

# 创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 26 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 基金投资顾问.....	5
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	37
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	44
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	

.....	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	44
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例 .....	45
7.13 投资组合报告附注 .....	45
§8 基金份额持有人信息 .....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.3 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 .....	47
§9 开放式基金份额变动 .....	47
§10 重大事件揭示 .....	48
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
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 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
§12 备查文件目录 .....	51
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金	
基金简称	创金合信群力一年定开混合（MOM）	
基金主代码	011367	
交易代码	011367	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 9 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	120,842,886.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信群力一年定开混合（MOM）A	创金合信群力一年定开混合（MOM）C
下属分级基金的交易代码	011367	011368
报告期末下属分级基金的份额总额	106,388,622.52 份	14,454,263.82 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是管理人中管理人基金，基金管理人构建复合维度的资产配置体系，通过资产配置和优选不同投资风格、业绩良好的投资顾问，在分散化投资前提下合理控制投资组合风险并保持基金资产良好流动性，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。（一）封闭期内的投资策略。1、资产配置策略：基金管理人构建复合维度的资产配置体系，通过研究政策导向下的产业周期、消费结构等宏观基本面因素，同时考虑企业或资产本身的经营与运行质量、估值水平和交易结构等信息，进行大类资产配置。2、股票投资策略：（1）A 股股票投资策略。多种理念方式精选个股，通过企业价值的快速成长或重新估值等方式实现投资资产的增值；（2）港股通标的股票投资策略。本基金将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。3、固定收益类资产投资策略：（1）债券投资策略；（2）资产支持证券投资策略；（3）可转换债券投资策略。4、衍生品投资策略。5、转融通证券出借业务。（二）开放期内的投资策略。本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应对当时市场条件下的赎回要求。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中证短融 AAA 指数收益率×30%+恒生中国企业指数收益率（经汇率调整后）×5%
风险收益特征	本基金为管理人中管理人基金，具备管理人中管理人基金特有的风险收

	<p>益特征，具有多元管理、多元资产、多元风格的特征，有利于均衡配置风险，减少投资组合受某类资产波动的影响，降低单一资产和单一风格方面的风险集中度。本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。</p> <p>本基金如投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及香港证券市场的风险。本基金在运作过程中将参考各投资顾问的投资建议进行投资操作，各投资顾问的研究水平和管理水平会影响本基金收益水平；同时本基金对投资顾问的筛选很大程度上依靠过往业绩和公开披露的信息，但投资顾问的过往业绩不能代表其未来表现，有可能影响基金投资业绩。</p>
--	---

## 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	创金合信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95559
传真	0755-25832571	021-62701216
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道5035华润前海大厦A座36-38楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	518052	200336
法定代表人	钱龙海	任德奇

## 2.4 基金投资顾问

序号	投资顾问名称	是否与基金管理人存在关联关系	是否与其他投资顾问存在关联关系
1	大成基金管理有限公司	否	否
2	永赢基金管理有限公司	否	否
3	信达澳亚基金管理有限公司	否	否
4	惠升基金管理有限责任公司	否	否

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

§ 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

1、创金合信群力一年定开混合（MOM）A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,490,325.06
本期利润	1,951,088.08
加权平均基金份额本期利润	0.0165
本期加权平均净值利润率	1.72%
本期基金份额净值增长率	2.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-13,449,001.13
期末可供分配基金份额利润	-0.1264
期末基金资产净值	103,065,451.23
期末基金份额净值	0.9688
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.12%

2、创金合信群力一年定开混合（MOM）C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	387,962.53
本期利润	149,259.71
加权平均基金份额本期利润	0.0089
本期加权平均净值利润率	0.96%
本期基金份额净值增长率	2.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,361,765.29
期末可供分配基金份额利润	-0.1634

期末基金资产净值	13,411,476.55
期末基金份额净值	0.9279
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-7.21%

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信群力一年定开混合（MOM）A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标准 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	0.98%	0.44%	1.82%	0.42%	-0.84%	0.02%
过去三个月	-0.80%	1.13%	1.18%	0.81%	-1.98%	0.32%
过去六个月	2.53%	1.06%	1.37%	0.74%	1.16%	0.32%
过去一年	16.26%	1.17%	11.77%	0.96%	4.49%	0.21%
过去三年	-3.17%	0.92%	-4.27%	0.78%	1.10%	0.14%
自基金合同 生效起至今	-3.12%	0.90%	-11.67%	0.80%	8.55%	0.10%

创金合信群力一年定开混合（MOM）C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标准 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	0.89%	0.44%	1.82%	0.42%	-0.93%	0.02%
过去三个月	-1.06%	1.14%	1.18%	0.81%	-2.24%	0.33%
过去六个月	2.02%	1.06%	1.37%	0.74%	0.65%	0.32%
过去一年	15.11%	1.17%	11.77%	0.96%	3.34%	0.21%
过去三年	-6.04%	0.92%	-4.27%	0.78%	-1.77%	0.14%
自基金合同 生效起至今	-7.21%	0.90%	-11.67%	0.80%	4.46%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基



## 准收益率变动的比较

创金合信群力一年定开混合（MOM）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年03月09日-2025年06月30日)



创金合信群力一年定开混合（MOM）C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年03月09日-2025年06月30日)



## § 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

创金合信基金管理有限公司于 2014 年 7 月 2 日获得中国证监会核准设立的批复，2014 年 7 月 9 日成立，注册地为深圳市。目前创金合信基金注册资本为 26,096 万元人民币，第一创业证券股份有限公司出资比例为 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）出资比例

为 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.63596%。

创金合信基金始终坚持“客户利益至上”，做客户投资理财的亲密伙伴。

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		
冯瑞玲	本基金基金经理	2024 年 7 月 13 日	-	8	冯瑞玲女士，中国国籍，中国人民大学硕士。2016 年 7 月加入中意资产管理有限责任公司，历任组合管理部资产配置专员、组合管理分析师，2018 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任量化指数与国际部、FOF 投资一部研究员，现任基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期；

2、证券从业年限的含义遵从《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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 上半年，国内权益市场整体表现较好，呈现明显的结构分化，上证指数上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，万得全 A 上涨 5.83%，恒生指数上涨 20%。时间维度上看，权益市场上半年主要经历了年初 DeepSeek 为代表的大模型技术突破带来的科技板块估值重塑，和 4 月海外关税政策冲击引发市场短期剧烈调整后，央行降准、国家队增持等托底政策迅速落地带动市场预期修复的两次收益机会；结构层面上，上半年权益收益锐度最高的几个方向，分别是年初的恒生科技股价值重估、基本面和政策双驱动的创新药和海外 AI 算力链的高景气机会。本产品配置层面，维持以价值风格为主，包括竞争壁垒较强的行业龙头价值品种和红利低波风格，适当配置较小比例质量和科技成长风格，在控制风险的前提下，保留一定的高赔率弹性仓位；操作上在 3 月中旬小比例止盈调减恒生科技股占比较高的均衡成长型投顾。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信群力一年定开混合（MOM）A 基金份额净值为 0.9688 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.53%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%；截至本报告期末创金合信群力一年定开混合（MOM）C 基金份额净值为 0.9279 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.02%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，对权益市场整体保持相对乐观。近期，除融资余额再创新高以外，出现了公募债基较大规模赎回现象，结合权益市场过去较好表现，合理推断权益市场有场外增量资金进场，在低利率背景下的股债风险溢价仍处于较高水平，即权益市场仍存在配置性价比，同期居民存款余额以高斜率增速累积到 162 万亿，在资金充足和资产比价效应下，未来权益市场的增量资金仍然有较大空间，持续看好权益资产的战略配置价值。市场当前的风险点主要集中在宏观基本面压力和微观交易结构层面，具体来讲，关税政策仍存在一定不确定性，已实行的关税政策也对上半年出口造成了明显冲击，同时近期经济数据显示内需和投资增速均有回落，传导到企业盈利和居民收入层面仍然面临较大压力，而“反内卷”政策的落地执行力度和效果还需要进一步数据验证；交易层面部分板块结构显示出较高拥挤度，高拥挤状态下随时可能触发情绪性调整。本组合将继续以长期配置为主，价值风格作底仓，关注成长风格阶段性调整后较高胜率的收益机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金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，基金托管人在创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，创金合信基金管理有限公司在创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由创金合信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金的中期报告中财务指标、净

值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金  
报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	15,880,202.92	11,234,659.04
结算备付金		4,310,884.67	3,189,647.27
存出保证金		310,554.11	8,869.06
交易性金融资产	6.4.7.2	96,693,167.51	123,388,975.14
其中：股票投资		96,693,167.51	123,388,975.14
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		219,942.61	284,568.17
应收股利		54,766.54	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		117,469,518.36	138,106,718.68
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		710,684.62	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		114,056.62	137,953.53
应付托管费		19,009.45	22,992.24
应付销售服务费		10,948.11	14,174.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	137,891.78	179,124.09
负债合计		992,590.58	354,243.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	120,842,886.34	146,482,521.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-4,365,958.56	-8,730,046.29
净资产合计		116,476,927.78	137,752,474.71
负债和净资产总计		117,469,518.36	138,106,718.68

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，创金合信群力一年定开混合（MOM）A 份额净值 0.9688 元，基金份额总额 106,388,622.52 份；创金合信群力一年定开混合（MOM）C 份额净值 0.9279 元，基金份额总额 14,454,263.82 份；总份额合计 120,842,886.34 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金  
本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,169,514.59	3,381,144.20
1.利息收入		52,622.54	60,865.50
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,821.52	52,758.15
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		20,801.02	8,107.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		4,894,831.85	-9,218,766.10

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,448,348.77	-10,938,456.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	253,654.43
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-55.74	-118,820.40
股利收益	6.4.7.15	1,446,538.82	1,584,856.19
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,777,939.80	12,539,044.48
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	-	0.32
减：二、营业总支出		1,069,166.80	1,147,786.60
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	767,408.43	822,058.03
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	127,901.40	137,009.75
3.销售服务费	6.4.10.2.3	76,905.69	86,629.28
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	1,330.98
8.其他费用	6.4.7.19	96,951.28	100,758.56
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		2,100,347.79	2,233,357.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		2,100,347.79	2,233,357.60
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		2,100,347.79	2,233,357.60

### 6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	146,482,521.00	-	-8,730,046.29	137,752,474.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	146,482,521.00	-	-8,730,046.29	137,752,474.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,639,634.66	-	4,364,087.73	-21,275,546.93
（一）、综合收益总额	-	-	2,100,347.79	2,100,347.79
（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）	-25,639,634.66	-	2,263,739.94	-23,375,894.72
其中：1.基金申购款	88,804.94	-	-8,145.72	80,659.22
2.基金赎回款	-25,728,439.60	-	2,271,885.66	-23,456,553.94
（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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	120,842,886.34	-	-4,365,958.56	116,476,927.78
项目	上年度可比期间 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	188,239,721.78	-	-34,039,787.33	154,199,934.45
加：会计政策变更	-	-	-	-



更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	188,239,721.78	-	-34,039,787.33	154,199,934.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-41,757,200.78	-	9,107,511.52	-32,649,689.26
（一）、综合收益总额	-	-	2,233,357.60	2,233,357.60
（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）	-41,757,200.78	-	6,874,153.92	-34,883,046.86
其中：1.基金申购款	119,206.57	-	-22,492.81	96,713.76
2.基金赎回款	-41,876,407.35	-	6,896,646.73	-34,979,760.62
（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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	146,482,521.00	-	-24,932,275.81	121,550,245.19

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：

\_\_\_\_苏彦祝\_\_\_\_                      \_\_\_\_奚胜田\_\_\_\_                      \_\_\_\_吉祥\_\_\_\_  
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

创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2020年12月23日证监许可[2020]3613号文《关于准予创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人(MOM)证券投资

资基金注册的批复》核准募集。本基金由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2021 年 3 月 9 日生效。本基金为契约型、定期开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 337,637,300.17 份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”),投资顾问为大成基金管理有限公司、永赢基金管理有限公司、信达澳银基金管理有限公司以及惠升基金管理有限公司。

本基金于 2021 年 2 月 18 日至 2021 年 3 月 4 日募集,募集期间净认购资金人民币 337,482,845.96 元,认购资金在募集期间产生的利息人民币 154,454.21 元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 337,637,300.17 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第 2100095 号验资报告。

根据《创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金招募说明书》,本基金根据所收取费用的差异等因素,将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费,但不计提销售服务费的基金份额类别为 A 类基金份额;不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用不同,本基金不同类别的基金份额将分别计算并公告各类基金份额的基金份额净值,计算公式如下: T 日某类基金份额的基金份额净值=T 日该类基金份额的基金资产净值/T 日该类基金份额的基金份额余额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、永续债)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金在封闭期内可参与转融通证券出借业务。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 60%(其中,投资港股通标的股票占股票资产的 0-50%),但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前 1 个月、开放期及开放期结束后 1 个月内,基金投资不受上述股票投资比例限制。在开放期内,每个交易日日终,在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;封闭期内,本基金不受上述 5%的限制,但如有衍生品投资,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票

期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 65%+中证短融 AAA 指数收益率 $\times$ 30%+恒生中国企业指数收益率(经汇率调整后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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。

#### 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 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46

号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《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[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39 号《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 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H

股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	15,880,202.92
等于：本金	15,880,066.40
加：应计利息	136.52
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	15,880,202.92

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	89,280,160.15	-	96,693,167.51	7,413,007.36

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		89,280,160.15	-	96,693,167.51	7,413,007.36

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,329,600.00	-	-	-
--股指期货	2,329,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,329,600.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2509	IC2509	1.00	1,155,160.00	2,880.00
IF2509	IF2509	1.00	1,166,100.00	-11,220.00
合计				-8,340.00
减：可抵销期货暂收款				-8,340.00
净额				-

#### 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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金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

本基金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 2025 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	50,240.50
其中：交易所市场	50,240.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,651.28
合计	137,891.78

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信群力一年定开混合（MOM）A		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,815,905.44	127,815,905.44
本期申购	66,473.78	66,473.78
本期赎回（以“-”号填列）	-21,493,756.70	-21,493,756.70
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	106,388,622.52	106,388,622.52

创金合信群力一年定开混合（MOM）C		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,666,615.56	18,666,615.56
本期申购	22,331.16	22,331.16
本期赎回（以“-”号填列）	-4,234,682.90	-4,234,682.90
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	14,454,263.82	14,454,263.82

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

创金合信群力一年定开混合（MOM）A
--------------------

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,191,058.06	13,149,982.69	-7,041,075.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-20,191,058.06	13,149,982.69	-7,041,075.37
本期利润	3,490,325.06	-1,539,236.98	1,951,088.08
本期基金份额交易产生的变动数	3,251,731.87	-1,484,915.87	1,766,816.00
其中：基金申购款	-10,009.47	4,515.64	-5,493.83
基金赎回款	3,261,741.34	-1,489,431.51	1,772,309.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,449,001.13	10,125,829.84	-3,323,171.29

创金合信群力一年定开混合（MOM）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,530,126.74	1,841,155.82	-1,688,970.92
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,530,126.74	1,841,155.82	-1,688,970.92
本期利润	387,962.53	-238,702.82	149,259.71
本期基金份额交易产生的变动数	780,398.92	-283,474.98	496,923.94
其中：基金申购款	-4,149.24	1,497.35	-2,651.89
基金赎回款	784,548.16	-284,972.33	499,575.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,361,765.29	1,318,978.02	-1,042,787.27

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,903.63
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	25,888.56
其他	29.33
合计	31,821.52

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	------------------------------------



股票投资收益——买卖股票差价收入	3,448,348.77
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,448,348.77

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	101,004,833.05
减：卖出股票成本总额	97,395,478.43
减：交易费用	161,005.85
买卖股票差价收入	3,448,348.77

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
期货投资	-55.74

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,446,538.82

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,446,538.82

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,769,599.80
——股票投资	-1,769,599.80
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-8,340.00
——权证投资	-
——期货投资	-8,340.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,777,939.80

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
合计	96,951.28

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本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
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
大成基金管理有限公司	基金投资顾问
永赢基金管理有限公司	基金投资顾问
信达澳亚基金管理有限公司	基金投资顾问
惠升基金管理有限公司	基金投资顾问

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

本基金于本报告期末及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	767,408.43	822,058.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	359,560.08	381,586.09
应支付基金管理人的净管理费	407,848.35	440,471.94
应支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.2%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	127,901.40	137,009.75

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信群力一年定期混合（MOM）A	创金合信群力一年定期混合（MOM）C	合计
创金合信直销	-	1.81	1.81
第一创业证券	-	699.05	699.05
交通银行	-	410.30	410.30
合计	-	1,111.16	1,111.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		

	创金合信群力一年定 开混合（MOM）A	创金合信群力一年定 开混合（MOM）C	合计
创金合信直销	-	2.75	2.75
第一创业证券	-	894.94	894.94
交通银行	-	573.68	573.68
合计	-	1,471.37	1,471.37

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 1% / 当年天数。  
销售服务费费率优惠（如有），请见产品公告。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 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

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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

交通银行股份有 限公司	15,880,202.92	5,903.63	13,045,825.92	16,659.37
----------------	---------------	----------	---------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业存款利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

**6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2025 年 06 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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金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**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

**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**

本基金在日常经营活动中涉及的金融工具风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、合规与风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行股份有限公司，因而与货币资金相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金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，有效保障基金持有人利益。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金主动投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金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基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：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，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金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。

本基金的基金管理人定期对本基金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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	15,880,202.92	-	-	-	15,880,202.92
结算备付金	4,310,884.67	-	-	-	4,310,884.67
存出保证金	310,554.11	-	-	-	310,554.11
交易性金融资产	-	-	-	96,693,167.51	96,693,167.51
应收股利	-	-	-	54,766.54	54,766.54
应收清算款	-	-	-	219,942.61	219,942.61
资产总计	20,501,641.7	-	-	96,967,876.6	117,469,518.3

	0			6	6
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	114,056.62	114,056.62
应付托管费	-	-	-	19,009.45	19,009.45
应付销售服务费	-	-	-	10,948.11	10,948.11
应付清算款	-	-	-	710,684.62	710,684.62
其他负债	-	-	-	137,891.78	137,891.78
负债总计	-	-	-	992,590.58	992,590.58
利率敏感度缺口	20,501,641.70	-	-	95,975,286.08	116,476,927.78
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,234,659.04	-	-	-	11,234,659.04
结算备付金	3,189,647.27	-	-	-	3,189,647.27
存出保证金	8,869.06	-	-	-	8,869.06
交易性金融资产	-	-	-	123,388,975.14	123,388,975.14
应收清算款	-	-	-	284,568.17	284,568.17
资产总计	14,433,175.37	-	-	123,673,543.31	138,106,718.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	137,953.53	137,953.53
应付托管费	-	-	-	22,992.24	22,992.24
应付销售服务费	-	-	-	14,174.11	14,174.11
其他负债	-	-	-	179,124.09	179,124.09
负债总计	-	-	-	354,243.97	354,243.97
利率敏感度缺口	14,433,175.37	-	-	123,319,299.34	137,752,474.71

注：表中所示为本基金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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	10,526,616.05	-	-	-	10,526,616.05
应收股利	-	54,766.54	-	-	-	54,766.54
资产合计	-	10,581,382.59	-	-	-	10,581,382.59
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	10,581,382.59	-	-	-	10,581,382.59

项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	13,432,162.05	-	-	-	13,432,162.05
资产合计	-	13,432,162.05	-	-	-	13,432,162.05
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	13,432,162.05	-	-	-	13,432,162.05

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（ 2025 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	529,069.13	671,608.10
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-529,069.13	-671,608.10

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	96,693,167.51	83.01	123,388,975.14	89.57
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	96,693,167.51	83.01	123,388,975.14	89.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（ 2025 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1.业绩比较基准上升 5%	6,244,444.76	6,420,545.32
	2.业绩比较基准下降 5%	-6,244,444.76	-6,420,545.32

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	96,693,167.51
第二层次	-
第三层次	-
合计	96,693,167.51

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2024 年 12 月 31 日：同)。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 报告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	权益投资	96,693,167.51	82.31
	其中：股票	96,693,167.51	82.31
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	20,191,087.59	17.19
7	其他各项资产	585,263.26	0.50
8	合计	117,469,518.36	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 10,526,616.05 元，占净值比为 9.04%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	124,012.00	0.11
B	采矿业	1,792,308.00	1.54
C	制造业	61,550,874.63	52.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,117,550.00	1.82
E	建筑业	484,951.00	0.42
F	批发和零售业	712,351.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	2,903,600.00	2.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,426,890.03	2.94
J	金融业	10,000,182.80	8.59
K	房地产业	1,662,832.00	1.43
L	租赁和商务服务业	108,295.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	895,709.00	0.77

N	水利、环境和公共设施管理业	199,380.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	187,616.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	86,166,551.46	73.98

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	878,207.85	0.75
能源	1,906,850.97	1.64
工业	2,026,170.51	1.74
信息技术	945,569.04	0.81
通讯业务	4,769,817.68	4.10
合计	10,526,616.05	9.04

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	H00941	中国移动	48,500	3,852,395.98	3.31
1	600941	中国移动	13,000	1,463,150.00	1.26
2	000333	美的集团	71,300	5,147,860.00	4.42
3	002595	豪迈科技	83,700	4,956,714.00	4.26
4	000651	格力电器	105,500	4,739,060.00	4.07
5	600690	海尔智家	168,400	4,172,952.00	3.58
6	603337	杰克股份	107,900	3,871,452.00	3.32
7	600660	福耀玻璃	66,300	3,779,763.00	3.25
8	600741	华域汽车	212,000	3,741,800.00	3.21
9	600031	三一重工	174,100	3,125,095.00	2.68
10	000739	普洛药业	203,200	2,844,800.00	2.44
11	600298	安琪酵母	68,800	2,419,696.00	2.08
12	H00001	长和	46,000	2,026,170.51	1.74
13	603296	华勤技术	23,800	1,920,184.00	1.65
14	H00883	中国海洋石油	118,000	1,906,850.97	1.64
15	688019	安集科技	9,798	1,487,336.40	1.28
16	H00700	腾讯控股	2,000	917,421.70	0.79

17	688286	敏芯股份	12,644	893,804.36	0.77
18	H02015	理想汽车一 W	9,000	878,207.85	0.75
19	002484	江海股份	40,300	825,747.00	0.71
20	603986	兆易创新	6,400	809,792.00	0.70
21	300750	宁德时代	3,100	781,882.00	0.67
22	000425	徐工机械	90,300	701,631.00	0.60
23	300679	电连技术	15,400	698,852.00	0.60
24	300446	航天智造	38,700	670,284.00	0.58
25	601318	中国平安	11,600	643,568.00	0.55
26	301004	嘉益股份	9,660	639,781.80	0.55
27	688002	睿创微纳	8,759	610,677.48	0.52
28	002138	顺络电子	21,100	593,332.00	0.51
29	002241	歌尔股份	25,400	592,328.00	0.51
30	601899	紫金矿业	29,400	573,300.00	0.49
31	603950	长源东谷	22,500	563,175.00	0.48
32	H02382	舜宇光学科 技	8,900	562,869.22	0.48
33	603486	科沃斯	9,000	524,070.00	0.45
34	605196	华通线缆	29,700	523,017.00	0.45
35	600958	东方证券	53,700	519,816.00	0.45
36	300806	斯迪克	31,200	514,800.00	0.44
37	001914	招商积余	41,600	514,592.00	0.44
38	002683	广东宏大	15,100	512,494.00	0.44
39	001979	招商蛇口	58,400	512,168.00	0.44
40	600036	招商银行	11,000	505,450.00	0.43
41	600048	保利发展	59,300	480,330.00	0.41
42	601187	厦门银行	68,800	467,152.00	0.40
43	002967	广电计量	26,400	464,376.00	0.40
44	688377	迪威尔	18,878	450,617.86	0.39
45	301383	天键股份	10,800	445,824.00	0.38
46	688213	思特威	4,361	445,781.42	0.38
47	601601	中国太保	11,800	442,618.00	0.38
48	300416	苏试试验	30,100	431,333.00	0.37
49	600900	长江电力	14,100	424,974.00	0.36
50	600710	苏美达	42,900	412,269.00	0.35
51	H01810	小米集团一 W	7,000	382,699.82	0.33
52	601872	招商轮船	59,600	373,096.00	0.32
53	603112	华翔股份	22,500	372,150.00	0.32
54	300922	天秦装备	13,300	371,602.00	0.32
55	300207	欣旺达	18,400	369,104.00	0.32
56	688111	金山办公	1,285	359,864.25	0.31



57	603816	顾家家居	13,900	354,728.00	0.30
58	600160	巨化股份	12,000	344,160.00	0.30
59	688141	杰华特	9,928	323,454.24	0.28
60	600919	江苏银行	25,900	309,246.00	0.27
61	603508	思维列控	11,500	304,520.00	0.26
62	300408	三环集团	9,000	300,600.00	0.26
63	000429	粤高速 A	22,500	299,925.00	0.26
64	603833	欧派家居	5,300	299,185.00	0.26
65	002690	美亚光电	17,600	296,912.00	0.25
66	002870	香山股份	9,400	296,194.00	0.25
67	600642	申能股份	34,300	294,980.00	0.25
68	002948	青岛银行	59,100	294,318.00	0.25
69	002966	苏州银行	33,500	294,130.00	0.25
70	600548	深高速	27,800	291,066.00	0.25
71	601169	北京银行	41,300	282,079.00	0.24
72	600350	山东高速	26,300	280,358.00	0.24
73	601006	大秦铁路	42,300	279,180.00	0.24
74	688595	芯海科技	7,453	278,667.67	0.24
75	601229	上海银行	26,200	277,982.00	0.24
76	601166	兴业银行	11,800	275,412.00	0.24
77	601000	唐山港	66,100	268,366.00	0.23
78	601077	渝农商行	37,500	267,750.00	0.23
79	600030	中信证券	9,600	265,152.00	0.23
80	601009	南京银行	21,700	252,154.00	0.22
81	600016	民生银行	53,000	251,750.00	0.22
82	601398	工商银行	32,800	248,952.00	0.21
83	601998	中信银行	29,000	246,500.00	0.21
84	601288	农业银行	40,800	239,904.00	0.21
85	002807	江阴银行	50,100	237,975.00	0.20
86	600418	江淮汽车	5,900	236,531.00	0.20
87	600461	洪城环境	24,500	236,180.00	0.20
88	601939	建设银行	24,900	235,056.00	0.20
89	600377	宁沪高速	15,300	234,702.00	0.20
90	601963	重庆银行	21,500	233,490.00	0.20
91	601211	国泰海通	12,100	231,836.00	0.20
92	601818	光大银行	55,700	231,155.00	0.20
93	600015	华夏银行	29,000	229,390.00	0.20
94	002327	富安娜	30,100	223,342.00	0.19
95	603920	世运电路	7,300	222,723.00	0.19
96	601577	长沙银行	22,300	221,662.00	0.19
97	601988	中国银行	39,100	219,742.00	0.19
98	688150	莱特光电	8,849	218,747.28	0.19
99	600901	江苏金租	35,600	215,736.00	0.19

100	601857	中国石油	25,000	213,750.00	0.18
101	688225	亚信安全	10,368	211,403.52	0.18
102	001965	招商公路	17,500	210,000.00	0.18
103	600008	首创环保	68,600	207,172.00	0.18
104	601088	中国神华	5,000	202,700.00	0.17
105	603323	苏农银行	36,080	202,408.80	0.17
106	603379	三美股份	4,200	202,104.00	0.17
107	002839	张家港行	44,900	202,050.00	0.17
108	601658	邮储银行	36,900	201,843.00	0.17
109	600000	浦发银行	14,300	198,484.00	0.17
110	688590	新致软件	9,629	197,779.66	0.17
111	600694	大商股份	10,560	195,888.00	0.17
112	601298	青岛港	22,500	195,525.00	0.17
113	601668	中国建筑	33,500	193,295.00	0.17
114	600820	隧道股份	31,200	190,320.00	0.16
115	601098	中南传媒	14,300	187,616.00	0.16
116	601997	贵阳银行	29,500	184,080.00	0.16
117	600887	伊利股份	6,600	184,008.00	0.16
118	003005	竞业达	9,100	183,911.00	0.16
119	002032	苏泊尔	3,500	183,365.00	0.16
120	002937	兴瑞科技	11,000	182,820.00	0.16
121	600098	广州发展	28,500	178,125.00	0.15
122	300115	长盈精密	8,300	177,620.00	0.15
123	601319	中国人保	20,200	175,942.00	0.15
124	688433	华曙高科	4,771	175,334.25	0.15
125	600177	雅戈尔	24,000	175,200.00	0.15
126	600967	内蒙一机	9,000	174,150.00	0.15
127	600332	白云山	6,400	168,704.00	0.14
128	600028	中国石化	29,800	168,072.00	0.14
129	600908	无锡银行	26,500	167,215.00	0.14
130	600269	赣粤高速	32,700	165,462.00	0.14
131	600064	南京高科	20,200	155,742.00	0.13
132	600572	康恩贝	35,300	154,614.00	0.13
133	600928	西安银行	39,100	153,272.00	0.13
134	601860	紫金银行	50,600	151,800.00	0.13
135	000623	吉林敖东	8,800	149,160.00	0.13
136	301377	鼎泰高科	4,100	147,436.00	0.13
137	688123	聚辰股份	1,779	144,081.21	0.12
138	600674	川投能源	8,700	139,548.00	0.12
139	600236	桂冠电力	22,100	138,567.00	0.12
140	600018	上港集团	23,600	134,756.00	0.12
141	603186	华正新材	4,300	129,774.00	0.11
142	600598	北大荒	8,600	124,012.00	0.11

143	601163	三角轮胎	8,800	123,640.00	0.11
144	601688	华泰证券	6,900	122,889.00	0.11
145	600968	海油发展	29,900	121,992.00	0.10
146	600886	国投电力	7,900	116,446.00	0.10
147	000685	中山公用	13,100	115,018.00	0.10
148	601827	三峰环境	13,300	111,720.00	0.10
149	600755	厦门国贸	17,900	108,295.00	0.09
150	603108	润达医疗	5,900	104,194.00	0.09
151	600050	中国联通	19,300	103,062.00	0.09
152	301041	金百泽	4,000	102,800.00	0.09
153	603501	豪威集团	800	102,120.00	0.09
154	688502	茂莱光学	355	102,119.30	0.09
155	003816	中国广核	27,900	101,556.00	0.09
156	600170	上海建工	42,400	101,336.00	0.09
157	300606	金太阳	5,100	100,572.00	0.09
158	002736	国信证券	8,700	100,224.00	0.09
159	002460	赣锋锂业	2,900	97,933.00	0.08
160	600717	天津港	21,400	97,584.00	0.08
161	002837	英维克	3,120	92,695.20	0.08
162	000598	兴蓉环境	12,800	92,288.00	0.08
163	601766	中国中车	12,500	88,000.00	0.08
164	600323	瀚蓝环境	3,600	87,660.00	0.08
165	002993	奥海科技	2,000	82,940.00	0.07
166	001309	德明利	700	82,838.00	0.07
167	688009	中国通号	15,800	81,212.00	0.07
168	600352	浙江龙盛	7,900	80,264.00	0.07
169	688343	云天励飞	1,497	73,981.74	0.06
170	600125	铁龙物流	13,000	73,580.00	0.06
171	601985	中国核电	7,800	72,696.00	0.06
172	000528	柳工	7,300	70,153.00	0.06
173	688519	南亚新材	1,468	65,766.40	0.06
174	600104	上汽集团	4,000	64,200.00	0.06
175	605133	嵘泰股份	1,300	57,304.00	0.05
176	603809	豪能股份	3,656	55,936.80	0.05
177	603119	浙江荣泰	1,100	50,864.00	0.04
178	688157	松井股份	1,237	49,331.56	0.04
179	688615	合合信息	300	47,373.00	0.04
180	002273	水晶光电	1,700	33,949.00	0.03
181	002179	中航光电	650	26,234.00	0.02
182	605068	明新旭腾	1,100	19,767.00	0.02
183	603659	璞泰来	1,000	18,780.00	0.02
184	688515	裕太微	187	17,129.20	0.01
185	002706	良信股份	1,900	16,929.00	0.01

186	688320	禾川科技	14	662.06	0.00
-----	--------	------	----	--------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	H00941	中国移动	3,859,971.17	2.80
2	600941	中国移动	492,505.00	0.36
3	000333	美的集团	4,330,890.00	3.14
4	600690	海尔智家	4,145,143.00	3.01
5	002595	豪迈科技	3,759,147.00	2.73
6	600660	福耀玻璃	3,717,230.00	2.70
7	000739	普洛药业	2,989,270.00	2.17
8	600741	华域汽车	2,907,280.00	2.11
9	600298	安琪酵母	2,300,994.00	1.67
10	H00883	中国海洋石油	2,051,952.41	1.49
11	H00001	长和	1,877,127.15	1.36
12	300750	宁德时代	789,694.00	0.57
13	000680	山推股份	756,067.00	0.55
14	301004	嘉益股份	752,775.00	0.55
15	002241	歌尔股份	720,826.00	0.52
16	000425	徐工机械	702,097.00	0.51
17	300565	科信技术	655,006.00	0.48
18	H00728	中国电信	624,186.06	0.45
19	002668	TCL 智家	575,610.00	0.42
20	002967	广电计量	533,408.00	0.39
21	600519	贵州茅台	489,851.00	0.36

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600941	中国移动	5,130,811.00	3.72
2	H00941	中国移动	1,693,754.22	1.23
3	002595	豪迈科技	6,700,752.00	4.86
4	000063	中兴通讯	5,324,950.00	3.87
5	000333	美的集团	5,019,967.00	3.64
6	002884	凌霄泵业	4,375,765.18	3.18
7	002484	江海股份	3,991,467.00	2.90
8	600741	华域汽车	3,985,679.00	2.89

9	H01810	小米集团－W	2,872,973.83	2.09
10	603279	景津装备	2,766,346.00	2.01
11	603337	杰克股份	2,498,697.00	1.81
12	600031	三一重工	1,907,149.00	1.38
13	000680	山推股份	1,819,623.00	1.32
14	603187	海容冷链	1,697,685.00	1.23
15	H00728	中国电信	1,204,495.97	0.87
16	601728	中国电信	373,201.00	0.27
17	002668	TCL 智家	1,485,168.00	1.08
18	000651	格力电器	1,442,869.00	1.05
19	H01024	快手－W	1,401,035.46	1.02
20	600007	中国国贸	1,308,330.00	0.95
21	688271	联影医疗	1,095,263.95	0.80
22	688686	奥普特	1,049,731.80	0.76

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	72,469,270.60
卖出股票收入（成交）总额	101,004,833.05

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在过去能够较大胜率判断市场处于系统性能市时，通过股指期货空头仓位做一定程度套期保值以保护组合收益；2024 年 9 月以来，组合清空期货空头仓位。当下市场处于震荡市概率较大，组合加入股指期货多头，在震荡市享受股指期货贴水收敛的收益，并保有上涨的弹性空间。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货合约。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

7.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例

资产单元	投资顾问名称	报告期末资产单元资产净值（元）	占期末基金资产净值比例（%）
1	大成基金管理有限公司	48,362,823.66	41.52
2	永赢基金管理有限公司	10,653,267.66	9.15
3	信达澳亚基金管理有限公司	14,719,237.79	12.64
4	惠升基金管理有限责任公司	10,526,477.39	9.04

注：报告期末本基金管理人管理的资产单元资产净值为 32,215,121.28 元，占期末基金资产净值的 27.66%。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 7.13.3 报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	310,554.11
2	应收清算款	219,942.61
3	应收股利	54,766.54
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	585,263.26

### 7.13.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.13.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
创金合信群力一年定开混合（MOM）A	2,357	45,137.30	-	-	106,388,622.52	100.00%
创金合信群力一年定开混合（MOM）C	3,340	4,327.62	-	-	14,454,263.82	100.00%
合计	5,639	21,429.84	-	-	120,842,886.34	100.00%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	份额级别	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	创金合信群力一年定开混合（MOM）A	35,862.11	0.03%
	创金合信群力一年定开混合（MOM）C	10,456.52	0.07%
	合计	46,318.63	0.04%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 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	份额级别	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	创金合信群力一年定开混合（MOM）A	0
	创金合信群力一年定开混合（MOM）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信群力一年定开混合（MOM）A	0
	创金合信群力一年定开混合（MOM）C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信群力一年定开混合（MOM）A	创金合信群力一年定开混合（MOM）C
基金合同生效日(2021年3月9日)基金份额总额	291,620,442.49	46,016,857.68
本报告期期初基金份额总额	127,815,905.44	18,666,615.56
本报告期基金总申购份额	66,473.78	22,331.16



减：本报告期基金总赎回份额	21,493,756.70	4,234,682.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	106,388,622.52	14,454,263.82

§ 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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内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

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内，未出现管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣金	

	数量		票成交总 额的比例		总量的比例	
中信建投 证券	2	121,441,093.03	70.01%	56,203.69	69.72%	-
国泰海通 证券	4	41,951,632.61	24.18%	19,810.12	24.58%	-
东方财富 证券	2	9,618,754.01	5.54%	4,384.50	5.44%	-
华福证券	2	462,624.00	0.27%	210.99	0.26%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
第一创业 证券	4	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

1、基金管理人负责选择代理本基金证券交易的证券公司，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择标准：

- （1）实力雄厚，信誉良好；
- （2）研究实力较强，有固定的研究机构/部门和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的投研咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专项研究报告；
- （3）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- （4）经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （5）合规风控能力较强，近一年无重大违法违规事项等；
- （6）交易能力较强，具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件和信息系统，交易设施符合证券交易的需要等；
- （7）公司认为需要考虑的其他事项。

2、证券公司及其专用交易单元的选择程序：

- （1）本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。
- （2）本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

3、本基金报告期内新租华源证券 2 个交易单元，退租东兴证券 1 个交易单元。

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	-	-	19,000,000.00	7.45%	-	-
国泰海通证券	-	-	50,900,000.00	19.97%	-	-
东方财富证券	-	-	185,000,000.00	72.58%	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
2	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金 2024 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-28
3	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金开放申购、赎回、转换业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-02
4	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金 2025 年第 1 季度	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-21

	报告		
5	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-26
6	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-26
7	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金（2025 年 6 月）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-26

§ 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

本基金本报告期末未出现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

根据基金合同相关约定，本基金股票投资占基金资产的比例上限高于 80%，结合本基金的投资策略和市场情况，本基金股票投资占基金资产的比例可能阶段性或长期高于 80%，将面临着较高的市场波动和投资风险，请投资者充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金 2025 年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

### 12.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日