

# 中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

2020 年第 1 季度报告

2020 年 03 月 31 日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2020 年 04 月 21 日

## 目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	8
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	9
4.5 报告期内基金的业绩表现	10
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	10
§5 投资组合报告	10
5.1 报告期末基金资产组合情况	10
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	11
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	11
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	11
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	11
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	12
5.8 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权证投资明细	12
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	12
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	12
5.11 投资组合报告附注	12
§6 开放式基金份额变动	19
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	19
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	19
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	20
§8 备查文件目录	20
8.1 备查文件目录	20
8.2 存放地点	20
8.3 查阅方式	20

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年1月19日（基金合同生效日）起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	中泰中证可转债及可交债指数
基金主代码	008402
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年01月19日
报告期末基金份额总额	371,479,287.62份
投资目标	本基金主要采用分层抽样复制和动态最优化的方法,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动管理的指数基金,主要采用分层抽样复制和动态最优化的方法,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金力争将净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,将年化跟踪误差控制在4%以内。
业绩比较基准	95%×中证可转债及可交换债券指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是债券型基金,属于较低预期风险、较低预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

	本基金属于指数基金，采用抽样复制和动态最优化策略，跟踪中证可转债及可交换债券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中泰中证可转债及可交换债指数A	中泰中证可转债及可交换债指数C
下属分级基金的交易代码	008402	008403
报告期末下属分级基金的份额总额	143,789,298.46份	227,689,989.16份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年01月19日 - 2020年03月31日)	
	中泰中证可转债及可交换债指数A	中泰中证可转债及可交换债指数C
1. 本期已实现收益	59,990.46	-39,211.27
2. 本期利润	-2,022,555.35	-3,335,185.97
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0141	-0.0146
4. 期末基金资产净值	141,766,743.11	224,354,803.19
5. 期末基金份额净值	0.9859	0.9854

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、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、本基金基金合同在当期生效，生效日为2020年1月19日。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 中泰中证可转债及可交债指数A净值表现

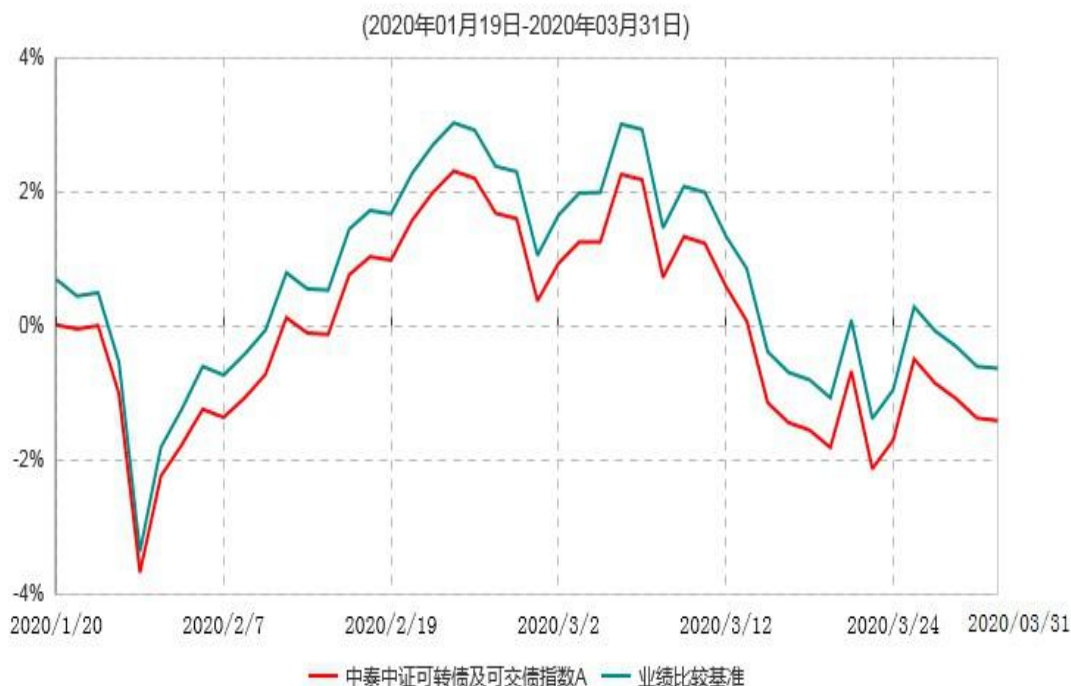
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-1.41%	0.77%	-0.63%	0.81%	-0.78%	-0.04%

### 中泰中证可转债及可交债指数C净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	-1.46%	0.77%	-0.63%	0.81%	-0.83%	-0.04%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中泰中证可转债及可交债指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

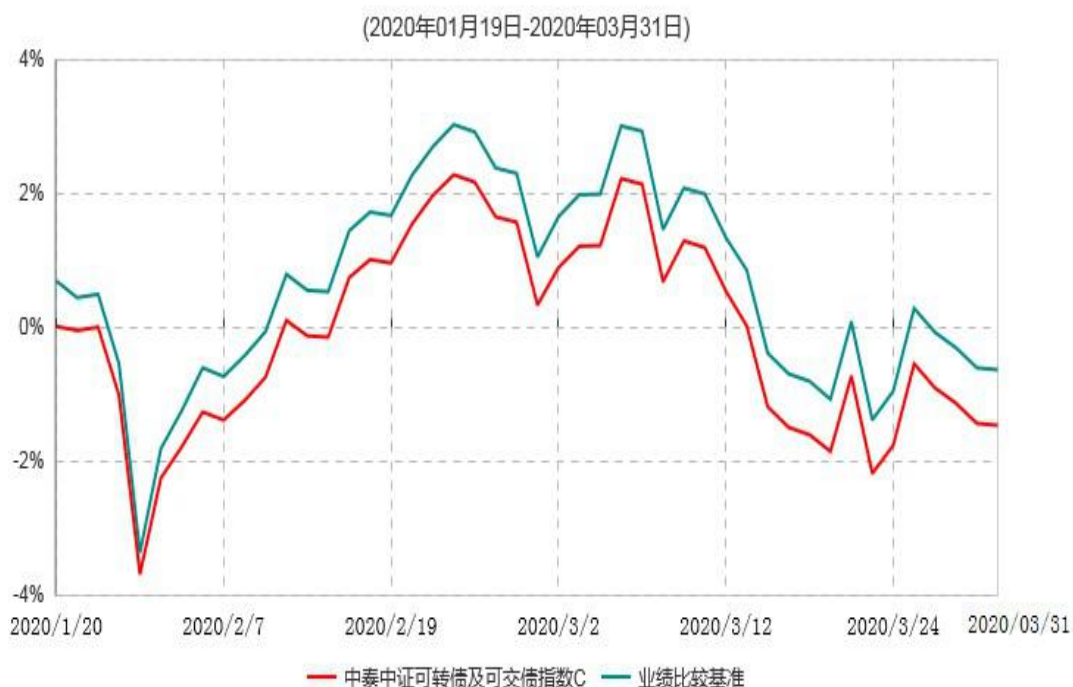


注：

(1) 本基金基金合同生效日期为 2020 年 1 月 19 日，至本报告期末本基金成立未满 1 年。

(2) 根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金已建仓完毕，且建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

中泰中证可转债及可交换债券指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：

(1) 本基金基金合同生效日期为 2020 年 1 月 19 日，至本报告期末本基金成立未满 1 年。

(2) 根据基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金已建仓完毕，且建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱未一	本基金基金经理。	2020-01-19	-	10	国籍：中国。学历：中国人民大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任中信建投证券股份有限公司固定收益部交易员；上海国泰君安证券资产管理有限公司固

					定收益部投资经理。2014年8月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司任固定收益部投资经理。2020年1月19日至今担任中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金基金经理。
张蓓蓓 (Phoebe Zhang)	本基金基金经理；中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金经理；中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理；基金业务部副总经理。	2020-02-25	-	13	国籍：澳大利亚。学历：澳大利亚邦德大学金融系硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任国泰基金管理有限公司交易管理部交易员、部门负责人；上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部投资经理、高级投资经理、首席投资经理；2017年5月起加入中泰证券（上海）资产管理有限公司固定收益部任副总经理，现任基金业务部副总经理。2019年4月26日起任中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金经理。2019年8月9日起任中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理。2020年2月25日起任中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金基金经理。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理规定》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，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。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，我司旗下产品所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节均严格执行《中泰证券（上海）资产管理有限公司公平交易及异常交易制度》。

公司建立了针对公平交易进行事前控制、事中监控、事后分析的完整流程，形成有效的公平交易体系。

事前控制包括：通过建立投资研究沟通机制确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会；对各投资组合的重大非公开投资信息进行相互隔离；并通过投资交易系统进行公平交易和反向交易风控设置。

事中监控通过执行集中交易制度，将投资管理与交易执行相分离，交易由交易部集中执行。交易部以公平交易为原则，保证投资组合的交易得到公平、及时、准确、高效地执行，确保不同产品享有公平的交易执行机会；对不同账户的交易指令按照“时间优先、价格优先”原则执行；同时接收的交易指令在分配和执行过程中，避免因投资组合资产的大小、成交额的大小及交易难易等客观因素或个人主观好恶而出现执行时间及执行数量比例的明显不均现象；同时收到不同投资组合账户同种证券同向买卖指令时，避免交易因执行的时间、比例明显不同而出现交易均价明显差异的现象。

事后分析主要集中在对不同投资组合同日或者临近交易日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，监督检验公平交易原则实施情况，识别是否存在不公平交易和任何利益输送嫌疑的交易行为。

1、同向交易价差分析，主要是通过分析产品间不同时间窗口（1日、3日、5日）的同向交易价差，来分析判断同向交易是否存在违反公平交易原则和利益输送的行为，分析判断的方法和指标包括同向交易价差T检验、差价率均值、占优比率、差价贡献率等。

2、反向交易分析，主要通过分析产品不同时间窗口（同日、隔日、3日、5日）反向交易成交较少的单边交易量占相关证券当日成交量情况的分析，识别是否存在任何利益输送嫌疑的交易行为。

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

- 1、报告期内不存在产品间同向交易行为导致利益输送的结果；
- 2、报告期内不存在产品间反向交易行为导致利益输送的结果。

本报告期内，各项公平交易及异常交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未出现违反制度的情况。



### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

异常交易是指本公司所管理的各产品自身或产品之间所发生的交易对象、交易时间、交易价格、交易数量和交易理由等单项或多项出现异常。公司管理的同一产品或不同产品之间在同一交易日内进行的反向交易，关联交易，以及买卖法规、产品管理合同等限制投资对象的交易均认定为交易对象异常型异常交易。产品收盘前15 分钟的密集交易达到当日市场交易量的10%，则认定为交易时间异常型异常交易。不同产品临近交易日的同向交易价格差达到5%以上，则作为交易价格异常型异常交易。公司管理的产品单独或共同在单个交易日的交易量占市场交易量比例达到30%以上，即作为交易数量异常型异常交易。内幕交易，频繁申报与撤单，不能列示有充分投资研究成果支持的交易，以及投资管理人员受他人干预，未能就投资、交易等事项做出客观、公正的独立判断与决策的交易，均作为交易理由异常型异常交易。

风险管理部通过系统或人工手段，监控各产品的异常交易，如果发现某笔交易符合异常交易界定标准，将其列为异常交易，并建立异常交易档案，系统记录异常交易发生的时间、具体交易情况及认定人和认定依据，对于风险管理部识别出的异常交易，要求基金经理（投资经理）进行合理解释，并提交书面说明至风险管理部备案。

本报告期内，未发生异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，由于新冠肺炎疫情的爆发及蔓延，全面且严格的疫情防控被实施，经济增长因此被冻结，1-2月的主要经济数据创下了历史最低水平。2月制造业PMI下降至35.7，工业增加值当月同比下降25.9%，固定资产投资下降24.5%，社会消费品零售总额下降20.5%。3月国内经济继续探底，但失速阶段可能已经过去。二季度国内宏观环境可能体现为总量衰退见底，结构性矛盾突出的局面。

一季度，全球金融市场大震荡，国内A股市场也跌宕起伏。1月初，A股延续去年底的上行势头继续冲高，中旬开始各主要指数先后回落；2月首个交易日开盘，受疫情影响，指数大幅低开，随着国内疫情逐步得到控制，指数很快修复并持续回升，连续3周上涨，月末一周大跌。3月初，A股再度尝试冲高，但未能成功，之后出现大幅回落，上证综指一度跌至2646.8点，月末止跌企稳，整个3月份指数波动很大。整个一季度，上证综指下跌9.83%，沪深300指数下跌10.02%。从28个申万一级行业来看，一季度仅有5个行业上涨，分别为农林牧渔、医药生物、计算机、通信、建筑材料，受疫情影响严重的休闲服务行业跌幅最大。二季度市场最大的不确定性仍然来自于新冠疫情。

一季度，受国内外疫情及央行持续宽松的货币政策影响，债市收益率震荡下行，10年期国债收益率从年初的3.15%下行至季末的2.59%，下行了56BP。

一季度债券市场共发行债券12万亿元，同比增长14%；余额为103万亿元，较上年末增长4%。市场规模位居全球第二。

一季度，转债市场走势相对权益市场稳健，回调幅度较小，抗跌属性凸显。截至一季度末，中证可转债及可交换债券指数报收于372.65点，上涨0.09%。

在本报告期末，本基金严格按照中证可转债及可交换债券指数的成分及其权重构建投资组合，较好地跟踪了基准指数。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰中证可转债及可交债指数A基金份额净值为0.9859元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.41%，同期业绩比较基准收益率为-0.63%；截至报告期末中泰中证可转债及可交债指数C基金份额净值为0.9854元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.46%，同期业绩比较基准收益率为-0.63%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	343,545,675.53	93.75
	其中：债券	343,545,675.53	93.75
	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	22,341,018.57	6.10
8	其他资产	560,460.61	0.15
9	合计	366,447,154.71	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 5.2.2 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。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	343,545,675.53	93.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	343,545,675.53	93.83

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	320,060	33,996,773.20	9.29
2	113021	中信转债	256,060	27,782,510.00	7.59
3	113011	光大转债	192,020	22,485,542.00	6.14
4	110053	苏银转债	128,020	14,360,003.40	3.92
5	132018	G三峡EB1	128,020	14,039,953.40	3.83

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期无立案调查。

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内未受到公开谴责。

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚的情形如下：

#### 1、浦发转债（证券代码：110059.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 2、中信转债（证券代码：113021.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内因违规经营、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 3、光大转债（证券代码：113011.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 4、苏银转债（证券代码：110053.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 5、18中油EB（证券代码：132015.SH）

2019年6月，国家市场监督管理总局发布行政处罚决定书，因违法收取587.03万元供气手续费，该证券发行人中国石油天然气股份有限公司的天然气销售川渝分公司被罚587.03万元。

#### 6、17宝武EB（证券代码：132013.SH）

2019年9月，该证券发行人宝山钢铁股份有限公司未采取相应防范措施，造成工业固体废物渗漏，违反《中华人民共和国固体废物污染环境防治法》第十六条规定，受到上海市生态环境局的处罚。

#### 7、东财转2（证券代码：123041.SH）

2020年2月，根据上海证监局公告，该证券发行人东方财富信息股份有限公司的全资子公司上海东方财富证券研究所有限公司因投顾业务违规被采取责令改正监督管理措施。

#### 8、国君转债（证券代码：113013.SH）

2019年9月，该证券发行人国泰君安证券股份有限公司的四平中央西路证券营业部因未依法履行职责，被监管责令改正。

2019年11月，该证券发行人国泰君安证券股份有限公司因科创板项目信息披露不当，被上交所出具监管工作函。

2020年3月，该证券发行人国泰君安证券股份有限公司的深圳红荔西路证券营业部因未依法履行职责，被监管出具警示函。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 5.11.2 本基金本报告期末投资股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	560,460.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	560,460.61
---	----	------------

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113021	中信转债	27,782,510.00	7.59
2	113011	光大转债	22,485,542.00	6.14
3	110053	苏银转债	14,360,003.40	3.92
4	132015	18中油EB	12,880,366.20	3.52
5	132013	17宝武EB	9,791,040.00	2.67
6	132009	17中油EB	6,447,360.00	1.76
7	113013	国君转债	5,268,647.70	1.44
8	113026	核能转债	5,250,691.60	1.43
9	127005	长证转债	3,728,754.40	1.02
10	127012	招路转债	3,461,327.28	0.95
11	132007	16凤凰EB	3,264,000.00	0.89
12	113008	电气转债	3,213,189.10	0.88
13	132004	15国盛EB	3,213,120.00	0.88
14	110051	中天转债	2,981,388.60	0.81
15	113022	浙商转债	2,590,596.00	0.71
16	113020	桐昆转债	2,580,332.50	0.70
17	132014	18中化EB	2,406,161.70	0.66
18	110048	福能转债	2,123,397.50	0.58
19	110043	无锡转债	2,065,843.40	0.56
20	113014	林洋转债	2,042,967.40	0.56
21	113024	核建转债	2,024,353.10	0.55
22	110045	海澜转债	1,938,598.40	0.53
23	128048	张行转债	1,878,984.90	0.51
24	113009	广汽转债	1,866,192.40	0.51
25	110042	航电转债	1,801,888.20	0.49
26	110031	航信转债	1,786,982.40	0.49
27	113028	环境转债	1,748,889.90	0.48
28	132006	16皖新EB	1,736,284.50	0.47
29	127006	敖东转债	1,669,764.96	0.46

30	110047	山鹰转债	1,664,096.00	0.45
31	132008	17山高EB	1,658,070.00	0.45
32	128045	机电转债	1,650,607.52	0.45
33	113019	玲珑转债	1,601,691.70	0.44
34	128035	大族转债	1,586,001.06	0.43
35	132011	17浙报EB	1,515,482.00	0.41
36	113508	新风转债	1,478,318.40	0.40
37	132005	15国资EB	1,412,096.00	0.39
38	110041	蒙电转债	1,364,222.20	0.37
39	110056	亨通转债	1,350,204.00	0.37
40	113025	明泰转债	1,327,233.60	0.36
41	132012	17巨化EB	1,308,417.00	0.36
42	128034	江银转债	1,245,243.40	0.34
43	110057	现代转债	1,209,294.00	0.33
44	128046	利尔转债	1,191,442.62	0.33
45	113543	欧派转债	1,166,844.00	0.32
46	110052	贵广转债	1,160,187.50	0.32
47	110034	九州转债	1,114,166.20	0.30
48	113017	吉视转债	1,069,556.60	0.29
49	127007	湖广转债	995,719.20	0.27
50	128029	太阳转债	971,117.75	0.27
51	128074	游族转债	935,676.80	0.26
52	127011	中鼎转2	907,230.36	0.25
53	113516	苏农转债	892,485.00	0.24
54	123029	英科转债	872,298.00	0.24
55	110033	国贸转债	867,986.70	0.24
56	113534	鼎胜转债	867,801.40	0.24
57	113518	顾家转债	836,994.60	0.23
58	113544	桃李转债	806,313.90	0.22
59	127013	创维转债	803,253.50	0.22
60	128013	洪涛转债	788,659.20	0.22
61	128053	尚荣转债	787,781.80	0.22
62	128019	久立转2	769,237.28	0.21

63	128059	视源转债	761,764.80	0.21
64	128028	赣锋转债	740,182.60	0.20
65	110058	永鼎转债	710,704.50	0.19
66	128032	双环转债	662,915.22	0.18
67	128075	远东转债	652,021.90	0.18
68	127003	海印转债	648,273.20	0.18
69	128023	亚太转债	648,170.64	0.18
70	128026	众兴转债	630,688.80	0.17
71	110055	伊力转债	623,214.90	0.17
72	128018	时达转债	607,262.00	0.17
73	128065	雅化转债	584,854.02	0.16
74	123004	铁汉转债	583,794.90	0.16
75	113016	小康转债	580,142.00	0.16
76	113537	文灿转债	579,256.20	0.16
77	113515	高能转债	577,124.80	0.16
78	128062	亚药转债	559,761.70	0.15
79	128064	司尔转债	554,383.90	0.15
80	113504	艾华转债	534,024.40	0.15
81	113505	杭电转债	526,325.20	0.14
82	128015	久其转债	525,639.00	0.14
83	113527	维格转债	494,183.20	0.13
84	113519	长久转债	494,083.50	0.13
85	128063	未来转债	483,992.00	0.13
86	110050	佳都转债	476,086.50	0.13
87	128022	众信转债	469,878.50	0.13
88	128044	岭南转债	468,825.60	0.13
89	110038	济川转债	467,238.20	0.13
90	128017	金禾转债	463,948.80	0.13
91	128067	一心转债	457,796.56	0.13
92	123020	富祥转债	456,917.50	0.12
93	113542	好客转债	448,792.80	0.12
94	120002	18中原EB	448,187.80	0.12
95	128058	拓邦转债	445,450.32	0.12



96	113027	华钰转债	442,701.60	0.12
97	113530	大丰转债	440,279.20	0.12
98	128057	博彦转债	437,464.00	0.12
99	113528	长城转债	431,406.00	0.12
100	128071	合兴转债	415,807.00	0.11
101	123031	晶瑞转债	415,797.90	0.11
102	123023	迪森转债	406,752.50	0.11
103	128021	兄弟转债	406,393.20	0.11
104	128037	岩土转债	405,735.48	0.11
105	123002	国祯转债	398,215.40	0.11
106	123022	长信转债	372,289.05	0.10
107	113525	台华转债	371,451.30	0.10
108	128033	迪龙转债	353,412.90	0.10
109	113012	骆驼转债	352,534.40	0.10
110	123028	清水转债	352,187.60	0.10
111	113509	新泉转债	349,689.60	0.10
112	128066	亚泰转债	347,711.24	0.09
113	113535	大业转债	347,643.00	0.09
114	128010	顺昌转债	347,012.40	0.09
115	123017	寒锐转债	337,848.00	0.09
116	123010	博世转债	321,785.60	0.09
117	113532	海环转债	315,873.60	0.09
118	123025	精测转债	307,152.00	0.08
119	128042	凯中转债	294,954.90	0.08
120	123018	溢利转债	288,804.00	0.08
121	113531	百姓转债	287,679.00	0.08
122	128049	华源转债	281,932.80	0.08
123	127004	模塑转债	276,119.40	0.08
124	128056	今飞转债	269,639.00	0.07
125	128050	钧达转债	263,886.00	0.07
126	123027	蓝晓转债	258,989.50	0.07
127	128025	特一转债	252,880.00	0.07
128	128073	哈尔转债	237,962.82	0.06

129	113541	荣晟转债	234,620.40	0.06
130	123030	九洲转债	233,739.00	0.06
131	128069	华森转债	233,088.00	0.06
132	128030	天康转债	230,968.80	0.06
133	113524	奇精转债	227,073.00	0.06
134	128014	永东转债	227,061.50	0.06
135	123007	道氏转债	216,932.80	0.06
136	128072	翔鹭转债	205,004.60	0.06
137	123011	德尔转债	196,885.50	0.05
138	128051	光华转债	189,168.00	0.05
139	128070	智能转债	179,346.40	0.05
140	128036	金农转债	176,653.50	0.05
141	128039	三力转债	176,619.60	0.05
142	113511	千禾转债	173,401.00	0.05
143	113521	科森转债	172,729.60	0.05
144	113526	联泰转债	172,652.00	0.05
145	123026	中环转债	170,910.00	0.05
146	128040	华通转债	167,773.00	0.05
147	123024	岱勒转债	153,886.50	0.04
148	113503	泰晶转债	153,672.10	0.04
149	128043	东音转债	150,368.40	0.04
150	128054	中宠转债	149,219.84	0.04
151	113536	三星转债	145,545.90	0.04
152	123014	凯发转债	137,484.60	0.04
153	113520	百合转债	133,915.20	0.04
154	113502	嘉澳转债	133,637.00	0.04
155	127008	特发转债	114,303.20	0.03
156	132016	19东创EB	113,926.50	0.03
157	123012	万顺转债	112,719.23	0.03
158	128041	盛路转债	88,932.20	0.02
159	110044	广电转债	85,255.80	0.02
160	128052	凯龙转债	82,320.50	0.02
161	113514	威帝转债	80,465.10	0.02

162	123015	蓝盾转债	80,032.00	0.02
163	123013	横河转债	53,380.00	0.01

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.11.6 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，分项之和与合计可能有尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰中证可转债及可交 债指数A	中泰中证可转债及可交 债指数C
基金合同生效日(2020年01月19日)基金份额总额	143,789,298.46	227,689,989.16
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	143,789,298.46	227,689,989.16

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	中泰中证可转债及可交 债指数A	中泰中证可转债及可交 债指数C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	9,999,450.00	0.00
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	0.00	0.00
基金合同生效日起至报告期期末卖出	0.00	0.00

出/赎回总份额		
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,450.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	6.95	0.00

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、报告期内中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人网站。

### 8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

客户服务中心电话：400-821-0808

网站：<https://www.ztzqzg.com/>

中泰证券（上海）资产管理有限公司

2020年04月21日