

中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划 2023 年第 2 季度报告

2023 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

报告送出日期：2023 年 7 月 21 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 7 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 2023 年 4 月 1 日起至 2023 年 6 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	14,493,631,871.32 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。 主要策略有债券的投资策略、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。具体详见《中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划资产管理合同》。
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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	54,576,997.14
2. 本期利润	54,576,997.14
3. 期末基金资产净值	14,493,631,871.32

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

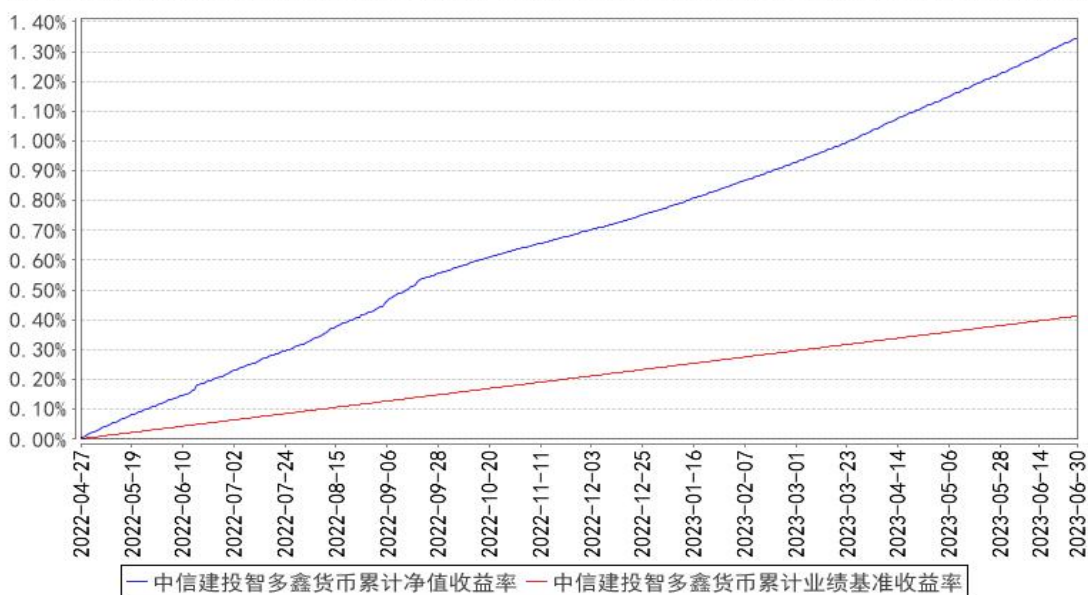
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.3175%	0.0004%	0.0870%	0.0000%	0.2305%	0.0004%
过去六个月	0.5748%	0.0005%	0.1731%	0.0000%	0.4017%	0.0005%
过去一年	1.1191%	0.0011%	0.3498%	0.0000%	0.7693%	0.0011%
自基金合同 生效起至今	1.3445%	0.0012%	0.4123%	0.0000%	0.9322%	0.0012%

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	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、8 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

2023 年二季度，海外通货膨胀有所收敛，欧美央行加息逐渐进入尾声。但是 CPI 数据的回落速率低于市场预期，导致欧美央行始终面临通货膨胀压力的掣肘，难以放松货币政策，降息预期有所降低。国内二季度经济复苏斜率进一步放缓，货币政策“以我为主”，货币市场保持了稳健合理的流动性水平。债券市场整体迎来一波较大幅度的收益率下行：短端债券收益率在资金面宽松的推动下整体下行；而长端债券收益率在稳经济、宽信用的预期和弱现实反复交替中下行，收益率曲线陡峭化。

分阶段来看，4 月中上旬公布的 3 月及一季度经济、金融数据表现良好，但受制于通缩预期扰动，一年期同业存单收益率整体维持在 2.60%-2.65% 的区间震荡。4 月下旬伊始，流动性持续宽松，一年期同业存单收益率加速下行，五一假期后收益率更是较 4 月高点下行 10BP 至 2.55%。自 5 月开始，经济、金融数据全面转弱，市场转向交易弱复苏现实。同时以 DR007 为代表的资金价格中枢持续下行以及多家国有银行下调存款利率等多重利好因素的影响，债券市场收益率全面开启下行行情。6 月 13 日，央行下调 OMO 利率 10BP 后，一年期同业存单收益率达到本轮低点。6 月下旬受到跨半年资金扰动的影响，收益率略有波动。

操作方面，报告期内产品以同业存单、同业存款、短期逆回购和政策性金融债为主要配置资

产，产品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，组合在二季度保持了较好的流动性和较稳定的收益率。下一阶段，随着债券收益率的持续下行，市场风险逐步积聚，产品将继续密切关注货币、信用和财政的组合方式，以及经济修复的斜率变化和汇率贬值压力的释放情况。防范风险之余，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 1.00 元，本报告期内，基金份额净值收益率为 0.3175%，同期业绩比较基准收益率为 0.0870%。

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	8,349,644,481.50	51.74
	其中：债券	8,349,644,481.50	51.74
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	299,893,219.19	1.86
	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	7,487,649,580.84	46.40
4	其他资产	167,671.21	0.00
5	合计	16,137,354,952.74	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	13.08	
	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	1,565,521,826.22	10.80
	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	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

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	45.08	10.80
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	23.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	23.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	111.10	10.80

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	437,873,773.10	3.02
	其中：政策性金融债	437,873,773.10	3.02

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	334,008,123.48	2.30
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,577,762,584.92	52.28
8	其他	-	-
9	合计	8,349,644,481.50	57.61
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	012284373	22 电网 SCP024	3,000,000	303,523,429.97	2.09
2	112306043	23 交通银行 CD043	3,000,000	297,666,355.88	2.05
3	220408	22 农发 08	2,000,000	202,484,385.51	1.40
4	112217145	22 光大银行 CD145	2,000,000	199,706,933.60	1.38
5	112211093	22 平安银行 CD093	2,000,000	199,654,150.68	1.38
6	112214124	22 江苏银行 CD124	2,000,000	199,535,264.68	1.38
7	112313104	23 浙商银行 CD104	2,000,000	199,348,355.57	1.38
8	112317135	23 光大银行 CD135	2,000,000	199,311,802.48	1.38
9	112204047	22 中国银行 CD047	2,000,000	199,273,887.91	1.37
10	112310181	23 兴业银行 CD181	2,000,000	199,219,631.24	1.37

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	0.0566%
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	0.0272%

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

【交通银行股份有限公司】

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。

【江苏银行股份有限公司】

2023 年 2 月 6 日，中国人民银行对江苏银行股份有限公司因如下违法违规行为公开警告，没收违法所得 42 元，罚款 773.6 万元：（一）违反账户管理规定；（二）违反流通人民币管理规定；（三）违反人民币反假有关规定；（四）占压财政存款或者资金；（五）违反国库科目设置和使用规定；（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）对金融产品作出虚假或者引人误解的宣传。

【中国银行股份有限公司】

2023 年 2 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司因如下违法违规行为对总行罚款 1600 万元，对分支机构罚款 1680 万元，合计罚款 3280 万元：（一）小微企业贷款风险分类不准确；（二）小微企业贷款资金被挪用于房地产领域；（三）贷款资金被挪用于证券市场；（四）小微企业贷款资金被挪用于购买本行理财；（五）小微企业贷款统计数据不真实；（六）向银行员工和公务员发放个人经营性贷款；（七）违反监管规定向小微企业客户收取承诺费、咨询费。

2023 年 6 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对中国银行股份有限公司因如下违法违规行为要求责令改正，并处罚没款共计 696.9076 万元：（一）2020 年 11 月至 2021 年 5 月，该单位违反规定从事未经批准的业务活动；（二）2020 年 4 月，该单位违规超授权交易；（三）

2019 年 6 月至 2021 年 2 月，该单位同业业务超期限。

【兴业银行股份有限公司】

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。

2023 年 6 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司因如下违法违规行为责令改正，并处罚款共计 400 万元：（一）衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格；（二）对实际无贷款利率避险需求的客户提供代客 LPR 利率互换业务；（三）代客 LPR 利率互换业务未按规定进行分类管理；（四）债券交易超授权；（五）通过资产管理产品开展不正当交易；（六）超比例投资本行主承销的债券；（七）债券投资五级分类不准确；（八）债券投资风险未独立于当地分支行；（九）通过金融交易市场进行电子化交易的同业业务委托分支机构询价和项目发起；（十）市场风险资本计量严重不审慎。

本基金投资 23 交通银行 CD043、22 江苏银行 CD124、22 中国银行 CD047、23 兴业银行 CD181 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 23 交通银行 CD043、22 江苏银行 CD124、22 中国银行 CD047、23 兴业银行 CD181 外，本基金投资的其余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

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	167,671.21
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	167,671.21

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	14,927,962,185.84
报告期期间基金总申购份额	100,160,042,440.66
报告期期间基金总赎回份额	100,594,372,755.18
报告期期末基金份额总额	14,493,631,871.32

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	2023-04-03	-100,000,000.00	-100,000,000.00	-
2	非交易过户	2023-04-03	99,999,275.00	99,999,275.00	-
3	赎回	2023-04-04	-99,999,275.00	-99,999,275.00	-
4	非交易过户	2023-04-04	99,999,995.00	99,999,995.00	-
5	赎回	2023-04-06	-99,999,995.00	-99,999,995.00	-
6	非交易过户	2023-04-06	99,999,559.00	99,999,559.00	-
7	赎回	2023-04-07	-99,999,559.00	-99,999,559.00	-
8	非交易过户	2023-04-07	99,999,588.00	99,999,588.00	-
9	赎回	2023-04-10	-99,999,588.00	-99,999,588.00	-
10	非交易过户	2023-04-10	99,999,789.00	99,999,789.00	-
11	赎回	2023-04-11	-99,999,789.00	-99,999,789.00	-
12	非交易过户	2023-04-11	100,000,000.00	100,000,000.00	-
13	赎回	2023-04-12	-100,000,000.00	-100,000,000.00	-
14	非交易过户	2023-04-12	99,999,964.00	99,999,964.00	-
15	赎回	2023-04-13	-99,999,964.00	-99,999,964.00	-
16	非交易过户	2023-04-13	99,999,949.00	99,999,949.00	-
17	赎回	2023-04-14	-99,999,949.00	-99,999,949.00	-
18	非交易过户	2023-04-14	100,000,000.00	100,000,000.00	-
19	赎回	2023-04-17	-100,000,000.00	-100,000,000.00	-
20	非交易过户	2023-04-17	99,999,987.00	99,999,987.00	-
21	赎回	2023-04-18	-99,999,987.00	-99,999,987.00	-
22	非交易过户	2023-04-18	99,999,761.00	99,999,761.00	-

23	赎回	2023-04-19	-99,999,761.00	-99,999,761.00	-
24	非交易过户	2023-04-19	100,000,000.00	100,000,000.00	-
25	赎回	2023-04-20	-100,000,000.00	-100,000,000.00	-
26	非交易过户	2023-04-20	97,673,001.00	97,673,001.00	-
27	赎回	2023-04-21	-97,673,001.00	-97,673,001.00	-
28	非交易过户	2023-04-21	99,999,935.00	99,999,935.00	-
29	赎回	2023-04-24	-99,999,935.00	-99,999,935.00	-
30	非交易过户	2023-04-24	99,999,618.00	99,999,618.00	-
31	赎回	2023-04-25	-99,999,618.00	-99,999,618.00	-
32	非交易过户	2023-04-25	99,999,782.00	99,999,782.00	-
33	赎回	2023-04-26	-99,999,782.00	-99,999,782.00	-
34	非交易过户	2023-04-26	99,999,926.00	99,999,926.00	-
35	赎回	2023-04-27	-99,999,926.00	-99,999,926.00	-
36	非交易过户	2023-04-27	99,999,999.00	99,999,999.00	-
37	赎回	2023-04-28	-99,999,999.00	-99,999,999.00	-
38	非交易过户	2023-04-28	100,000,000.00	100,000,000.00	-
39	赎回	2023-05-04	-100,000,000.00	-100,000,000.00	-
40	非交易过户	2023-05-04	99,999,335.00	99,999,335.00	-
41	赎回	2023-05-05	-99,999,335.00	-99,999,335.00	-
42	非交易过户	2023-05-05	99,999,683.00	99,999,683.00	-
43	赎回	2023-05-08	-99,999,683.00	-99,999,683.00	-
44	非交易过户	2023-05-08	99,999,717.00	99,999,717.00	-
45	赎回	2023-05-09	-99,999,717.00	-99,999,717.00	-
46	非交易过户	2023-05-09	99,999,466.00	99,999,466.00	-
47	赎回	2023-05-10	-99,999,466.00	-99,999,466.00	-
48	非交易过户	2023-05-10	99,999,336.00	99,999,336.00	-
49	赎回	2023-05-11	-99,999,336.00	-99,999,336.00	-
50	非交易过户	2023-05-11	95,736,108.00	95,736,108.00	-

51	赎回	2023-05-12	-95,736,108.00	-95,736,108.00	-
52	非交易过户	2023-05-12	97,847,097.00	97,847,097.00	-
53	赎回	2023-05-15	-97,847,097.00	-97,847,097.00	-
54	非交易过户	2023-05-15	110,517,444.00	110,517,444.00	-
55	赎回	2023-05-16	-110,517,444.00	-110,517,444.00	-
56	非交易过户	2023-05-16	90,714,580.00	90,714,580.00	-
57	赎回	2023-05-17	-90,714,580.00	-90,714,580.00	-
58	非交易过户	2023-05-17	80,100,383.00	80,100,383.00	-
59	赎回	2023-05-18	-80,100,383.00	-80,100,383.00	-
60	非交易过户	2023-05-18	85,299,435.00	85,299,435.00	-
61	赎回	2023-05-19	-85,299,435.00	-85,299,435.00	-
62	非交易过户	2023-05-19	93,410,587.00	93,410,587.00	-
63	赎回	2023-05-22	-93,410,587.00	-93,410,587.00	-
64	非交易过户	2023-05-22	83,663,289.00	83,663,289.00	-
65	赎回	2023-05-23	-83,663,289.00	-83,663,289.00	-
66	非交易过户	2023-05-23	98,571,584.00	98,571,584.00	-
67	赎回	2023-05-24	-98,571,584.00	-98,571,584.00	-
68	非交易过户	2023-05-24	88,050,659.00	88,050,659.00	-
69	赎回	2023-05-25	-88,050,659.00	-88,050,659.00	-
70	非交易过户	2023-05-25	83,871,186.00	83,871,186.00	-
71	赎回	2023-05-26	-83,871,186.00	-83,871,186.00	-
72	非交易过户	2023-05-26	86,315,650.00	86,315,650.00	-
73	赎回	2023-05-29	-86,315,650.00	-86,315,650.00	-
74	非交易过户	2023-05-29	97,348,436.00	97,348,436.00	-
75	赎回	2023-05-30	-97,348,436.00	-97,348,436.00	-
76	非交易过户	2023-05-30	95,606,446.00	95,606,446.00	-
77	赎回	2023-05-31	-95,606,446.00	-95,606,446.00	-
78	非交易过户	2023-05-31	87,150,518.00	87,150,518.00	-

79	赎回	2023-06-01	-87,150,518.00	-87,150,518.00	-
80	非交易过户	2023-06-01	81,115,786.00	81,115,786.00	-
81	赎回	2023-06-02	-81,115,786.00	-81,115,786.00	-
82	非交易过户	2023-06-02	85,796,620.00	85,796,620.00	-
83	赎回	2023-06-05	-85,796,620.00	-85,796,620.00	-
84	非交易过户	2023-06-05	97,332,129.00	97,332,129.00	-
85	赎回	2023-06-06	-97,332,129.00	-97,332,129.00	-
86	非交易过户	2023-06-06	103,745,992.00	103,745,992.00	-
87	赎回	2023-06-07	-103,745,992.00	-103,745,992.00	-
88	非交易过户	2023-06-07	95,499,103.00	95,499,103.00	-
89	赎回	2023-06-08	-95,499,103.00	-95,499,103.00	-
90	非交易过户	2023-06-08	96,013,585.00	96,013,585.00	-
91	赎回	2023-06-09	-96,013,585.00	-96,013,585.00	-
92	非交易过户	2023-06-09	95,909,599.00	95,909,599.00	-
93	赎回	2023-06-12	-95,909,599.00	-95,909,599.00	-
94	非交易过户	2023-06-12	99,461,963.00	99,461,963.00	-
95	赎回	2023-06-13	-99,461,963.00	-99,461,963.00	-
96	非交易过户	2023-06-13	99,820,156.00	99,820,156.00	-
97	赎回	2023-06-14	-99,820,156.00	-99,820,156.00	-
98	非交易过户	2023-06-14	106,835,153.00	106,835,153.00	-
99	赎回	2023-06-15	-106,835,153.00	-106,835,153.00	-
100	非交易过户	2023-06-15	90,983,540.00	90,983,540.00	-
101	赎回	2023-06-16	-90,983,540.00	-90,983,540.00	-
102	非交易过户	2023-06-16	108,423,425.00	108,423,425.00	-
103	赎回	2023-06-19	-108,423,425.00	-108,423,425.00	-
104	非交易过户	2023-06-19	119,601,355.00	119,601,355.00	-
105	赎回	2023-06-20	-119,601,355.00	-119,601,355.00	-
106	非交易过户	2023-06-20	119,999,770.00	119,999,770.00	-

107	赎回	2023-06-21	-119,999,770.00	-119,999,770.00	-
108	非交易过户	2023-06-21	114,928,042.00	114,928,042.00	-
109	赎回	2023-06-26	-114,928,042.00	-114,928,042.00	-
110	非交易过户	2023-06-26	107,295,418.00	107,295,418.00	-
111	赎回	2023-06-27	-107,295,418.00	-107,295,418.00	-
112	非交易过户	2023-06-27	116,598,017.00	116,598,017.00	-
113	赎回	2023-06-28	-116,598,017.00	-116,598,017.00	-
114	非交易过户	2023-06-28	105,191,047.00	105,191,047.00	-
115	赎回	2023-06-29	-105,191,047.00	-105,191,047.00	-
116	非交易过户	2023-06-29	102,712,993.00	102,712,993.00	-
117	赎回	2023-06-30	-102,712,993.00	-102,712,993.00	-
118	非交易过户	2023-06-30	119,820,678.00	119,820,678.00	-
合计			19,820,678.00	19,820,678.00	

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

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

根据中信建投证券股份有限公司（以下简称公司）于 6 月 1 日发布的《中信建投证券股份有限公司关于执行董事辞任的公告》，公司执行董事李格平先生因个人原因，向公司董事会提交辞职报告，申请辞去公司执行董事、董事会发展战略委员会委员、董事会风险管理委员会委员以及公司总经理、执行委员会委员、财务负责人等职务。其关于公司总经理、执行委员会委员、财务负责人等高级管理人员职务的辞任将按照有关法律法规和《公司章程》的规定尽快履行公司治理程序。公司于 6 月 21 日发布《中信建投证券股份有限公司第二届董事会第五十四次会议决议公告》，公司第二届董事会第五十四次会议于 2023 年 6 月 21 日完成通讯表决并形成会议决议。会议指定公司董事长王常青先生在公司总经理、财务负责人空缺期间代为履行相应高级管理人员职责。该代行自 2023 年 6 月 1 日起生效，至董事会聘任新的总经理、财务负责人之日止。李格平先生不再

担任公司总经理、执行委员会委员、财务负责人等职务。会议授权公司经营管理层负责办理与上述职务变动相关的备案手续。

§ 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
2023 年 7 月 21 日