

# 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 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 1 月 21 日

|  |    |
|--|----|
| §1 重要提示.....                                     | 2  |
| §2 基金产品概况.....                                   | 2  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                            | 3  |
| 3.1 主要财务指标.....                                  | 3  |
| 3.2 基金净值表现.....                                  | 4  |
| §4 管理人报告.....                                    | 5  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....                         | 5  |
| 4.2 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.....          | 5  |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....                  | 5  |
| 4.4 公平交易专项说明.....                                | 6  |
| 4.5 报告期内基金投资策略和运作分析.....                         | 6  |
| 4.6 报告期内基金的业绩表现.....                             | 7  |
| 4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....                   | 7  |
| §5 投资组合报告.....                                   | 7  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况.....                            | 7  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                        | 7  |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细.....        | 8  |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....                      | 9  |
| 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....        | 9  |
| 5.6 报告期末按公允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>细..... | 9  |
| 5.7 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<br>明细.....   | 9  |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资<br>明细.....    | 10 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....                    | 10 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....                   | 10 |
| 5.11 投资组合报告附注.....                               | 10 |
| §6 管理人中管理人（MOM）产品.....                           | 12 |
| 6.1 报告期末各资产单元的资产净值及占基金资产净值的比例.....               | 12 |
| 6.2 基金投资顾问.....                                  | 12 |
| §7 开放式基金份额变动.....                                | 13 |
| §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....                       | 13 |
| 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....                        | 13 |
| 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....                    | 13 |
| §9 影响投资者决策的其他重要信息.....                           | 13 |
| 9.1 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.....          | 13 |
| 9.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                          | 13 |
| §10 备查文件目录.....                                  | 14 |
| 10.1 备查文件目录.....                                 | 14 |
| 10.2 存放地点.....                                   | 14 |
| 10.3 查阅方式.....                                   | 14 |

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 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  |
| 报告期末基金份额总额 | 337,637,300.17 份  |
| 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          | <p>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> |                    |
| 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   |                    |
| 基金投资顾问          | 创金合信基金管理有限公司   |                    |
|                 | 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   |                    |
|                 | 惠升基金管理有限责任公司   |                    |
| 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 | 291,620,442.49 份   | 46,016,857.68 份    |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期（2021 年 10 月 1 日—2021 年 12 月 31 日） |                    |
|----------------|---------------------------------------|--------------------|
|                | 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 |
| 1.本期已实现收益      | 2,903,163.37                          | 334,226.52         |
| 2.本期利润         | 17,254,088.84                         | 2,582,750.68       |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0592                                | 0.0561             |
| 4.期末基金资产净值     | 315,738,162.16                        | 49,418,899.79      |

|            |        |        |
|------------|--------|--------|
| 5.期末基金份额净值 | 1.0827 | 1.0739 |
|------------|--------|--------|

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 5.78%    | 0.64%       | 0.97%      | 0.55%         | 4.81%  | 0.09%  |
| 过去六个月      | 7.22%    | 0.79%       | -4.20%     | 0.72%         | 11.42% | 0.07%  |
| 自基金合同生效起至今 | 8.27%    | 0.63%       | -2.19%     | 0.73%         | 10.46% | -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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 5.51%    | 0.64%       | 0.97%      | 0.55%         | 4.54%  | 0.09%  |
| 过去六个月      | 6.68%    | 0.79%       | -4.20%     | 0.72%         | 10.88% | 0.07%  |
| 自基金合同生效起至今 | 7.39%    | 0.63%       | -2.19%     | 0.73%         | 9.58%  | -0.10% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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-2021年12月31日)





- 注：1、本基金合同于 2021 年 3 月 9 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。  
2、本基金建仓期为 6 个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限    |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---------|----------------|------|--------|---|
|    |         | 任职日期           | 离任日期 |        |   |
| 张荣 | 本基金基金经理 | 2021 年 3 月 9 日 | -    | 11     | 张荣先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，2004 年就职于深圳银监局从事银行监管工作，历任多家银行监管员。2010 年加入第一创业证券资产管理部，历任金融行业研究主管、投资主办等职务。2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司担任高级研究员，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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关决定。

### 4.2 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

### 4.3 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》、《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。

## 4.4 公平交易专项说明

### 4.4.1 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。

### 4.4.2 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。

## 4.5 报告期内基金投资策略和运作分析

第四季度，市场在经济的不确定性和资产的变化与波动当中徐徐展开运行。不论是降准预期对于债券市场的提振，还是双减等政策对于前期强势的周期品行业带来的波动，都是市场定价产生明显阶段性扰动的体现。

群力 MOM 在这一个运作阶段当中，将固定收益单元对流动性管理的稳定把握和权益单元的配置结构作为了投资运作的重点。在总体的风格风险暴露上积极的在成长与价值风格间进行了一定程度的均衡。在不放弃高景气成长方向的因为产业格局进一步放开，行业渗透变化，和利润兑现带来的收益的前提下，对上游周期行业回调带来的风险扰动进行了一定的防范。同时增加了中小盘价值风格的风格配置比重，在市场风格的再平衡中获得了一定的收益。整体产品在第四季度体现出了良好的风险收益控制能力，通过各投顾单元的协同均衡，实现了在结构变化的震荡市场环境中，把握收益和把控风险并重，在价值和成长风格上都取得了良好的投资效果。

在未来的投资当中，2022 年的第一季度将是一个波动与机会并存的阶段。产品在结构上将进行一定程度的风险防范，在配置上会更考虑股债间的和权益市场投资结构的均衡性以期在严守风险底线的基础上把握投资机遇。

#### 4.6 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 1.0827 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 5.78%，同期业绩比较基准收益率为 0.97%；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 1.0739 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 5.51%，同期业绩比较基准收益率为 0.97%。

#### 4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 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（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 291,913,536.28 | 78.04        |
|    | 其中：股票             | 291,913,536.28 | 78.04        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 66,966,610.80  | 17.90        |
|    | 其中：债券             | 66,966,610.80  | 17.90        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 14,115,382.73  | 3.77         |
| 8  | 其他资产              | 1,060,200.67   | 0.28         |
| 9  | 合计                | 374,055,730.48 | 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 8,040,768.96 元，占净值比为 2.20%。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 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         | -              | -     |
| B | 采矿业              | 1,531,630.00   | 0.42  |
| C | 制造业              | 222,620,125.79 | 60.97 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,018,920.00   | 0.28  |
| E | 建筑业              | 292,496.00     | 0.08  |
| F | 批发和零售业           | 227,920.00     | 0.06  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 874,433.00     | 0.24  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 7,942,887.00   | 2.18  |
| J | 金融业              | 23,659,546.00  | 6.48  |
| K | 房地产业             | 20,281,788.33  | 5.55  |
| L | 租赁和商务服务业         | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业       | 1,368,413.20   | 0.37  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -     |
| 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        | -              | -     |
| S | 综合               | 4,054,608.00   | 1.11  |
|   | 合计               | 283,872,767.32 | 77.74 |

### 5.2.2 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 | 2,127,754.94 | 0.58         |
| 金融       | 1,377,639.65 | 0.38         |
| 医疗保健     | 1,672,564.32 | 0.46         |
| 信息技术     | 335,641.15   | 0.09         |
| 电信服务     | 2,527,168.90 | 0.69         |
| 合计       | 8,040,768.96 | 2.20         |

以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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  | 000063 | 中兴通讯 | 367,044 | 12,295,974.00 | 3.37         |
| 2  | 603279 | 景津环保 | 231,400 | 10,732,332.00 | 2.94         |
| 3  | 002884 | 凌霄泵业 | 362,178 | 10,130,118.66 | 2.77         |
| 4  | 002372 | 伟星新材 | 416,395 | 10,126,726.40 | 2.77         |
| 5  | 600690 | 海尔智家 | 300,900 | 8,993,901.00  | 2.46         |
| 6  | 605080 | 浙江自然 | 118,134 | 8,836,423.20  | 2.42         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 7  | 601877 | 正泰电器 | 160,400 | 8,643,956.00 | 2.37 |
| 8  | 603989 | 艾华集团 | 201,700 | 8,350,380.00 | 2.29 |
| 9  | 603187 | 海容冷链 | 175,600 | 8,332,220.00 | 2.28 |
| 10 | 002879 | 长缆科技 | 348,000 | 8,212,800.00 | 2.25 |

#### 5.4 报告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      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 40,231,000.00 | 11.02        |
| 6  | 中期票据      | 25,849,000.00 | 7.08         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 886,610.80    | 0.24         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 66,966,610.80 | 18.34        |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称                 | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 101756043 | 17 吴中经发 MTN002       | 100,000 | 10,605,000.00 | 2.90         |
| 2  | 101801277 | 18 黄冈城投 MTN002       | 100,000 | 10,152,000.00 | 2.78         |
| 3  | 042100167 | 21 高速地产 CP001        | 100,000 | 10,098,000.00 | 2.77         |
| 4  | 042100203 | 21 宜春城投 CP002        | 100,000 | 10,049,000.00 | 2.75         |
| 5  | 012102208 | 21 邯郸交投 SCP001(乡村振兴) | 100,000 | 10,044,000.00 | 2.75         |

#### 5.6 报告期末按公允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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有股指期货合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末持有股指期货合约。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货合约。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

2021 年 9 月 25 日，方大炭素新材料科技股份有限公司（下称“方大炭素”，股票代码：600516）于近日收到中国证券监督管理委员会甘肃监管局下发的《关于对方大炭素新材料科技股份有限公司、董事长党锡江、董事会秘书安民采取责令改正监督管理措施的决定》的行政监管措施决定书，认为方大炭素公司存在以下违规问题：一、内幕信息知情人登记制度不完善且执行不到位；二、上市公司治理专项自查清单填报期间，公司未能督促控股股东及董事、监事、高级管理人员及时、准确、完整的向你公司报送关联人名单；三、公司超半数董事、监事、高级管理人员未出席、列席 2019 年 7 月至检查日之间的历次股东大会。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，方大炭素公司改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，公司及董事长、董事会秘书高度重视上述《行政监管措施决定书》中提出的问题，并表示按要求采取有效措施进行整改，公司高管将以本次整改为契机，加强对证券法律法规的学习，强化规范运作意识，切实提高公司规范运作水平。该事件发

生后该公司经营状况正常。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对方大炭素进行了投资。

2021 年 1 月 14 日，衡阳市城市建设投资有限公司（简称：衡阳城投）因提供不真实统计资料，受到警告并处罚款，本基金投研人员分析认为，衡阳市经济财政相对较强，在湖南全省排名较为靠前，衡阳的债务压力在湖南省算中游水平，衡阳城投是衡阳市核心主平台，主要负责衡阳市土地开发、基础设施和保障房受托代建，业务公益属性强，政府支持强，且当前投资压力减缓。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对 18 衡阳城投 MTN003 进行了投资。

2021 年 5 月 28 日，平安银行股份有限公司（下称“平安银行”，股票代码：000001）收到中国银保监会云南监管局《行政处罚决定书》，认定平安银行固定资产授信严重不审慎、贷款用途审查监控不到位等行为违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，并对公司处以罚款人民币 210 万元。

该行政处罚决定未对公司经营运作造成重大影响，罚款金额对公司净利润影响较小，且不影响公司打造零售银行的长期投资逻辑，对平安银行维持继续持有意见。本基金管理人在严格遵守法律法规、基金合同、投资顾问协议和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

2021 年 3 月 12 日，国家市场监督管理总局根据《中华人民共和国反垄断法》第四十八条、第四十九条作出行政处罚决定，对腾讯控股有限公司（以下简称“腾讯控股”）处以 50 万元人民币罚款。腾讯控股构成未依法申报违法实施的经营者集中，且不具有排除、限制竞争的效果。

本基金投研人员分析，对于反垄断的界定、应对、管理，是互联网巨头在发展中会持续面临的问题，一方面对于垄断属性的科技巨头是持续存在的业务层问题，另一方面由于社会环境和企业阶段的不同、其导向和界定也不是泾渭分明的。在受到处罚后腾讯控股改正态度积极，该事件发生后该公司经营状况正常，不影响腾讯控股企业地位和竞争力，至于变现渠道，是在监管环境和政策调整中顺应发展和衍生。基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对腾讯控股进行了投资。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 84,162.74 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息  | 976,037.93   |
| 5 | 应收申购款 | -            |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 其他    | -            |
| 8 | 合计    | 1,060,200.67 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 110079 | 杭银转债 | 261,534.00 | 0.07         |
| 2  | 113050 | 南银转债 | 117,136.80 | 0.03         |
| 3  | 123107 | 温氏转债 | 75,588.80  | 0.02         |

#### 5.11.5 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。

## § 6 管理人中管理人（MOM）产品

### 6.1 报告期末各资产单元的资产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    | 创金合信基金管理有限公司 | 62,434,323.38   | 17.10          |
| 2    | 大成基金管理有限公司   | 107,831,006.73  | 29.53          |
| 3    | 永赢基金管理有限公司   | 55,688,818.49   | 15.25          |
| 4    | 信达澳银基金管理有限公司 | 87,777,915.73   | 24.04          |
| 5    | 惠升基金管理有限责任公司 | 51,424,997.62   | 14.08          |

### 6.2 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  | 创金合信基金管理有限公司 | 是              | 否               |
| 2  | 大成基金管理有限公司   | 否              | 否               |
| 3  | 永赢基金管理有限公司   | 否              | 否               |

|   |                  |   |   |
|---|------------------|---|---|
|   | 司                |   |   |
| 4 | 信达澳银基金管理有<br>限公司 | 否 | 否 |
| 5 | 惠升基金管理有限责<br>任公司 | 否 | 否 |

## § 7 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<br>(MOM) A | 创金合信群力一年定开混合<br>(MOM) C |
|-------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 291,620,442.49          | 46,016,857.68           |
| 报告期期间基金总申购份额                  | -                       | -                       |
| 减：报告期期间基金总赎回<br>份额            | -                       | -                       |
| 报告期期间基金拆分变动份<br>额（份额减少以“-”填列） | -                       | -                       |
| 报告期期末基金份额总额                   | 291,620,442.49          | 46,016,857.68           |

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月，是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念，创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争

力，并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2021 年 12 月 31 日，创金合信基金共管理 79 只公募基金，公募管理规模 829 亿元。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 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 2021 年 4 季度报告原文。

### 10.2 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

### 10.3 查阅方式

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

创金合信基金管理有限公司

2022 年 1 月 21 日