

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式
证券投资基金
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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 2022 年 6 月 30 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	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	46
7.7 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	46
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	46

7.9 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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 市场中性策略执行情况	47
7.13 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金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	中金绝对收益
基金主代码	001059
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 21 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,738,884.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金灵活应用多种绝对收益策略对冲本系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值，以期实现超越业绩比较基准的绝对收益。
投资策略	本基金采用市场中性策略为主的多种绝对收益策略剥离系统风险，力争实现基金资产长期稳定的绝对回报。其中，市场中性策略包括量化选股策略和期货对冲策略两大策略。具体包括：1、量化选股策略；2、存托凭证投资策略；3、期货对冲策略；4、其他策略。详见《中金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》。
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，实现基金资产的保值增值，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。

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	中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	席晓峰
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	400-868-1166	021-60637111
传真	010-66159121	021-60635778
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100004	100033
法定代表人	胡长生	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/

基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所
------------	----------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

§ 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

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	-968,119.86
本期利润	-2,213,959.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0420
本期加权平均净值利润率	-3.77%
本期基金份额净值增长率	-1.42%
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	4,739,092.33
期末可供分配基金份额利润	0.0972
期末基金资产净值	54,014,443.24
期末基金份额净值	1.1082
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	10.82%

注：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、本报告所列示的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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.08%	0.20%	0.11%	0.00%	-0.03%	0.20%
过去三个月	-0.71%	0.26%	0.34%	0.00%	-1.05%	0.26%

过去六个月	-1.42%	0.25%	0.67%	0.00%	-2.09%	0.25%
过去一年	-2.28%	0.24%	1.37%	0.00%	-3.65%	0.24%
过去三年	7.07%	0.27%	4.22%	0.00%	2.85%	0.27%
自基金合同生效起至今	10.82%	0.25%	11.31%	0.00%	-0.49%	0.25%

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



§ 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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 41 只公募基金，证券投资基金管理规模 914.35 亿元。

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		
刘重晋	本基金基金经理	2021 年 11 月 4 日	-	10 年	刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司副总经理、量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。
王阳峰	本基金基金经理	2022 年 1 月 14 日	-	8 年	王阳峰先生，理学硕士。历任泰达宏利基金管理有限公司金融工程部投资经理、嘉实基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、本基金无基金经理助理。

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

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。

本报告期内，本公司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%。

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

在报告期内，本组合严格遵守基金合同的约定，基于深入的研究和完备的风控流程进行组合管理，在严格控制组合各项风控指标的基础上，采用多种策略灵活配置，包括量化对冲策略、股票多头策略等。未来将继续努力开发和改进选股策略，在遵守合同约定和法律法规的前提下管理组合，力争为客户创造稳健回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金的份额净值为 1.1082 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.42%，业绩比较基准收益率为 0.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2022 年上半年，我国经济增长面临来自各方面的不确定性因素影响。国内方面，局部新冠疫情对短期增长造成一定影响；外部方面，地缘冲突加剧供给受限问题，欧美经济体面临较高通胀压力，主要央行多采取紧缩的货币政策。我国经济增速从 3 月开始出现一定下滑；随着局部疫情好转及稳增长政策支持，5 月经济增速开始逐步好转。通胀方面，CPI 自低位逐渐回升，PPI 自高位开始回落，PPI 与 CPI 的剪刀差有所收敛；流动性方面，为应对内外部不确定性，国内流动性整体保持在合理充裕水平。

年初以来，A 股市场在各不确定性因素影响下持续调整至四月，调整幅度和时间超市场预期。随着风险因素的逐步缓解，市场自四月底开始反弹。以四月底为分界，在市场下跌过程中，风险偏好迅速下降，过去几年表现较好的成长板块调整幅度较大，价值板块有相对收益；四月底以来的反弹行情中，以新能源为代表的成长板块领涨，反弹幅度较大。回顾上半年，宽基指数中，沪深 300 下跌 9.22%，中证 500 下跌 12.30%，创业板指下跌 15.41%；风格方面，大盘优于小盘，价值战胜成长；行业方面，煤炭、消费者服务、交通运输、建筑、银行表现靠前，国防军工、计算机、综合金融、传媒、电子表现落后。

展望未来，四月底以来流动性充裕驱动 A 股估值抬升，当前尽管流动性依然充裕，但进一步宽松的空间不大，因流动性宽松驱动 A 股进一步抬升的空间有限，A 股市场正处于由分母端估值驱动转换为分子端盈利验证的关键阶段。在没有突发性外部事件冲击的情况下，权益市场可能处于一个“上有顶、下有底”的阶段，存在波段和结构性机会。存量市场下，对部分板块的估值泡沫化仍需留一份清醒，估值的空间一方面取决于市场对板块未来业绩增长的预期，另一方面取决于宏观和微观资金面。配置方向来看，消费端，疫情扰动趋弱和常态化核酸后，消费场景逐渐打

开，存在内生反弹动能，估值处于合理区间的部分消费板块等相关领域或孕育阶段性投资机会。在流动性适度宽松、经济渐复苏的状态下，基本面预期已见底、长期景气程度仍在向上的科技方向具有稀缺性，具备较高的配置价值。未来我们仍将沿着全年策略展望的思路挖掘市场机会，寻找长期前景与短期业绩、景气周期与估值位置等匹配度较好的高性价比机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期内未实施利润分配。

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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监

督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：中金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：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	19,305,695.29	23,262,727.39
结算备付金		4,226,983.24	16,610,123.07
存出保证金		2,781,160.70	15,702,425.92
交易性金融资产	6.4.7.2	27,901,331.34	139,852,819.68
其中：股票投资		25,372,919.07	139,852,819.68
基金投资		-	-
债券投资		2,528,412.27	-
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	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		6,956.69	70,930.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,563.86
资产总计		54,222,127.26	195,500,590.10
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2022 年 6 月 30 日	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		-	-
应付清算款		4,091.81	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		44,380.12	165,270.31
应付托管费		11,095.05	41,317.57
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6.95	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	148,110.09	644,749.63
负债合计		207,684.02	851,337.51
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	48,738,884.20	173,148,107.13
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,275,559.04	21,501,145.46
净资产合计		54,014,443.24	194,649,252.59
负债和净资产总计		54,222,127.26	195,500,590.10

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1082 元，基金份额总额 48,738,884.20 份。

6.2 利润表

会计主体：中金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：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	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,710,477.96	5,785,705.70
1. 利息收入		85,133.27	76,666.75
其中：存款利息收入	6.4.7.13	25,923.31	31,128.66
债券利息收入		-	7,034.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59,209.96	38,503.23
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-721,016.14	5,786,621.02
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-9,998,365.23	6,704,270.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	33,007.31	4,291.17
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	9,001,553.08	-1,835,311.36
股利收益	6.4.7.19	242,788.70	913,370.77
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,245,839.19	-271,623.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	171,244.10	194,041.09
减：二、营业总支出		503,481.09	4,145,563.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	295,734.59	918,431.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	73,933.74	207,164.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	3,326.17
其中：卖出回购金融资产支出		-	3,326.17
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		35,564.60	22,957.92
8. 其他费用	6.4.7.23	98,248.16	2,993,683.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,213,959.05	1,640,141.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,213,959.05	1,640,141.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,213,959.05	1,640,141.93

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中金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：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)	173,148,107.13	-	21,501,145.46	194,649,252.59
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)	173,148,107.13	-	21,501,145.46	194,649,252.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-124,409,222.93	-	-16,225,586.42	-140,634,809.35
(一)、综合收益总额	-	-	-2,213,959.05	-2,213,959.05
(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)	-124,409,222.93	-	-14,011,627.37	-138,420,850.30
其中:1.基金申购款	1,042.49	-	121.76	1,164.25
2.基金赎回款	-124,410,265.42	-	-14,011,749.13	-138,422,014.55

(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)	48,738,884.20	-	5,275,559.04	54,014,443.24
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 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)	47,198,796.37	-	5,427,225.99	52,626,022.36
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)	47,198,796.37	-	5,427,225.99	52,626,022.36
三、本期 增减变动 额(减少 以“-” 号填列)	102,423,632.46	-	14,659,569.19	117,083,201.65

(一)、 综合收 益总额	-	-	1,640,141.93	1,640,141.93
(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)	102,423,632.46	-	13,019,427.26	115,443,059.72
其中:1. 基金申 购款	162,395,340.12	-	20,228,173.75	182,623,513.87
2 .基金赎 回款	-59,971,707.66	-	-7,208,746.49	-67,180,454.15
(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)	149,622,428.83	-	20,086,795.18	169,709,224.01

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：

<u>孙菁</u>	二	<u>白娜</u>
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

中金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“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2015 年 1 月 28 日证监许可[2015]144 号《关于准予中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为混合型发起式证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

本基金通过管理人中金基金直销柜台、建设银行、平安银行股份有限公司、中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）、华西证券股份有限公司、国信证券股份有限公司及中泰证券股份有限公司（原齐鲁证券股份有限公司）共同销售，募集期为 2015 年 3 月 23 日至 2015 年 4 月 16 日。经向中国证监会备案，《中金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》（以下简称“基金合同”）于 2015 年 4 月 21 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 709,513,460.11 份（含利息转份额 365,426.61 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) 审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融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。具体包括：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）、存托凭证、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、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的相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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合同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 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 139,852,819.68 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 139,852,819.68 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(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

本基金在本报告期末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(以下简称“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	19,305,695.29
等于：本金	19,304,998.56
加：应计利息	696.73
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	19,305,695.29

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	24,102,947.67	-	25,372,919.07	1,269,971.40	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,512,038.69	6,262.27	2,528,412.27	10,111.31
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,512,038.69	6,262.27	2,528,412.27	10,111.31
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	26,614,986.36	6,262.27	27,901,331.34	1,280,082.71	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30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	-20,749,980.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-20,749,980.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-20,749,980.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2207	沪深300期货2207合约	-9.00	-12,077,640.00	-654,000.00
IF2209	沪深300期货2209合约	-8.00	-10,673,280.00	-1,346,940.00
合计				-2,000,940.00
减：可抵销期货 暂收款				-2,000,940.00
净额				-

注：1、按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 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	59,766.93
其中：交易所市场	59,766.93
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	88,343.16
合计	148,110.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	173,148,107.13	173,148,107.13
本期申购	1,042.49	1,042.49
本期赎回（以“-”号填列）	-124,410,265.42	-124,410,265.42
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	48,738,884.20	48,738,884.20

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 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
本期期初	15,159,043.59	6,342,101.87	21,501,145.46
本期利润	-968,119.86	-1,245,839.19	-2,213,959.05
本期基金份额交易产生的变动数	-9,451,831.40	-4,559,795.97	-14,011,627.37
其中：基金申购款	144.65	-22.89	121.76
基金赎回款	-9,451,976.05	-4,559,773.08	-14,011,749.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,739,092.33	536,466.71	5,275,559.04

6.4.7.13 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

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	7,898.65
其他	395.71
合计	25,923.31

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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	-9,998,365.23
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	-9,998,365.23

6.4.7.14.2 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	220,561,958.66
减：卖出股票成本总额	230,065,771.99
减：交易费用	494,551.90
买卖股票差价收入	-9,998,365.23

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 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	284.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	32,723.12
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	33,007.31

6.4.7.15.2 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	411,251.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	377,725.11
减：应计利息总额	776.67
减：交易费用	26.47
买卖债券差价收入	32,723.12

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	9,001,553.08

6.4.7.19 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	242,788.70
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	242,788.70

6.4.7.20 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	2,439,420.81
股票投资	2,429,309.50
债券投资	10,111.31
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-3,685,260.00
权证投资	-
期货投资	-3,685,260.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,245,839.19

6.4.7.21 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	171,244.10
合计	171,244.10

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
上交所查询费	600.00
划款手续费	305.00
合计	98,248.16

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中金基金	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
建设银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国中金财富证券有限公司（“中金财富证券”，原“中国中投证券有限责任公司”）	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间没有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	295,734.59	918,431.51
其中：支付销售机构的客户维护费	59,483.08	90,973.21

注：1、支付基金管理人中金基金的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。其计算公式为：日基本管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

2、基金管理人的附加管理费

1) 基金管理人可在同时满足以下条件的前提下，提取附加管理费：

①符合基金收益分配条件；

②附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。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，基金管理人才能收取附加管理费。

提取评价日：每个基金封闭期的最后一个工作日。

2) 附加管理费的计算方法和提取

在每个提取评价日，在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为：

$$\text{附加管理费} = (\text{PA} - \text{PH}) \times 10\% \times \text{SA}$$

其中：

PA 为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值；

PH 为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，其中首次封闭期的 PH 为 1；

SA 为提取评价日的基金总份额数。

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	73,933.74	207,164.48

注：支付基金托管人建设银行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。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

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未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未与关联方进行转融通证券出借业务。

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未与关联方进行转融通证券出借业务。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 4 月 21 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	8,000,000.00
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	8,000,000.00	8,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金	16.4140%	5.3468%

总份额比例		
-------	--	--

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

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

本基金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。

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1月1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
建设银行	19,305,695.29	17,628.95	4,545,455.15	15,255.50

注：1、本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
中金公司	600938	中国海油	网上	3,000	32,400.00
中金公司	603206	嘉环科技	网下	1,089	15,823.17
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
中金公司	003033	征和工业	网下	253	5,889.84
中金公司	688696	极米科技	网下	465	62,184.45
中金公司	688316	青云科技	网下	857	54,590.90
中金公司	605090	九丰能源	网下	1,090	37,681.30
中金公司	601156	东航物流	网下	2,090	32,959.30
中金公司	688425	铁建重工	网下	20,911	60,014.57

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末(2022年6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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	119	6,612.83	3,573.57	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	65	4,165.20	2,438.80	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	56	4,070.64	4,006.24	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金为特殊的混合型基金，通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，实现基金资产的保值增值，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下

形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。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金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可接受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

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	706,542.51	-
AAA 以下	1,821,869.76	-
未评级	-	-
合计	2,528,412.27	-

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人在本基金开放期可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成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。首先，本基金在开放期保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、期货交易所等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金在开放期主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 15%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。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

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理

方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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	19,304,998.56			696.73	19,305,695.29
结算备付金	1,184,913.35			3,042,069.89	4,226,983.24
存出保证金	51,027.40			2,730,133.30	2,781,160.70
交易性金融资产-股票投资				25,372,919.07	25,372,919.07
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券		1,900,872.10	621,277.90	6,262.27	2,528,412.27
买入返售金融资产					
应收证券清算款				6,956.69	6,956.69
应收股利					
应收申购款					
资产总计	20,540,939.31	1,900,872.10	621,277.90	31,159,037.95	54,222,127.26
负债					
卖出回购金融资产款					
应付证券清算款				4,091.81	4,091.81
应付赎回款					
应付管理人报酬				44,380.12	44,380.12
应付托管费				11,095.05	11,095.05
应付销售服务费					
应交税费				6.95	6.95
其他负债				148,110.09	148,110.09
负债总计				207,684.02	207,684.02
利率敏感度缺口	20,540,939.31	1,900,872.10	621,277.90	30,951,353.93	54,014,443.24
上年度末 2021年12月31日					
资产					
银行存款	23,262,727.39				23,262,727.39
结算备付金	1,124,497.89			15,485,625.18	16,610,123.07
存出保证金	29,062.72			15,673,363.20	15,702,425.92
交易性金融资产-股票投资				139,852,819.68	139,852,819.68
交易性金融资产-债券投资、资产支持证券					

买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	70,930.18	70,930.18
应收利息	-	-	1,563.86	1,563.86
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
资产总计	24,416,288.00	-	-171,084,302.10	195,500,590.10
负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	165,270.31	165,270.31
应付托管费	-	-	41,317.57	41,317.57
应付交易费用	-	-	550,749.63	550,749.63
应付销售服务费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
其他负债	-	-	94,000.00	94,000.00
负债总计	-	-	851,337.51	851,337.51
利率敏感度缺口	24,416,288.00	-	-170,232,964.59	194,649,252.59

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.67%，上年度末未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的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的股票，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，采用市场中性策略为主的多种绝对收益策略剥离系统风险，力争实现基金资产长期稳定的绝对回报。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：权益类空头头

寸的价值占权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	25,372,919.07	46.97	139,852,819.68	71.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	25,372,919.07	46.97	139,852,819.68	71.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	276,394.23	1,213,349.44
	沪深 300 指数下降 5%	-276,394.23	-1,213,349.44

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	27,891,312.73	138,627,297.81
第二层次	-	1,093,019.82
第三层次	10,018.61	132,502.05
合计	27,901,331.34	139,852,819.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末无非持续的以公允价值计量的金融工具。

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

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	25,372,919.07	46.79
	其中：股票	25,372,919.07	46.79
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	2,528,412.27	4.66
	其中：债券	2,528,412.27	4.66
	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	23,532,678.53	43.40
8	其他各项资产	2,788,117.39	5.14
9	合计	54,222,127.26	100.00

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	85,118.00	0.16
B	采矿业	1,068,392.00	1.98
C	制造业	14,793,998.68	27.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	779,613.00	1.44
E	建筑业	532,076.00	0.99
F	批发和零售业	112,271.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	619,715.00	1.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,052,221.00	1.95
J	金融业	5,059,824.59	9.37
K	房地产业	247,998.00	0.46
L	租赁和商务服务业	93,172.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	634,448.80	1.17
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	247,367.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	46,704.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	25,372,919.07	46.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

7.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	800	1,636,000.00	3.03
2	300750	宁德时代	1,300	694,200.00	1.29
3	600036	招商银行	13,800	582,360.00	1.08
4	600030	中信证券	24,185	523,847.10	0.97
5	603259	药明康德	4,120	428,438.80	0.79
6	000568	泸州老窖	1,700	419,118.00	0.78
7	002129	TCL 中环	6,600	388,674.00	0.72
8	601318	中国平安	8,161	381,037.09	0.71
9	000001	平安银行	24,100	361,018.00	0.67
10	600809	山西汾酒	1,100	357,280.00	0.66
11	601985	中国核电	50,800	348,488.00	0.65
12	601012	隆基绿能	4,944	329,418.72	0.61
13	600690	海尔智家	11,200	307,552.00	0.57
14	000858	五粮液	1,518	306,529.74	0.57
15	601658	邮储银行	54,200	292,138.00	0.54
16	002821	凯莱英	1,000	289,000.00	0.54
17	000333	美的集团	4,531	273,627.09	0.51
18	002594	比亚迪	800	266,792.00	0.49
19	002142	宁波银行	7,340	262,845.40	0.49
20	600887	伊利股份	6,400	249,280.00	0.46
21	601319	中国人保	49,200	248,952.00	0.46
22	601899	紫金矿业	26,300	245,379.00	0.45
23	600050	中国联通	70,300	243,238.00	0.45
24	600176	中国巨石	13,900	241,999.00	0.45
25	003816	中国广核	85,400	239,120.00	0.44
26	601166	兴业银行	11,900	236,810.00	0.44
27	600438	通威股份	3,900	233,454.00	0.43
28	300316	晶盛机电	3,400	229,806.00	0.43
29	600919	江苏银行	30,800	219,296.00	0.41
30	002352	顺丰控股	3,900	217,659.00	0.40
31	600926	杭州银行	14,200	212,716.00	0.39
32	002049	紫光国微	1,100	208,692.00	0.39
33	300347	泰格医药	1,800	206,010.00	0.38
34	601238	广汽集团	13,400	204,216.00	0.38
35	002304	洋河股份	1,100	201,465.00	0.37
36	000596	古井贡酒	800	199,728.00	0.37
37	603986	兆易创新	1,400	199,094.00	0.37
38	603882	金域医学	2,400	198,120.00	0.37

39	601998	中信银行	40,900	194,275.00	0.36
40	601211	国泰君安	12,400	188,480.00	0.35
41	601898	中煤能源	17,700	183,726.00	0.34
42	002938	鹏鼎控股	6,000	181,260.00	0.34
43	601088	中国神华	5,100	169,830.00	0.31
44	600089	特变电工	6,200	169,818.00	0.31
45	002460	赣锋锂业	1,100	163,570.00	0.30
46	603659	璞泰来	1,900	160,360.00	0.30
47	600018	上港集团	27,400	159,742.00	0.30
48	600660	福耀玻璃	3,800	158,878.00	0.29
49	601398	工商银行	33,200	158,364.00	0.29
50	002410	广联达	2,900	157,876.00	0.29
51	000651	格力电器	4,600	155,112.00	0.29
52	002466	天齐锂业	1,225	152,880.00	0.28
53	300628	亿联网络	2,000	152,300.00	0.28
54	002459	晶澳科技	1,880	148,332.00	0.27
55	002241	歌尔股份	4,400	147,840.00	0.27
56	300661	圣邦股份	800	145,616.00	0.27
57	688012	中微公司	1,200	140,100.00	0.26
58	002371	北方华创	500	138,560.00	0.26
59	601838	成都银行	8,300	137,614.00	0.25
60	601669	中国电建	17,000	133,790.00	0.25
61	300124	汇川技术	2,000	131,740.00	0.24
62	000625	长安汽车	7,530	130,419.60	0.24
63	603369	今世缘	2,500	127,500.00	0.24
64	600383	金地集团	9,400	126,336.00	0.23
65	603019	中科曙光	4,300	124,786.00	0.23
66	002415	海康威视	3,400	123,080.00	0.23
67	601328	交通银行	23,400	116,532.00	0.22
68	002709	天赐材料	1,800	111,708.00	0.21
69	300122	智飞生物	1,000	111,010.00	0.21
70	601728	中国电信	29,700	110,781.00	0.21
71	600741	华域汽车	4,800	110,400.00	0.20
72	603486	科沃斯	900	109,701.00	0.20
73	603392	万泰生物	705	109,486.50	0.20
74	601618	中国中冶	31,200	109,200.00	0.20
75	600256	广汇能源	10,100	106,454.00	0.20
76	600406	国电南瑞	3,900	105,300.00	0.19
77	002050	三花智控	3,800	104,424.00	0.19
78	601919	中远海控	7,500	104,250.00	0.19
79	600873	梅花生物	9,100	102,648.00	0.19
80	601601	中国太保	4,300	101,179.00	0.19

81	600900	长江电力	4,300	99,416.00	0.18
82	600332	白云山	3,100	97,929.00	0.18
83	300014	亿纬锂能	1,000	97,500.00	0.18
84	600837	海通证券	9,900	97,119.00	0.18
85	601009	南京银行	9,200	95,864.00	0.18
86	600893	航发动力	2,100	95,571.00	0.18
87	601615	明阳智能	2,800	94,640.00	0.18
88	000661	长春高新	400	93,368.00	0.17
89	601888	中国中免	400	93,172.00	0.17
90	603799	华友钴业	970	92,751.40	0.17
91	002841	视源股份	1,200	90,384.00	0.17
92	600048	保利发展	5,100	89,046.00	0.16
93	002920	德赛西威	600	88,800.00	0.16
94	600039	四川路桥	8,400	88,452.00	0.16
95	601225	陕西煤业	4,100	86,838.00	0.16
96	601881	中国银河	8,800	85,096.00	0.16
97	600585	海螺水泥	2,400	84,672.00	0.16
98	002555	三七互娱	3,900	82,797.00	0.15
99	600845	宝信软件	1,500	81,900.00	0.15
100	300059	东方财富	3,205	81,407.00	0.15
101	601668	中国建筑	15,100	80,332.00	0.15
102	002475	立讯精密	2,300	77,717.00	0.14
103	603290	斯达半导	200	77,180.00	0.14
104	688981	中芯国际	1,661	75,027.37	0.14
105	600188	兖矿能源	1,900	75,012.00	0.14
106	600989	宝丰能源	5,100	74,715.00	0.14
107	601229	上海银行	11,400	74,670.00	0.14
108	002252	上海莱士	12,500	74,125.00	0.14
109	600436	片仔癀	200	71,346.00	0.13
110	002202	金风科技	4,800	71,040.00	0.13
111	000338	潍柴动力	5,600	69,832.00	0.13
112	000933	神火股份	5,300	69,324.00	0.13
113	603501	韦尔股份	400	69,212.00	0.13
114	601766	中国中车	13,300	69,160.00	0.13
115	600085	同仁堂	1,300	68,744.00	0.13
116	000776	广发证券	3,600	67,320.00	0.12
117	600905	三峡能源	10,600	66,674.00	0.12
118	601066	中信建投	2,300	66,493.00	0.12
119	601916	浙商银行	20,000	66,400.00	0.12
120	600584	长电科技	2,400	64,800.00	0.12
121	603993	洛阳钼业	11,300	64,749.00	0.12
122	601877	正泰电器	1,800	64,404.00	0.12

123	600015	华夏银行	12,300	64,083.00	0.12
124	000938	紫光股份	3,300	64,020.00	0.12
125	002179	中航光电	1,000	63,320.00	0.12
126	601006	大秦铁路	9,600	63,264.00	0.12
127	601186	中国铁建	8,000	63,200.00	0.12
128	000792	盐湖股份	2,100	62,916.00	0.12
129	603087	甘李药业	1,300	62,361.00	0.12
130	600019	宝钢股份	10,200	61,404.00	0.11
131	600183	生益科技	3,600	61,164.00	0.11
132	688008	澜起科技	1,000	60,580.00	0.11
133	600028	中国石化	14,800	60,384.00	0.11
134	300896	爱美客	100	60,001.00	0.11
135	002801	微光股份	2,000	59,700.00	0.11
136	002601	龙佰集团	2,900	58,145.00	0.11
137	600352	浙江龙盛	5,700	58,026.00	0.11
138	300498	温氏股份	2,700	57,483.00	0.11
139	601390	中国中铁	9,300	57,102.00	0.11
140	600655	豫园股份	6,000	56,640.00	0.10
141	600362	江西铜业	3,100	55,273.00	0.10
142	600941	中国移动	900	54,450.00	0.10
143	002648	卫星化学	2,100	54,285.00	0.10
144	600219	南山铝业	14,700	54,243.00	0.10
145	002311	海大集团	900	54,009.00	0.10
146	300457	赢合科技	1,900	53,979.00	0.10
147	300496	中科创达	400	52,192.00	0.10
148	600648	外高桥	3,800	51,680.00	0.10
149	601600	中国铝业	10,800	51,300.00	0.09
150	002932	明德生物	745	51,077.20	0.09
151	002567	唐人神	5,900	50,209.00	0.09
152	002812	恩捷股份	200	50,090.00	0.09
153	600588	用友网络	2,300	49,933.00	0.09
154	002008	大族激光	1,500	49,695.00	0.09
155	300015	爱尔眼科	1,100	49,247.00	0.09
156	300999	金龙鱼	900	48,618.00	0.09
157	600760	中航沈飞	800	48,360.00	0.09
158	300748	金力永磁	1,300	47,840.00	0.09
159	000977	浪潮信息	1,800	47,664.00	0.09
160	600096	云天化	1,500	47,220.00	0.09
161	600460	士兰微	900	46,800.00	0.09
162	600426	华鲁恒升	1,600	46,720.00	0.09
163	300413	芒果超媒	1,400	46,704.00	0.09
164	002001	新和成	2,000	45,620.00	0.08

165	601336	新华保险	1,400	45,066.00	0.08
166	300957	贝泰妮	200	43,506.00	0.08
167	300601	康泰生物	960	43,372.80	0.08
168	002074	国轩高科	900	41,040.00	0.08
169	000733	振华科技	300	40,791.00	0.08
170	600233	圆通速递	2,000	40,780.00	0.08
171	600481	双良节能	2,400	40,440.00	0.07
172	601628	中国人寿	1,300	40,404.00	0.07
173	688099	晶晨股份	400	40,400.00	0.07
174	600346	恒力石化	1,800	40,032.00	0.07
175	601857	中国石油	7,500	39,750.00	0.07
176	688111	金山办公	200	39,424.00	0.07
177	000553	安道麦 A	3,200	38,752.00	0.07
178	002216	三全食品	1,900	37,221.00	0.07
179	601808	中海油服	2,600	36,270.00	0.07
180	300390	天华超净	400	34,960.00	0.06
181	300575	中旗股份	1,700	34,340.00	0.06
182	600009	上海机场	600	34,020.00	0.06
183	601698	中国卫通	3,000	33,930.00	0.06
184	601231	环旭电子	2,300	33,028.00	0.06
185	601901	方正证券	4,900	32,879.00	0.06
186	600639	浦东金桥	2,400	32,616.00	0.06
187	300450	先导智能	500	31,590.00	0.06
188	601089	福元医药	1,493	31,427.65	0.06
189	300760	迈瑞医疗	100	31,320.00	0.06
190	603185	上机数控	200	31,198.00	0.06
191	600196	复星医药	700	30,863.00	0.06
192	600104	上汽集团	1,700	30,277.00	0.06
193	002032	苏泊尔	500	28,170.00	0.05
194	002714	牧原股份	500	27,635.00	0.05
195	603288	海天味业	300	27,108.00	0.05
196	688599	天合光能	400	26,100.00	0.05
197	600863	内蒙华电	7,100	25,915.00	0.05
198	688005	容百科技	200	25,888.00	0.05
199	601688	华泰证券	1,800	25,560.00	0.05
200	002408	齐翔腾达	600	4,866.00	0.01
201	301201	诚达药业	56	4,006.24	0.01
202	002758	浙农股份	300	3,951.00	0.01
203	300834	星辉环材	119	3,573.57	0.01
204	000960	锡业股份	200	3,354.00	0.01
205	301196	唯科科技	65	2,438.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	1,478,897.00	0.76
2	600519	贵州茅台	1,443,073.00	0.74
3	000858	五粮液	1,300,398.00	0.67
4	300750	宁德时代	1,207,420.00	0.62
5	002142	宁波银行	1,101,657.00	0.57
6	600887	伊利股份	972,319.00	0.50
7	601166	兴业银行	954,112.25	0.49
8	603259	药明康德	937,994.06	0.48
9	000333	美的集团	921,605.00	0.47
10	300059	东方财富	917,802.00	0.47
11	600104	上汽集团	917,647.00	0.47
12	601899	紫金矿业	880,347.00	0.45
13	000001	平安银行	837,143.00	0.43
14	601988	中国银行	831,658.00	0.43
15	002415	海康威视	799,125.00	0.41
16	000568	泸州老窖	795,644.00	0.41
17	002304	洋河股份	767,774.00	0.39
18	601211	国泰君安	767,733.00	0.39
19	600050	中国联通	759,113.00	0.39
20	600926	杭州银行	740,274.00	0.38

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	600519	贵州茅台	6,348,460.40	3.26
2	300750	宁德时代	5,822,336.00	2.99
3	300059	东方财富	3,508,366.00	1.80
4	600036	招商银行	3,492,382.00	1.79
5	000333	美的集团	3,065,918.00	1.58
6	600030	中信证券	2,898,392.00	1.49
7	601288	农业银行	2,772,667.00	1.42
8	000568	泸州老窖	2,567,196.00	1.32
9	600436	片仔癀	2,468,388.65	1.27
10	000063	中兴通讯	2,450,374.00	1.26
11	601318	中国平安	2,429,735.00	1.25
12	000858	五粮液	2,359,182.00	1.21
13	002129	TCL 中环	2,325,258.00	1.19
14	600926	杭州银行	2,307,879.64	1.19

15	002142	宁波银行	2,139,741.00	1.10
16	600887	伊利股份	2,139,604.00	1.10
17	601658	邮储银行	2,125,346.00	1.09
18	002371	北方华创	2,082,135.00	1.07
19	300316	晶盛机电	2,079,809.00	1.07
20	300347	泰格医药	2,033,596.20	1.04

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	113,156,561.88
卖出股票收入（成交）总额	220,561,958.66

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,528,412.27	4.68
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,528,412.27	4.68

7.6 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	3,660	399,152.58	0.74
2	110084	贵燃转债	2,610	322,419.31	0.60
3	110053	苏银转债	2,440	307,389.93	0.57
4	110080	东湖转债	2,580	305,207.99	0.57
5	128081	海亮转债	2,360	301,741.52	0.56

7.7 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。

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投资。

7.9 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投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金利用股指期货与股票现货组合进行对冲，并通过量化模型，寻找最优的股指期货对冲工具构建整个组合，从而剥离现货组合的系统性风险，仅保留现货组合相对于期货组合的超额收益，力争在牛市和熊市中均为投资者获取稳健的正向收益。

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。

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。

7.12 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 25,372,919.07 元，占基金资产净值的比例为 46.97%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 22,750,920.00 元，占基金资产净值的比例为 42.12%，空头合约市值占股票资产的比例为 89.67%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -996,812.15 元，公允价值变动损益为 -1,255,950.50 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除平安银行股份有限公司（平安银行）、招商银行股份有限公司（招商银行）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2022 年 3 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕24 号），对平安银行股份有限公司不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等违法违规事实进行处罚。

2022 年 3 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕21 号），对招商银行股份有限公司不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据等违法违规事实进行处罚。

本基金采用量化对冲的投资策略，由于有套保的限制很大一部分仓位集中于沪深 300 成分股内，而银行业在沪深 300 指数中占很大权重，所以不可避免的选入银行，同时我们认为平安银行（000001）、招商银行（600036）所受处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响，所以依然按

照模型选股的结果而没有进行专门的减仓操作。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	2,781,160.70
2	应收清算款	6,956.69
3	应收股利	-
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	2,788,117.39

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113044	大秦转债	399,152.58	0.74
2	110053	苏银转债	307,389.93	0.57
3	110080	东湖转债	305,207.99	0.57
4	128081	海亮转债	301,741.52	0.56
5	113631	皖天转债	299,447.70	0.55
6	127019	国城转债	296,769.58	0.55
7	110052	贵广转债	296,283.66	0.55

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)

800	60,923.61	30,910,216.55	63.42	17,828,667.65	36.58
-----	-----------	---------------	-------	---------------	-------

8.2 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	10,002.01	0.02

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	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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月21日） 基金份额总额	709,513,460.11
本报告期期初基金份额总额	173,148,107.13
本报告期基金总申购份额	1,042.49
减：本报告期基金总赎回份额	124,410,265.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	48,738,884.20

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2022年6月21日，本基金管理人发布公告，赵璧先生自2022年6月20日起担任公司副总经理、财务负责人，同日起不再担任公司督察长；席晓峰先生自2022年6月20日起担任公司督察长，同日起不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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 (%)	
平安证券	2	144,756,743.71	43.47	105,859.74	43.47	-
天风证券	2	75,444,446.11	22.66	55,170.47	22.66	-
中信建投证券	2	59,618,120.86	17.90	43,598.25	17.90	-
华泰证券	2	46,412,926.66	13.94	33,940.43	13.94	-
申万宏源证券	2	6,766,978.15	2.03	4,948.67	2.03	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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 (%)
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	38,696.00	1.20	52,400,000.00	7.38	-	-
中信建投证券	-	-	241,600,000.00	34.03	-	-
华泰证券	54,767.51	1.70	301,000,000.00	42.40	-	-
申万宏源证券	3,135,299.34	97.11	114,900,000.00	16.19	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	中金绝对收益策略定期开放混合型发	中国证监会规定媒介	2022-01-15

	起式证券投资基金基金经理变更公告		
2	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书(2022 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2022-01-17
3	中金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)(2022 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2022-01-17
4	中金基金管理有限公司旗下公募基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
5	中金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 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
6	关于中金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、赎回及转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-29
7	中金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	中国证监会规定媒介	2022-03-29
8	中金基金管理有限公司旗下公募基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
9	中金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	中国证监会规定媒介	2022-03-31
10	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-15
11	中金基金管理有限公司旗下公募基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
12	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
13	中金基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-23
14	中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书(2022 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2022-04-29
15	中金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(2022 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2022-04-29
16	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21
17	关于中金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、赎回及转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-28
18	中金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	中国证监会规定媒介	2022-06-28

对冲的投资策略执行情况公告		
---------------	--	--

§ 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

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金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、《中金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、《中金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》及其更新
- 5、中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 8、报告期内中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日