0.0000
74	赎回	2022-11-29	-71,471,076.00	-71,471,076.00	0.0000
75	非交易过户	2022-11-30	97,527,660.00	97,527,660.00	0.0000
76	赎回	2022-11-30	-97,527,660.00	-97,527,660.00	0.0000
77	非交易过户	2022-12-1	83,062,004.00	83,062,004.00	0.0000
78	赎回	2022-12-1	-83,062,004.00	-83,062,004.00	0.0000
79	非交易过户	2022-12-2	98,833,796.00	98,833,796.00	0.0000
80	赎回	2022-12-2	-98,833,796.00	-98,833,796.00	0.0000
81	非交易过户	2022-12-5	99,999,207.00	99,999,207.00	0.0000
82	赎回	2022-12-5	-99,999,207.00	-99,999,207.00	0.0000
83	非交易过户	2022-12-6	99,948,817.00	99,948,817.00	0.0000

84	赎回	2022-12-6	-99,948,817.00	-99,948,817.00	0.0000
85	非交易过户	2022-12-7	89,973,334.00	89,973,334.00	0.0000
86	赎回	2022-12-7	-89,973,334.00	-89,973,334.00	0.0000
87	非交易过户	2022-12-8	84,290,960.00	84,290,960.00	0.0000
88	赎回	2022-12-8	-84,290,960.00	-84,290,960.00	0.0000
89	非交易过户	2022-12-9	98,203,029.00	98,203,029.00	0.0000
90	赎回	2022-12-9	-98,203,029.00	-98,203,029.00	0.0000
91	非交易过户	2022-12-12	99,156,769.00	99,156,769.00	0.0000
92	赎回	2022-12-12	-99,156,769.00	-99,156,769.00	0.0000
93	非交易过户	2022-12-13	95,317,819.00	95,317,819.00	0.0000
94	赎回	2022-12-13	-95,317,819.00	-95,317,819.00	0.0000
95	非交易过户	2022-12-14	70,977,796.00	70,977,796.00	0.0000
96	赎回	2022-12-14	-70,977,796.00	-70,977,796.00	0.0000
97	非交易过户	2022-12-15	85,533,445.00	85,533,445.00	0.0000
98	赎回	2022-12-15	-85,533,445.00	-85,533,445.00	0.0000
99	非交易过户	2022-12-16	82,346,742.00	82,346,742.00	0.0000
100	赎回	2022-12-16	-82,346,742.00	-82,346,742.00	0.0000
101	非交易过户	2022-12-19	81,527,478.00	81,527,478.00	0.0000
102	赎回	2022-12-19	-81,527,478.00	-81,527,478.00	0.0000
103	非交易过户	2022-12-20	75,822,052.00	75,822,052.00	0.0000
104	赎回	2022-12-20	-75,822,052.00	-75,822,052.00	0.0000
105	非交易过户	2022-12-21	64,064,949.00	64,064,949.00	0.0000
106	赎回	2022-12-21	-64,064,949.00	-64,064,949.00	0.0000
107	非交易过户	2022-12-22	63,300,707.00	63,300,707.00	0.0000
108	赎回	2022-12-22	-63,300,707.00	-63,300,707.00	0.0000
109	非交易过户	2022-12-23	86,527,054.00	86,527,054.00	0.0000
110	赎回	2022-12-23	-86,527,054.00	-86,527,054.00	0.0000
111	非交易过户	2022-12-26	85,854,083.00	85,854,083.00	0.0000



112	赎回	2022-12-26	-85,854,083.00	-85,854,083.00	0.0000
113	非交易过户	2022-12-27	88,171,752.00	88,171,752.00	0.0000
114	赎回	2022-12-27	-88,171,752.00	-88,171,752.00	0.0000
115	非交易过户	2022-12-28	75,872,388.00	75,872,388.00	0.0000
116	赎回	2022-12-28	-75,872,388.00	-75,872,388.00	0.0000
117	非交易过户	2022-12-29	85,708,571.00	85,708,571.00	0.0000
118	赎回	2022-12-29	-85,708,571.00	-85,708,571.00	0.0000
119	非交易过户	2022-12-30	99,999,176.00	99,999,176.00	0.0000
120	赎回	2022-12-30	-99,999,176.00	-99,999,176.00	0.0000
合计			0.00	0.00	

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。

## § 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

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。

### 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](http://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  
2023 年 1 月 20 日