

中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

2020 年第 2 季度报告

2020 年 06 月 30 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 07 月 20 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 | 9 |
| 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 | 10 |
| 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 | 11 |
| 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 | 11 |
| 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 | 20 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 | 20 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 20 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 21 |
| §8 备查文件目录 | 21 |
| 8.1 备查文件目录 | 21 |
| 8.2 存放地点 | 21 |
| 8.3 查阅方式 | 21 |

§ 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7月17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4月1日起至6月30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 | 272,390,336.60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。 |

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 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 债指数A | 中泰中证可转债及可交 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 | 113,669,648.72份 | 158,720,687.88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04月01日 - 2020年06月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|--------------------|
| | 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 |
| 1. 本期已实现收益 | -696,122.29 | -1,180,048.30 |
| 2. 本期利润 | -1,891,040.63 | -3,011,437.54 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0149 | -0.0154 |
| 4. 期末基金资产净值 | 110,254,714.83 | 153,746,150.59 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9700 | 0.9687 |

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。

3.2 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

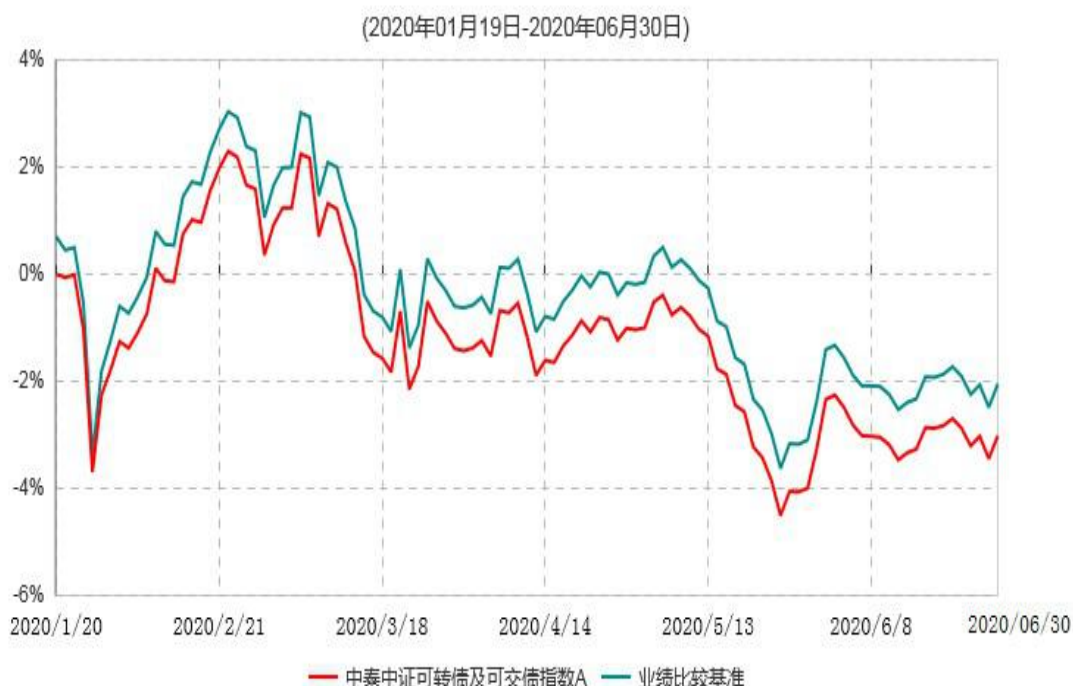
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -1.61% | 0.36% | -1.43% | 0.37% | -0.18% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.00% | 0.58% | -2.05% | 0.60% | -0.95% | -0.02% |

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 |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -1.69% | 0.36% | -1.43% | 0.37% | -0.26% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.13% | 0.58% | -2.05% | 0.60% | -1.08% | -0.02% |

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

二季度，随着新冠疫情得到控制，国内经济增速有望转正，A股止跌回升。2020年6月30日，上证综指收于2984.67点，二季度累计上涨8.52%；深证成指收于11954.99点，二季度累计上涨20.05%；创业板指数收于2426.91点，二季度累计上涨29.69%。分行业来看，二季度涨幅居前的板块分别是休闲服务、食品饮料、医药生物、电子、传媒等等；跌幅居前的板块分别是建筑装饰、纺织服装、采掘、银行、钢铁等。

二季度，由于市场宽松预期落空、地方债供给增加等原因，债券市场经历了一轮明显的牛熊转换，债券收益率一路上行，10年期国债收益率从一季度末的2.59%上行23BP至二季度末的2.82%，10年期国开债收益率从2.95%上行15BP至3.10%。

二季度，由于可转债估值较高及受债券市场调整影响，可转债市场开始下跌，进入压估值阶段，可转债市场走势落后于权益市场。2020年6月30日，中证可转债及可交换债券指数收于367.03点，二季度累计下跌1.51%。二季度，涨幅居前的转债分别是振德转债、国轩转债、福特转债、新泉转债、长信转债；涨幅居前的板块分别是电子、医药生物、食品饮料、电力设备及新能源、煤炭；跌幅居前的分别是农林牧渔、纺织服装、家电、建筑、汽车。经过5-6月份的下跌后，可转债市场整体估值性价比较之前有所提高，三季度可转债的整体表现主要取决于正股的表现。

在本报告期内，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0.9700元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.61%，同期业绩比较基准收益率为-1.43%；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0.9687元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.69%，同期业绩比较基准收益率为-1.43%。

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 | 245,754,087.05 | 90.57 |
| | 其中：债券 | 245,754,087.05 | 90.57 |
| | 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 | 25,043,760.97 | 9.23 |
| 8 | 其他资产 | 556,191.22 | 0.20 |
| 9 | 合计 | 271,354,039.24 | 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） | 245,754,087.05 | 93.09 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 245,754,087.05 | 93.09 |

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 | 216,000 | 21,999,600.00 | 8.33 |
| 2 | 113021 | 中信转债 | 172,790 | 18,089,385.10 | 6.85 |
| 3 | 113011 | 光大转债 | 129,590 | 14,781,035.40 | 5.60 |
| 4 | 132018 | G三峡EB1 | 86,390 | 9,585,834.40 | 3.63 |
| 5 | 110053 | 苏银转债 | 86,400 | 9,151,488.00 | 3.47 |

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依次为：上海浦东发展银行股份有限公司（浦发转债）、中信银行股份有限公司（中信转债）、中国光大银行股份有限公司（光大转债）、中国长江三峡集团有限公司（G三峡EB1）、江苏银行股份有限公司（苏银转债）、中国石油天然气集团有限公司（18中油EB、17中油EB）、中国宝武钢铁集团有限公司（17宝武EB）、东方财富信息股份有限公司（东财转2）、国泰君安证券股份有限公司（国君转债）。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，除中信银行股份有限公司外，本期无立案调查。其中中信银行被立案调查的情形如下：2020年5月9日，中国银保监会消费者权益保护局就中信银行侵害消费者合法权益的情况进行了通报，并表示已对中信银行启动立案调查程序。

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所示：

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期内因违规经营、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

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期内因违规经营、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期内因违规经营、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

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期内因违规经营、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

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。

2020年4月，中国石油天然气股份有限公司长庆油田分公司第二采油厂因违反《中华人民共和国水污染防治法》被庆阳市生态环境局庆城分局罚款16.5万元。

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》第十六条的规定，受到上海市生态环境局的处罚。

7、东财转2（证券代码123041.SZ）

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。

2020年5月，该证券发行人国泰君安证券股份有限公司作为富贵鸟股份有限公司公开发行人2014年公司债券的承销机构和受托管理人，在尽职调查和受托管理过程中未严格遵守执业规范，未能勤勉尽责地履行相关责任，违反了中国证监会《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第113号）第七条和第四十九条的规定，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 本基金本报告期未投资股票。

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 | 556,191.22 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 556,191.22 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 21,999,600.00 | 8.33 |
| 2 | 113021 | 中信转债 | 18,089,385.10 | 6.85 |
| 3 | 113011 | 光大转债 | 14,781,035.40 | 5.60 |
| 4 | 132018 | G三峡EB1 | 9,585,834.40 | 3.63 |
| 5 | 110053 | 苏银转债 | 9,151,488.00 | 3.47 |
| 6 | 132015 | 18中油EB | 8,853,000.00 | 3.35 |
| 7 | 132013 | 17宝武EB | 6,625,526.30 | 2.51 |
| 8 | 132009 | 17中油EB | 4,439,720.60 | 1.68 |
| 9 | 128080 | 顺丰转债 | 3,441,259.80 | 1.30 |
| 10 | 113013 | 国君转债 | 3,438,590.40 | 1.30 |
| 11 | 113026 | 核能转债 | 3,366,978.60 | 1.28 |
| 12 | 127005 | 长证转债 | 2,519,773.92 | 0.95 |
| 13 | 110051 | 中天转债 | 2,211,079.50 | 0.84 |
| 14 | 132007 | 16凤凰EB | 2,202,180.00 | 0.83 |
| 15 | 127012 | 招路转债 | 2,174,760.70 | 0.82 |
| 16 | 132004 | 15国盛EB | 2,174,738.40 | 0.82 |
| 17 | 113008 | 电气转债 | 2,123,160.00 | 0.80 |
| 18 | 110061 | 川投转债 | 1,943,396.00 | 0.74 |
| 19 | 113020 | 桐昆转债 | 1,765,476.20 | 0.67 |
| 20 | 128086 | 国轩转债 | 1,754,843.70 | 0.66 |
| 21 | 110062 | 烽火转债 | 1,729,727.70 | 0.66 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 22 | 113022 | 浙商转债 | 1,676,656.80 | 0.64 |
| 23 | 132014 | 18中化EB | 1,539,216.00 | 0.58 |
| 24 | 128081 | 海亮转债 | 1,414,709.40 | 0.54 |
| 25 | 128084 | 木森转债 | 1,405,863.69 | 0.53 |
| 26 | 110043 | 无锡转债 | 1,330,353.50 | 0.50 |
| 27 | 110048 | 福能转债 | 1,315,336.50 | 0.50 |
| 28 | 113014 | 林洋转债 | 1,297,719.50 | 0.49 |
| 29 | 113024 | 核建转债 | 1,294,647.00 | 0.49 |
| 30 | 110065 | 淮矿转债 | 1,256,147.70 | 0.48 |
| 31 | 110045 | 海澜转债 | 1,233,690.00 | 0.47 |
| 32 | 128048 | 张行转债 | 1,214,028.00 | 0.46 |
| 33 | 110042 | 航电转债 | 1,183,026.00 | 0.45 |
| 34 | 132006 | 16皖新EB | 1,166,399.00 | 0.44 |
| 35 | 113028 | 环境转债 | 1,159,069.00 | 0.44 |
| 36 | 113009 | 广汽转债 | 1,153,992.60 | 0.44 |
| 37 | 132008 | 17山高EB | 1,120,956.00 | 0.42 |
| 38 | 110031 | 航信转债 | 1,118,611.90 | 0.42 |
| 39 | 128085 | 鸿达转债 | 1,105,585.01 | 0.42 |
| 40 | 127006 | 敖东转债 | 1,080,768.16 | 0.41 |
| 41 | 128045 | 机电转债 | 1,079,918.88 | 0.41 |
| 42 | 128035 | 大族转债 | 1,076,167.12 | 0.41 |
| 43 | 110047 | 山鹰转债 | 1,071,631.40 | 0.41 |
| 44 | 113019 | 玲珑转债 | 1,067,703.60 | 0.40 |
| 45 | 132011 | 17浙报EB | 1,040,760.00 | 0.39 |
| 46 | 128088 | 深南转债 | 1,033,329.60 | 0.39 |
| 47 | 110057 | 现代转债 | 940,097.70 | 0.36 |
| 48 | 113508 | 新风转债 | 932,808.90 | 0.35 |
| 49 | 132005 | 15国资EB | 927,725.00 | 0.35 |
| 50 | 132012 | 17巨化EB | 886,095.00 | 0.34 |
| 51 | 110056 | 亨通转债 | 879,336.10 | 0.33 |
| 52 | 132017 | 19新钢EB | 876,808.00 | 0.33 |
| 53 | 110041 | 蒙电转债 | 862,232.20 | 0.33 |
| 54 | 110063 | 鹰19转债 | 856,822.80 | 0.32 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 55 | 113029 | 明阳转债 | 839,065.10 | 0.32 |
| 56 | 113551 | 福特转债 | 815,955.00 | 0.31 |
| 57 | 113025 | 明泰转债 | 815,431.50 | 0.31 |
| 58 | 113543 | 欧派转债 | 803,559.40 | 0.30 |
| 59 | 128034 | 江银转债 | 785,308.00 | 0.30 |
| 60 | 128074 | 游族转债 | 753,672.00 | 0.29 |
| 61 | 110034 | 九州转债 | 746,869.20 | 0.28 |
| 62 | 113545 | 金能转债 | 746,220.20 | 0.28 |
| 63 | 110064 | 建工转债 | 729,332.40 | 0.28 |
| 64 | 110052 | 贵广转债 | 713,394.00 | 0.27 |
| 65 | 113555 | 振德转债 | 690,802.00 | 0.26 |
| 66 | 113558 | 日月转债 | 688,401.60 | 0.26 |
| 67 | 113017 | 吉视转债 | 667,144.90 | 0.25 |
| 68 | 113554 | 仙鹤转债 | 663,156.00 | 0.25 |
| 69 | 128029 | 太阳转债 | 654,250.55 | 0.25 |
| 70 | 113518 | 顾家转债 | 614,887.50 | 0.23 |
| 71 | 128078 | 太极转债 | 606,914.00 | 0.23 |
| 72 | 123036 | 先导转债 | 578,491.67 | 0.22 |
| 73 | 127007 | 湖广转债 | 575,851.78 | 0.22 |
| 74 | 113516 | 苏农转债 | 568,251.40 | 0.22 |
| 75 | 110033 | 国贸转债 | 566,496.40 | 0.21 |
| 76 | 113534 | 鼎胜转债 | 565,086.20 | 0.21 |
| 77 | 128028 | 赣锋转债 | 554,053.20 | 0.21 |
| 78 | 113544 | 桃李转债 | 542,419.20 | 0.21 |
| 79 | 128013 | 洪涛转债 | 541,776.20 | 0.21 |
| 80 | 128059 | 视源转债 | 540,658.80 | 0.20 |
| 81 | 127011 | 中鼎转2 | 536,282.12 | 0.20 |
| 82 | 110060 | 天路转债 | 530,298.90 | 0.20 |
| 83 | 113550 | 常汽转债 | 528,836.80 | 0.20 |
| 84 | 123029 | 英科转债 | 511,776.00 | 0.19 |
| 85 | 127013 | 创维转债 | 507,265.60 | 0.19 |
| 86 | 128019 | 久立转2 | 495,574.20 | 0.19 |
| 87 | 113547 | 索发转债 | 476,013.60 | 0.18 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 88 | 128046 | 利尔转债 | 470,931.97 | 0.18 |
| 89 | 110055 | 伊力转债 | 458,665.20 | 0.17 |
| 90 | 128075 | 远东转债 | 455,990.64 | 0.17 |
| 91 | 127003 | 海印转债 | 449,775.70 | 0.17 |
| 92 | 110058 | 永鼎转债 | 435,066.40 | 0.16 |
| 93 | 128065 | 雅化转债 | 419,509.30 | 0.16 |
| 94 | 128032 | 双环转债 | 417,608.72 | 0.16 |
| 95 | 128023 | 亚太转债 | 409,329.44 | 0.16 |
| 96 | 113504 | 艾华转债 | 409,151.60 | 0.15 |
| 97 | 128083 | 新北转债 | 408,087.12 | 0.15 |
| 98 | 123035 | 利德转债 | 405,009.25 | 0.15 |
| 99 | 113549 | 白电转债 | 401,574.00 | 0.15 |
| 100 | 128026 | 众兴转债 | 389,426.40 | 0.15 |
| 101 | 128018 | 时达转债 | 375,208.80 | 0.14 |
| 102 | 128067 | 一心转债 | 368,997.48 | 0.14 |
| 103 | 113016 | 小康转债 | 366,941.10 | 0.14 |
| 104 | 123004 | 铁汉转债 | 352,606.80 | 0.13 |
| 105 | 128064 | 司尔转债 | 348,941.00 | 0.13 |
| 106 | 128015 | 久其转债 | 339,830.80 | 0.13 |
| 107 | 113505 | 杭电转债 | 327,499.20 | 0.12 |
| 108 | 113519 | 长久转债 | 319,860.00 | 0.12 |
| 109 | 128022 | 众信转债 | 319,032.80 | 0.12 |
| 110 | 110038 | 济川转债 | 317,703.60 | 0.12 |
| 111 | 120002 | 18中原EB | 314,020.00 | 0.12 |
| 112 | 128017 | 金禾转债 | 310,128.00 | 0.12 |
| 113 | 113509 | 新泉转债 | 305,750.60 | 0.12 |
| 114 | 113542 | 好客转债 | 295,467.90 | 0.11 |
| 115 | 128063 | 未来转债 | 295,419.20 | 0.11 |
| 116 | 128058 | 拓邦转债 | 291,659.82 | 0.11 |
| 117 | 113527 | 维格转债 | 285,163.20 | 0.11 |
| 118 | 128044 | 岭南转债 | 282,068.80 | 0.11 |
| 119 | 128087 | 孚日转债 | 280,908.85 | 0.11 |
| 120 | 123022 | 长信转债 | 280,062.90 | 0.11 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 121 | 113528 | 长城转债 | 279,524.70 | 0.11 |
| 122 | 128071 | 合兴转债 | 277,534.30 | 0.11 |
| 123 | 113027 | 华钰转债 | 277,193.80 | 0.10 |
| 124 | 113530 | 大丰转债 | 276,876.60 | 0.10 |
| 125 | 113537 | 文灿转债 | 276,629.50 | 0.10 |
| 126 | 128057 | 博彦转债 | 269,723.20 | 0.10 |
| 127 | 113557 | 森特转债 | 267,728.30 | 0.10 |
| 128 | 127014 | 北方转债 | 265,757.70 | 0.10 |
| 129 | 123023 | 迪森转债 | 253,292.00 | 0.10 |
| 130 | 128037 | 岩土转债 | 252,907.48 | 0.10 |
| 131 | 128021 | 兄弟转债 | 250,711.20 | 0.09 |
| 132 | 113548 | 石英转债 | 247,570.20 | 0.09 |
| 133 | 113525 | 台华转债 | 244,582.00 | 0.09 |
| 134 | 123025 | 精测转债 | 232,880.00 | 0.09 |
| 135 | 128066 | 亚泰转债 | 228,770.16 | 0.09 |
| 136 | 128010 | 顺昌转债 | 228,624.00 | 0.09 |
| 137 | 113012 | 骆驼转债 | 226,402.00 | 0.09 |
| 138 | 123028 | 清水转债 | 224,524.50 | 0.09 |
| 139 | 113559 | 永创转债 | 222,599.40 | 0.08 |
| 140 | 123037 | 新莱转债 | 220,813.74 | 0.08 |
| 141 | 123017 | 寒锐转债 | 219,905.00 | 0.08 |
| 142 | 128033 | 迪龙转债 | 218,696.10 | 0.08 |
| 143 | 113556 | 至纯转债 | 216,015.80 | 0.08 |
| 144 | 113535 | 大业转债 | 213,831.80 | 0.08 |
| 145 | 123002 | 国祯转债 | 209,091.20 | 0.08 |
| 146 | 123018 | 溢利转债 | 208,790.40 | 0.08 |
| 147 | 123033 | 金力转债 | 205,089.20 | 0.08 |
| 148 | 113553 | 金牌转债 | 202,749.30 | 0.08 |
| 149 | 113532 | 海环转债 | 201,965.10 | 0.08 |
| 150 | 123010 | 博世转债 | 199,622.50 | 0.08 |
| 151 | 128042 | 凯中转债 | 191,136.40 | 0.07 |
| 152 | 128049 | 华源转债 | 179,515.80 | 0.07 |
| 153 | 123034 | 通光转债 | 179,251.20 | 0.07 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 154 | 128053 | 尚荣转债 | 165,701.20 | 0.06 |
| 155 | 128082 | 华锋转债 | 164,367.90 | 0.06 |
| 156 | 128056 | 今飞转债 | 155,977.60 | 0.06 |
| 157 | 123030 | 九洲转债 | 155,298.00 | 0.06 |
| 158 | 113541 | 荣晟转债 | 154,141.00 | 0.06 |
| 159 | 128014 | 永东转债 | 149,139.00 | 0.06 |
| 160 | 128050 | 钧达转债 | 146,228.00 | 0.06 |
| 161 | 113524 | 奇精转债 | 145,152.00 | 0.05 |
| 162 | 128069 | 华森转债 | 141,570.00 | 0.05 |
| 163 | 113030 | 东风转债 | 140,584.20 | 0.05 |
| 164 | 128025 | 特一转债 | 139,165.00 | 0.05 |
| 165 | 123007 | 道氏转债 | 137,196.30 | 0.05 |
| 166 | 128073 | 哈尔转债 | 136,618.86 | 0.05 |
| 167 | 128030 | 天康转债 | 133,113.50 | 0.05 |
| 168 | 128072 | 翔鹭转债 | 131,930.10 | 0.05 |
| 169 | 123027 | 蓝晓转债 | 127,283.28 | 0.05 |
| 170 | 128051 | 光华转债 | 121,124.00 | 0.05 |
| 171 | 113526 | 联泰转债 | 120,666.20 | 0.05 |
| 172 | 128079 | 英联转债 | 116,830.80 | 0.04 |
| 173 | 128040 | 华通转债 | 111,899.20 | 0.04 |
| 174 | 123026 | 中环转债 | 111,059.60 | 0.04 |
| 175 | 127004 | 模塑转债 | 110,295.00 | 0.04 |
| 176 | 113552 | 克来转债 | 110,089.20 | 0.04 |
| 177 | 123011 | 德尔转债 | 107,588.60 | 0.04 |
| 178 | 123020 | 富祥转债 | 105,540.00 | 0.04 |
| 179 | 113521 | 科森转债 | 104,917.20 | 0.04 |
| 180 | 113546 | 迪贝转债 | 102,415.50 | 0.04 |
| 181 | 128070 | 智能转债 | 101,770.00 | 0.04 |
| 182 | 128039 | 三力转债 | 98,266.50 | 0.04 |
| 183 | 113536 | 三星转债 | 92,438.60 | 0.04 |
| 184 | 128076 | 金轮转债 | 91,947.84 | 0.03 |
| 185 | 123024 | 岱勒转债 | 91,819.00 | 0.03 |
| 186 | 132016 | 19东创EB | 89,091.90 | 0.03 |

| | | | | |
|-----|--------|------|-----------|------|
| 187 | 113520 | 百合转债 | 88,603.20 | 0.03 |
| 188 | 123032 | 万里转债 | 86,915.40 | 0.03 |
| 189 | 128036 | 金农转债 | 82,744.20 | 0.03 |
| 190 | 113502 | 嘉澳转债 | 81,097.20 | 0.03 |
| 191 | 123031 | 晶瑞转债 | 80,100.90 | 0.03 |
| 192 | 128043 | 东音转债 | 74,109.00 | 0.03 |
| 193 | 123012 | 万顺转债 | 62,966.64 | 0.02 |
| 194 | 123014 | 凯发转债 | 59,559.50 | 0.02 |
| 195 | 113514 | 威帝转债 | 56,574.00 | 0.02 |
| 196 | 110044 | 广电转债 | 54,483.00 | 0.02 |
| 197 | 123015 | 蓝盾转债 | 50,641.10 | 0.02 |

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 |
|-------------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 143,789,298.46 | 227,689,989.16 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 30,119,649.74 | 68,969,301.28 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 113,669,648.72 | 158,720,687.88 |

§ 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 |
|-------------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 9,999,450.00 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 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 (%) | 8.80 | 0.00 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金份额。

§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07月20日