

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 清算报告

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

报告出具日期：2023年2月17日

报告公告日期：2023年2月22日

1 重要提示

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”或“中金绝对收益”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2015〕144号文注册，2015年4月21日基金合同生效。本基金的基金管理人为中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”或“本基金管理人”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据《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》（以下或简称“《基金合同》”）第五部分“基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效3年后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，并召开基金份额持有人大会进行表决。”

由于本基金已出现基金资产净值连续60个交易日低于5000万元的情形，本基金管理人经与本基金托管人中国建设银行协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议审议了《关于终止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有关事项的议案》，并由参加基金份额持有人大会的基金份额持有人对本次会议议案进行表决。本次基金份额持有人大会表决投票时间自2023年1月11日起至2023年1月30日止，并于2023年1月31日计票表决通过了上述议案，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。本次决议生效后，根据基金份额持有人大会通过的议案及说明，本基金自2023年2月2日起至2023年2月8日止为赎回选择期，该期间本基金持有人可以办理赎回业务，不可以办理申购业务。

本基金自2023年2月9日起进入清算期，由基金管理人中金基金、基金托管人中国建设银行、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2 基金概况

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
最后运作日(2023年2月8日)	
基金份额总额	28,507,347.39份

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基金的系统性风险，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。

3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

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：2023年2月8日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2023年2月8日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	30,609,860.84
结算备付金	397,648.78
存出保证金	7,191.50

交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	31,014,701.12
负债和净资产	本期末 2023 年 2 月 8 日 (基金最后运作日)
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	101,867.36
应付管理人报酬	7,694.75
应付托管费	1,923.70
应付销售服务费	-
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	50,758.08
负债合计	162,243.89
净资产：	
实收基金	28,507,347.39
其他综合收益	-
未分配利润	2,345,109.84

净资产合计	30,852,457.23
负债和净资产总计	31,014,701.12

注：报告截止日 2023 年 2 月 8 日，中金绝对收益的基金份额净值为 1.0823 元，基金份额总额为 28,507,347.39 份。

4 清盘事项说明

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依据中国证券监督管理委员会于 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。本基金的基金管理人为中金基金，基金托管人为中国建设银行。

本基金通过基金管理人中金基金直销柜台、中国建设银行、平安银行股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、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》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）。

4.2 清算原因

根据《基金合同》第五部分“基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效 3 年后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，并召开基金份额持有人大会进行表决。”

由于本基金已出现基金资产净值连续 60 个交易日低于 5000 万元的情形，本基金管理人经与本基金托管人中国建设银行协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议审议了《关于终止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有关事项的议案》，并由参加基金份额持有人大会的基金份额持有人对本次会议议案进行表决。本次基金份额持有人大会表决投票时间自 2023 年 1 月 11 日起至 2023 年 1 月 30 日止，并于 2023 年 1 月 31 日计票表决通过了上述议案，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。本次决议生效后，根据基金份额持有人大会通过的议案及说明，本基金自 2023 年 2 月 2 日起至 2023 年 2 月 8 日止为赎回选择期，该期间本基金持有人可以办理赎回业务，不可以办理申购业务。

4.3 清算起始日

本基金于 2023 年 2 月 9 日起进入清算期，清算期为 2023 年 2 月 9 日至 2023 年 2 月 10 日。本基金将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

4.4 清算报表编制基础

本基金清算报表的编制遵循了《企业会计准则》以及《资产管理产品相关会计处理规定》的有关规定。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5 清算情况

自 2023 年 2 月 9 日至 2023 年 2 月 10 日止为本基金清算报告期，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 清算费用

按照《基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.2 资产处置情况

(1) 银行存款、保证金及应收款项资产处置情况 (单位: 人民币元)

序号	项目	最后运作日账面价值	清算金额	清算期期末账面价值
1	银行存款(注)	30,609,860.84(其中: 应计利息 6,450.59)	- 256,940.24	30,353,511.45(其中: 应计利息 7,041.44)

2	结算备付金（注）	397,648.78（其中：应计利息 773.78）		397,684.50（其中：应计利息 809.50）
3	存出保证金（注）	7,191.50（其中：应计利息 12.27）	-	7,192.14（其中：应计利息 12.91）

注：银行存款、结算备付金及存出保证金中所包含的应计利息部分由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.3 负债清偿情况

（1）本基金自 2023 年 2 月 9 日进入清算期，按照《基金合同》第六部分“基金份额的申购与赎回”的规定，本基金最后运作日应付赎回款为人民币 101,867.36 元，该款项已于 2023 年 2 月 9 日支付；2023 年 2 月 9 日确认的赎回申请为人民币 79,696.35 元，该款项已于 2023 年 2 月 10 日支付。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 7,694.75 元，该款项已于 2023 年 2 月 9 日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,923.70 元，该款项已于 2023 年 2 月 9 日支付。

（4）本基金最后运作日其他负债为人民币 50,758.08 元，其中应付交易费用人民币 10,758.08 元；预提审计费人民币 40,000.00 元，本次清算审计费用为人民币 20,000.00 元，于 2023 年 2 月 9 日回冲人民币 20,000.00 元，上述款项均于 2023 年 2 月 9 日支付。

（5）本基金本次清算律师费用和持有人大会律师费用合计 35,000.00 元，上述款项已于 2023 年 2 月 9 日支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 9 日（基金清算起始日）至 2023 年 2 月 10 日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	627.21
1. 利息收入	627.21
其中：存款利息收入	627.21
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-
其中：股票投资收益	-
债券投资收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、清算费用	15,065.00
1. 其他费用	15,065.00

二、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-14,437.79
---------------------	------------

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2023年2月8日基金净资产	30,852,457.23
加：清算期间净收益	-14,437.79
减：基金净赎回金额	79,696.35
二、2023年2月10日基金净资产	30,758,323.09

资产处置及负债清偿后，于2023年2月10日本基金剩余财产为人民币30,758,323.09元，根据《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日起至清算款项支付日前一日的存款利息归基金份额持有人所有。如清算款项支付日前应计利息余额尚未结清，则由基金管理人以自有资金先行垫付，垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。除清算划款以及负债清偿产生的银行汇划费从基金资产中支付外，其他与本次清算相关产生的银行汇划费由基金管理人承担。

5.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- (1) 中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 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清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

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财产清算小组

二〇二三年二月二十二日