

中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 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：2024 年 4 月 23 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 2024 年 4 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 3 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 | 14,641,212,057.67 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日） |
|-------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 48,710,759.59 |
| 2. 本期利润 | 48,710,759.59 |
| 3. 期末基金资产净值 | 14,641,212,057.67 |

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

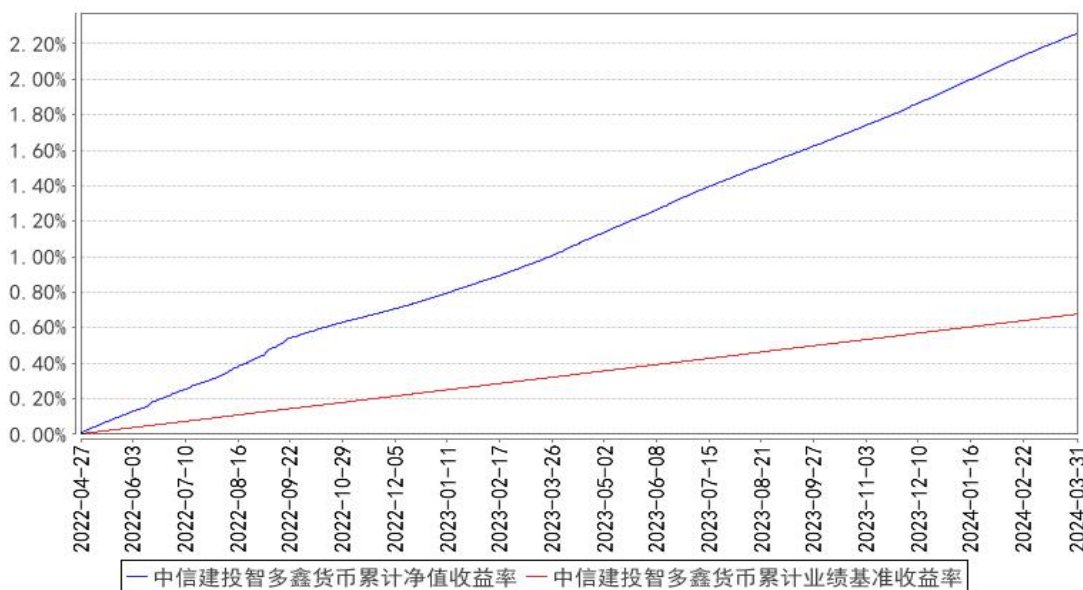
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.3149% | 0.0003% | 0.0867% | 0.0000% | 0.2282% | 0.0003% |
| 过去六个月 | 0.6175% | 0.0003% | 0.1746% | 0.0000% | 0.4429% | 0.0003% |
| 过去一年 | 1.2231% | 0.0003% | 0.3498% | 0.0000% | 0.8733% | 0.0003% |
| 自基金合同 生效起至今 | 2.2593% | 0.0010% | 0.6760% | 0.0000% | 1.5833% | 0.0010% |

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 | - | 13 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 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 年一季度基本面延续弱修复态势。1-2 月制造业 PMI（采购经理指数）延续上一季度的弱势，持续处于荣枯线以下。3 月制造业 PMI 受到了前期政策支持、春节后全面复工以及外需回暖的共同影响，重回荣枯线以上，但是可持续性仍受关注。目前经济依然处于新旧动能的切换阶段，未来经济复苏的节奏仍然依赖于逆周期调节政策的出台。一季度在债券市场参与主体较强的配置需求下，债券收益率曲线整体下行，尤其是春节后配置情绪高涨，下行幅度剧烈。但是在“防止资金套利和空转”的要求下，资金面保持低位，收益率曲线持续走平，期限利差位于历史较低水平。总体来看，一年期同业存单收益率在一季度保持下行趋势，从 2.44%持续下行至 2.23%，10 年国债收益率下行 27BP 至 2.29%。

操作方面，报告期内本集合计划以同业存单、同业存款、短期逆回购和政策性金融债为主要配置资产，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，本集合计划在一季度保持了较好的流动性和较稳定的收益率。下一阶段，本集合计划将继续密切关注货币、信用和

财政的组合方式，以及世界主要经济体降息的进展。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 0.3149%，同期业绩比较基准收益率为 0.0867%。

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 | 7,133,292,458.03 | 44.22 |
| | 其中：债券 | 7,133,292,458.03 | 44.22 |
| | 资产支持证 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,388,260,749.93 | 8.61 |
| | 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 | 7,609,922,669.55 | 47.17 |
| 4 | 其他资产 | - | - |
| 5 | 合计 | 16,131,475,877.51 | 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 | 11.26 | |
| | 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 | 622,111,580.05 | 4.25 |
| | 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 | 63 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 71 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 32 |

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 | 51.77 | 9.71 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 21.88 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 8.32 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 2.71 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 25.37 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 110.05 | 9.71 |

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 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 430,814,107.00 | 2.94 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 6,702,478,351.03 | 45.78 |

| | | | |
|----|----------------------|------------------|-------|
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 7,133,292,458.03 | 48.72 |
| 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 | 012480575 | 24 国家能源 SCP003 | 3,000,000 | 300,527,561.52 | 2.05 |
| 2 | 112317284 | 23 光大银行 CD284 | 3,000,000 | 299,094,995.11 | 2.04 |
| 3 | 112304055 | 23 中国银行 CD055 | 2,500,000 | 249,229,811.41 | 1.70 |
| 4 | 112314053 | 23 江苏银行 CD053 | 2,000,000 | 199,892,620.17 | 1.37 |
| 5 | 112317286 | 23 光大银行 CD286 | 2,000,000 | 199,423,978.31 | 1.36 |
| 6 | 112303108 | 23 农业银行 CD108 | 2,000,000 | 199,020,804.11 | 1.36 |
| 7 | 112304053 | 23 中国银行 CD053 | 2,000,000 | 198,450,100.31 | 1.36 |
| 8 | 112308171 | 23 中信银行 CD171 | 2,000,000 | 198,404,179.08 | 1.36 |
| 9 | 112317188 | 23 光大银行 CD188 | 2,000,000 | 198,174,784.83 | 1.35 |
| 10 | 112413038 | 24 浙商银行 CD038 | 2,000,000 | 197,923,758.50 | 1.35 |

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 | 0.0348% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0086% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0186% |

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

【中国银行股份有限公司】

2023 年 11 月 29 日，中国人民银行对中国银行股份有限公司因如下违法违规行为公开处罚，处以警告，没收违法所得 37.34 万元，处以罚款 3664.2 万元：（一）违反账户管理规定；（二）违反清算管理规定；（三）违反商户管理规定；（四）违反备付金管理规定；（五）违反人民币反假有关规定；（六）违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；（七）未按规定履行客户身份识别义务；（八）未按规定保存客户身份资料和交易记录；（九）未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；（十）与身份不明的客户进行交易；（十一）违反金融营销宣传管理规定；（十二）违反个人金融信息保护规定。

2023 年 12 月 28 日，国家金融监督管理总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 430 万元：（一）部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要；（二）重要信息系统投产及变更未向监管部门报告，且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件；（三）信息系统运行风险识别不到位、处置不及时，引发重要信息系统重大突发事件；（四）监管意见整改落实不到位，引发重要信息系统重大突发事件；（五）信息科技外包管理不审慎；（六）网络安全域未开展安全评估，网络架构重大变更未开展风险评估且未向监管部门报告；（七）信息系统突发事件定级不准确，导致未按监管要求上报；（八）迟报重要信息系统重大突发事件；（九）错报漏报监管标准化（EAST）数据。

【江苏银行股份有限公司】

2023 年 8 月 10 日，国家金融监督管理总局江苏监管局对江苏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，处 16 万元罚款：报送的互联网保险业务数据不真实，未按规定披露互联网保险信息。

【中国农业银行股份有限公司】

2023 年 4 月 3 日，中国银行保险监督管理委员会随州监管分局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 20 万元：贷前调查不到位。

2023 年 8 月 15 日，国家金融监督管理总局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，没收违法所得并处罚款合计 4420.184584 万元。其中，对总行罚款 1760.092292 万元，没收违法所得 60.092292 万元，对分支机构罚款 2600 万元：（一）农户贷款发放后流入房地产企业；（二）农村个人生产经营贷款贷后管理不到位；（三）农户小额贷款发放后转为定期存款；（四）违规向房地产开发企业提供融资；（五）违规发放流动资金贷款；（六）装修贷款发放不审慎；（七）商业用房贷款发放不审慎；（八）违规向关系人发放信用贷款；（九）贷款风险分类不准确导致不良率失实；（十）违规发放固定资产贷款；（十一）对不具备法人资格的分支公司客户单独办理授信；（十二）集团客户统一授信管理不到位；（十三）贷款回流用于归还本行贷款；（十四）贷款回流用于缴纳银承保证金；（十五）贷款回流用于转存定期存款；（十六）贴现资金回流出票人；（十七）信贷资金流入证券账户；（十八）贷后管理不尽责导致信贷资金实质被关联企业占用；（十九）扶贫小额信贷“户贷企用”。

2023 年 11 月 16 日，国家金融监督管理总局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，处罚款合计 570.9738 万元：（一）流动资金贷款被用于固定资产投资；（二）贷款受托支付问题整改不到位；（三）贷款风险分类不准确；（四）个别精准扶贫贷款被挪用；（五）不良资产转让流程问题整改不到位；（六）小微企业划型不准确；（七）贷款资金转存银承汇票保证金问题整改不到位；（八）个人贷款违规流入房地产市场问题整改不到位；（九）审计人员配备不足问题未整改；（十）非现场数据报送不准确，整改不到位；（十一）人员内部问责不到位；（十二）向关系人发放信用贷款；（十三）个人贷款管理不到位，部分贷款资金被挪用。

2023 年 11 月 17 日，国家外汇管理局北京市分局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，没收非法所得 141.85 万元，处罚款合计 553 万元：（一）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；（二）违反规定办理资本项目资金收付；（三）违反规定办理结汇、售汇业务；（四）未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料。

【中信银行股份有限公司】

2023 年 11 月 16 日，国家金融监督管理总局对中信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 22012.59 万元，没收违法所得 462.59 万元：（一）违反高管准入管理相关规定；（二）关联贷款管理不合规；（三）绩效考核不符合规定；（四）重大关联交易信息披露不充分；（五）统一授信管理不符合要求；（六）内审人员配置不足；（七）案件防控工作落实不到位；（八）贷款风险分类不准确；（九）并购贷款三查失职；（十）违规发放并购贷款收购保险公司股权；（十一）发放大量贷款代持本行不良；（十二）流动资金贷款业务未严格执行贷款三查要求；（十三）

贷款资金用作归还本行理财融资；（十四）固定资产贷款第一还款来源调查不实；（十五）贴现资金直接转回出票人账户；（十六）发放贷款偿还银行相关垫款；（十七）批量转让不良资产未严格遵守真实转让原则；（十八）通过同业业务投资已出表的不良资产；（十九）利用空存空取规避信贷资金监控；（二十）以贷转存；（二十一）贷款用途监控及支付管理不到位；（二十二）股票质押贷款管控不到位；（二十三）部分个人贷款业务品种设计存在缺陷；（二十四）承担委托贷款实质性风险；（二十五）违规向非融资性担保公司提供授信；（二十六）票据贸易背景审查不到位；（二十七）未严格审查国内信用证业务贸易背景真实性；（二十八）不良债权批量转让对象不合规；（二十九）部分业务不符合国家政策要求；（三十）资产证券化信息披露不准确；（三十一）为企业入股金融机构提供融资；（三十二）非标债权资产比例超监管标准；（三十三）理财产品承接违约资产；（三十四）利用管理费弥补投资损失；（三十五）违规用于项目资本金；（三十六）面向一般客户销售的理财产品投资权益类资产；（三十七）通过同业投资归还本行不良贷款；（三十八）未为每只理财产品开设独立的托管账户；（三十九）改变资产交易价格，调节产品收益；（四十）行长办公会有关决议不符合服务实体经济要求；（四十一）理财业务与其他业务相互承接；（四十二）超比例向并购项目提供理财融资；（四十三）未严格落实授信批复条件；（四十四）理财资金被挪用；（四十五）同业理财未按产品说明书进行投资；（四十六）理财产品信息披露不合规；（四十七）部分结构性存款业务不符合监管要求；（四十八）代销信托产品审慎性不足；（四十九）以同业返存模式吸收存款；（五十）变更还款计划，分类不准确；（五十一）同业投资业务风险审查和资金投向合规性审查不到位；（五十二）部分新产品时点指标不符合新规监管标准；（五十三）理财业务风险隔离不符合监管规定；（五十四）理财与自营业务未严格分离；（五十五）部分信用卡业务不合规；（五十六）违反集团授信相关规定。

2023 年 11 月 16 日，国家金融监督管理总局对中信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 400 万元：（一）部分重要信息系统应认定未认定，相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求；（二）同城数据中心长期存在基础设施风险隐患未得到整改；（三）对外包数据中心的准入前尽职调查和日常管理不符合监管要求，部分数据中心存在风险隐患；（四）数据中心机房演练流于形式，部分演练为虚假演练，实际未开展；（五）数据中心重大变更事项未向监管部门报告；（六）运营中断事件报告不符合监管要求。

【浙商银行股份有限公司】

2024 年 2 月 2 日，国家金融监督管理总局浙江监管局对浙商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 55 万元：向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押评估费；向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押登记费。

本基金投资 23 中国银行 CD055、23 江苏银行 CD053、23 农业银行 CD108、23 中国银行 CD053、23 中信银行 CD171、24 浙商银行 CD038 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 23 中国银行 CD055、23 江苏银行 CD053、23 农业银行 CD108、23 中国银行 CD053、23 中信银行 CD171、24 浙商银行 CD038 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

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 | 12,616,499,812.59 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 96,301,883,958.09 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 94,277,171,713.01 |
| 报告期期末基金份额总额 | 14,641,212,057.67 |

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 | 非交易过户 | 2024-01-02 | 120,000,000.00 | 120,000,000.00 | - |
| 2 | 赎回 | 2024-01-02 | -117,620,361.00 | -117,620,361.00 | - |
| 3 | 非交易过户 | 2024-01-03 | 120,000,000.00 | 120,000,000.00 | - |
| 4 | 赎回 | 2024-01-03 | -120,000,000.00 | -120,000,000.00 | - |
| 5 | 非交易过户 | 2024-01-04 | 119,999,067.00 | 119,999,067.00 | - |
| 6 | 赎回 | 2024-01-04 | -120,000,000.00 | -120,000,000.00 | - |
| 7 | 非交易过户 | 2024-01-05 | 119,999,598.00 | 119,999,598.00 | - |
| 8 | 赎回 | 2024-01-05 | -119,999,067.00 | -119,999,067.00 | - |
| 9 | 非交易过户 | 2024-01-08 | 119,999,044.00 | 119,999,044.00 | - |
| 10 | 赎回 | 2024-01-08 | -119,999,598.00 | -119,999,598.00 | - |

| | | | | | |
|----|-------|------------|-----------------|-----------------|---|
| 11 | 非交易过户 | 2024-01-09 | 120,000,000.00 | 120,000,000.00 | - |
| 12 | 赎回 | 2024-01-09 | -119,999,044.00 | -119,999,044.00 | - |
| 13 | 非交易过户 | 2024-01-10 | 109,176,635.00 | 109,176,635.00 | - |
| 14 | 赎回 | 2024-01-10 | -120,000,000.00 | -120,000,000.00 | - |
| 15 | 非交易过户 | 2024-01-11 | 92,698,171.00 | 92,698,171.00 | - |
| 16 | 赎回 | 2024-01-11 | -109,176,635.00 | -109,176,635.00 | - |
| 17 | 非交易过户 | 2024-01-12 | 98,097,741.00 | 98,097,741.00 | - |
| 18 | 赎回 | 2024-01-12 | -92,698,171.00 | -92,698,171.00 | - |
| 19 | 非交易过户 | 2024-01-15 | 98,292,699.00 | 98,292,699.00 | - |
| 20 | 赎回 | 2024-01-15 | -98,097,741.00 | -98,097,741.00 | - |
| 21 | 非交易过户 | 2024-01-16 | 84,159,479.00 | 84,159,479.00 | - |
| 22 | 赎回 | 2024-01-16 | -98,292,699.00 | -98,292,699.00 | - |
| 23 | 赎回 | 2024-01-17 | -84,159,479.00 | -84,159,479.00 | - |
| 24 | 非交易过户 | 2024-01-17 | 77,951,921.00 | 77,951,921.00 | - |
| 25 | 赎回 | 2024-01-18 | -77,951,921.00 | -77,951,921.00 | - |
| 26 | 非交易过户 | 2024-01-18 | 83,500,650.00 | 83,500,650.00 | - |
| 27 | 非交易过户 | 2024-01-19 | 89,444,513.00 | 89,444,513.00 | - |
| 28 | 赎回 | 2024-01-19 | -83,500,650.00 | -83,500,650.00 | - |
| 29 | 赎回 | 2024-01-22 | -89,444,513.00 | -89,444,513.00 | - |
| 30 | 非交易过户 | 2024-01-22 | 99,712,292.00 | 99,712,292.00 | - |
| 31 | 赎回 | 2024-01-23 | -99,712,292.00 | -99,712,292.00 | - |
| 32 | 非交易过户 | 2024-01-23 | 109,466,439.00 | 109,466,439.00 | - |
| 33 | 非交易过户 | 2024-01-24 | 86,880,597.00 | 86,880,597.00 | - |
| 34 | 赎回 | 2024-01-24 | -109,466,439.00 | -109,466,439.00 | - |
| 35 | 非交易过户 | 2024-01-25 | 86,805,579.00 | 86,805,579.00 | - |
| 36 | 赎回 | 2024-01-25 | -86,880,597.00 | -86,880,597.00 | - |
| 37 | 非交易过户 | 2024-01-26 | 100,395,308.00 | 100,395,308.00 | - |
| 38 | 赎回 | 2024-01-26 | -86,805,579.00 | -86,805,579.00 | - |

| | | | | | |
|----|-------|------------|-----------------|-----------------|---|
| 39 | 非交易过户 | 2024-01-29 | 106,100,200.00 | 106,100,200.00 | - |
| 40 | 赎回 | 2024-01-29 | -100,395,308.00 | -100,395,308.00 | - |
| 41 | 非交易过户 | 2024-01-30 | 111,517,299.00 | 111,517,299.00 | - |
| 42 | 赎回 | 2024-01-30 | -106,100,200.00 | -106,100,200.00 | - |
| 43 | 非交易过户 | 2024-01-31 | 111,415,024.00 | 111,415,024.00 | - |
| 44 | 赎回 | 2024-01-31 | -111,517,299.00 | -111,517,299.00 | - |
| 45 | 赎回 | 2024-02-01 | -111,415,024.00 | -111,415,024.00 | - |
| 46 | 非交易过户 | 2024-02-01 | 115,052,678.00 | 115,052,678.00 | - |
| 47 | 非交易过户 | 2024-02-02 | 120,000,000.00 | 120,000,000.00 | - |
| 48 | 赎回 | 2024-02-02 | -115,052,678.00 | -115,052,678.00 | - |
| 49 | 非交易过户 | 2024-02-05 | 119,999,680.00 | 119,999,680.00 | - |
| 50 | 赎回 | 2024-02-05 | -120,000,000.00 | -120,000,000.00 | - |
| 51 | 非交易过户 | 2024-02-06 | 120,000,000.00 | 120,000,000.00 | - |
| 52 | 赎回 | 2024-02-06 | -119,999,680.00 | -119,999,680.00 | - |
| 53 | 非交易过户 | 2024-02-07 | 119,999,852.00 | 119,999,852.00 | - |
| 54 | 赎回 | 2024-02-07 | -120,000,000.00 | -120,000,000.00 | - |
| 55 | 非交易过户 | 2024-02-08 | 120,000,000.00 | 120,000,000.00 | - |
| 56 | 赎回 | 2024-02-08 | -119,999,852.00 | -119,999,852.00 | - |
| 57 | 赎回 | 2024-02-19 | -120,000,000.00 | -120,000,000.00 | - |
| 58 | 非交易过户 | 2024-02-19 | 118,533,801.00 | 118,533,801.00 | - |
| 59 | 非交易过户 | 2024-02-20 | 119,999,763.00 | 119,999,763.00 | - |
| 60 | 赎回 | 2024-02-20 | -118,533,801.00 | -118,533,801.00 | - |
| 61 | 非交易过户 | 2024-02-21 | 119,999,961.00 | 119,999,961.00 | - |
| 62 | 赎回 | 2024-02-21 | -119,999,763.00 | -119,999,763.00 | - |
| 63 | 非交易过户 | 2024-02-22 | 120,000,000.00 | 120,000,000.00 | - |
| 64 | 赎回 | 2024-02-22 | -119,999,961.00 | -119,999,961.00 | - |
| 65 | 非交易过户 | 2024-02-23 | 104,495,096.00 | 104,495,096.00 | - |
| 66 | 赎回 | 2024-02-23 | -120,000,000.00 | -120,000,000.00 | - |

| | | | | | |
|----|-------|------------|-----------------|-----------------|---|
| 67 | 赎回 | 2024-02-26 | -104,495,096.00 | -104,495,096.00 | - |
| 68 | 非交易过户 | 2024-02-26 | 110,944,990.00 | 110,944,990.00 | - |
| 69 | 非交易过户 | 2024-02-27 | 119,999,242.00 | 119,999,242.00 | - |
| 70 | 赎回 | 2024-02-27 | -110,944,990.00 | -110,944,990.00 | - |
| 71 | 赎回 | 2024-02-28 | -119,999,242.00 | -119,999,242.00 | - |
| 72 | 非交易过户 | 2024-02-28 | 101,559,880.00 | 101,559,880.00 | - |
| 73 | 非交易过户 | 2024-02-29 | 106,915,361.00 | 106,915,361.00 | - |
| 74 | 赎回 | 2024-02-29 | -101,559,880.00 | -101,559,880.00 | - |
| 75 | 非交易过户 | 2024-03-01 | 104,909,515.00 | 104,909,515.00 | - |
| 76 | 赎回 | 2024-03-01 | -106,915,361.00 | -106,915,361.00 | - |
| 77 | 非交易过户 | 2024-03-04 | 99,271,822.00 | 99,271,822.00 | - |
| 78 | 赎回 | 2024-03-04 | -104,909,515.00 | -104,909,515.00 | - |
| 79 | 非交易过户 | 2024-03-05 | 100,369,794.00 | 100,369,794.00 | - |
| 80 | 赎回 | 2024-03-05 | -99,271,822.00 | -99,271,822.00 | - |
| 81 | 非交易过户 | 2024-03-06 | 95,961,374.00 | 95,961,374.00 | - |
| 82 | 赎回 | 2024-03-06 | -100,369,794.00 | -100,369,794.00 | - |
| 83 | 非交易过户 | 2024-03-07 | 87,313,932.00 | 87,313,932.00 | - |
| 84 | 赎回 | 2024-03-07 | -95,961,374.00 | -95,961,374.00 | - |
| 85 | 非交易过户 | 2024-03-08 | 91,794,609.00 | 91,794,609.00 | - |
| 86 | 赎回 | 2024-03-08 | -87,313,932.00 | -87,313,932.00 | - |
| 87 | 非交易过户 | 2024-03-11 | 104,419,134.00 | 104,419,134.00 | - |
| 88 | 赎回 | 2024-03-11 | -91,794,609.00 | -91,794,609.00 | - |
| 89 | 非交易过户 | 2024-03-12 | 111,299,004.00 | 111,299,004.00 | - |
| 90 | 赎回 | 2024-03-12 | -104,419,134.00 | -104,419,134.00 | - |
| 91 | 非交易过户 | 2024-03-13 | 97,121,377.00 | 97,121,377.00 | - |
| 92 | 赎回 | 2024-03-13 | -111,299,004.00 | -111,299,004.00 | - |
| 93 | 非交易过户 | 2024-03-14 | 97,673,860.00 | 97,673,860.00 | - |
| 94 | 赎回 | 2024-03-14 | -97,121,377.00 | -97,121,377.00 | - |

| | | | | | |
|-----|-------|------------|-----------------|-----------------|---|
| 95 | 非交易过户 | 2024-03-15 | 96,219,266.00 | 96,219,266.00 | - |
| 96 | 赎回 | 2024-03-15 | -97,673,860.00 | -97,673,860.00 | - |
| 97 | 非交易过户 | 2024-03-18 | 101,730,627.00 | 101,730,627.00 | - |
| 98 | 赎回 | 2024-03-18 | -96,219,266.00 | -96,219,266.00 | - |
| 99 | 非交易过户 | 2024-03-19 | 109,646,981.00 | 109,646,981.00 | - |
| 100 | 赎回 | 2024-03-19 | -101,730,627.00 | -101,730,627.00 | - |
| 101 | 非交易过户 | 2024-03-20 | 101,248,898.00 | 101,248,898.00 | - |
| 102 | 赎回 | 2024-03-20 | -109,646,981.00 | -109,646,981.00 | - |
| 103 | 非交易过户 | 2024-03-21 | 100,946,163.00 | 100,946,163.00 | - |
| 104 | 赎回 | 2024-03-21 | -101,248,898.00 | -101,248,898.00 | - |
| 105 | 非交易过户 | 2024-03-22 | 93,180,811.00 | 93,180,811.00 | - |
| 106 | 赎回 | 2024-03-22 | -100,946,163.00 | -100,946,163.00 | - |
| 107 | 赎回 | 2024-03-25 | -93,180,811.00 | -93,180,811.00 | - |
| 108 | 非交易过户 | 2024-03-25 | 111,366,132.00 | 111,366,132.00 | - |
| 109 | 非交易过户 | 2024-03-26 | 119,999,880.00 | 119,999,880.00 | - |
| 110 | 赎回 | 2024-03-26 | -111,366,132.00 | -111,366,132.00 | - |
| 111 | 非交易过户 | 2024-03-27 | 102,993,719.00 | 102,993,719.00 | - |
| 112 | 赎回 | 2024-03-27 | -119,999,880.00 | -119,999,880.00 | - |
| 113 | 非交易过户 | 2024-03-28 | 102,219,577.00 | 102,219,577.00 | - |
| 114 | 赎回 | 2024-03-28 | -102,993,719.00 | -102,993,719.00 | - |
| 115 | 非交易过户 | 2024-03-29 | 119,999,310.00 | 119,999,310.00 | - |
| 116 | 赎回 | 2024-03-29 | -102,219,577.00 | -102,219,577.00 | - |
| 合计 | | | 2,378,949.00 | 2,378,949.00 | |

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

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
2024 年 4 月 23 日