

# 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 3 季度报告

2024 年 09 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：2024 年 10 月 24 日

## 目录

|  |    |
|--|----|
| §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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....                  | 6  |
| 4.3 公平交易专项说明.....                                | 7  |
| 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析.....                         | 7  |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现.....                             | 8  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....                   | 8  |
| §5 投资组合报告.....                                   | 8  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况.....                            | 8  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                        | 9  |
| 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.....        | 10 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....                      | 10 |
| 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.....        | 10 |
| 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..... | 10 |
| 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.....       | 10 |
| 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.....        | 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.....                   | 11 |
| 5.11 投资组合报告附注.....                               | 11 |
| §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.....                                | 12 |
| §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.....                                  | 13 |
| 10.1 备查文件目录.....                                 | 13 |
| 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的法律责任。

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 2024 年 10 月 22 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 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 | 146,482,521.00 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。<br>(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          | 大成基金管理有限公司   |                    |
|                 | 永赢基金管理有限公司   |                    |
|                 | 信达澳亚基金管理有限公司   |                    |
|                 | 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 | 127,815,905.44 份   | 18,666,615.56 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（2024 年 7 月 1 日—2024 年 9 月 30 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      | 1,284,004.76                        | 144,879.31         |
| 2. 本期利润         | 11,275,647.28                       | 1,551,300.32       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0882                              | 0.0831             |
| 4. 期末基金资产净值     | 117,779,016.44                      | 16,598,176.35      |

|            |        |        |
|------------|--------|--------|
| 5.期末基金份额净值 | 0.9215 | 0.8892 |
|------------|--------|--------|

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

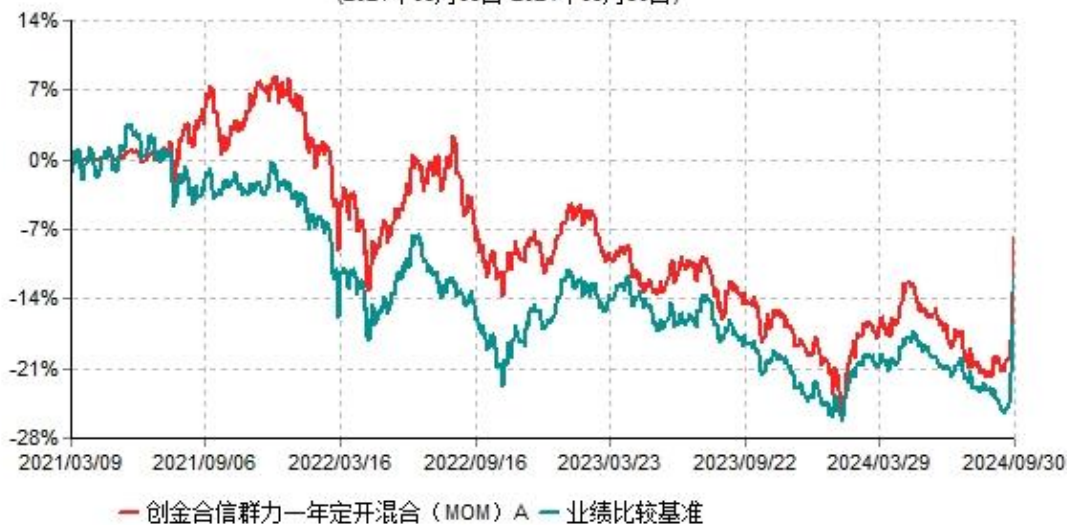
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 10.58%   | 1.24%       | 11.46%     | 1.08%         | -0.88% | 0.16% |
| 过去六个月      | 10.78%   | 1.01%       | 10.65%     | 0.86%         | 0.13%  | 0.15% |
| 过去一年       | 7.65%    | 0.92%       | 8.15%      | 0.76%         | -0.50% | 0.16% |
| 过去三年       | -9.97%   | 0.88%       | -9.06%     | 0.78%         | -0.91% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.85%   | 0.84%       | -11.91%    | 0.78%         | 4.06%  | 0.06% |

创金合信群力一年定开混合（MOM）C

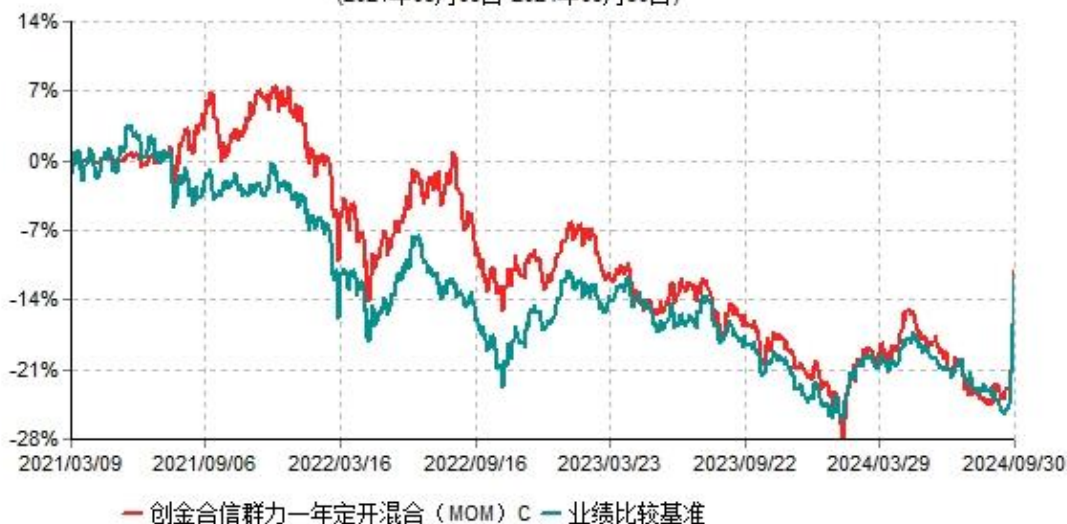
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 10.31%   | 1.24%       | 11.46%     | 1.08%         | -1.15% | 0.16% |
| 过去六个月      | 10.23%   | 1.01%       | 10.65%     | 0.86%         | -0.42% | 0.15% |
| 过去一年       | 6.57%    | 0.92%       | 8.15%      | 0.76%         | -1.58% | 0.16% |
| 过去三年       | -12.64%  | 0.88%       | -9.06%     | 0.78%         | -3.58% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | -11.08%  | 0.84%       | -11.91%    | 0.78%         | 0.83%  | 0.06% |

#### 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-2024年09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-2024年09月30日)



## § 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 |        |  |
| 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。  |
| Sibo Guo | 本基金基金经理（已离任）             | 2022 年 12 月 16 日 | 2024 年 7 月 13 日 | 7  | Sibo Guo（郭思博）先生，加拿大籍，加拿大麦吉尔大学学士、康考迪亚大学硕士。2011 年 8 月加入加拿大普拉特惠特尼公司，任战略规划与市场分析部行业研究分析师，2017 年 6 月加入第一创业证券股份有限公司，任上海分公司财富管理金融产品总监，从事资产配置和金融产品研究工作，2018 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任网金与财富管理部资产配置与服务岗、CTA 投资部、FOF 投资一部投资经理助理、FOF 投资一部投资经理、基金经理，现任投资经理。   |
| 尹海影      | 本基金基金经理、FOF 投资一部负责人（已离任） | 2022 年 4 月 12 日  | 2024 年 7 月 13 日 | 11 | 尹海影先生，中国国籍，麻省理工大学硕士。2011 年 6 月加入美国摩根斯坦利有限责任公司，任固定收益部多资产交易员、分析师，2013 年 10 月加入美国银行美林证券有限公司，任全球市场部量化交易经理，2015 年 2 月加入美国道富基金管理有限公司，任量化与资产配置研究部助理副总经理、量化与资产配置分析师，2016 年 2 月加入美国富达基金管理有限公司，任全球资产配置部分析师，核心投资团队成员，2017 年 3 月加入广发基金管理有限公司，历任资产配置部投资经理、总经理助理，2020 年 2 月加入创金合信基金管理有限公司，现任 FOF 投资一部负责人、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。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年第三季度，国内市场的债券和股票资产都经历了较大的波动。季度前半段 2 个多月时间内，整体上呈现宏观经济复苏较弱，债券利率震荡下行，权益市场在宏观和中观企业盈利双弱的环境中悲观情绪进一步发酵，指数较大幅度回调。随着 9 月 24 日及之后的各项政策，市场预期快速扭转，权益市场迎来大幅反转。

回顾本季度权益市场的表现，上证指数本季度录得 12.44% 的涨幅，但过程可谓跌宕起伏，涨幅贡献基本上集中于最后 5 个交易日。7、8 月以及 9 月上半月整体较弱：宏观经济较弱且未有边际好转迹象，政策层面市场期待的财政政策进展较为缓慢；中观层面上，房地产销量数据持续下行，价格也再探新低，地产财富效应的缩水进一步挤压居民预期和消费行为，消费数据，尤其是一线城市消费数据很弱；8 月份上市公司集中披露中报，顺周期相关板块公司基本上很难在宏观弱势环境中独善其身。同时，8 月份是主动权益基金近期赎回压力最大的一个月，负债端压力反作用于市场资产价格。在宏观、中观基本面和情绪共同作用下，权益资产价格进一步承压。但 9 月底国新办发布会和政治局会议迅速扭转了悲观预期，权益资产大幅反转，连续多日录得较大涨幅并在 9 月 30 日成交 2.61 万亿创下历史新高。

本产品在三季度 8 月份陆续降低股指期货套保头寸并在 9 月底政策早期平掉所有套保头寸，有效保护了产品收益并平滑波动；产品结构上本季度维持对家电、装备制造板块和价值质量风格的偏配。产品当前维持高权益仓位运作。



展望第四季度，我们认为过去这一年多来陆续推出的优化资本市场政策和近期进一步提振资本市场与实体经济的政策，为更加健康稳健的资本市场提供了更好的环境和土壤。虽然过去的三个季度宏观和基本面数据承压，但也不乏亮点，比如半导体周期触底回升后企业利润的显著改善、消费结构和偏好的变化带来的下沉市场消费逆市增长等。改革不会是一蹴而就的，我们有信心，也有耐心陪伴投资者继续在中深耕发掘高收益风险比的机会。

#### 4.5 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 0.9215 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.58%，同期业绩比较基准收益率为 11.46%；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 0.8892 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.31%，同期业绩比较基准收益率为 11.46%。

#### 4.6 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              | 110,673,808.32 | 81.74        |
|    | 其中：股票             | 110,673,808.32 | 81.74        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -            |
|    | 其中：债券             | -              | -            |
|    | 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      | 24,668,704.47  | 18.22        |
| 8  | 其他资产              | 58,871.96      | 0.04         |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 135,401,384.75 | 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 11,668,594.48 元，占净值比为 8.68%。

## 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              | 951,382.00    | 0.71         |
| C  | 制造业              | 78,609,214.41 | 58.50        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,152,445.00  | 0.86         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 7,520,901.23  | 5.60         |
| J  | 金融业              | 6,032,261.00  | 4.49         |
| K  | 房地产业             | 4,705,283.00  | 3.50         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 33,727.20     | 0.03         |
| 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               | -             | -            |
|    | 合计               | 99,005,213.84 | 73.68        |

### 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 | 1,990,872.77  | 1.48         |
| 日常消费品    | 1,373,462.24  | 1.02         |
| 能源       | 507,870.09    | 0.38         |
| 医疗保健     | 408,510.87    | 0.30         |
| 信息技术     | 1,825,222.96  | 1.36         |
| 通讯业务     | 4,994,852.49  | 3.72         |
| 公用事业     | 567,803.06    | 0.42         |
| 合计       | 11,668,594.48 | 8.68         |

注：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  | 600941 | 中国移动 | 50,100  | 5,495,970.00 | 4.09         |
| 1  | H00941 | 中国移动 | 20,000  | 1,324,729.51 | 0.99         |
| 2  | 000063 | 中兴通讯 | 205,500 | 6,401,325.00 | 4.76         |
| 3  | 002595 | 豪迈科技 | 136,300 | 6,307,964.00 | 4.69         |
| 4  | 000333 | 美的集团 | 82,200  | 6,252,132.00 | 4.65         |
| 5  | 000651 | 格力电器 | 129,200 | 6,193,848.00 | 4.61         |
| 6  | 002884 | 凌霄泵业 | 283,778 | 5,831,637.90 | 4.34         |
| 7  | 603337 | 杰克股份 | 197,300 | 5,548,076.00 | 4.13         |
| 8  | 600031 | 三一重工 | 274,100 | 5,175,008.00 | 3.85         |
| 9  | 600741 | 华域汽车 | 288,000 | 5,163,840.00 | 3.84         |
| 10 | 002484 | 江海股份 | 259,000 | 3,923,850.00 | 2.92         |

### 5.4 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。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

金额单位：人民币元

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明        |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-------------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -           |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | -           |
| 股指期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | 358,052.06  |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | -126,780.00 |

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本产品采用一定比例的股指期货进行套期保值。股指期货主要用于在市场震荡下跌时进行收益保护，同时降低组合的整体风险。股指期货投资策略参考市场波动率，风险调整后收益和风险溢价进行套保比例的确定和调整。本产品在三季度 8 月份陆续降低股指期货套保头寸并在 9 月底政策早期平掉所有套保头寸，有效保护了产品收益并平滑波动。

## 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

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。

### 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 | 22,078.40 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | 36,793.56 |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | -         |

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 6 | 其他应收款 | -         |
| 7 | 其他    | -         |
| 8 | 合计    | 58,871.96 |

#### 5.11.4 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。

#### 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    | 大成基金管理有限<br>公司   | 68,240,198.23   | 50.78          |
| 2    | 永赢基金管理有限<br>公司   | 11,926,714.77   | 8.88           |
| 3    | 信达澳亚基金管理<br>有限公司 | 10,490,191.17   | 7.81           |
| 4    | 惠升基金管理有限<br>责任公司 | 27,168,207.40   | 20.22          |

注：报告期末本基金管理人管理的资产单元资产净值为 16,551,881.22 元，占期末基金资产净值的 12.32%。

### 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  | 大成基金管理有限<br>公司   | 否              | 否               |
| 2  | 永赢基金管理有限<br>公司   | 否              | 否               |
| 3  | 信达澳亚基金管理<br>有限公司 | 否              | 否               |
| 4  | 惠升基金管理有限<br>责任公司 | 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                   | 127,815,905.44          | 18,666,615.56           |
| 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                   | 127,815,905.44          | 18,666,615.56           |

## § 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，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 家合伙企业出资设立。创金合信基金成立以来坚持以客户为中心，倡导合伙文化，致力于为客户提供优质的产品和服务。截至 2024 年 9 月 30 日，创金合信基金共管理 99 只公募基金，公募管理规模 1646.07 亿元。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

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 3 季度报告

- 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 2024 年 3 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

2024 年 10 月 24 日