

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：中邮创业基金管理股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 11 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金管理人-中邮创业基金管理股份有限公司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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 10 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，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。

本报告财务资料已经审计，致同会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	15
4.10 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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	56
8.3 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.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
8.6 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.....	65

8.7 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	65
8.8 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	65
8.9 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	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 市场中性策略执行情况	66
8.13 投资组合报告附注	66
§9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.3 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的情况	68
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	68
§10 开放式基金份额变动	69
§ 11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 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	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	71
§12 影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1 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	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	中邮绝对收益策略定期开放混合
基金主代码	002224
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 30 日
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	272, 272, 252. 39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活应用各种金融工具和风险对冲策略降低投资组合风险，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>（一）股票绝对收益投资策略</p> <p>本策略积极依托基金管理人投研平台的研究能力进行积极主动的个股选择策略，通过定量与定性相结合的分析方法考量上市公司的盈利状况、估值水平、市场情绪、股价催化剂等因素，辅以量化投资模型从基金管理人的股票库中精选股票，努力获取超额收益，同时在金融衍生品市场上对冲，剥离系统性风险，力争实现较为稳定的绝对收益。在构建投资组合的过程中，本基金将遵循以下投资策略：</p> <p>1、定性与定量相结合构建股票组合</p> <p>本基金选取具有良好投资价值的股票作为投资对象，以深入的基本面研究为基础，采取自下而上的方法，通过定量和定性相结合的方法精选个股。</p> <p>2、市场中性策略</p> <p>现阶段本基金将利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。</p> <p>（二）其他绝对收益策略</p> <p>1、固定收益品种投资策略</p> <p>本基金投资债券首先综合考量股票组合及股指期货套期保值对资金的需求，对闲置资金投资债券做出规划，包括债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排等。然后在这些约束条件下，综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。</p> <p>2、衍生品投资策略</p> <p>本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规</p>

	规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准构成为：金融机构人民币一年期定期存款基准利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中邮创业基金管理股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	林兴盛
	联系电话	010-82295160—157	021-52629999-213707
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	linxingsheng@cib.com.cn
客户服务电话		010—58511618	95561
传真		010-82295155	021-62159217
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	福州市湖东路 154 号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		100013	200120
法定代表人		毕劲松	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.postfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人或基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
注册登记机构	中邮创业基金管理股份有限公司	北京市东城区和平里中街乙 16 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	53,205,910.64	20,840,279.55	13,384,283.13
本期利润	15,059,972.88	57,920,973.58	20,451,994.55
加权平均基金份额本期利润	0.0199	0.1155	0.0736
本期加权平均净值利润率	1.87%	11.31%	8.42%
本期基金份额净值增长率	1.99%	15.57%	8.06%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	3,394,170.18	-53,007,281.94	-35,540,992.15
期末可供分配基金份额利润	0.0125	-0.0564	-0.1485
期末基金资产净值	292,609,104.36	990,368,902.71	218,099,924.33
期末基金份额净值	1.075	1.054	0.912
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	7.50%	5.40%	-8.80%

注：本报告期是 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日。

1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2. 所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。
3. 期末可供分配利润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（为期末余额，不是当前发生额）。

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

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	0.84%	0.25%	0.73%	0.01%	0.11%	0.24%
过去六个月	1.03%	0.32%	1.48%	0.01%	-0.45%	0.31%
过去一年	1.99%	0.32%	2.98%	0.01%	-0.99%	0.31%
过去三年	27.37%	0.31%	9.51%	0.01%	17.86%	0.30%
过去五年	17.49%	0.28%	16.91%	0.01%	0.58%	0.27%
自基金合同生效起至今	7.50%	0.27%	21.04%	0.01%	-13.54%	0.26%

注：所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。

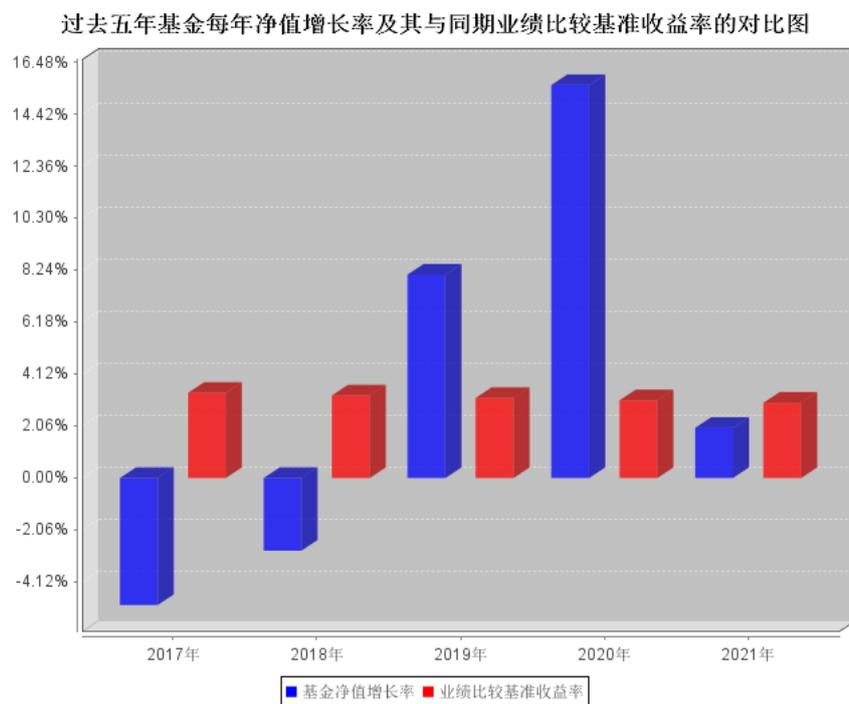
本基金整体业绩比较基准构成为：金融机构人民币一年期定期存款基准利率（税后）+2%

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：本基金自 2015 年 12 月 30 日基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§ 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

基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司成立于 2006 年 5 月 8 日，截至 2021 年 12 月 31 日，本公司共管理 53 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮睿利增强债券型证券投资基金、中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金、中邮科技创新精选混合型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮价值精选混合型证券投资基金、中邮价值优选一年定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮未来成长混合型证券投资基金、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中邮睿丰增强债券型证券投资基金、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、中邮鑫溢中短债债券型证券投资基金。

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		
王喆	基金经理	2018 年 12 月 19 日	-	9 年	曾任工商银行北京分行海淀西区支行个金部职员、工商银行总行资产管理部投资管理岗、中邮创业基金管理股份有限公司证券投资研究分析员、中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金经理。现任中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的基金经理注册或变更等通知的日期。

4.1.3 基金经理薪酬机制

公司用职级职等管理办法作为薪酬管理机制，根据员工不同的工作内容及工作表现，设立不同序列、不同职级以及不同职等。基金经理作为公司运营的核心，设立单独职级序列。基金经理薪酬严格按照职级职等管理办法进行管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》

等相关法律法规及本基金基金合同的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。

本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合有关法律法规和基金合同的规定和约定；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发生内幕交易的情况；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回及其他交易类业务、注册登记业务均按规定的程序、规则进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，制定了《中邮基金管理股份有限公司公平交易制度》。从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过制度流程和信息技术手段以保证实现公平交易原则。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（1日内、3日、5日）同向交易的样本，根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度进行分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

基金经理严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易相关制度要求执行，对公平交易进行管理，独立确定投资组合的交易价格和数量。报告期内，不存在违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人所管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

本基金主要通过量化多因子模型构建股票多头组合，并通过持有股指期货空头对冲股票投资组合的系统性风险，从而将多头组合相对指数的超额收益转化为绝对收益。股票投资组合在报告期内主要以沪深 300 指数为基准，控制行业、市值等风险因子的敞口。

2021 年，市场风格发生多次切换，从因子角度观察，市场主要是在龙头股、赛道股代表的成长、机构持仓、动量等因子与周期、价值股代表的估值、波动、反转因子之间的博弈。演绎路径是：一季度初至春节前，龙头股延续 2020 年四季度强势，春节过后，市场风格切换，强势股快速杀跌，估值因子修复；临近一季报和年报披露期，强势股反弹，直至二季度末，新能源、汽车等成长性行业超额收益显著，市场风格较为稳定；三季度，市场风格切换，伴随商品价格上涨，周期行业股价快速上行，强势股再次杀跌；四季度，市场从季度初的成长风格，在 12 月份又切换到价值风格。

一方面，市场风格在 2021 年发生快速切换，风格动量较难捕捉；另一方面，负基差在三、四季度的大幅波动也提升了对冲策略的运作难度。为了应对以上情况，本基金根据市场情况灵活调整对冲策略仓位，当市场风格频繁切换时，组合维持中低仓位运行；此外，在量化模型使用时，采用多模型方式，降低单一策略阶段性失效的风险，在组合预期收益波动较大时，以控制净值回撤为首要目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.075 元，累计净值为 1.075 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.99%，业绩比较基准收益率为 2.98%。

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 2022 年，我们认为经济增长放缓的压力不断增大，货币政策整体趋于宽松，利率仍会维持在偏低位置，中短期内市场流动性无忧；另一方面，“疫情”对经济社会的影响会逐步下降，全球经济贸易逐步恢复。我们认为今年的股票市场会更趋于均衡，近年来大幅上涨的景气板块面临估值高的压力比较大，板块内个股会有较大分化，没有持续增长的业绩支撑的个股可能面临较大回调压力，业绩不断兑现的股票仍有机会不断上涨；而前几年受“疫情”影响较大的板块今年会迎来一定的修复，同时估值受压制的低估值板块今年也有望受到资金青睐，估值因子有望获得

一定程度的修复。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人致力于建立和健全公司内部控制制度，努力防范和化解公司各项经营管理活动中的风险，促进公司诚信、合法、有效经营，切实保障基金份额持有人的利益。

公司建立了督察长制度，督察长全权负责公司的监察与稽核工作，对基金运作的合法合规性进行全面检查与监督，遇有重大风险事件立即向公司董事长和中国证监会报告。公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，由督察长直接领导。监察稽核部按照规定的权限和程序，通过日常实时监控、现场专项检查、定期监察稽核评估等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向公司董事和管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人主要内部监察稽核工作如下：

1. 制度建设不断完善

基金管理人进一步健全公司内控体系，保持了良好的内控环境、完善了内部控制的三道防线，并根据公司实际业务情况细化了岗位风险控制。在制订部门规章制度和业务流程时，将内控要求融入到各业务规范当中。同时根据公司业务的发展及监管部门法律法规的更新，对公司和部门制度进行持续的完善、修订及补充。制定了《中邮创业基金管理股份有限公司重大事项报告制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司总经理办公会议事规则》、《中邮创业基金管理股份有限公司数据资产管理制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司自有资金投资管理制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司洗钱和恐怖融资风险自评估制度》等，修改并完善了《中邮创业基金管理股份有限公司廉洁从业管理制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司危机处理实施办法》、《中邮创业基金管理股份有限公司关联交易管理制度》、《中邮创业基金合规管理手册》等，进一步完善了公司的制度体系。

2. 日常监察稽核工作

为规范基金投资运作、防范风险、更好的保护基金份额持有人的利益，对基金投资运作进行日常的监察工作，保障研究、投资决策、交易执行等环节严格执行法律法规及基金合同的有关规定。在日常实时电脑监控中，对基金投资及相关业务进行事中的风险控制，保障公司管理的基金规范运作。此外对信息技术、基金的注册登记、基金会计、信息披露等业务进行例行检查。

3. 专项监察稽核工作

根据监管部门的要求及公司业务开展情况，对相关业务部门进行专项监察稽核。报告期内，对公司的研究部、权益投资部、固定收益部、信息技术部、营销部、直销柜台等进行了专项稽核，

通过检查发现内部控制薄弱点，及时提出了整改意见及建议。

4. 定期监察稽核及内控检查评估工作

每季度对公司及基金运作的合法合规性及内部控制情况进行检查，对公司各项业务的制度建设、制度执行、风险控制等情况进行评估，发现内控的薄弱环节，并提出相应改进措施，促进公司内部控制和风险管理水平的加强和提高。

在本报告期内，本基金管理人运用基金财产进行投资严格按照招募说明书所披露的投资决策程序进行，无不当内幕交易和关联交易。没有发生重大违法违规行为。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持内部控制优先原则，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理公司于本报告期内成立估值小组，成员由总经理、督察长、基金清算部经理、基金经理及基金会计组成。估值小组负责确定基金估值程序及标准以及对突发事件的处理，在采用估值政策和程序时，充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

否。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 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

本托管人依据《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》与《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》，自 2015 年 12 月 30 日起托管中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	致同审字(2022)第 110A001515 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称中邮绝对收益基金）的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定编制，公允反映了中邮绝对收益基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中邮绝对收益基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>中邮绝对收益基金的基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中邮绝对收益基金 2021 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、</p>

	<p>执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中邮绝对收益基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中邮绝对收益基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中邮绝对收益基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据所获取的审计证据,就可能导致对中邮绝对收益基金的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;</p>

	<p>如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中邮绝对收益基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	致同会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	卫俏嫔 张丽雯
会计师事务所的地址	中国北京朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
审计报告日期	2022 年 3 月 10 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	6,606,581.08	53,676,668.82
结算备付金		29,439,701.53	242,582,400.53
存出保证金		27,058,878.15	65,943,584.86
交易性金融资产	7.4.7.2	232,175,040.17	634,024,308.55
其中：股票投资		232,175,040.17	616,036,908.55
基金投资		-	-
债券投资		-	17,987,400.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	20,000,000.00
应收证券清算款		384,810.12	-
应收利息	7.4.7.5	14,017.14	433,804.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		295,679,028.19	1,016,660,767.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,277,899.37	23,386,289.83
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		379,910.29	746,653.74
应付托管费		94,977.60	186,663.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	997,136.57	1,472,257.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	320,000.00	500,000.00
负债合计		3,069,923.83	26,291,864.31
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	272,272,252.39	939,870,419.98
未分配利润	7.4.7.10	20,336,851.97	50,498,482.73
所有者权益合计		292,609,104.36	990,368,902.71
负债和所有者权益总计		295,679,028.19	1,016,660,767.02

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.075 元，基金份额总额 272,272,252.39 份。

7.2 利润表

会计主体：中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		38,147,491.42	75,214,822.98
1. 利息收入		4,348,412.75	2,775,540.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,104,909.99	2,288,317.84
债券利息收入		453,507.44	183,332.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		789,995.32	303,891.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		71,242,380.67	34,985,401.15
其中：股票投资收益	7.4.7.12	86,132,460.88	136,537,606.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-511,205.53	-8,417.66
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-20,844,740.00	-105,806,778.27
股利收益	7.4.7.16	6,465,865.32	4,262,990.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-38,145,937.76	37,080,694.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	702,635.76	373,186.84
减：二、费用		23,087,518.54	17,293,849.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,096,105.90	7,725,493.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,025,844.36	1,264,794.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	9,705,305.08	8,045,185.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		34.49	19,645.19
7. 其他费用	7.4.7.20	260,228.71	238,730.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,059,972.88	57,920,973.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,059,972.88	57,920,973.58

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	939,870,419.98	50,498,482.73	990,368,902.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,059,972.88	15,059,972.88
三、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）	-667,598,167.59	-45,221,603.64	-712,819,771.23
其中：1. 基金申购款	123,128,777.47	7,945,181.44	131,073,958.91
2. 基金赎回款	-790,726,945.06	-53,166,785.08	-843,893,730.14
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	272,272,252.39	20,336,851.97	292,609,104.36
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制，执行财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）和中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、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〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础的财务报表符合企业会计准则的要求，真实完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年度，即从每年 1 月 1 日至 12 月 31 日为一个会计期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款、应收款项。除与权证投资有关的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示；与权证投资有关的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

本基金持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的各类应收款项等在活跃市场没有报价、回收金额固定或可以确定的非衍生金融资产分类为贷款与应收款项。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。除与权证投资有关的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示，与权证投资有关的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金目前持有的金融负债全部为其他金融负债，包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行清算。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。股票投资收益按卖出股票成交总额与其成本和估值增值或减值的差额入账，同时将原计入该卖出股票的公允价值变动损益转入股票投资收益，卖出股票应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

股票持有期间分派的股票股利，应于除权除息日根据上市公司股东大会决议公告，按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量，在本账户“数量”栏进行记录。因持有股票而享有的配股权，配股除权日在配股缴款截止日之后的，在除权日按所配的股数确认未流通部分的股票投资，与已流通部分分别核算。配股除权日在配股缴款截止日之前的，按照权证的有关原则进行核算。

股票投资应分派的现金股利，在除息日确认为股利收入。

估值日对持有的股票估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认债券投资；债券投资按交易日债券的公允价值（不含支付价款中所包含的应收利息）入账，应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应

作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行资金交收。

持有债券期间，每日确认利息收入，计入应收利息和利息收入科目。

债券派息日，按应收利息金额，与证券登记结算机构进行资金交收。

估值日对持有的债券估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

卖出债券应于交易日确认债券投资收益。债券投资收益按卖出债券应收取的全部价款与其成本、应收利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该卖出债券的公允价值变动损益转入债券投资收益，卖出债券应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

到期收回债券本金和利息，债券投资收益按收回债券应收取的全部价款与其成本、应收利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该收回债券的公允价值变动损益转入债券投资收益。

可转换债券转股时，按可转换股票的公允价值计入股票投资科目，按应收取的现金余额返还扣除可转换股票的公允价值后的余额，与可转换债券成本、应收利息和估值增值或减值的差额计入债券投资收益，同时，将原计入该转换债券的公允价值变动损益转入债券投资收益。

（3）权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行清算。

获赠权证（包括配股权证）在除权日应按持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，在本账户“数量”栏进行记录。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益。衍生工具收益按卖出权证成交总额与其成本和估值增值或减值的差额入账，同时将原计入该卖出权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

权证行权按结算方式分为证券结算方式和现金结算方式，具体核算如下：

A、证券结算方式

认购权证以证券结算方式行权时，按股票的公允价值确认股票投资成本，按股票公允价值与权证成本、估值增值或减值、行权价款及相关费用的差额确认衍生工具收益，同时将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

认沽权证以证券结算方式行权时，按认沽权证的理论价值与账面价值之差（若有）确认衍生工具收益，按行权价款扣除费用后的余额与权证投资成本、估值增值或减值、结转的股票投资成本、估值增值或减值、认沽权证的理论价值与账面价值之差（若有）的差额确认股票投资收益，同时，将原计入卖出股票和原计入权证的公允价值变动损益转入股票投资收益和衍生工具收益。

B、现金结算方式

权证以现金结算方式行权时，按确定的金额扣减交易费用后的余额与结转的权证成本、估值增值或减值的差额确认衍生工具收益，同时，将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

放弃行权，在放弃行权确定日，按结转的权证成本、估值增值或减值，确认衍生工具收益，同时，将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

(4) 资产支持证券

取得资产支持证券时，按公允价值入账；取得资产支持证券支付的款项时，区分属于资产支持证券投资本金部分和证券投资收益部分，将收到的本金部分冲减成本，将收到的收益部分冲减应计利息（若有）后的差额，记入资产支持证券利息收入，其他与资产支持证券投资相关业务的账务处理比照债券投资。

(5) 买入返售金融资产和卖出回购金融资产

根据返售协议，按照应付和实际支付的金额确认入账；返售前，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；返售日，按照应收或实际收到的金额与账面余额和应收利息的差额，计算确认利息收入。

根据回购协议，按照应收和实际收到的金额确认入账；融资期限内，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；到期回购时，按照应付或实际支付的金额与账面余额和应付利息的差额，计算确认利息支出。

(6) 股指期货投资

股指期货在买入和卖出合约时，记录初始合约价值。估值日对股指期货估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

买入合约卖出平仓、卖出合约买入平仓或到期交割时，采用移动加权方法结转平仓合约的初始合约价值。日终结算时，对股指期货进行估值，确认平仓损益，进行当日无负债结算，并对合约占用的交易保证金进行调整。

(7) 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值原则遵循《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13号）及《中国基金估值标准 2018》中的相关法规，具体估值方法如下：

（1）股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无市价，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件，应采用最近交易市价确定公允价值；有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行的股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售的股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，参考《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（中基协发〔2017〕6号）进行估值。

（2）债券投资

本基金在对银行间和交易所市场的固定收益品种估值时，主要依据由第三方估值机构提供的价格数据。第三方估值机构包括中央国债登记结算公司（以下简称“中央结算公司”）和中证指数有限公司。第三方估值机构根据以下原则确定估值品种公允价值：对于存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。

未上市流通的债券在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

（3）权证投资

上市权证按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应采用最近交易市价确定公允价值。估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

（4）股指期货投资

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交

易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(5) 其他投资品种

交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

资产支持证券等固定收益品种采用估值技术确定公允价值。

(6) 估值不能客观反映其公允价值的处理

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(7) 实际投资成本与估值的差异处理

实际投资成本与估值的差异计入“公允价值变动损益”科目。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示不得相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

本基金单位总额不固定，基金单位总数随时增减。基金合同生效时，实收基金按实际收到的基金单位发行总额入账；基金合同生效后，实收基金应于基金申购、赎回确认日根据基金契约和招募说明书中载明的有关事项进行确认和计量。

7.4.4.8 损益平准金

基金管理公司于收到基金投资人申购或转换申请之日起规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，计算有效申购或转换款中含有的实收基金部分，确认并增加实收基金，按基金申购或转换款与实收基金的差额，确认并增加损益平准金。

基金管理公司于收到基金投资人赎回或转换申请之日起规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，对基金赎回款或转换转出款中含有的实收基金，确认并减少实收基金，按基金赎回款或转换转出款与实收基金的差额，确认并减少损益平准金。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 股票投资收益

于卖出股票交易日确认，按卖出股票成交总额与其成本的差额入账。

(2) 债券投资收益

于卖出债券交易日确认，按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

(3) 股利收入

于除息日确认，按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

(4) 债券利息收入

在债券实际持有期内逐日计提，按摊余成本和实际利率计算确定的金额入账。

(5) 存款利息收入

逐日计提，按本金与适用的利率计提的金额入账。

(6) 买入返售证券收入

在证券持有期内采用实际利率逐日计提，按计提的金额入账。

(7) 公允价值变动损益

于估值日，对采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的损益进行确认；卖出股票、债券、权证等资产时，将原计入该卖出资产的公允价值变动损益转入股票投资收益、债券投资收益、衍生工具收益等科目。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理人报酬

①基金管理人的基本管理费

本基金的基本管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率逐日计提。

②基金管理人的附加管理费

附加管理费是在符合基金收益分配原则的前提下，在提取评价日(每次基金封闭期的最后一个工作日)计算并提取，按照“新高法原则”提取超额收益的 10%作为附加管理费：即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，管理人才能收取附加管理费。

(2) 基金托管费

按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

(3) 交易费用

对股票、债券、资产支持证券、基金、权证等交易过程中发生的，可直接归属于取得或处置

某项基金资产或承担某项基金负债的新增外部成本，包括支付给交易代理机构的规费、佣金、代征的税金及其他必要的可以正确估算的支出，在资产交易日确认各项交易费用。

(4) 利息支出

对银行借款利息支出、交易性金融负债利息支出和卖出回购金融资产支出，在借款期或融资期内按实际利率逐日计提并确认入账。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

7.4.6 税项

财税[2008]1号《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[2012]85号《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[2016]36号《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《财政部国家税务总局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《财政部国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2017]56号《财政部国家税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《财政部国家税务总局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，本基金主要税项列示如下：

1. 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免

征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产（质押式、买断式）；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

基金增值税应税行为包括贷款服务和金融商品转让。采用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。基金管理人运营基金提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（1）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；（2）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

2. 对证券投资基金从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。

3. 基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。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；对个人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。

4. 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	6,606,581.08	53,676,668.82
定期存款	-	-
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	-	-
合计:	6,606,581.08	53,676,668.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	226,940,367.33	232,175,040.17	5,234,672.84
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	226,940,367.33	232,175,040.17	5,234,672.84
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	549,078,163.80	616,036,908.55	66,958,744.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	17,969,374.15	17,987,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	17,969,374.15	17,987,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	567,047,537.95	634,024,308.55	66,976,770.60

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	

权益衍生工具	-224,736,779.90	-	-	
其中：股指期货	-224,736,779.90	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-224,736,779.90	-	-	
项目	上年度末 2020年12月31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	-523,153,299.90	-	-	
其中：股指期货	-523,153,299.90	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-523,153,299.90	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况（买入持仓以正数表示，卖出持仓以负数表示）：代码为 IF2201，名称为沪深 300 指数期货 IF2201 合约，持仓量为-61 手，合约市值为-90,537,420.00 元，公允价值变动数为 1,714,347.02 元；代码为 IF2203，名称为沪深 300 指数期货 IF2203 合约，持仓量为-40 手，合约市值为-59,407,200.00 元，公允价值变动数为-754,544.08 元；代码为 IH2201，名称为上证 50 指数期货 IH2201 合约，持仓量为-59 手，合约市值为-58,137,420.00 元，公允价值变动数为-72,823.04 元；代码为 IH2202，名称为上证 50 指数期货 IH2202 合约，持仓量为-8 手，合约市值为-7,899,840.00 元，公允价值变动数为-12,480.00 元；代码为 IH2203，名称为上证 50 指数期货 IH2203 合约，持仓量为-8 手，合约市值为-7,916,640.00 元，公允价值变动数为-36,240.00 元。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有买断式逆回购金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	843.98	7,413.54
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	13,087.16	138,540.43
应收债券利息	-	287,654.79
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	86.00	195.50
合计	14,017.14	433,804.26

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	997,136.57	1,472,257.32
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	997,136.57	1,472,257.32

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	-	-

预提费用	320,000.00	500,000.00
合计	320,000.00	500,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	939,870,419.98	939,870,419.98
本期申购	123,128,777.47	123,128,777.47
本期赎回（以“-”号填列）	-790,726,945.06	-790,726,945.06
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	272,272,252.39	272,272,252.39

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-53,007,281.94	103,505,764.67	50,498,482.73
本期利润	53,205,910.64	-38,145,937.76	15,059,972.88
本期基金份额交易产生的变动数	3,195,541.48	-48,417,145.12	-45,221,603.64
其中：基金申购款	-1,962,267.47	9,907,448.91	7,945,181.44
基金赎回款	5,157,808.95	-58,324,594.03	-53,166,785.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,394,170.18	16,942,681.79	20,336,851.97

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
	活期存款利息收入	243,929.54
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	2,848,530.86	2,031,803.06
其他	12,449.59	17,949.30
合计	3,104,909.99	2,288,317.84

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	3,270,205,060.44	2,469,312,266.98
减：卖出股票成本总额	3,184,072,599.56	2,332,774,660.85
买卖股票差价收入	86,132,460.88	136,537,606.13

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-511,205.53	-8,417.66
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	-511,205.53	-8,417.66

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	165,937,906.16	34,566,957.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	164,012,467.81	34,050,864.26
减：应收利息总额	2,436,643.88	524,510.40

买卖债券差价收入	-511,205.53	-8,417.66
----------	-------------	-----------

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-20,844,740.00	-105,806,778.27

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,465,865.32	4,262,990.95
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	6,465,865.32	4,262,990.95

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-61,742,097.76	56,839,785.61
——股票投资	-61,724,071.91	56,838,669.65
——债券投资	-18,025.85	1,115.96
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	23,596,160.00	-19,759,091.58

——权证投资	-	-
——股指期货	23,596,160.00	-19,759,091.58
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	-38,145,937.76	37,080,694.03

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	702,635.76	373,023.30
其他	-	163.54
合计	702,635.76	373,186.84

注：本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%，随持有期限的增加而递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对持续持有期小于30日（不含30日）的，赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日（含30日）但少于93日的，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于93日（含93日）但少于186日的，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于186日（含186日）的，将不低于赎回费总额的25%归基金财产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	9,705,305.08	8,045,185.96
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	9,705,305.08	8,045,185.96

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

审计费用	100,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行结算费用	3,028.71	1,530.36
债券帐户维护费	18,000.00	18,000.00
上清所债券账户维护费	18,000.00	19,200.00
其他	1,200.00	-
合计	260,228.71	238,730.36

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2022 年 3 月 10 日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中邮创业基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国邮政集团有限公司	基金管理人的股东
三井住友银行股份有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,096,105.90	7,725,493.54
其中：支付销售机构的客户维护费	904,062.59	425,627.87

注：支付基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司的基金管理费，为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。

其中，基本管理费按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数

附加管理费是在符合基金收益分配原则的前提下，在提取评价日（每次基金封闭期的最后一个工作日）计算并提取，按照“新高法原则”提取超额收益的 10% 作为附加管理费：即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，管理人才能收取附加管理费。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,025,844.36	1,264,794.35

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金合同生效日（2015年12月30日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	18,690,654.21	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	28,689,654.21	9,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.5400%	1.0600%

7.4.10.5.2 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除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	6,606,581.08	243,929.54	53,676,668.82	238,565.48

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	41.98	41.98	2,563	107,594.74	107,594.74	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股流通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688187	时代电气	2021 年 8 月 30 日	2022 年 3 月 7 日	新股流通受限	31.38	76.65	13,771	432,133.98	1,055,547.15	-
688779	长远锂科	2021 年 8 月 3 日	2022 年 2 月 11 日	新股流通受限	5.65	22.86	34,069	192,489.85	778,817.34	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2022 年 1 月 5 日	新股流通受限	11.48	67.46	4,926	56,550.48	332,307.96	-
688230	芯导科技	2021 年 11 月 24 日	2022 年 6 月 1 日	新股流通受限	134.81	130.31	2,179	293,750.99	283,945.49	-
688793	倍轻松	2021 年 7 月 7 日	2022 年 1 月 17 日	新股流通受限	27.40	101.73	1,454	39,839.60	147,915.42	-

688737	中自科技	2021年10月14日	2022年4月22日	新股流通受限	70.90	55.06	2,186	154,987.40	120,361.16	-
688768	容知日新	2021年7月16日	2022年1月26日	新股流通受限	18.23	108.54	907	16,534.61	98,445.78	-
688210	统联精密	2021年12月20日	2022年6月27日	新股流通受限	42.76	39.53	2,218	94,841.68	87,677.54	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	116.88	116.08	330	38,570.40	38,306.40	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	352	32,767.68	26,519.68	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-

301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股流通受限	10.45	11.22	2,113	22,080.85	23,707.86	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股流通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	12.03	17.12	1,069	12,860.07	18,301.28	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股流通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	201	15,999.60	15,784.53	-

301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	58.08	49.85	307	17,830.56	15,303.95	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	86.06	94.50	127	10,929.62	12,001.50	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	203	13,434.54	11,493.86	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-

301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月18日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月14日	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月19日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-

301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-

301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

说明：①润丰股份（301035）于2021年9月23日实施分红：A股每10股派发现金红利5.40元（含税）；

②中集车辆（301039）于2021年11月9日实施分红：A股每10股派发现金红利人民币3.00元（含税）；

- ③时代电气（688187）于 2021 年 12 月 17 日实施分红：A 股每股现金红利 0.45 元（含税）；
- ④倍轻松（688793）于 2021 年 9 月 22 日实施分红：A 股每股现金红利 0.486 元（含税）；
- ⑤久祺股份（300994）于 2021 年 10 月 18 日实施分红：A 股每 10 股现金红利 3.60 元（含税）；
- ⑥申菱环境（301018）于 2021 年 9 月 27 日实施分红：A 股每 10 股现金红利 1.50 元（含税）；
- ⑦东亚机械（301028）于 2021 年 9 月 30 日实施分红：A 股每 10 股现金红利 1.60 元（含税）；
- ⑧以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末及上年度末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末及上年度末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控和可承受。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理组织架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助进行风险管理决策，以实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险限度，及时对各种风险进行监督、分析和评估，并制定应对措施，将风险控制在预期可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的信用风险状况进行评级，并对交易对手设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.2.1 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	17,987,400.00
合计	-	17,987,400.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金在报告期内的运作过程中未发生过流动性风险情况。在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。公司每日跟踪监测本基金持有资产的交易量、持仓集中度、流通受限资产占比、可流通资产变现天数、7 日可变现资产比例、信用债券和逆回购质押券最新主体及债项评级、利率债券组合久期、基金杠杆率等涉及资产流动性风险的指标，并设置合理有效的风控阈值进行持续监测。

在负债端，基金管理人详细分析本基金投资者类型、投资者结构、投资者风险偏好和历史申购与赎回数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者赎回需求，制定了健全有效的流动性风

险压力测试方法。当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整基金投资策略，预留充足现金头寸、确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如果遇到极端市场情形或发生巨额赎回情形，公司将采取本基金合同约定的巨额赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下潜在流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险指因受各种因素影响而引起的证券及其衍生品市场价格不利波动，使投资组合资产、公司资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控分析，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	6,606,581.08	-	-	-	6,606,581.08
结算备付金	29,439,701.53	-	-	-	29,439,701.53
存出保证金	27,058,878.15	-	-	-	27,058,878.15
交易性金融资产	-	-	-	-232,175,040.17	232,175,040.17
应收证券清算款	-	-	-	384,810.12	384,810.12
应收利息	-	-	-	14,017.14	14,017.14
资产总计	63,105,160.76	-	-	-232,573,867.43	295,679,028.19
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,277,899.37	1,277,899.37
应付管理人报酬	-	-	-	379,910.29	379,910.29
应付托管费	-	-	-	94,977.60	94,977.60

应付交易费用	-	-	-	997,136.57	997,136.57
其他负债	-	-	-	320,000.00	320,000.00
负债总计	-	-	-	3,069,923.83	3,069,923.83
利率敏感度缺口	63,105,160.76	-	-	-229,503,943.60	292,609,104.36
上年度末 2020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	53,676,668.82	-	-	-	53,676,668.82
结算备付金	242,582,400.53	-	-	-	242,582,400.53
存出保证金	65,943,584.86	-	-	-	65,943,584.86
交易性金融资产	17,987,400.00	-	-	-616,036,908.55	634,024,308.55
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收利息	-	-	-	433,804.26	433,804.26
资产总计	400,190,054.21	-	-	-616,470,712.81	1,016,660,767.02
负债					
应付证券清算款	-	-	-	23,386,289.83	23,386,289.83
应付管理人报酬	-	-	-	746,653.74	746,653.74
应付托管费	-	-	-	186,663.42	186,663.42
应付交易费用	-	-	-	1,472,257.32	1,472,257.32
其他负债	-	-	-	500,000.00	500,000.00
负债总计	-	-	-	26,291,864.31	26,291,864.31
利率敏感度缺口	400,190,054.21	-	-	-590,178,848.50	990,368,902.71

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率平移上升 25 个基点且其他市场变量保持不变	
	市场利率平移下降 25 个基点且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(2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
基金净资产变动	-	-12,622.08
基金净资产变动	-	12,686.11

注：本基金本报告期末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 其他价格风险

市场价格风险

市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%~120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。

开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收

支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	232,175,040.17	79.35	616,036,908.55	62.20
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	17,987,400.00	1.82
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	232,175,040.17	79.35	634,024,308.55	64.02

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1%		
	固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1%		
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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	基金净资产变动	-517,163.84	57,474,487.11
基金净资产变动	517,163.84	-57,474,487.11	

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，利用 2021 年 1 月 1 日以来基金日收益率与基金基准日收益率计算得到基金的 Beta 系数为-0.22。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	232,175,040.17	78.52
	其中：股票	232,175,040.17	78.52
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	36,046,282.61	12.19
8	其他各项资产	27,457,705.41	9.29
9	合计	295,679,028.19	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	747,040.00	0.26
B	采矿业	5,952,149.00	2.03
C	制造业	142,390,382.24	48.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,287,838.00	1.81
E	建筑业	3,297,135.44	1.13
F	批发和零售业	544,453.74	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	3,618,766.12	1.24
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,830,781.31	1.99
J	金融业	52,273,961.92	17.86
K	房地产业	3,979,778.00	1.36
L	租赁和商务服务业	3,378,914.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	4,773,511.19	1.63

N	水利、环境和公共设施管理业	39,652.99	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	37,906.44	0.01
S	综合	-	-
	合计	232,175,040.17	79.35

注：由于四舍五入原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未投资港股通股票。

8.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	9,759	20,005,950.00	6.84
2	600036	招商银行	213,801	10,414,246.71	3.56
3	601318	中国平安	158,331	7,981,465.71	2.73
4	601012	隆基股份	82,700	7,128,740.00	2.44
5	600030	中信证券	204,100	5,390,281.00	1.84
6	000001	平安银行	274,100	4,517,168.00	1.54
7	603259	药明康德	35,080	4,159,786.40	1.42
8	600887	伊利股份	99,100	4,108,686.00	1.40
9	600900	长江电力	179,000	4,063,300.00	1.39
10	300750	宁德时代	6,900	4,057,200.00	1.39
11	600276	恒瑞医药	73,539	3,729,162.69	1.27
12	601888	中国中免	15,400	3,378,914.00	1.15
13	600690	海尔智家	110,000	3,287,900.00	1.12
14	601919	中远海控	172,100	3,216,549.00	1.10
15	603566	普莱柯	134,700	2,976,870.00	1.02
16	600809	山西汾酒	9,320	2,943,069.60	1.01
17	600309	万华化学	27,900	2,817,900.00	0.96
18	603501	韦尔股份	9,000	2,796,930.00	0.96
19	600436	片仔癀	6,300	2,754,045.00	0.94
20	601601	中国太保	101,182	2,744,055.84	0.94
21	603986	兆易创新	15,000	2,637,750.00	0.90
22	600372	中航电子	105,600	2,364,384.00	0.81
23	600438	通威股份	52,200	2,346,912.00	0.80
24	002142	宁波银行	60,840	2,328,955.20	0.80

25	600585	海螺水泥	56,300	2,268,890.00	0.78
26	600837	海通证券	184,700	2,264,422.00	0.77
27	002475	立讯精密	45,700	2,248,440.00	0.77
28	600048	保利发展	140,800	2,200,704.00	0.75
29	000977	浪潮信息	60,600	2,171,298.00	0.74
30	300760	迈瑞医疗	5,600	2,132,480.00	0.73
31	300059	东方财富	56,520	2,097,457.20	0.72
32	002008	大族激光	37,000	1,998,000.00	0.68
33	000858	五粮液	8,807	1,960,966.62	0.67
34	603131	上海沪工	70,000	1,907,500.00	0.65
35	601899	紫金矿业	196,200	1,903,140.00	0.65
36	600745	闻泰科技	14,700	1,900,710.00	0.65
37	600919	江苏银行	310,530	1,810,389.90	0.62
38	000063	中兴通讯	53,600	1,795,600.00	0.61
39	601688	华泰证券	100,900	1,791,984.00	0.61
40	000729	燕京啤酒	210,000	1,778,700.00	0.61
41	002555	三七互娱	62,400	1,686,048.00	0.58
42	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.57
43	601398	工商银行	356,300	1,649,669.00	0.56
44	002385	大北农	155,800	1,634,342.00	0.56
45	300115	长盈精密	79,900	1,585,216.00	0.54
46	002241	歌尔股份	29,100	1,574,310.00	0.54
47	300122	智飞生物	12,400	1,545,040.00	0.53
48	002594	比亚迪	5,700	1,528,284.00	0.52
49	002371	北方华创	4,400	1,526,888.00	0.52
50	601009	南京银行	165,258	1,480,711.68	0.51
51	000661	长春高新	5,400	1,465,560.00	0.50
52	600741	华域汽车	50,800	1,437,640.00	0.49
53	000333	美的集团	19,356	1,428,666.36	0.49
54	600031	三一重工	60,600	1,381,680.00	0.47
55	603288	海天味业	12,900	1,355,919.00	0.46
56	002013	中航机电	71,500	1,299,870.00	0.44
57	603916	苏博特	47,000	1,210,720.00	0.41
58	688600	皖仪科技	55,000	1,177,000.00	0.40
59	002202	金风科技	69,800	1,149,606.00	0.39
60	300014	亿纬锂能	9,500	1,122,710.00	0.38
61	600256	广汇能源	167,500	1,095,450.00	0.37
62	601668	中国建筑	212,900	1,064,500.00	0.36
63	688187	时代电气	13,771	1,055,547.15	0.36

64	601288	农业银行	356,800	1,048,992.00	0.36
65	601633	长城汽车	21,600	1,048,464.00	0.36
66	600000	浦发银行	119,300	1,017,629.00	0.35
67	002212	天融信	51,700	991,089.00	0.34
68	600104	上汽集团	47,700	984,051.00	0.34
69	002415	海康威视	18,700	978,384.00	0.33
70	001979	招商蛇口	70,600	941,804.00	0.32
71	600196	复星医药	18,500	905,390.00	0.31
72	603456	九洲药业	15,600	877,656.00	0.30
73	600426	华鲁恒升	28,030	877,339.00	0.30
74	600893	航发动力	13,600	863,056.00	0.29
75	600456	宝钛股份	12,000	861,360.00	0.29
76	600958	东方证券	57,200	843,128.00	0.29
77	601211	国泰君安	46,000	822,940.00	0.28
78	000568	泸州老窖	3,200	812,384.00	0.28
79	601177	杭齿前进	90,000	810,900.00	0.28
80	601985	中国核电	97,100	805,930.00	0.28
81	002049	紫光国微	3,500	787,500.00	0.27
82	603517	绝味食品	11,500	785,795.00	0.27
83	000596	古井贡酒	3,200	780,800.00	0.27
84	688779	长远锂科	34,069	778,817.34	0.27
85	601088	中国神华	33,700	758,924.00	0.26
86	002714	牧原股份	14,000	747,040.00	0.26
87	600884	杉杉股份	22,600	740,602.00	0.25
88	600570	恒生电子	11,900	739,585.00	0.25
89	002129	中环股份	17,700	738,975.00	0.25
90	000425	徐工机械	119,500	715,805.00	0.24
91	688599	天合光能	8,933	704,813.70	0.24
92	603799	华友钴业	6,235	687,782.85	0.24
93	002304	洋河股份	4,000	658,920.00	0.23
94	601877	正泰电器	12,000	646,680.00	0.22
95	300124	汇川技术	9,050	620,830.00	0.21
96	601377	兴业证券	62,700	619,476.00	0.21
97	600019	宝钢股份	85,700	613,612.00	0.21
98	002821	凯莱英	1,400	609,000.00	0.21
99	600801	华新水泥	31,200	602,160.00	0.21
100	002812	恩捷股份	2,400	600,960.00	0.21
101	600588	用友网络	16,700	599,196.00	0.20
102	601636	旗滨集团	34,217	585,110.70	0.20

103	600028	中国石化	136,100	575,703.00	0.20
104	600660	福耀玻璃	12,100	570,394.00	0.19
105	600702	舍得酒业	2,400	545,520.00	0.19
106	000776	广发证券	22,000	540,980.00	0.18
107	601328	交通银行	116,700	537,987.00	0.18
108	000338	潍柴动力	30,000	536,700.00	0.18
109	002985	北摩高科	4,400	530,024.00	0.18
110	600176	中国巨石	29,100	529,620.00	0.18
111	601818	光大银行	158,800	527,216.00	0.18
112	601336	新华保险	13,500	524,880.00	0.18
113	601390	中国中铁	90,400	523,416.00	0.18
114	600188	兖矿能源	21,800	512,954.00	0.18
115	601618	中国中冶	133,300	510,539.00	0.17
116	601628	中国人寿	16,900	508,521.00	0.17
117	000002	万科 A	25,700	507,832.00	0.17
118	002311	海大集团	6,900	505,770.00	0.17
119	002508	老板电器	13,900	500,678.00	0.17
120	603369	今世缘	9,200	500,480.00	0.17
121	300450	先导智能	6,700	498,279.00	0.17
122	300601	康泰生物	5,000	492,700.00	0.17
123	601567	三星医疗	30,000	489,300.00	0.17
124	601857	中国石油	99,200	487,072.00	0.17
125	002460	赣锋锂业	3,400	485,690.00	0.17
126	603939	益丰药房	8,800	484,968.00	0.17
127	601669	中国电建	60,000	484,800.00	0.17
128	002563	森马服饰	62,600	483,898.00	0.17
129	300347	泰格医药	3,700	472,860.00	0.16
130	300861	美畅股份	6,000	466,620.00	0.16
131	603833	欧派家居	3,100	457,250.00	0.16
132	002409	雅克科技	5,600	454,552.00	0.16
133	600150	中国船舶	18,000	446,220.00	0.15
134	601186	中国铁建	56,700	442,260.00	0.15
135	300274	阳光电源	3,000	437,400.00	0.15
136	601717	郑煤机	37,300	432,307.00	0.15
137	000932	华菱钢铁	82,000	419,020.00	0.14
138	600803	新奥股份	22,800	418,608.00	0.14
139	002352	顺丰控股	5,836	402,217.12	0.14
140	603486	科沃斯	2,600	392,470.00	0.13
141	601066	中信建投	13,200	386,100.00	0.13

142	603659	璞泰来	2,400	385,464.00	0.13
143	300648	星云股份	6,000	361,140.00	0.12
144	002791	坚朗五金	1,900	345,021.00	0.12
145	600547	山东黄金	18,300	344,406.00	0.12
146	688239	航宇科技	4,926	332,307.96	0.11
147	002466	天齐锂业	3,100	331,700.00	0.11
148	600383	金地集团	25,400	329,438.00	0.11
149	601238	广汽集团	19,300	293,167.00	0.10
150	688230	芯导科技	2,179	283,945.49	0.10
151	601225	陕西煤业	22,500	274,500.00	0.09
152	601800	中国交建	31,108	266,906.64	0.09
153	600132	重庆啤酒	1,700	257,244.00	0.09
154	002271	东方雨虹	4,500	237,060.00	0.08
155	600999	招商证券	10,700	188,855.00	0.06
156	601995	中金公司	3,400	166,702.00	0.06
157	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.05
158	688737	中自科技	2,186	120,361.16	0.04
159	688262	国芯科技	2,563	107,594.74	0.04
160	688768	容知日新	907	98,445.78	0.03
161	688210	统联精密	2,218	87,677.54	0.03
162	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.03
163	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.02
164	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.02
165	301029	怡合达	517	46,586.54	0.02
166	301177	迪阿股份	330	38,306.40	0.01
167	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
168	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.01
169	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
170	301087	可孚医疗	352	26,519.68	0.01
171	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.01
172	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
173	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.01
174	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
175	301090	华润材料	2,113	23,707.86	0.01
176	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
177	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
178	301100	风光股份	599	18,652.86	0.01
179	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
180	301127	天源环保	1,069	18,301.28	0.01

181	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
182	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.01
183	301190	善水科技	575	15,789.50	0.01
184	301096	百诚医药	201	15,784.53	0.01
185	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.01
186	301093	华兰股份	307	15,303.95	0.01
187	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
188	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
189	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
190	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
191	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
192	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
193	301166	优宁维	127	12,001.50	0.00
194	301189	奥尼电子	203	11,493.86	0.00
195	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
196	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
197	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
198	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
199	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
200	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
201	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
202	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
203	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
204	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
205	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
206	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
207	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
208	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
209	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
210	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
211	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
212	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
213	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
214	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
215	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
216	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
217	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
218	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
219	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00

220	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
221	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
222	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
223	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
224	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
225	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
226	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
227	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
228	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	35,460,417.86	3.58
2	600036	招商银行	30,325,236.00	3.06
3	600809	山西汾酒	28,849,581.00	2.91
4	600887	伊利股份	27,769,275.00	2.80
5	601318	中国平安	27,457,884.18	2.77
6	000063	中兴通讯	25,928,658.51	2.62
7	603501	韦尔股份	24,408,101.00	2.46
8	000100	TCL 科技	23,311,694.00	2.35
9	300443	金雷股份	22,531,680.40	2.28
10	000661	长春高新	21,874,178.65	2.21
11	000651	格力电器	21,313,139.00	2.15
12	600309	万华化学	21,255,379.77	2.15
13	300122	智飞生物	21,076,258.00	2.13
14	002409	雅克科技	19,991,897.88	2.02
15	300059	东方财富	19,986,020.49	2.02
16	002415	海康威视	19,947,400.11	2.01
17	600703	三安光电	19,102,957.00	1.93
18	300428	立中集团	18,980,119.32	1.92
19	300601	康泰生物	18,920,954.50	1.91
20	000725	京东方 A	18,898,509.00	1.91

注：买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600519	贵州茅台	52,128,110.00	5.26
2	601318	中国平安	42,724,116.74	4.31
3	600036	招商银行	36,832,530.00	3.72
4	000858	五粮液	33,455,410.20	3.38
5	600887	伊利股份	31,760,232.50	3.21
6	000100	TCL 科技	30,208,567.00	3.05
7	300059	东方财富	28,814,393.66	2.91
8	600809	山西汾酒	28,661,393.56	2.89
9	300122	智飞生物	27,448,712.96	2.77
10	603501	韦尔股份	27,217,503.80	2.75
11	002415	海康威视	26,422,265.80	2.67
12	000651	格力电器	25,664,200.00	2.59
13	002487	大金重工	24,021,394.58	2.43
14	600690	海尔智家	23,979,310.00	2.42
15	000661	长春高新	23,555,744.26	2.38
16	000063	中兴通讯	23,505,635.81	2.37
17	300443	金雷股份	23,078,961.00	2.33
18	000001	平安银行	23,048,288.00	2.33
19	000333	美的集团	22,884,588.25	2.31
20	603799	华友钴业	22,852,961.18	2.31
21	002013	中航机电	22,744,583.66	2.30
22	600030	中信证券	22,691,905.45	2.29
23	600031	三一重工	22,398,432.01	2.26
24	000725	京东方 A	21,638,880.00	2.18
25	300428	立中集团	21,583,653.00	2.18
26	601688	华泰证券	21,244,907.60	2.15
27	002304	洋河股份	20,675,204.44	2.09
28	000002	万科 A	20,486,163.00	2.07
29	002409	雅克科技	20,181,946.44	2.04
30	601888	中国中免	20,092,502.81	2.03
31	601336	新华保险	19,916,219.00	2.01
32	002714	牧原股份	19,911,427.80	2.01

注：卖出金额均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	2,861,934,803.09
卖出股票收入（成交）总额	3,270,205,060.44

注：买入股票成本及卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

8.6 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

本报告期末本基金未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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
IF2201	IF2201	-61	-90,537,420.00	1,714,347.02	-
IF2203	IF2203	-40	-59,407,200.00	-754,544.08	-
IH2201	IH2201	-59	-58,137,420.00	-72,823.04	-
IH2202	IH2202	-8	-7,899,840.00	-12,480.00	-
IH2203	IH2203	-8	-7,916,640.00	-36,240.00	-
公允价值变动总额合计（元）					838,259.90
股指期货投资本期收益（元）					-20,844,740.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					23,596,160.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。目前衍生品投资策略主要是股指期货套利，即采用股指期货套利的对冲策略积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对

收益。股指期货套利包括以下两种方式：

1) 期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

2) 跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他绝对收益策略。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本期末本基金未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本期末本基金未持有国债期货。

8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 232,175,040.17 元，占基金资产净值的比例为 79.35%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 -223,898,520.00 元，占基金资产净值的比例为 -76.52%，空头合约市值占股票资产的比例为 -96.44%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 71,753,586.20 元，公允价值变动损益为 -38,127,911.91 元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的招商银行（600036），其发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会发出的银保监罚决字【2021】16 号，被处以罚款。

除此，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,058,878.15
2	应收证券清算款	384,810.12
3	应收股利	-
4	应收利息	14,017.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,457,705.41

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末不存在流通受限的股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,288	211,391.50	241,212,776.97	88.59%	31,059,475.42	11.41%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,169.20	0.0004%

9.3 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	28,689,654.21	10.54	9,999,000.00	3.67	不少于3年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	28,689,654.21	10.54	9,999,000.00	3.67	不少于3年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 12 月 30 日 ）基金份额总额	1,239,463,253.94
本报告期期初基金份额总额	939,870,419.98
本报告期基金总申购份额	123,128,777.47
减:本报告期基金总赎回份额	790,726,945.06
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	272,272,252.39

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

11.2 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

报告期内，无涉及本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为人民币拾万元整，目前该会计师事务所为本基金提供审计服务为 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
东北证券	2	6,106,191,680.39	100.00%	5,686,703.00	100.00%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

11.7.2 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
东北证券	283,651,975.54	100.00%	2,485,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在部分销售机构 暂停定期定额投资业务的公告	规定媒介	2021 年 12 月 8 日
2	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 开放申购、赎回业务公告	规定媒介	2021 年 12 月 8 日
3	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	规定媒介	2021 年 12 月 8 日
4	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金产品资料概要（更新）	规定媒介	2021 年 11 月 24 日
5	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金招募说明书（更新）	规定媒介	2021 年 11 月 24 日
6	中邮创业基金管理股份有限公司	规定媒介	2021 年 11 月 16 日

	关于旗下部分基金 参加华安证 券股份有限公司费率优惠活动的 公告		
7	中邮绝对收益策略定期开放混合 型发起式证券投资基金 2021 年 第 3 季度报告	规定媒介	2021 年 10 月 27 日
8	中邮创业基金管理股份有限公司 关于增加 泰信财富基金销售有 限公司为代销机构并参加其费率 优惠的公告	规定媒介	2021 年 9 月 28 日
9	中邮创业基金管理股份有限公司 关于调整旗下部分基金在 上海 天天基金销售有限公司申购及定 投起点金额的公告	规定媒介	2021 年 9 月 23 日
10	中邮绝对收益策略定期开放混合 型发起式证券投资基金 关于运 用股指期货对冲的投资策略执行 情况公告	规定媒介	2021 年 9 月 9 日
11	中邮绝对收益策略定期开放混合 型发起式证券投资基金 开放申 购、赎回业务公告	规定媒介	2021 年 9 月 8 日
12	中邮绝对收益策略定期开放混合 型发起式证券投资基金 2021 年 中期报告	规定媒介	2021 年 8 月 31 日
13	关于调整中邮旗下部分基金申购 及定投起点金额 并参加其费率 优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 8 月 24 日
14	关于调整中邮旗下部分基金申购 及定投起点金额 并参加其费率	规定媒介	2021 年 8 月 23 日

	优惠活动的公告		
15	关于调整中邮旗下部分基金申购及定投起点金额 并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 8 月 17 日
16	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 参加兴业银行费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 8 月 3 日
17	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金产品资料概要（更新）	规定媒介	2021 年 7 月 30 日
18	中邮创业基金管理股份有限公司关于根据《侧袋机制指引》修改旗下基金基金合同的公告	规定媒介	2021 年 7 月 30 日
19	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金招募说明书（更新）	规定媒介	2021 年 7 月 30 日
20	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起 式证券投资基金基金合同	规定媒介	2021 年 7 月 30 日
21	中邮绝对收益策略定期开放混合型 发起式证券投资基金托管协议	规定媒介	2021 年 7 月 30 日
22	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加腾安基金 为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 7 月 30 日
23	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金 参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 7 月 29 日

24	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	规定媒介	2021 年 7 月 21 日
25	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 6 月 30 日
26	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 6 月 17 日
27	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	规定媒介	2021 年 6 月 10 日
28	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 6 月 10 日
29	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	规定媒介	2021 年 6 月 9 日
30	中邮创业基金管理股份有限公司关于玄元保险调整基金申购起点金额下限的公告	规定媒介	2021 年 5 月 27 日
31	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定媒介	2021 年 4 月 22 日
32	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整特定投资群体通过直销	规定媒介	2021 年 4 月 22 日

	柜台申购旗下部分基金费率优惠方案的公告		
33	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京度小满基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠的公告	规定媒介	2021 年 4 月 19 日
34	中邮创业基金管理股份有限公司关于珠海盈米调整基金申购及定投起点金额下限的公告	规定媒介	2021 年 3 月 26 日
35	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	规定媒介	2021 年 3 月 11 日
36	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	规定媒介	2021 年 3 月 11 日
37	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	规定媒介	2021 年 3 月 10 日
38	中邮创业基金管理股份有限公司关于中邮绝对收益赎回费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 3 月 10 日
39	风险揭示书	规定媒介	2021 年 1 月 28 日
40	中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	规定媒介	2021 年 1 月 22 日

注：规定媒介指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及规定的互联网网站等媒介。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20211214-20211231	59,939,060.94	-	-	59,939,060.94	22.01%
	2	20210913-20211213	95,876,318.31	38,021,863.12	133,898,181.43	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%引起的风险，主要是由于持有人结构相对集中，机构同质化，资金呈现“大进大出”特点，在市场突变情况下，赎回行为高度一致，给基金投资运作可能会带来较大压力，使得基金资产的变现能力和投资者赎回管理的匹配与平衡可能面临较大考验，继而可能给基金带来潜在的流动性风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件
2. 《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
4. 《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登陆基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司。

客户服务中心电话：010-58511618 400-880-1618

基金管理人网址：www.postfund.com.cn

中邮创业基金管理股份有限公司

2022 年 3 月 11 日