

中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2020年08月26日

送出日期：2020年08月31日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	中泰中证可转债及可 交债指数	基金代码	008402
基金简称A	中泰中证可转债及可 交债指数A	基金代码A	008402
基金简称C	中泰中证可转债及可 交债指数C	基金代码C	008403
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
基金合同生效 日	2020年01月19日	上市交易所及 上市日期	暂未上市
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
朱未一	2020年01月19日	2013年04月17日	
张蓓蓓	2020年02月25日	2012年12月04日	

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

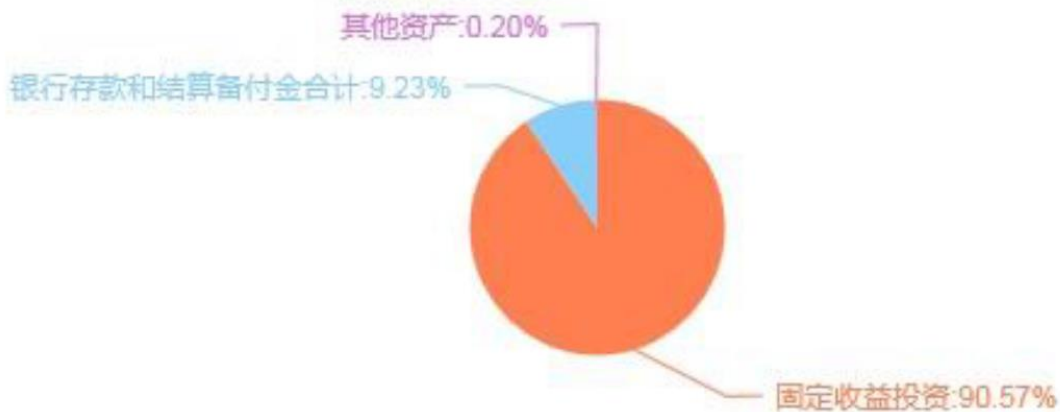
投资者欲了解详细情况，请阅读招募说明书第九部分“基金的投资”。

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。
投资范围	<p>本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券。为更好实现投资目标，本基金还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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。</p> <p>本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证可转债及可交换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、应收申购款等，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p>

主要投资策略	<p>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。如因指数编制规则调整、债券利息税等其他原因导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金构建投资组合的过程主要分为三步：划分可转债及可交换债券层级、筛选目标组合成份券和逐步调整建仓。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：20200630



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

本基金基金合同生效日为2020年1月19日，尚未披露过年度报告，故暂不披露每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

中泰中证可转债及可交债指数A

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式 / 费率	备注
申购费	M < 100万	0.35%	

(前收费)	100万≤M<500万	0.15%	
	500万≤M	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.30%	
	30天≤N<365天	0.10%	
	365天≤N	0.00%	

中泰中证可转债及可交债指数C

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费(前收费)			本基金C类份额无申购费
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.10%	
	30天≤N	0.00%	

注:投资人重复申购,须按每次申购金额所对应的费率档次分别计费。

A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.60%
托管费	0.05%
销售服务费C	0.30%
指数使用费	0.015%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费 and 仲裁费;基金份额持有人大会费用;基金的证券交易费用;基金的银行汇划费用;基金的开户费用、账户维护费用等。

注:1、指数使用费收取下限为每季度2.5万元;

2、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除;

3、上表中"其他费用"类别列示的费用项目,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

四、 风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金投资运作过程中面临的主要风险如下:

1、市场风险

市场风险指由于经济、政治、社会等环境因素的变化对证券价格造成的影响。

2、信用风险

本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行为。

3、运作管理风险

主要包括管理风险、交易风险、运作风险和道德风险。

4、流动性风险

流动性风险包括投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现的风险以及申购赎回要求可能导致流动资金不足的风险。

5、本基金特定风险

(1) 指数投资风险：主要包括标的指数编制缺陷和不成熟风险、标的指数波动风险和跟踪偏离风险。

(2) 可转换债券和可交换债券市场的流动性风险、债券价格受所对应股票价格波动影响而波动的风险以及在转股期或换股期不能转股或换股的风险等。

(3) 本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券存在信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

(4) 基金合同生效后，连续60个工作日，基金资产净值低于5000万元，或基金份额持有人数量不满200人时，基金管理人可以直接终止《基金合同》。

(5) 本基金采用证券公司交易模式和结算模式，该种交易结算模式可能存在信息系统风险、操作风险、效率降低风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等风险。

6、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

7、除以上主要风险以外，基金还可能遇到以下风险：技术风险、不可抗力风险和其他意外风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应经友好协商解决。如经友好协商未能解决的，则任何一方有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁裁决是终局的。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：<https://www.ztzqzg.com/> 客服电话：
400-821-0808

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书；
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告；
- 3、基金份额净值；
- 4、基金销售机构及联系方式；
- 5、其他重要资料。

六、其他情况说明

无