

# 中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                 | 2         |
| 1.2 目录                                   | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                          | 7         |
| 3.2 基金净值表现                               | 7         |
| 3.3 其他指标                                 | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                         | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                         | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明               | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                  | 10        |
| 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              | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望              | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                 | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                  | 12        |
| 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        | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                         | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                   | 13        |
| 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  | 13        |
| 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        | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                                | 14        |
| 6.2 利润表                                  | 15        |
| 6.3 净资产变动表                               | 16        |
| 6.4 报表附注                                 | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                        | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                           | 38        |
| 7.2 债券回购融资情况                             | 38        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                         | 38        |
| 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          | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                     | 39        |
| 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 | 40        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....                | 40        |
| 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<br>明细 ..... | 41        |
| 7.9 投资组合报告附注 .....                                      | 41        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                              | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                             | 45        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                            | 45        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                          | 45        |
| 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 .....                  | 45        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                              | <b>46</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                                | <b>47</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                                  | 47        |
| 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 .....                  | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                       | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                                    | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                             | 47        |
| 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 .....                     | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                            | 51        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                             | 52        |
| 10.9 其他重大事件 .....                                       | 52        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                        | <b>54</b> |
| 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 .....                | 54        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                               | 54        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                                | <b>55</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                                       | 55        |
| 12.2 存放地点 .....   | 55        |
| 12.3 查阅方式 .....   | 55        |

## § 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 | 15,661,388,284.76 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

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”。

### 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。<br>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。  |

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<br>负责人 | 姓名   | 张昕帆                 | 陈晨                      |
|             | 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        |      | 北京市朝阳区光华路 10 号      | 北京市西城区锦什坊街 26 号         |
| 邮政编码        |      | 100020              | 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 | <a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a> |
| 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(2024年1月1日-2024年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 90,744,999.24             |
| 本期利润          | 90,744,999.24             |
| 本期净值收益率       | 0.5635%                   |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024年6月30日)          |
| 期末基金资产净值      | 15,661,388,284.76         |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2024年6月30日)          |
| 累计净值收益率       | 2.5127%                   |

注：1. 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；

2. 本基金收益“每日分配、按季支付”，收益支付方式为现金分红。

#### 3.2 基金净值表现

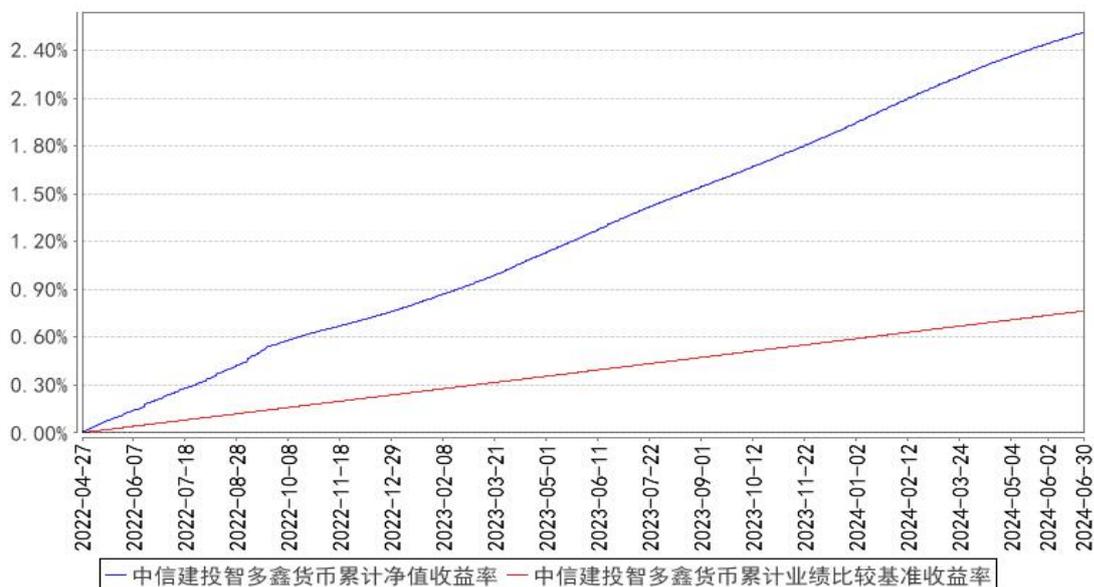
##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0.0732%  | 0.0001%     | 0.0286%    | 0.0000%       | 0.0446% | 0.0001% |
| 过去三个月      | 0.2478%  | 0.0003%     | 0.0867%    | 0.0000%       | 0.1611% | 0.0003% |
| 过去六个月      | 0.5635%  | 0.0005%     | 0.1735%    | 0.0000%       | 0.3900% | 0.0005% |
| 过去一年       | 1.1527%  | 0.0004%     | 0.3495%    | 0.0000%       | 0.8032% | 0.0004% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.5127%  | 0.0009%     | 0.7633%    | 0.0000%       | 1.7494% | 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。

### 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 2024 年 6 月 30 日，中信建投证券共管理 5 只参照公募基金运作的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、中信建投悠享 12 个月持有期债券型集合资产管理计划、中信建投悦享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划以及中信建投欣享债券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、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 13 年证券行业工作经验、9 年投资管理经验，专注固定收益类领域研究。 |
| 李劼  | 本基金的基金经理助理                   | 2022 年 6 月 15 日 | -    | 5 年    | 金融学硕士，具备基金从业资格。2018 年加入中信建投证券资产管理部，曾任中信建投证券资产管理部债券交易员。                    |

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 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 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

2024 年上半年实际 GDP 同比增长 5.0%。二季度同比增长 4.7%，与一季度相比有所放缓。从经济的三驾马车来看，出口依然是经济增长最重要的引擎，民企进出口总量同比增长 11.2%，增速为 GDP 增速的两倍。东盟仍是第一贸易合作伙伴，对美出口也在恢复增长；投资端，在“高质量发展”引领下，部分行业投资依然保持较快增速，制造业大规模设备更新政策效果显著，但是

基建投资趋缓，房地产投资延续下行，固定资产投资增速累积同比值呈逐月下降趋势；消费端，居民消费结构分化明显，下沉市场消费表现强劲，可选消费呈现下降趋势，办公用品消费降幅靠前。上半年以银行理财为代表的市场参与主体规模增长迅速，银行理财存续规模增长近 2 万亿。市场参与主体配置债券需求旺盛，债券收益率曲线整体下行，尤其是春节后配置情绪高涨，下行速度加快。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、信用利差均位于历史较低水平。总体来看，一年期同业存单收益率在 4 月虽略有反弹，但整体保持下行趋势，从 2.44% 持续下行至 1.96%，10 年国债收益率从 2.68% 下行至 2.20%。

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，本集合计划在上半年保持了较好的流动性和较稳定的收益率，但进入二季度后优质资产面临的“资产荒”情况给产品配置带来了压力。下一阶段，本集合计划将继续密切关注货币、信用和财政政策的组合方式。防范风险之余，力争抓住市场波段机会以期增厚收益。

#### 4.4.2 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 0.5635%，同期业绩比较基准收益率为 0.1735%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，伴随着各种稳增长政策的出台和落地，我国经济长期向好的基本面没有改变，全年完成 GDP 增长 5% 的目标较大概率能够实现。但需要注意的是，经济增长的三驾马车中，消费不足仍是影响国内经济循环的重要问题。消费意愿偏低、收入信心偏弱对消费支出的阶段性影响有所提升。这是当前中国经济增长引擎转换面临的阶段挑战，也是市场期待的跨周期逆周期调控政策的着力点之一。下半年美国有可能即将进入降息周期，而欧洲已先于美国进入降息周期，人民币汇率的压力或将降低。货币政策的主动权将重回央行手中，我们对未来货币政策和财政政策的组合充满信心。对于债券市场而言，未来的宏观经济悲观预期和当下宽松的流动性环境共同造就了低位、扁平化的收益率曲线，下半年已出台政策的落地效果和新一轮政策支持力度将成为影响债券市场的核心因素。对于短期债券来说，资金面对其影响更重要，我们认为当前货币市场利率继续下行空间有限。

目前债券市场的主要参与者高度集中，容易形成过于一致的预期或投资行为。一旦超预期事件发生，市场较容易发生调整风险。基于此，本集合计划将继续密切关注货币、信用和财政政策的组合方式。在坚持将组合流动性放在首位的原则下，继续保持合理的组合久期和杠杆，防范风险之余，争取把握市场的波段操作机会，力争为投资人提供长期、稳定的回报。

#### 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，建立了估值工作小组，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。本报告期内，本集合计划应分配利润金额为 90,744,999.24 元，实际分配金额为 99,217,371.45 元（包含本集合计划上年度未分配利润）。

#### 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 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号     | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>    |         |                        |                          |
| 货币资金          | 6.4.7.1 | 4,738,729,284.82       | 6,548,006,603.66         |
| 结算备付金         |         | -                      | 6,821,556.84             |
| 存出保证金         |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2 | 9,531,356,209.44       | 7,433,323,259.27         |
| 其中：股票投资       |         | -                      | -                        |
| 基金投资          |         | -                      | -                        |
| 债券投资          |         | 9,531,356,209.44       | 7,433,323,259.27         |
| 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 | 1,500,836,174.51       | 900,033,000.00           |
| 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         |         | -                      | -                        |
| 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          |         | 15,770,921,668.77      | 14,888,184,419.77        |
| <b>负债和净资产</b> |         |                        |                          |
|               | 附注号     | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
| <b>负债：</b>    |         |                        |                          |
| 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     |         | 49,007,853.43          | 1,303,163,411.73         |
| 应付清算款         |         | -                      | 900,000,000.00           |

|             |          |                   |                   |
|-------------|----------|-------------------|-------------------|
| 应付赎回款       |          | -                 | -                 |
| 应付管理人报酬     |          | 12,649,944.17     | 11,922,771.33     |
| 应付托管费       |          | 702,774.72        | 662,376.14        |
| 应付销售服务费     |          | 3,513,873.39      | 3,311,880.91      |
| 应付投资顾问费     |          | -                 | -                 |
| 应交税费        |          | 9,836.55          | 853.79            |
| 应付利润        |          | 43,136,193.36     | 51,878,327.36     |
| 递延所得税负债     |          | -                 | -                 |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 512,908.39        | 744,985.92        |
| 负债合计        |          | 109,533,384.01    | 2,271,684,607.18  |
| <b>净资产：</b> |          |                   |                   |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 15,661,388,284.76 | 12,616,499,812.59 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -                 | -                 |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | -                 | -                 |
| 净资产合计       |          | 15,661,388,284.76 | 12,616,499,812.59 |
| 负债和净资产总计    |          | 15,770,921,668.77 | 14,888,184,419.77 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，集合计划份额净值 1.0000 元，集合计划份额总额 15,661,388,284.76 份。

## 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|-------------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
|                   |          | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 204,083,747.87                  | 217,282,085.10                  |
| 1. 利息收入           |          | 108,964,250.77                  | 111,036,069.08                  |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 95,710,994.16                   | 105,511,591.38                  |
| 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        |          | 13,253,256.61                   | 5,524,477.70                    |
| 其他利息收入            |          | -                               | -                               |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 94,723,298.15                   | 106,246,016.02                  |
| 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 | 94,723,298.15                   | 106,246,016.02                  |
| 资产支持证券投资          | 6.4.7.16 | -                               | -                               |
| 投资收益              |          |                                 |                                 |

|                            |            |                |                |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 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<br>(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   | 396,198.95     | -              |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 113,338,748.63 | 119,218,272.14 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 72,965,186.75  | 76,208,321.10  |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -              | -              |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 4,053,621.47   | 4,233,795.66   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 20,268,107.43  | 21,168,978.04  |
| 4. 投资顾问费                   |            | -              | -              |
| 5. 利息支出                    |            | 15,831,891.84  | 17,341,577.34  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 15,831,891.84  | 17,341,577.34  |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -              | -              |
| 7. 税金及附加                   |            | 20,055.72      | 3,853.96       |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 199,885.42     | 261,746.04     |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |            | 90,744,999.24  | 98,063,812.96  |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -              |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |            | 90,744,999.24  | 98,063,812.96  |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 90,744,999.24  | 98,063,812.96  |

### 6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 12,616,499,812                        | -      | -     | 12,616,499,812. |

|  |  |        |                |                     |
|--|--|--------|----------------|---------------------|
|  | . 59                                       |        |                | 59                  |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -              | -                   |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -              | -                   |
| 其他                                       | -  | -      | -              | -                   |
| 二、本期期初净资产                                | 12,616,499,812.59                          | -      | -              | 12,616,499,812.59   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 3,044,888,472.17                           | -      | -              | 3,044,888,472.17    |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | 90,744,999.24  | 90,744,999.24       |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 3,044,888,472.17                           | -      | -              | 3,044,888,472.17    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 192,396,354,085.08                         | -      | -              | 192,396,354,085.08  |
| 2. 基金赎回款                                 | -189,351,465,612.91                        | -      | -              | -189,351,465,612.91 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -  | -      | -90,744,999.24 | -90,744,999.24      |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -  | -      | -              | -                   |
| 四、本期期末净资产                                | 15,661,388,284.76                          | -      | -              | 15,661,388,284.76   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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                                | 13,481,016,573.11                          | -      | -              | 13,481,016,573.11   |

|  |                     |   |                |                     |
|--|---------------------|---|----------------|---------------------|
| 加：会计政策变更                                 | -                   | - | -              | -                   |
| 前期差错更正                                   | -                   | - | -              | -                   |
| 其他                                       | -                   | - | -              | -                   |
| 二、本期期初净资产                                | 13,481,016,573.11   | - | -              | 13,481,016,573.11   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 1,012,615,298.21    | - | -              | 1,012,615,298.21    |
| (一)、综合收益总额                               | -                   | - | 98,063,812.96  | 98,063,812.96       |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 1,012,615,298.21    | - | -              | 1,012,615,298.21    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 197,397,735,335.60  | - | -              | 197,397,735,335.60  |
| 2. 基金赎回款                                 | -196,385,120,037.39 | - | -              | -196,385,120,037.39 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                   | - | -98,063,812.96 | -98,063,812.96      |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                   | - | -              | -                   |
| 四、本期期末净资产                                | 14,493,631,871.32   | - | -              | 14,493,631,871.32   |

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：

张昕帆

李志山

李志山

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。合同变更后,本集合计划的托管人、登记机构不变。《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。本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为中信建投证券,托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

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)。

### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和集合计划净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本期财务报表所采用的会计政策与编制 2023 年年度财务报表所采用的会计政策一致。

#### 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,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)、基金份额净值、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《中华人民共和国印花税法》(2022 年 7 月 1 日起施行),证券交易印花税对证券交易的出让方征收,不对受让方征收。证券交易印花税按成交金额的千分之一计算,证券登记结算机构为证券交易印花税的扣缴义务人。计划管理人运用资产管理计划买卖股票,卖出股票按 1% 的税率缴纳证券交易印花税,买入股票不征收证券交易印花税。根据《关于减半征收证券交易印花税的公告》(财政部税务总局公告 2023 年第 39 号),自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

| 项目              | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款            | 1,524,068,814.25       |
| 等于: 本金          | 1,522,472,015.26       |
| 加: 应计利息         | 1,596,798.99           |
| 减: 坏账准备         | -                      |
| 定期存款            | 3,214,660,470.57       |
| 等于: 本金          | 3,200,000,000.00       |
| 加: 应计利息         | 14,660,470.57          |
| 减: 坏账准备         | -                      |
| 其中: 存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月     | 501,034,444.36         |
| 存款期限 3 个月以上     | 2,713,626,026.21       |
| 其他存款            | -                      |
| 等于: 本金          | -                      |
| 加: 应计利息         | -                      |
| 减: 坏账准备         | -                      |
| 合计              | 4,738,729,284.82       |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |      |      |     |
|----|------------------------|------|------|-----|
|    | 按实际利率计算的账              | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 |
|    |                        |      |      |     |

|        |       | 面价值              |                  | (%)          |        |
|--------|-------|------------------|------------------|--------------|--------|
| 债券     | 交易所市场 | -                | -                | -            | -      |
|        | 银行间市场 | 9,531,356,209.44 | 9,535,616,630.14 | 4,260,420.70 | 0.0272 |
|        | 合计    | 9,531,356,209.44 | 9,535,616,630.14 | 4,260,420.70 | 0.0272 |
| 资产支持证券 |       | -                | -                | -            | -      |
| 合计     |       | 9,531,356,209.44 | 9,535,616,630.14 | 4,260,420.70 | 0.0272 |

### 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<br>2024年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                 | -         |
| 银行间市场 | 1,500,836,174.51  | -         |
| 合计    | 1,500,836,174.51  | -         |

#### 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<br>2024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      | 224,045.27        |

|          |            |
|----------|------------|
| 其中：交易所市场 | 15,000.00  |
| 银行间市场    | 209,045.27 |
| 应付利息     | -          |
| 预提信息披露费  | 119,672.34 |
| 预提账户维护费  | 9,300.00   |
| 预提审计费    | 159,890.78 |
| 合计       | 512,908.39 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                     |
|---------------|----------------------------|---------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额                |
| 上年度末          | 12,616,499,812.59          | 12,616,499,812.59   |
| 本期申购          | 192,396,354,085.08         | 192,396,354,085.08  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -189,351,465,612.91        | -189,351,465,612.91 |
| 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           | 15,661,388,284.76          | 15,661,388,284.76   |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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        |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 上年度末           | -              | -     | -              |
| 加：会计政策变更       | -              | -     | -              |
| 前期差错更正         | -              | -     | -              |
| 其他             | -              | -     | -              |
| 本期期初           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 90,744,999.24  | -     | 90,744,999.24  |
| 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        | -90,744,999.24 | -     | -90,744,999.24 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|           | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 61,014,653.93                   |
| 定期存款利息收入  | 34,627,027.74                   |
| 其他存款利息收入  | -                               |
| 结算备付金利息收入 | 69,312.49                       |
| 其他        | -                               |
| 合计        | 95,710,994.16                   |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

注：本集合计划本报告期无买卖股票差价收入。

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 93,442,383.69              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,280,914.46               |
| 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                           | 94,723,298.15              |

##### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 17,710,415,955.09          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 17,675,558,413.94          |
| 减：应计利息总额               | 33,536,626.69              |
| 减：交易费用                 | 40,000.00                  |
| 买卖债券差价收入               | 1,280,914.46               |

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赎回债券差价收入。

##### 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申购债券差价收入。

#### 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买卖资产支持证券差价收入。

##### 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赎回资产支持证券差价收入。

##### 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申购资产支持证券差价收入。

#### 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买卖贵金属差价收入。

##### 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赎回贵金属差价收入。

##### 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申购贵金属差价收入。

#### 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买卖权证差价收入。

##### 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其它投资收益。

#### 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

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                     |
| 其他      | 396,198.95                            |
| 合计      | 396,198.95                            |

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 59,890.78                             |
| 信息披露费   | 59,672.34                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行费用    | 61,722.30                             |
| 账户维护费   | 18,600.00                             |
| 合计      | 199,885.42                            |

#### 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，本集合计划不存在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，本集合计划不存在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（“中信建投证券”）     | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国证券登记结算有限责任公司（“中国证券登记结算”） | 基金托管人        |

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及上年度可比期间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及上年度可比期间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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                    | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                    |
|--------------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|--------------------|
|              | 成交金额                       | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额                            | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) |
| 中信建投证券股份有限公司 | 7,407,415,000.00           | 100.00             | 10,800,000,000.00               | 100.00             |

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间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<br>2024年1月1日至2024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 | 219,718.07                      | 100.00         | 15,000.00 | 100.00           |
| 关联方名称        | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023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 | 384,000.00                      | 100.00         | 59,000.00 | 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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 72,965,186.75                         | 76,208,321.10                              |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | -                                     | -  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 72,965,186.75                         | 76,208,321.10                              |

注：1、支付集合计划管理人中信建投证券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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,053,621.47                          | 4,233,795.66                               |

注：支付托管人中国证券登记结算有限责任公司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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日      |
|----------------|--|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费<br>中信建投智多鑫货币              |
| 中信建投证券股份有限公司   | 20,268,107.43                              |
| 合计             | 20,268,107.43                              |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费<br>中信建投智多鑫货币              |
| 中信建投证券股份有限公司   | 21,168,978.04                              |
| 合计             | 21,168,978.04                              |

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。

### 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及上年度可比期间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                   | 上年度可比期间              |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
|                            | 2024年1月1日至2024年6月30日 | 2023年1月1日至2023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 | 0.00                 | -                    |
| 报告期初持有的基金份额                | 117,620,361.00       | 99,999,176.00        |
| 报告期间申购/买入总份额               | 12,152,531,287.00    | 11,578,186,562.00    |
| 报告期间因拆分变动份额                | 0.00                 | 0.00                 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额             | 12,159,945,924.00    | 11,558,365,060.00    |
| 报告期末持有的基金份额                | 110,205,724.00       | 119,820,678.00       |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 0.7037%              | 0.8267%              |

注：1. 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；

2. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

#### 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                   |           | 上年度可比期间              |            |
|----------------|----------------------|-----------|----------------------|------------|
|                | 2024年1月1日至2024年6月30日 |           | 2023年1月1日至2023年6月30日 |            |
|                | 期末余额                 | 当期利息收入    | 期末余额                 | 当期利息收入     |
| 中国证券登记结算有限责任公司 | 2,399,790.26         | 67,894.04 | 5,129,856.10         | 965,045.61 |

注：本集合计划的银行存款由托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，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及上年度可比期间未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及上年度可比期间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<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动  | 本期利润分配合计      | 备注 |
|------------------|-------------------|---------------|---------------|----|
| -                | -                 | 90,744,999.24 | 90,744,999.24 | -  |

#### 6.4.12 期末（2024 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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本集合计划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 49,007,853.43 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称              | 回购到期日             | 期末估值单<br>价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|-------------------|-------------------|------------|---------|---------------|
| 112410048 | 24 兴业银<br>行 CD048 | 2024 年 7 月 1<br>日 | 98.61      | 550,000 | 54,234,172.12 |
| 合计        |                   |                   |            | 550,000 | 54,234,172.12 |

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本集合计划无因从事证券交易所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。

本集合计划管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本集合计划的投资目标，结合集合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划的银行活期存款存放在托管人中国证券登记结算有限责任公司和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。对于买入返售等业务，本集合计划管理人主要考虑同业规模、财务状况及内外部信用风险评级结果确定交易对手的信用情况，对手方信用风险由本集合计划管理人定期统一审查，实行额度管理。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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本集合计划管理人采用预期信用损失模型评估以摊余成本计量的金融资产的减值损失。

##### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 100,576,361.13         | 101,195,221.53           |
| 合计     | 100,576,361.13         | 101,195,221.53           |

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：无。

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 9,430,779,848.31       | 7,332,128,037.74         |
| 合计     | 9,430,779,848.31       | 7,332,128,037.74         |

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：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指无法通过变现资产等途径以合理成本及时获得充足资金，用于偿付到期债务、满足计划份额持有人赎回需求、履行其他支付义务和满足正常业务开展的其他资金需求的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人于约定开放日要求赎回本集合计划，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

流动性风险的管理目标是建立科学完善的流动性风险管理体系，对流动性风险进行有效识别、计量、监测和控制，确保流动性需求能够及时以合理成本得到满足。针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划管理人在集合计划合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 49,007,853.43 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金中的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净资产无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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

本集合计划管理人在集合计划运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过监控集合计划平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

同时，本集合计划管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本集合计划管理人建立了逆回购交易质押品管理制度，要求根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，使可接受质押品的资质要求与集合计划合同约定的投资范围保持一致。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，本期末本集合计划无流通受限不能自由转让的资产。

#### 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。

本集合计划主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，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<br>2024 年 6 月 30 日   | 6 个月以内                   | 6 个月-1 年                | 1-5 年    | 不计息                   | 合计                       |
|--------------------------|--------------------------|-------------------------|----------|-----------------------|--------------------------|
| <b>资产</b>                |                          |                         |          |                       |                          |
| 货币资金                     | 4,137,345,284.92         | 601,383,999.90          | -        | -                     | 4,738,729,284.82         |
| 交易性金融资产                  | 8,249,837,489.81         | 1,281,518,719.63        | -        | -                     | 9,531,356,209.44         |
| 买入返售金融资产                 | 1,500,836,174.51         | -                       | -        | -                     | 1,500,836,174.51         |
| <b>资产总计</b>              | <b>13,888,018,949.24</b> | <b>1,882,902,719.53</b> | <b>-</b> | <b>-</b>              | <b>15,770,921,668.77</b> |
| <b>负债</b>                |                          |                         |          |                       |                          |
| 应付管理人报酬                  | -                        | -                       | -        | 12,649,944.17         | 12,649,944.17            |
| 应付托管费                    | -                        | -                       | -        | 702,774.72            | 702,774.72               |
| 卖出回购金融资产款                | 49,007,853.43            | -                       | -        | -                     | 49,007,853.43            |
| 应付销售服务费                  | -                        | -                       | -        | 3,513,873.39          | 3,513,873.39             |
| 应付利润                     | -                        | -                       | -        | 43,136,193.36         | 43,136,193.36            |
| 应交税费                     | -                        | -                       | -        | 9,836.55              | 9,836.55                 |
| 其他负债                     | -                        | -                       | -        | 512,908.39            | 512,908.39               |
| <b>负债总计</b>              | <b>49,007,853.43</b>     | <b>-</b>                | <b>-</b> | <b>60,525,530.58</b>  | <b>109,533,384.01</b>    |
| <b>利率敏感度缺口</b>           | <b>13,839,011,095.81</b> | <b>1,882,902,719.53</b> | <b>-</b> | <b>-60,525,530.58</b> | <b>15,661,388,284.76</b> |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 6 个月以内                   | 6 个月-1 年                | 1-5 年    | 不计息                   | 合计                       |
| <b>资产</b>                |                          |                         |          |                       |                          |
| 货币资金                     | 6,045,906,437.70         | 502,100,165.96          | -        | -                     | 6,548,006,603.66         |
| 结算备付金                    | 6,821,556.84             | -                       | -        | -                     | 6,821,556.84             |
| 交易性金融资产                  | 6,400,609,228.82         | 1,032,714,030.45        | -        | -                     | 7,433,323,259.27         |
| 买入返售金融资产                 | 900,033,000.00           | -                       | -        | -                     | 900,033,000.00           |
| <b>资产总计</b>              | <b>13,353,370,223.36</b> | <b>1,534,814,196.41</b> | <b>-</b> | <b>-</b>              | <b>14,888,184,419.77</b> |
| <b>负债</b>                |                          |                         |          |                       |                          |
| 应付管理人报酬                  | -                        | -                       | -        | 11,922,771.33         | 11,922,771.33            |
| 应付托管费                    | -                        | -                       | -        | 662,376.14            | 662,376.14               |
| 应付清算款                    | -                        | -                       | -        | -900,000,000.00       | 900,000,000.00           |

|           |                   |                  |   |                 |                   |
|-----------|-------------------|------------------|---|-----------------|-------------------|
| 卖出回购金融资产款 | 1,303,163,411.73  | -                | - | -               | 1,303,163,411.73  |
| 应付销售服务费   | -                 | -                | - | 3,311,880.91    | 3,311,880.91      |
| 应付利润      | -                 | -                | - | 51,878,327.36   | 51,878,327.36     |
| 应交税费      | -                 | -                | - | 853.79          | 853.79            |
| 其他负债      | -                 | -                | - | 744,985.92      | 744,985.92        |
| 负债总计      | 1,303,163,411.73  | -                | - | -968,521,195.45 | 2,271,684,607.18  |
| 利率敏感度缺口   | 12,050,206,811.63 | 1,534,814,196.41 | - | -968,521,195.45 | 12,616,499,812.59 |

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               | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|------------------|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析               | 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（2024年6月30日）             | 上年度末（2023年12月31日） |
|                  | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 7,305,345.22                | 5,937,985.60      |
| 2. 市场利率上升 25 个基点 | -7,289,618.02      | -5,926,182.61               |                   |

#### 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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                 | -                   |
| 第二层次          | 9,531,356,209.44  | 7,433,323,259.27    |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 9,531,356,209.44  | 7,433,323,259.27    |

##### 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2024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和负债主要包括货币资金、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款，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不存在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                | 9,531,356,209.44  | 60.44         |
|    | 其中：债券                 | 9,531,356,209.44  | 60.44         |
|    | 资产支持证<br>券            | -                 | -             |
| 2  | 买入返售金融资产              | 1,500,836,174.51  | 9.52          |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                 | -             |
| 3  | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 4,738,729,284.82  | 30.05         |
| 4  | 其他各项资产                | -                 | -             |
| 5  | 合计                    | 15,770,921,668.77 | 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 | 9.53           |                    |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              |                    |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值的<br>比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 49,007,853.43  | 0.31               |
|    | 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    | 97 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 99 |
| 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。

### 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                 | 26.31               | 0.31                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 17.39               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 11.83               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 2.54                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 42.50               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 100.59              | 0.31                |

### 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：本基金本报告期内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              | 100,576,361.13   | 0.64          |
| 6  | 中期票据                 | -                | -             |
| 7  | 同业存单                 | 9,430,779,848.31 | 60.22         |
| 8  | 其他                   | -                | -             |
| 9  | 合计                   | 9,531,356,209.44 | 60.86         |
| 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  | 112306210 | 23 交通银行 CD210   | 3,000,000 | 298,966,879.10  | 1.91         |
| 2  | 112497494 | 24 宁波银行 CD030   | 2,000,000 | 199,748,270.15  | 1.28         |
| 3  | 112497517 | 24 重庆农村商行 CD035 | 2,000,000 | 199,746,946.83  | 1.28         |
| 4  | 112497972 | 24 南京银行 CD110   | 2,000,000 | 199,580,880.47  | 1.27         |
| 5  | 112304053 | 23 中国银行 CD053   | 2,000,000 | 199,533,763.36  | 1.27         |
| 6  | 112308171 | 23 中信银行 CD171   | 2,000,000 | 199,478,475.60  | 1.27         |
| 7  | 112492681 | 24 杭州银行 CD022   | 2,000,000 | 199,421,013.41  | 1.27         |
| 8  | 112317188 | 23 光大银行 CD188   | 2,000,000 | 199,394,215.14  | 1.27         |
| 9  | 112306202 | 23 交通银行 CD202   | 2,000,000 | 199,368,569.69  | 1.27         |
| 10 | 112413038 | 24 浙商银行 CD038   | 2,000,000 | 199,025,961.55  | 1.27         |

### 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 | 0       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0491% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0086% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0241% |

#### 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：本基金本报告期末无资产支持证券投资。

## 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

#### 【交通银行股份有限公司】

2023 年 6 月 3 日，国家金融监督管理总局对交通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 160 万元：（一）安全测试存在薄弱环节；（二）运行管理存在漏洞；（三）数据安全全管理不足；（四）灾备管理不足。

#### 【宁波银行股份有限公司】

2023 年 9 月 8 日，国家外汇管理局宁波市分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，处以警告，处以罚款 670 万元并没收违法所得 183.02 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）违反规定办理结汇、售汇业务；（三）违反规定办理资本项目资金收付；（四）违反外汇账户管理规定；（五）违反外汇登记管理规定；（六）未按照规定报送统计报表等资料。

2023 年 11 月 27 日，国家金融监督管理总局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，处以罚款 100 万元：（一）消费者个人信息管理不到位；（二）贷款“三查”不尽职；（三）押品管理不到位。

2023 年 11 月 27 日，国家金融监督管理总局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，处以罚款 520 万元：（一）监管标准化数据与 1104 数据交叉核验不一致；（二）监管标准化数据与客户风险数据交叉核验不一致；（三）监管标准化数据漏报；（四）监管标准化数据错报；（五）虚假受托支付，贷款资金长期留存借款人账户；（六）企业划型不准确。

2024 年 6 月 14 日，国家金融监督管理总局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，处以罚款 65 万元：（一）违规置换已核销贷款；（二）授信准入管理不到位。

#### 【南京银行股份有限公司】

2023 年 8 月 25 日，国家外汇管理局江苏省分局对南京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 60 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性审查；（二）未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料；（三）违反外汇登记管理规定。

**【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。

2024 年 4 月 3 日，国家外汇管理局北京市分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 40 万元，没收违法所得 0.22 万元：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。

**【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 12 月 29 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。

**【杭州银行股份有限公司】**

2024 年 1 月 9 日，国家金融监督管理总局浙江监管局对杭州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 210 万元：（一）债券承销业务与债券交易/投资业务间“防火墙”建设不到位；（二）余额包销业务未严格执行统一授信要求；（三）包销余券处置超期限；（四）结构

性存款产品设计不符合监管要求，内嵌衍生交易不真实；（五）本行贷款及贴现资金被用于购买本行结构性存款；（六）理财资金用于偿还本行贷款。

**【中国光大银行股份有限公司】**

2024 年 5 月 14 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 20 万元：投诉处理内部控制不严行为。

**【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 交通银行 CD210、24 宁波银行 CD030、24 南京银行 CD110、23 中国银行 CD053、23 中信银行 CD171、24 杭州银行 CD022、23 光大银行 CD188、23 交通银行 CD202、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 交通银行 CD210、24 宁波银行 CD030、24 南京银行 CD110、23 中国银行 CD053、23 中信银行 CD171、24 杭州银行 CD022、23 光大银行 CD188、23 交通银行 CD202、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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 7.9.4 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。

## § 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（%） |
| 321,285  | 48,746.09 | 1,238,593,179.18 | 7.91      | 14,422,795,105.58 | 92.09     |

### 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  | 个人    | 199,156,731.21 | 1.27      |
| 2  | 券商类机构 | 110,205,724.00 | 0.70      |
| 3  | 其他机构  | 88,976,225.32  | 0.57      |
| 4  | 其他机构  | 59,022,205.90  | 0.38      |
| 5  | 其他机构  | 56,813,605.55  | 0.36      |
| 6  | 其他机构  | 39,084,182.57  | 0.25      |
| 7  | 个人    | 36,220,091.28  | 0.23      |
| 8  | 个人    | 35,214,909.18  | 0.22      |
| 9  | 其他机构  | 34,914,377.18  | 0.22      |
| 10 | 其他机构  | 32,977,904.09  | 0.21      |

### 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 | 94,588,742.49 | 0.6040      |

### 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                 |

## § 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）<br>基金份额总额 | 11,173,523,306.08  |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 12,616,499,812.59  |
| 本报告期基金总申购份额                        | 192,396,354,085.08 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 189,351,465,612.91 |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | -                  |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 15,661,388,284.76  |

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。

## § 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执行委员会委员周志钢因达到法定退休年龄离任。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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施 1                  | 内容  |
|-----------------------|---|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 中信建投证券股份有限公司及相关人员   |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 1 月 3 日  |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 深交所   |
| 受到的具体措施类型             | 书面警示  |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 2024 年 1 月 3 日，深交所出具《关于对中信建投证券股份有限公司、汪浩吉、方英健的监管函》（深证函〔2024〕11 号），指出公司作为保荐人，汪浩吉、方英健作为保荐代表人，在保荐芯天下技术股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市的过程中，存在以下违规行为：未对发行人所处市场情况及同行业可比公司情况予以充分关注，未充分核查发行人对终端客户的销售情况，对发行人业绩预计情况未审慎发表专业意见并督促发行人提高信息披露质量。上述行为违反了《深圳证券交易所创业板股票发行上市审核规则》第三十条、第四十二条的规定。深交所决定对公司、汪浩吉、方英健采取书面警示的自律监管措施。 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，通过发布业务提醒、持续开展培训、加强行业学习和交流等方式，   |

|                       |  |
|-----------------------|--|
|                       | 提升从业人员投行执业能力,进一步夯实业务人员的履职意识,提高质控、内核等岗位人员的风控意识。   |
| 其他                    | 无  |
| <b>措施 2</b>           | <b>内容</b>  |
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 中信建投证券股份有限公司   |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 1 月 24 日  |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 山东证监局  |
| 受到的具体措施类型             | 出具警示函  |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 2024 年 1 月 24 日,山东证监局出具《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》((2024)13 号),指出公司存在持续督导不规范问题:2022 年 9 月 8 日,云鼎科技股份有限公司通过非公开发行股票募集资金人民币 8.68 亿元。2022 年 10 月 28 日,募集资金由募集资金专户转出,用于补充流动资金和偿还债务。山东证监局发现发行人存在相关制度不健全、使用不规范的情形。作为保荐机构,公司未能勤勉尽责、持续督导发行人完善制度、采取措施规范募集资金补充流动资金和偿还债务使用过程。上述情形违反了《上市公司监管指引第 2 号-上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第十四条、《证券发行上市保荐业务管理办法》第十六条规定,山东证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施,同时将相关情况记入证券期货市场诚信档案数据库。上述处罚中所涉行为,同时还违反《深圳证券交易所股票上市规则》第 1.4 条、第 12.1.2 条和《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 13 号——保荐业务》第三条第一款的规定,深交所于 2024 年 7 月 3 日对公司采取书面警示的自律监管措施。 |
| 管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见) | 针对上述处罚,公司整改措施如下:公司积极落实整改,通过组织工作人员深入学习相关法规、加强对发行人相关人员的持续督导培训、进一步加强对发行人募集资金使用情况的现场检查力度等方式,提高发行人规范使用募集资金的意识以及公司持续督导责任意识。  |
| 其他                    | 无  |
| <b>措施 3</b>           | <b>内容</b>  |
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 中信建投证券股份有限公司   |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 4 月 24 日  |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 广东证监局  |
| 受到的具体措施类型             | 出具警示函  |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 2024 年 4 月 24 日,广东证监局出具《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》((2024)35 号),指出公司作为格力地产股份有限公司债券“23 格地 01”的主承销商和受托管理人,咨询审计机构工作底稿留痕不足,未对发行人管理层制作访谈记录,未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告,不符合《公司债券承销业务尽职调查指引(2020 年)》第十一条、第二十一条,《公司债券受  |

|                       |   |
|-----------------------|---|
|                       | 托管理人执业行为准则（2022 年）》第十二条、第十八条等要求，违反了《公司债券发行与交易管理办法》第六条第一款的规定。广东证监局决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。前述行为同时还违反《上海证券交易所非公开发行公司债券挂牌规则（2022 年修订）》的相关规定，上交所于 2024 年 5 月 28 日对公司采取书面警示的监管措施。   |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，持续组织债券高质量执业系列培训，发布合规业务提示，梳理并细化受托管理执业要求，加强对日常执业质量评价，完善考核机制，加大内部追责，进一步提升业务人员债券执业水平和公司债券业务执业质量。  |
| 其他                    | 无   |
| <b>措施 4</b>           | <b>内容</b>   |
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 中信建投证券股份有限公司  |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 4 月 30 日   |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 北京证监局   |
| 受到的具体措施类型             | 责令增加合规检查次数  |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 2024 年 4 月 30 日，北京证监局出具《关于对中信建投证券股份有限公司采取责令增加合规检查次数的行政监管措施的决定》（〔2024〕99 号），指出公司存在以下问题：开展场外期权及自营业务不审慎，对从业人员管理不到位，公司治理不规范，反映出公司未能有效实施合规管理、风险管理和内部控制，违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法（2020 年修订）》第三条的规定。北京证监局决定对公司采取如下监管措施：责令公司就上述问题认真整改，并在监管措施决定下发之日起一年内，每 3 个月开展一次内部合规检查，根据检查情况不断完善管理制度和内部控制措施，加强对业务和人员管理，防范和控制风险，并在每次检查后 10 个工作日内向北京证监局报送合规检查报告。 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，修订场外期权及自营业务制度流程，加强从业人员管理，强化合规培训，持续完善公司内部治理，从严落实合规、风险管理和内部控制要求，并按照要求增加内部合规检查次数。  |
| 其他                    | 无   |
| <b>措施 5</b>           | <b>内容</b>   |
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 中信建投证券股份有限公司  |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 5 月 14 日   |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 上交所   |
| 受到的具体措施类型             | 监管警示  |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 2024 年 5 月 14 日，上交所出具《关于对中信建投证券股份有限公司予以监管警示的决定》（〔2024〕26 号），指出公司作为深圳中兴新材技术股份有限公司首次公开发行股票并在科创板上市申请项目的保荐人，在相关项目的保荐工作  |

|                       |   |
|-----------------------|---|
|                       | 中，存在以下保荐职责履行不到位的情形：对发行人废膜管理相关内部控制缺陷整改及运行情况的核查工作明显不到位；对发行人研发费用的核查工作明显不到位。上述行为违反了《上海证券交易所股票发行上市审核规则》第十五条、第二十七条等有关规定。上交所决定对公司采取监管警示的监管措施。  |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，通过开展风险警示教育与业务能力提升培训、细化完善业务要求等方式，进一步夯实业务人员的履职意识，提高质控、内核等岗位人员的风控意识。   |
| 其他                    | 无   |
| <b>措施 6</b>           | <b>内容</b>   |
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 中信建投证券股份有限公司及相关人员   |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 5 月 17 日   |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 江苏证监局   |
| 受到的具体措施类型             | 出具警示函   |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 2024 年 5 月 17 日，江苏证监局出具《江苏证监局关于对中信建投证券股份有限公司及张铁、张悦采取出具警示函措施的决定》（〔2024〕91 号），指出江苏常熟汽饰集团股份有限公司（以下简称常熟汽饰）2019 年公开发行可转换公司债券募集资金 9.92 亿元。按照项目立项时间和募集资金投资项目原定规划建设期，上饶项目、常熟项目、余姚项目分别应于 2020 年 1 月、2020 年 1 月和 2020 年 7 月完成建设，但上述项目均未如期完成建设。常熟汽饰未在历次募集资金存放和实际使用情况的专项报告中披露上述项目实施进度未达计划进度的情况，风险提示不充分，信息披露不真实。公司作为保荐机构，未能勤勉尽责履行持续督导义务，未发现上述问题，且在历次关于常熟汽饰募集资金实际使用情况的专项核查报告中发表了不真实的核查意见。公司上述行为违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》、《证券发行上市保荐业务管理办法》、《上市公司信息披露管理办法》等制度的相关规定。张铁、张悦作为持续督导工作的签字保荐代表人，是上述违规行为的直接责任人员。江苏证监局决定对公司及张铁、张悦采取出具警示函的监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，责令相关人员反思学习、提高执业谨慎度，全面梳理发行人募集资金使用情况，督促发行人自查整改，增强持续督导工作力度，持续督促常熟汽饰完善信息披露，进一步强化公司内部培训学习，提升合规、责任和风险意识。  |
| 其他                    | 无   |
| <b>措施 7</b>           | <b>内容</b>   |
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 中信建投证券股份有限公司  |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 6 月 19 日   |

|                       |  |
|-----------------------|--|
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 上交所  |
| 受到的具体措施类型             | 监管警示   |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 2024 年 6 月 19 日，上交所出具《关于对中信建投证券股份有限公司予以监管警示的决定》（〔2024〕36 号），指出上交所在审核大参林医药集团股份有限公司向特定对象发行股票的申请过程中，发行人申请撤回申报材料，上交所于 2024 年 1 月 31 日作出终止审核决定。公司作为项目的保荐人，存在以下保荐职责履行不到位的情形：茂名大参林连锁药店有限公司（以下简称茂名子公司）为发行人全资子公司，柯金龙为发行人实际控制人之一兼时任董事（任职期间为 2016 年 8 月 18 日至 2024 年 2 月 9 日）。2023 年 8 月 18 日，茂名子公司收到广东省茂名市监察委员会下发的《立案通知书》，载明茂名子公司受到立案调查；2023 年 8 月 24 日，收到广东省茂名市公安局电白分局下发的《拘留通知书》，载明柯金龙受到刑事拘留；2023 年 11 月 23 日，收到广东省茂名市电白区人民检察院《起诉书》，载明茂名子公司、柯金龙因涉嫌单位行贿罪被依法提起公诉。上述事项发生后，保荐人未按规定及时向上交所报告并申请审核中止，直至 2024 年 3 月 14 日，发行人告知保荐人，保荐人才向上交所报告上述事项。保荐人在项目保荐期间未能勤勉尽责，未能及时发现并向上交所报告相关事项。上述行为违反了《上海证券交易所上市公司证券发行上市审核规则》第十七条、第十九条及《上海证券交易所股票发行上市审核规则》第五十四条、第六十条等有关规定。上交所决定对公司采取监管警示的监管措施。 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，通过进一步完善核查程序、持续开展业务培训、发布合规提醒等方式，提升从业人员执业能力和敏锐度，进一步提高保荐工作质量。   |
| 其他                    | 无  |

注：本报告期内管理人积极按要求整改受稽查或处罚等事项。但相关受稽查或处罚的事项与管理人资产管理业务及管理的资产管理计划无关。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

### 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 | - | -   | 219,718.07 | 100.00 | - |

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序：

- (1) 经营行为规范；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用本管理人的交易单元。

3. 报告期内本基金未变更交易单元。

### 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 | -    | -                | 7,407,415.00 | 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货币市场基金收益支付公告       | 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 | 2024 年 1 月 3 日  |
| 2  | 中信建投证券股份有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告 | 上海证券报                       | 2024 年 1 月 22 日 |
| 3  | 中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告    | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站       | 2024 年 1 月 22 日 |
| 4  | 中信建投证券股份有限公司旗下基金                     | 上海证券报                       | 2024 年 3 月 29 日 |

|    |  |                             |                 |
|----|--|-----------------------------|-----------------|
|    | 2023 年年度报告提示性公告                        |                             |                 |
| 5  | 中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划 2023 年年度报告          | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站       | 2024 年 3 月 29 日 |
| 6  | 中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划货币市场基金收益支付公告         | 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 | 2024 年 4 月 2 日  |
| 7  | 中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划产品资料概要更新             | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站       | 2024 年 4 月 19 日 |
| 8  | 中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划更新招募说明书(2024 年第 1 号) | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站       | 2024 年 4 月 19 日 |
| 9  | 中信建投证券股份有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告   | 上海证券报                       | 2024 年 4 月 23 日 |
| 10 | 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      | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站       | 2024 年 4 月 23 日 |
| 11 | 中信建投证券股份有限公司关于董事变更的公告                  | 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 | 2024 年 5 月 7 日  |
| 12 | 中信建投证券股份有限公司高级管理人员变更公告                 | 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 | 2024 年 5 月 25 日 |
| 13 | 中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划产品资料概要更新             | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站       | 2024 年 6 月 28 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

- 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

2024 年 8 月 30 日