

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 2022 年中期报告

2022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：2022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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 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.....	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
§5 托管人报告.....	13
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	42
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	50
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.....	50

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	50
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
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	50
7.13	投资组合报告附注	51
§8	基金份额持有人信息	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§9	开放式基金份额变动	53
§10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8	其他重大事件	55
§11	影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	56
§12	备查文件目录	56
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	57
12.3	查阅方式	57

§ 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	244,460,084.25 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	212,721,508.60 份	31,738,575.65 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	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
4	信达澳亚基金管理有限公司	否	否

5	惠升基金管理有限 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	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

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(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-11,244,982.19
本期利润	-27,911,522.73
加权平均基金份额本期利润	-0.1142
本期加权平均净值利润率	-11.68%
本期基金份额净值增长率	-7.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-6,344,085.18
期末可供分配基金份额利润	-0.0298
期末基金资产净值	212,825,586.00
期末基金份额净值	1.0005
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.05%

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(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,870,432.80
本期利润	-4,617,703.09
加权平均基金份额本期利润	-0.1234

本期加权平均净值利润率	-12.74%
本期基金份额净值增长率	-8.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,348,869.22
期末可供分配基金份额利润	-0.0425
期末基金资产净值	31,340,624.62
期末基金份额净值	0.9875
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-1.25%

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. 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	7.11%	0.83%	6.42%	0.78%	0.69%	0.05%
过去三个月	4.19%	1.12%	4.50%	1.01%	-0.31%	0.11%
过去六个月	-7.59%	1.13%	-5.66%	1.04%	-1.93%	0.09%
过去一年	-0.92%	0.97%	-9.62%	0.89%	8.70%	0.08%
自基金合同生效起至今	0.05%	0.85%	-7.73%	0.86%	7.78%	-0.01%

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	7.02%	0.83%	6.42%	0.78%	0.60%	0.05%
过去三个月	3.93%	1.12%	4.50%	1.01%	-0.57%	0.11%
过去六个月	-8.05%	1.13%	-5.66%	1.04%	-2.39%	0.09%
过去一年	-1.91%	0.97%	-9.62%	0.89%	7.71%	0.08%
自基金合同生效起至今	-1.25%	0.85%	-7.73%	0.86%	6.48%	-0.01%

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



注：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 3 日获得中国证监会批复，2014 年 7 月 9 日正式注册设立，注册地为深圳市。公司注册资本 2.33 亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例 51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例 21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市

金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.50645%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，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		
尹海影	本基金基金经理	2022 年 4 月 12 日	-	9	尹海影先生，中国国籍，麻省理工大学金融学硕士，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资产配置部历任投资经理、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 投资一部副总监，兼任基金经理。
张荣	本基金基金经理（已离任）	2021 年 3 月 9 日	2022 年 4 月 12 日	12	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《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 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

权益市场的风险资产情绪在 2022 年第二季度经历了一个触底回升的过程，由前半段对宏观经济，地缘政治和企业利润的担忧逐步转变为对风险的消化和对景气的确认。宏观经济层面在二季度看到修复的起始点，我们从细分数据上能够看到触底回升的迹象。加之从稳定经济和民生的角度出发，市场的政策底也已经出现，权益类资产得到一定程度的修复。

处于良性景气阶段的新兴产业，如风电光伏等，和具有估值提升空间的价值类方向，如稳增长、中游制造业中的一些优质资产，都成为市场在修复过程当中的收益提供者。我们从大类资产配置的研究角度出发，也能关注到经济活动的回暖和市场外部环境中系统性风险的去化对市场情绪回暖的促进作用。

2022 年上半年债券市场呈现下行趋势，短端利率债表现好于长端，信用债表现强于利率债。上半年，资金价格整体稳定，R007 平均值为 2.07%，在上海疫情影响下，4 月之后资金中枢从 2.2% 下移至 1.8% 左右，资金利率在较长时间维持大幅向下偏离央行公开市场操作利率的水平。信用债呈震荡下行的态势，1 年 AAA 城投债收益率由 2022 年 1 月 4 日的 2.72% 下行至 2022 年 6 月 30 日的 2.45%。相比信用债，利率债表现为震荡行情，10 年国债呈窄幅区间震荡，其收益率下限为 2022 年 1 月 24 日的 2.67%，上限为 2022 年 3 月 10 日的 2.85%。

货币政策方面，受地产低迷和疫情反复的影响，经济增长疲软，货币政策维持偏宽松的态势，银行间流动性充裕。财政政策方面，提前下达地方债，提升财政支出增速。在宽松的货币政策和财政政策刺激下，2022 年 1-2 月金融数据表现超预期，此外，在海外流动性收紧和地缘政治风险冲击下，股票市场持续快速下跌导致“固收+”产品赎回压力，3 月份债券市场持续调整。4-5 月长三角疫情对经济形成较大的负面冲击，经济增长压力加大，资金中枢下移且稳定维持在较低水平，短端收益率下行，信用债表现强势，呈现期限利差扩大和信用利差压缩的局面。

债券策略方面，投资策略上需保持中性偏防御的状态，保证组合较高的流动性，票息策略优于久期策略，久期维持中性偏低的状态，严格控制信用风险暴露情况，控制组合杠杆总体水平，以稳健的投资风格力争为投资者获取良好的投资回报。

在产品的投资管理过程中，有效的把握市场风险和风格的切换，在第一季度配置重心偏向风险防范。权益资产的整体比例偏防御，稳增长类的价值方向配置较多。在二季度后半期起，逐步增加权益配置的比例和风险偏好并且与市场节奏匹配适度，也起到了良好的收效。对债券类资产的投资采用平衡稳健的方式进行，从结果上看均衡的捕捉了票息和利差变化带来的收益，债券单元运行稳健且在必要时为整个产品的运行提供了有效的流动性管理。

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 1.0005 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.59%，同期业绩比较基准收益率为-5.66%；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 0.9875 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.05%，同期业绩比较基准收益率为-5.66%。

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，经济处于弱复苏的态势，债市表现可能弱于上半年。经过上半年政策持续的刺激，虽然地产可能企稳，但是在“停贷”的影响下，修复的动力仍较弱，地方债的提前下达对基建投资有支撑。精准防控和常态化核酸可以相对有效应对疫情，防范过度防疫，复工复产有序推进。在利率水平方面，债券市场资金充裕，但整体利率水平偏低，当前 1 年 AAA 存单价格低于央行公开市场操作利率，信用利差处于历史的低位，利率向下空间相对有限，债市利多的因素趋于弱化。

当前展望下半年，更看好权益类资产的性价比。债券类资产虽然在经济修复的过程当中往往受损，但目前经济的回暖的大趋势尚存不确定性，而且在上海解封等对经济有先验性判断作用的时间节点上，经济的变化在债市当中已经有了一些提前的定价反应。因此即使看好权益资产更好的性价比，也不代表债券类资产会有即刻的损失。但长期来看，债市

表现可能弱于上半年。第一，常态核酸可以相对有效应对疫情，再度出现对经济短期深度冲击的概率下降，而防控适度放松的概率在提高，这将有利于消费的恢复；第二，经过上半年政策持续的刺激，地产销售和投资可能会边际恢复，基建投资方面也有新的政策落地，如政策性金融支持等。因此，下半年的经济恢复预计好于上半年。对货币政策而言，短期市场利率水平会相应抬升，DR007 的均值水平预计将会从上半年的 1.9% 向政策利率水平附近回归。通胀的问题会制约货币政策，但还不足以调整货币政策利率。下半年通胀压力更多来自猪价因素，而非总需求因素，核心 CPI 有望保持稳定。因此，鉴于经济的恢复和货币政策潜在的微调，下半年债市表现预计要弱于上半年，来自基本面的利多因素趋于弱化，而利空在积累力量，机会可能更多来自于短期市场利率调整过度导致的超调机会。

6 月以来，市场利率出现上行调整，也是上海疫情得到控制之后，市场预期后续经济恢复和货币政策可能微调，但还没有到达超调的阶段。以政策利率为基准定价，当前国债、国开债和中长期信用债的曲线形态相对合理，但短端信用债的利差水平仍偏低。投资策略上，需保持中性偏防御的状态，票息策略优于久期策略，以稳健的投资风格力争为投资者获取良好的投资回报。

今年下半年，价值和成长领域都存在可能的投资机会。与年初的情况不同，5 月份以来市场的这一轮修复当中，表现最好的板块就是成长类的光伏、新能源汽车等。目前成长类方向的景气度回温和一些良性的企业层面的变化也并未停止。因此，相比于年初，权益类资产的格局可能将更加偏向均衡。价值与成长都有相应的投资机会。而价值方向的投资，也有可能和年初不完全相同。可能由纯粹的稳增长受益板块及上游资源品向更为广泛的价值类方向扩散过渡。

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的真实、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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	19,801,952.74	13,470,293.70

结算备付金		1,778,717.86	645,089.03
存出保证金		61,523.18	84,162.74
交易性金融资产	6.4.7.2	248,656,304.98	358,880,147.08
其中：股票投资		185,414,520.86	291,913,536.28
基金投资		-	-
债券投资		63,241,784.12	66,966,610.80
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		-	-
应收股利		136,580.94	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	976,037.93
资产总计		270,435,079.70	374,055,730.48
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		23,137,124.32	7,999,868.00
应付清算款		2,588,764.83	10,336.75
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		289,452.62	460,451.41
应付托管费		38,593.69	61,393.54
应付销售服务费		24,778.03	41,559.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,889.21	5,989.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	186,266.38	319,069.39
负债合计		26,268,869.08	8,898,668.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	244,460,084.25	337,637,300.17

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-293,873.63	27,519,761.78
净资产合计		244,166,210.62	365,157,061.95
负债和净资产总计		270,435,079.70	374,055,730.48

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，创金合信群力一年定开混合（MOM）A 份额净值 1.0005 元，基金份额总额 212,721,508.60 份；创金合信群力一年定开混合（MOM）C 份额净值 0.9875 元，基金份额总额 31,738,575.65 份；总份额合计 244,460,084.25 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效 日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-29,816,543.66	5,311,159.84
1.利息收入		86,239.12	1,864,744.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	32,620.52	154,345.49
债券利息收入		-	924,147.58
资产支持证券利息 收入		-	0.00
买入返售金融资产 收入		53,618.60	786,251.12
证券出借利息收入		-	0.00
其他利息收入		-	0.00
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-10,489,033.64	1,238,806.21
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-13,361,392.85	295,187.82
基金投资收益		-	0.00
债券投资收益	6.4.7.11	1,293,984.40	95,928.77
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	0.00
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	0.00
衍生工具收益	6.4.7.14	-	0.00
股利收益	6.4.7.15	1,578,374.81	847,689.62
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	6.4.7.16	-19,413,810.83	2,207,609.44

失以“-”号填列)			
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	61.69	0.00
减：二、营业总支出		2,712,682.16	2,138,900.28
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,058,495.39	1,571,264.05
2.托管费	6.4.10.2.2	274,466.07	209,501.89
3.销售服务费	6.4.10.2.3	180,920.30	142,576.72
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		91,658.33	18,720.28
其中：卖出回购金融资产支出		91,658.33	18,720.28
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		2,962.46	1,949.73
8.其他费用	6.4.7.19	104,179.61	194,887.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		-32,529,225.82	3,172,259.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-32,529,225.82	3,172,259.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-32,529,225.82	3,172,259.56

注：本基金合同生效日为 2021 年 3 月 9 日，上年度可比期间为 2021 年 3 月 9 日至 2021 年 6 月 30 日。

6.3 净资产（基金净值）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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值)	337,637,300.17	-	27,519,761.78	365,157,061.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	337,637,300.17	-	27,519,761.78	365,157,061.95

资产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-93,177,215.92	-	-27,813,635.41	-120,990,851.33
（一）、综合收益总额	-	-	-32,529,225.82	-32,529,225.82
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-93,177,215.92	-	4,715,590.41	-88,461,625.51
其中：1.基金申购款	97,021.35	-	-6,065.41	90,955.94
2.基金赎回款	-93,274,237.27	-	4,721,655.82	-88,552,581.45
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	244,460,084.25	-	-293,873.63	244,166,210.62
项目	上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 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（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	337,637,300.17	-	-	337,637,300.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	0.00	-	3,172,259.56	3,172,259.56
（一）、综合收益总额	-	-	3,172,259.56	3,172,259.56
（二）、本期基金份额交易产生的	-	-	-	-

基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)				
其中: 1.基金申购 款	-	-	-	-
2.基金赎 回款	-	-	-	-
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的基 金净值变动(净 值减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净值)	337,637,300.17	-	3,172,259.56	340,809,559.73

注：本基金合同生效日为 2021 年 3 月 9 日，上年度可比期间为 2021 年 3 月 9 日至 2021 年 6 月 30 日。

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”）。

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》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》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》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）。本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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》、《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》和在财务报表附注 6.4.4 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《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>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的未来现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为 13,470,293.70 元、645,089.03 元、84,162.74 元和 976,037.93 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金和存出保证金，金额分别为 13,471,571.05 元、645,369.64 元和 84,200.58 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 358,880,147.08 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 359,854,589.21 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产、应付利息、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和应付交易费用，金额分别为 7,999,868.00 元、9,957.30 元、10,336.75 元、460,451.41 元、61,393.54 元、41,559.55 元和 142,612.09 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产、应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 8,009,825.30 元、10,336.75 元、460,451.41 元、61,393.54 元、41,559.55 元和 142,612.09 元。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 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

根据财政部、国家税务总局财税 [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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《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] 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》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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）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：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；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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 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。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后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费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	19,801,952.74
等于：本金	19,800,235.51
加：应计利息	1,717.23
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	19,801,952.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	182,946,667.74	-	185,414,520.86	2,467,853.12	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,051,911.23	70,119.45	4,122,919.45	888.77
	银行间市场	57,667,327.41	1,096,864.67	59,118,864.67	354,672.59
	合计	61,719,238.64	1,166,984.12	63,241,784.12	355,561.36
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	244,665,906.38	1,166,984.12	248,656,304.98	2,823,414.48	

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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 2022 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	91,176.00
其中：交易所市场	87,978.91
银行间市场	3,197.09
应付利息	-
预提费用	95,090.38
合计	186,266.38

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	291,620,442.49	291,620,442.49
本期申购	58,704.97	58,704.97
本期赎回（以“-”号填列）	-78,957,638.86	-78,957,638.86
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	212,721,508.60	212,721,508.60

创金合信群力一年定开混合（MOM）C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	46,016,857.68	46,016,857.68
本期申购	38,316.38	38,316.38
本期赎回（以“-”号填列）	-14,316,598.41	-14,316,598.41
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	31,738,575.65	31,738,575.65

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
本期期初	4,895,847.90	19,221,871.77	24,117,719.67
本期利润	-11,244,982.19	-16,666,540.54	-27,911,522.73
本期基金份额交易产生的变动数	5,049.11	3,892,831.35	3,897,880.46
其中：基金申购款	-161.41	-3,262.40	-3,423.81
基金赎回款	5,210.52	3,896,093.75	3,901,304.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,344,085.18	6,448,162.58	104,077.40

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
本期期初	386,688.57	3,015,353.54	3,402,042.11
本期利润	-1,870,432.80	-2,747,270.29	-4,617,703.09
本期基金份额交易产生的变动数	134,875.01	682,834.94	817,709.95
其中：基金申购款	-439.28	-2,202.32	-2,641.60
基金赎回款	135,314.29	685,037.26	820,351.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,348,869.22	950,918.19	-397,951.03

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,878.06
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	2,270.39
其他	472.07
合计	32,620.52

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-13,361,392.85
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	-13,361,392.85

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	201,216,035.75
减：卖出股票成本总额	214,095,848.61
减：交易费用	481,579.99
买卖股票差价收入	-13,361,392.85

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	981,658.80
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	312,325.60
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	1,293,984.40

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	137,582,660.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	135,606,814.67
减：应计利息总额	1,659,658.27
减：交易费用	3,861.94
买卖债券差价收入	312,325.60

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

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,578,374.81
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	1,578,374.81

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-19,413,810.83
——股票投资	-19,168,131.52
——债券投资	-245,679.31
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	-19,413,810.83

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	61.69
合计	61.69

6.4.7.18 信用减值损失

本基金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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	26,283.01
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,289.23
账户维护费	13,200.00
查询服务费	900.00
合计	104,179.61

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

本报告期不存在重大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
惠升基金管理有限责任公司	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	124,715,250.60	38.03%	132,606,310.98	91.06%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	69,493.60	1.41%	105,497,198.50	61.71%

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 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
第一创业证券股份有限公司	-	-	3,835,400,000.00	67.12%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
第一创业证券股份有限公司	88,709.78	37.29%	7,598.41	8.64%

关联方名称	上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 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
第一创业证券股份有限公司	95,906.94	90.63%	95,906.94	95.89%

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金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。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,058,495.39	1,571,264.05
其中：支付销售机构的客户维护费	952,548.88	723,643.21
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 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	274,466.07	209,501.89

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 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----------	------------------------------------

各关联方名称	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	-	4.30	4.30
第一创业证券	-	1,375.26	1,375.26
交通银行	-	1,957.33	1,957.33
合计	-	3,336.89	3,336.89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 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	-	3.39	3.39
第一创业证券	-	1,069.66	1,069.66
交通银行	-	1,602.89	1,602.89
合计	-	2,675.94	2,675.94

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：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 1\% / \text{当年天数}。$$

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 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	19,801,952.74	29,878.06	80,869,436.03	76,757.75

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（2022 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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金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人民币 23,137,124.32 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	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
04228016	22 华发集	2022 年 7 月	100.86	100,000	10,086,421.37

1	团 CP001	4 日			
10175604 3	17 吴中经 发 MTN002	2022 年 7 月 1 日	108.96	45,000	4,902,984.25
10175604 3	17 吴中经 发 MTN002	2022 年 7 月 4 日	108.96	55,000	5,992,536.30
10177500 7	17 环太湖 MTN001	2022 年 7 月 4 日	107.61	8,000	860,904.99
10200007 1	20 衡阳城 投 MTN001	2022 年 7 月 4 日	102.55	49,000	5,024,792.94
合计	-	-	-	257,000	26,867,639.85

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，因而与银行存款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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	10,049,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	20,177,817.53	30,182,000.00
合计	20,177,817.53	40,231,000.00

未评级债券包括国债、政策性金融债、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

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	14,407,720.55	819,259.60
AAA 以下	28,656,246.04	25,916,351.20
未评级	-	-
合计	43,063,966.59	26,735,610.80

未评级债券包括国债、政策性金融债。

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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 23,141,272.68 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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 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上市公司发行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银行存款、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 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,801,952.74	-	-	-	19,801,952.74
结算备付金	1,778,717.86	-	-	-	1,778,717.86
存出保证金	61,523.18	-	-	-	61,523.18
交易性金融资产	59,118,864.67	4,122,919.45	-	185,414,520.86	248,656,304.98
应收股利	-	-	-	136,580.94	136,580.94
资产总计	80,761,058.45	4,122,919.45	-	185,551,101.80	270,435,079.70
负债					
卖出回购金融资产款	23,137,124.32	-	-	-	23,137,124.32
应付管理人报酬	-	-	-	289,452.62	289,452.62
应付托管费	-	-	-	38,593.69	38,593.69
应付销售服务费	-	-	-	24,778.03	24,778.03
应交税费	-	-	-	3,889.21	3,889.21
应付清算款	-	-	-	2,588,764.83	2,588,764.83

其他负债	-	-	-	186,266.38	186,266.38
负债总计	23,137,124.32	-	-	3,131,744.76	26,268,869.08
利率敏感度缺口	57,623,934.13	4,122,919.45	-	182,419,357.04	244,166,210.62
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,470,293.70	-	-	-	13,470,293.70
结算备付金	645,089.03	-	-	-	645,089.03
存出保证金	84,162.74	-	-	-	84,162.74
交易性金融资产	50,836,000.00	15,244,000.00	886,610.80	291,913,536.28	358,880,147.08
应收利息	-	-	-	976,037.93	976,037.93
资产总计	65,035,545.47	15,244,000.00	886,610.80	292,889,574.21	374,055,730.48
负债					
卖出回购金融资产款	7,999,868.00	-	-	-	7,999,868.00
应付管理人报酬	-	-	-	460,451.41	460,451.41
应付托管费	-	-	-	61,393.54	61,393.54
应付销售服务费	-	-	-	41,559.55	41,559.55
应付交易费用	-	-	-	142,612.09	142,612.09
应交税费	-	-	-	5,989.89	5,989.89
应付利息	-	-	-	9,957.30	9,957.30
应付证券清算款	-	-	-	10,336.75	10,336.75
其他负债	-	-	-	166,500.00	166,500.00
负债总计	7,999,868.00	-	-	898,800.53	8,898,668.53
利率敏感度缺口	57,035,677.47	15,244,000.00	886,610.80	291,990,773.68	365,157,061.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升相关风险变量的变动 25 个基点	-133,765.58	-158,384.14
2.市场利率平行下降相关风险变量的变动 25 个基点	134,600.93	159,478.08	

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，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 2022 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	-	11,120,753.94	-	-	-	11,120,753.94
应收股利	-	136,580.94	-	-	-	136,580.94
资产合计	-	11,257,334.88	-	-	-	11,257,334.88
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	-	11,257,334.88	-	-	-	11,257,334.88

项目	上年度末 2021 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	-	8,040,768.96	-	-	-	8,040,768.96
资产合计	-	8,040,768.96	-	-	-	8,040,768.96
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	-	8,040,768.96	-	-	-	8,040,768.96

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	562,866.74	402,038.45
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-562,866.74	-402,038.45

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	185,414,520.86	75.94	291,913,536.28	79.94
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	185,414,520.86	75.94	291,913,536.28	79.94

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	9,394,026.70	11,307,270.83
	2.业绩比较基准下降 5%	-9,394,026.70	-11,307,270.83

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

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	185,414,520.86
第二层次	63,241,784.12
第三层次	-
合计	248,656,304.98

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、债券和基金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 2022 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资产(2021 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应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，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 2022 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	185,414,520.86	68.56
	其中：股票	185,414,520.86	68.56
2	固定收益投资	63,241,784.12	23.39
	其中：债券	63,241,784.12	23.39
	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	21,580,670.60	7.98
7	其他资产	198,104.12	0.07
8	合计	270,435,079.70	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 11,120,753.94 元，占净值比为 4.55%。

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	-	-
B	采矿业	2,058,600.00	0.84
C	制造业	128,134,304.73	52.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,039,658.00	0.84
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	215,970.00	0.09

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	1,821,408.54	0.75
J	金融业	16,346,941.00	6.70
K	房地产业	20,486,915.44	8.39
L	租赁和商务服务业	460,502.61	0.19
M	科学研究和技术服务业	742,488.60	0.30
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	371,475.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,615,503.00	0.66
	合计	174,293,766.92	71.38

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	3,724,215.62	1.53
能源	1,639,057.15	0.67
金融	1,056,330.69	0.43
医疗保健	938,913.11	0.38
工业	653,792.76	0.27
电信服务	1,642,956.82	0.67
地产业	1,465,487.79	0.60
合计	11,120,753.94	4.55

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	600690	海尔智家	230,000	6,315,800.00	2.59
2	603187	海容冷链	152,200	5,562,910.00	2.28
3	603279	景津装备	177,100	5,491,871.00	2.25
4	603989	艾华集团	187,000	5,273,400.00	2.16
5	002884	凌霄泵业	255,978	5,244,989.22	2.15
6	605080	浙江自然	79,234	5,062,260.26	2.07
7	601877	正泰电器	133,139	4,763,713.42	1.95
8	000657	中钨高新	314,801	4,722,015.00	1.93
9	002879	长缆科技	297,300	4,631,934.00	1.90

10	002415	海康威视	115,100	4,166,620.00	1.71
11	600383	金地集团	309,500	4,159,680.00	1.70
12	600048	保利发展	225,300	3,933,738.00	1.61
13	002749	国光股份	383,034	3,811,188.30	1.56
14	300750	宁德时代	6,600	3,524,400.00	1.44
15	000063	中兴通讯	116,300	2,969,139.00	1.22
16	600919	江苏银行	409,700	2,917,064.00	1.19
17	000002	万科 A	138,200	2,833,100.00	1.16
18	600309	万华化学	28,700	2,783,613.00	1.14
19	600036	招商银行	65,100	2,747,220.00	1.13
20	000069	华侨城 A	406,800	2,640,132.00	1.08
21	000001	平安银行	172,400	2,582,552.00	1.06
22	001979	招商蛇口	183,200	2,460,376.00	1.01
23	002540	亚太科技	344,400	2,314,368.00	0.95
24	300930	屹通新材	57,400	2,061,808.00	0.84
25	600741	华域汽车	83,500	1,920,500.00	0.79
26	300457	赢合科技	67,300	1,911,993.00	0.78
27	603833	欧派家居	12,300	1,853,364.00	0.76
28	002965	祥鑫科技	60,900	1,844,661.00	0.76
29	600426	华鲁恒升	60,800	1,775,360.00	0.73
30	600926	杭州银行	116,500	1,745,170.00	0.71
31	002572	索菲亚	63,200	1,738,000.00	0.71
32	300917	特发服务	54,414	1,684,657.44	0.69
33	601058	赛轮轮胎	148,000	1,667,960.00	0.68
34	601688	华泰证券	116,400	1,652,880.00	0.68
35	H00883	中国海洋石油	185,000	1,639,057.15	0.67
36	603816	顾家家居	28,730	1,626,979.90	0.67
37	600673	东阳光	179,700	1,615,503.00	0.66
38	H03690	美团-W	9,700	1,610,955.61	0.66
39	002876	三利谱	37,300	1,492,746.00	0.61
40	000625	长安汽车	85,150	1,474,798.00	0.60
41	600887	伊利股份	36,300	1,413,885.00	0.58
42	H02331	李宁	22,000	1,367,790.89	0.56
43	600406	国电南瑞	49,980	1,349,460.00	0.55
44	002708	光洋股份	204,500	1,325,160.00	0.54
45	002304	洋河股份	7,200	1,318,680.00	0.54
46	601658	邮储银行	241,600	1,302,224.00	0.53
47	002101	广东鸿图	55,100	1,256,280.00	0.51
48	601166	兴业银行	63,000	1,253,700.00	0.51
49	H00700	腾讯控股	3,900	1,182,009.41	0.48
50	002824	和胜股份	21,300	1,171,287.00	0.48
51	002988	豪美新材	70,700	1,136,149.00	0.47

52	601012	隆基绿能	15,940	1,062,082.20	0.43
53	300611	美力科技	91,300	1,061,819.00	0.43
54	600104	上汽集团	59,500	1,059,695.00	0.43
55	H00388	香港交易所	3,200	1,056,330.69	0.43
56	300648	星云股份	25,600	1,039,360.00	0.43
57	600519	贵州茅台	500	1,022,500.00	0.42
58	000049	德赛电池	22,600	1,019,260.00	0.42
59	000656	金科股份	350,700	1,003,002.00	0.41
60	300866	安克创新	14,700	974,904.00	0.40
61	600030	中信证券	45,000	974,700.00	0.40
62	688779	长远锂科	48,724	974,480.00	0.40
63	603993	洛阳钼业	167,500	959,775.00	0.39
64	000423	东阿阿胶	24,300	897,885.00	0.37
65	H00688	中国海外发展	42,000	890,765.90	0.36
66	002850	科达利	5,500	874,500.00	0.36
67	300661	圣邦股份	4,800	873,696.00	0.36
68	600460	士兰微	15,800	821,600.00	0.34
69	601985	中国核电	119,400	819,084.00	0.34
70	002028	思源电气	22,500	802,350.00	0.33
71	600989	宝丰能源	54,500	798,425.00	0.33
72	300760	迈瑞医疗	2,500	783,000.00	0.32
73	000961	中南建设	254,900	777,445.00	0.32
74	300793	佳禾智能	48,500	776,485.00	0.32
75	300432	富临精工	34,650	762,300.00	0.31
76	601899	紫金矿业	81,000	755,730.00	0.31
77	002466	天齐锂业	6,000	748,800.00	0.31
78	H09992	泡泡玛特	23,000	745,469.12	0.31
79	000703	恒逸石化	70,700	743,057.00	0.30
80	603259	药明康德	7,140	742,488.60	0.30
81	688776	国光电气	4,100	696,959.00	0.29
82	300358	楚天科技	39,100	695,589.00	0.28
83	601995	中金公司	15,400	685,146.00	0.28
84	603659	璞泰来	8,000	675,200.00	0.28
85	300568	星源材质	22,800	662,112.00	0.27
86	H03808	中国重汽	69,500	653,792.76	0.27
87	300258	精锻科技	59,000	651,360.00	0.27
88	002250	联化科技	39,600	648,252.00	0.27
89	600499	科达制造	31,300	646,032.00	0.26
90	300890	翔丰华	11,400	630,648.00	0.26
91	H03990	美的置业	53,000	574,721.89	0.24
92	002139	拓邦股份	46,400	569,328.00	0.23
93	603337	杰克股份	25,200	541,296.00	0.22

94	002444	巨星科技	28,200	531,288.00	0.22
95	600376	首开股份	107,100	525,861.00	0.22
96	688077	大地熊	5,983	504,426.73	0.21
97	300679	电连技术	11,200	494,928.00	0.20
98	H02269	药明生物	8,000	491,221.14	0.20
99	603085	天成自控	55,700	470,108.00	0.19
100	600208	新湖中宝	169,900	468,924.00	0.19
101	603690	至纯科技	11,600	467,480.00	0.19
102	688668	鼎通科技	6,593	463,751.62	0.19
103	H00941	中国移动	11,000	460,947.41	0.19
104	601888	中国中免	1,977	460,502.61	0.19
105	600021	上海电力	43,900	449,975.00	0.18
106	H01801	信达生物	15,000	447,691.97	0.18
107	000875	吉电股份	59,200	411,440.00	0.17
108	000776	广发证券	21,100	394,570.00	0.16
109	300450	先导智能	6,200	391,716.00	0.16
110	603882	金域医学	4,500	371,475.00	0.15
111	000739	普洛药业	17,900	369,456.00	0.15
112	600905	三峡能源	57,100	359,159.00	0.15
113	000596	古井贡酒	1,400	349,524.00	0.14
114	002460	赣锋锂业	2,300	342,010.00	0.14
115	600938	中国海油	17,900	312,355.00	0.13
116	300390	天华超净	3,500	305,900.00	0.13
117	002213	大为股份	20,400	303,348.00	0.12
118	002136	安纳达	19,800	302,544.00	0.12
119	300035	中科电气	10,300	287,885.00	0.12
120	300409	道氏技术	10,100	262,398.00	0.11
121	002765	蓝黛科技	30,300	244,521.00	0.10
122	002705	新宝股份	10,200	224,298.00	0.09
123	002271	东方雨虹	4,300	221,321.00	0.09
124	603233	大参林	6,900	215,970.00	0.09
125	002706	良信股份	12,800	211,584.00	0.09
126	688772	珠海冠宇	6,865	210,755.50	0.09
127	300351	永贵电器	11,700	195,390.00	0.08
128	600933	爱柯迪	11,600	190,008.00	0.08
129	002179	中航光电	2,940	186,160.80	0.08
130	002230	科大讯飞	4,300	177,246.00	0.07
131	601238	广汽集团	11,300	172,212.00	0.07
132	002959	小熊电器	2,500	155,825.00	0.06
133	002459	晶澳科技	1,960	154,644.00	0.06
134	002176	江特电机	6,100	152,744.00	0.06
135	300014	亿纬锂能	1,500	146,250.00	0.06
136	002138	顺络电子	5,300	144,425.00	0.06

137	600114	东睦股份	18,000	143,640.00	0.06
138	605111	新洁能	1,100	138,391.00	0.06
139	600885	宏发股份	3,080	128,898.00	0.05
140	605068	明新旭腾	5,500	128,425.00	0.05
141	688048	长光华芯	1,046	127,277.28	0.05
142	688383	新益昌	1,118	127,172.50	0.05
143	603319	湘油泵	6,500	123,240.00	0.05
144	002897	意华股份	2,500	110,250.00	0.05
145	300499	高澜股份	8,900	107,423.00	0.04
146	300373	扬杰科技	1,500	106,875.00	0.04
147	688599	天合光能	1,554	101,398.50	0.04
148	002048	宁波华翔	6,300	100,926.00	0.04
149	603035	常熟汽饰	5,900	97,468.00	0.04
150	603383	顶点软件	3,300	81,477.00	0.03
151	688595	芯海科技	1,358	78,519.56	0.03
152	002057	中钢天源	6,700	77,385.00	0.03
153	603978	深圳新星	3,100	66,061.00	0.03
154	603335	迪生力	10,600	64,024.00	0.03
155	002937	兴瑞科技	3,400	62,866.00	0.03
156	603897	长城科技	2,000	62,300.00	0.03
157	600298	安琪酵母	1,200	58,500.00	0.02
158	600958	东方证券	5,500	56,155.00	0.02
159	000519	中兵红箭	1,900	55,385.00	0.02
160	688279	峰岬科技	747	55,218.24	0.02
161	002475	立讯精密	1,500	50,685.00	0.02
162	688682	霍莱沃	560	46,496.80	0.02
163	002335	科华数据	1,500	46,275.00	0.02
164	688800	瑞可达	362	45,724.22	0.02
165	002553	南方精工	4,500	42,120.00	0.02
166	605128	上海沿浦	1,100	40,997.00	0.02
167	688325	赛微微电	624	38,188.80	0.02
168	603179	新泉股份	1,300	37,700.00	0.02
169	688168	安博通	1,047	37,587.30	0.02
170	688258	卓易信息	1,040	35,734.40	0.01
171	002939	长城证券	3,500	35,560.00	0.01
172	300100	双林股份	3,700	34,928.00	0.01
173	688378	奥来德	872	34,016.72	0.01
174	301067	显盈科技	800	31,568.00	0.01
175	002192	融捷股份	200	30,740.00	0.01
176	603040	新坐标	1,600	30,000.00	0.01
177	000837	秦川机床	3,600	29,664.00	0.01
178	601038	一拖股份	2,100	23,646.00	0.01
179	603997	继峰股份	2,100	22,848.00	0.01

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	300750	宁德时代	4,976,399.00	1.36
2	002415	海康威视	4,969,380.00	1.36
3	000657	中钨高新	4,322,641.60	1.18
4	000063	中兴通讯	4,085,236.00	1.12
5	000069	华侨城 A	3,725,216.00	1.02
6	002488	金固股份	3,165,022.00	0.87
7	603501	韦尔股份	2,361,214.78	0.65
8	600309	万华化学	2,342,386.00	0.64
9	601658	邮储银行	2,122,695.00	0.58
10	603833	欧派家居	2,071,021.00	0.57
11	601688	华泰证券	2,010,385.00	0.55
12	600741	华域汽车	1,912,501.00	0.52
13	H03690	美团-W	1,816,634.50	0.50
14	000537	广宇发展	1,794,988.00	0.49
15	002965	祥鑫科技	1,773,657.00	0.49
16	000423	东阿阿胶	1,752,551.00	0.48
17	002540	亚太科技	1,691,170.00	0.46
18	603816	顾家家居	1,670,862.00	0.46
19	000002	万科 A	1,640,627.00	0.45
20	001979	招商蛇口	1,587,474.00	0.43

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	000063	中兴通讯	11,437,365.44	3.13
2	002372	伟星新材	9,570,251.59	2.62
3	603337	杰克股份	8,494,342.00	2.33
4	300679	电连技术	4,770,659.40	1.31
5	600048	保利发展	4,226,919.00	1.16
6	603279	景津装备	4,195,824.00	1.15
7	600036	招商银行	3,894,451.00	1.07
8	300750	宁德时代	3,415,336.00	0.94
9	601166	兴业银行	3,175,138.00	0.87
10	600426	华鲁恒升	3,086,253.50	0.85
11	002957	科瑞技术	2,937,936.00	0.80

12	002101	广东鸿图	2,745,041.00	0.75
13	600406	国电南瑞	2,697,170.00	0.74
14	600516	方大炭素	2,580,645.00	0.71
15	002635	安洁科技	2,566,720.00	0.70
16	600690	海尔智家	2,557,951.00	0.70
17	605080	浙江自然	2,553,401.00	0.70
18	001979	招商蛇口	2,543,412.00	0.70
19	002884	凌霄泵业	2,498,338.40	0.68
20	002488	金固股份	2,483,317.75	0.68

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	126,764,964.71
卖出股票收入（成交）总额	201,216,035.75

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

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	10,481,123.29	4.29
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,122,919.45	1.69
5	企业短期融资券	20,177,817.53	8.26
6	中期票据	28,459,923.85	11.66
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	63,241,784.12	25.90

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

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	10,895,520.55	4.46
2	1721046	17 联合农商二级 02	100,000	10,481,123.29	4.29
3	101901669	19 江宁城建	100,000	10,284,801.10	4.21

		MTN001			
4	012281237	22 昆山文商 SCP001	100,000	10,091,396.16	4.13
5	042280161	22 华发集团 CP001	100,000	10,086,421.37	4.13

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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	创金合信基金管理有限公司	46,334,354.69	18.98
2	大成基金管理有限公司	61,673,281.37	25.26
3	永赢基金管理有限公司	42,876,595.52	17.56
4	信达澳亚基金管理有限公司	54,199,654.96	22.20

5	惠升基金管理有限责 任公司	39,082,324.08	16.01
---	------------------	---------------	-------

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

2021 年 9 月 28 日，杭州联合农村商业银行股份有限公司（简称：杭州联合农商行）收到中国银保监会浙江监管局的行政处罚决定书（浙银保监罚决字〔2021〕36 号），因其信贷管理不到位，贷款资金被挪用于股权投资、贸易背景审查不严，违规办理无真实贸易背景的票据业务等违法违规事实，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，被中国银保监会浙江监管局处以罚款 80 万元。

2022 年 4 月 28 日，杭州联合农村商业银行股份有限公司收到中国人民银行杭州中心支行的行政处罚决定书（杭银处罚字〔2022〕18 号），因违反国库管理相关规定，被中国人民银行杭州中心支行予以警告并处罚 25 万元的行政处罚。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，杭州联合改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。杭州联合为杭州地区村镇银行，以中小微企业的传统存贷业务为主，吸储能力较好，信贷资产较为优良，不良和关注贷款占比较低，金融投资占比不高，整体信用风险较低。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 17 联合农商二级 02 进行了投资。

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	61,523.18
2	应收清算款	-
3	应收股利	136,580.94
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	198,104.12

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处于转股期的可转换债券。

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。

§ 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	4,323	49,206.92	990.41	0.00%	212,720,518.19	100.00%
创金合信群力一年定开混合 (MOM) C	5,288	6,002.00	-	-	31,738,575.65	100.00%
合计	9,506	25,716.40	990.41	0.00%	244,459,093.84	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	113,038.95	0.05%
	创金合信群力一年定开混合 (MOM) C	10,736.55	0.03%
	合计	123,775.50	0.05%

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	291,620,442.49	46,016,857.68
本报告期基金总申购份额	58,704.97	38,316.38
减：报告期基金总赎回份额	78,957,638.86	14,316,598.41
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	212,721,508.60	31,738,575.65

§ 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

本基金本报告期内基金管理人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未发生受到监管部门稽查或处罚的情况。

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	
东兴证券	1	113,076,657.28	34.48%	82,691.70	34.76%	-
海通证券	2	14,251,210.11	4.35%	11,400.95	4.79%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	24,843,579.84	7.57%	18,011.77	7.57%	-
中信证券	2	51,094,302.63	15.58%	37,064.46	15.58%	-
第一创业证券	3	124,715,250.60	38.03%	88,709.78	37.29%	-

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 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；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金报告期内新增中信建投证券证券 2 个交易单元、中信证券 2 个交易单元、山西证券 2 个交易单元、西藏东方财富证券 2 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
东兴证券	813,363.80	16.48%	9,700,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	4,051,911.23	82.11%	-	-	-	-
第一创业证券	69,493.60	1.41%	-	-	-	-

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 2021 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
2	创金合信基金管理有限公司 旗下基金 2021 年度第四季度报告提示性公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
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	2022-03-02
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(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	2022-03-26
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（2022 年 3 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	2022-03-26
6	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管	公司官网、中国证监	2022-03-26

	理人（MOM）证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	会基金电子披露网站	
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 2021 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
8	创金合信群力一年定期开放混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-13
9	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	2022-04-14
10	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（2022 年 4 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	2022-04-14
11	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	2022-04-14
12	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 2022 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
13	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-10

§ 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

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 2022 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 84 只公募基金，公募管理规模 1027.19 亿元。2022 年 7 月，创金合信基金荣获证券时报第十七届“明星基金公司成长奖”。

§ 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 2022 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

创金合信基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日