
中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 09 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 10 月 28 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	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	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	20
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	21
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	21
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	22

§ 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10月27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7月1日起至9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	58,020,453.16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	35,408,970.96份	22,611,482.20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07月01日 - 2020年09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	2,330,628.65	3,930,069.97
2. 本期利润	5,091,507.73	8,757,327.99
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1084	0.1685
4. 期末基金资产净值	35,509,495.69	22,627,285.10
5. 期末基金份额净值	1.0028	1.0007

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 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	3.38%	0.81%	3.87%	0.78%	-0.49%	0.03%
过去六个月	1.71%	0.64%	2.39%	0.62%	-0.68%	0.02%
自基金合同生效起至今	0.28%	0.68%	1.74%	0.67%	-1.46%	0.01%

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	3.30%	0.81%	3.87%	0.78%	-0.57%	0.03%
过去六个月	1.55%	0.64%	2.39%	0.62%	-0.84%	0.02%
自基金合同生效起至今	0.07%	0.68%	1.74%	0.67%	-1.67%	0.01%

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

(2020年01月19日-2020年09月30日)



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	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，公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

三季度，我国经济加速回暖，积极变化不断增多。8月全国规模以上工业增加值同比增长5.6%，8月社会消费品零售总额同比增长0.5%，为今年以来首次正增长。9月中国制造业PMI为51.5%，比上月增长0.5个百分点，连续7个月运行在50%以上。

三季度，权益市场主要指数集体上涨，9月30日，上证综指收于3218.05点，三季度累计上涨7.82%；深证成指收于12907.45点，三季度累计上涨7.63%；创业板指数收于2574.76点，三季度累计上涨5.60%。三季度A股涨幅在全球主要市场中位居前列。北向资金整个三季度累计净流出244亿元，其中9月份净流出328亿元，这一金额也创年内第二高值。展望四季度权益市场的表现，需关注三季报上市公司业绩、疫情发展、美国大选等因素的影响。

由于我国经济数据好于预期、资金面紧张、股债跷跷板等原因，整个三季度的债券收益率震荡上行，10年期国债收益率从二季度末的2.82%上行33BP至三季度末的3.15%，目前的债券收益率已变得较有吸引力。但当前中国经济继续复苏，债市未来走势仍需谨慎。三季度，转债市场跟随权益市场在7月初快速上涨，8月以震荡为主，9月整月下跌。9月30日，中证可转债及可交换债券指数收于381.93点，三季度累计上涨4.06%。经过9月份的调整后，目前可转债估值处于年内较低的位置，但今年以来转债估值整体处于偏高水平，所以当前的估值从历史上来看仍偏高。四季度可转债的整体表现主要取决于权益市场的表现。

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1.0028元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.38%，同期业绩比较基准收益率为3.87%；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1.0007元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.30%，同期业绩比较基准收益率为3.87%。

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	58,682,373.18	93.99
	其中：债券	58,682,373.18	93.99
	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	3,584,983.40	5.74
8	其他资产	170,087.41	0.27
9	合计	62,437,443.99	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）	58,682,373.18	100.94
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,682,373.18	100.94

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	49,030	5,016,259.30	8.63
2	113021	中信转债	39,220	4,117,707.80	7.08
3	113011	光大转债	29,420	3,466,264.40	5.96
4	132018	G三峡EB1	19,610	2,278,682.00	3.92
5	110053	苏银转债	19,610	2,173,964.60	3.74

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）、
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）、
中国长江三峡集团有限公司（G三峡EB1）、
中国宝武钢铁集团有限公司（17宝武EB）、
国投资本股份有限公司（国投转债）、
中国核能电力股份有限公司（核能转债）。

本基金投资的前十名证券的发行主体，除中信银行外，其余主体本期均无立案调查。

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、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期内因违规经营、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。

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、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）

根据银保监会公告，2019年10月，江苏银行股份有限公司徐州分行因个人消费贷款贷后监督不力，客户未按合同约定用途使用授信；个人消费贷款调查违反审慎经营规则被徐州银保监分局罚款70万元，同时相关负责人被予以警告。

5、国投转债（证券代码110073.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人国投资本股份有限公司在报告期内因未按规定代扣代缴个人所得税、未按照规定期限办理纳税申报和报送纳税资料等原因，多次受到监管机构的处罚。

6、核能转债（证券代码113026.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人中国核能电力股份有限公司在报告期内因擅自占用土地进行建设、未按照国家规定向交通运输主管部门或其委托的建设工程质量监督机构提交材料、办理工程质量监督手续等原因，多次受到监管机构的处罚。

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	169,023.13
5	应收申购款	1,064.28
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	170,087.41

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	5,016,259.30	8.63
2	113021	中信转债	4,117,707.80	7.08
3	113011	光大转债	3,466,264.40	5.96
4	132018	G三峡EB1	2,278,682.00	3.92
5	110053	苏银转债	2,173,964.60	3.74
6	132015	18中油EB	1,953,352.10	3.36
7	132013	17宝武EB	1,509,981.50	2.60
8	132009	17中油EB	985,316.40	1.69
9	113013	国君转债	839,458.20	1.44
10	113026	核能转债	778,005.00	1.34
11	127005	长证转债	634,252.08	1.09
12	127015	希望转债	567,929.60	0.98
13	127012	招路转债	513,373.00	0.88
14	128102	海大转债	492,112.17	0.85
15	110051	中天转债	477,283.80	0.82
16	132007	16凤凰EB	475,695.00	0.82
17	110061	川投转债	473,888.80	0.82
18	113008	电气转债	472,514.40	0.81
19	132004	15国盛EB	442,631.70	0.76
20	113020	桐昆转债	434,740.90	0.75
21	132014	18中化EB	405,820.00	0.70
22	110062	烽火转债	371,713.20	0.64
23	110067	华安转债	339,790.00	0.58
24	110043	无锡转债	329,779.80	0.57
25	110048	福能转债	322,785.80	0.56
26	113014	林洋转债	322,194.60	0.55
27	128081	海亮转债	321,545.40	0.55
28	110065	淮矿转债	320,864.00	0.55

29	113024	核建转债	303,290.40	0.52
30	132006	16皖新EB	300,025.00	0.52
31	128048	张行转债	290,276.00	0.50
32	110066	盛屯转债	287,141.40	0.49
33	110045	海澜转债	281,081.40	0.48
34	113032	桐20转债	270,202.50	0.46
35	113009	广汽转债	266,875.00	0.46
36	128085	鸿达转债	254,861.94	0.44
37	110031	航信转债	254,575.50	0.44
38	127006	敖东转债	252,807.10	0.43
39	132008	17山高EB	252,350.00	0.43
40	110047	山鹰转债	251,854.40	0.43
41	128098	康弘转债	242,468.10	0.42
42	128035	大族转债	241,391.88	0.42
43	132011	17浙报EB	229,039.00	0.39
44	113029	明阳转债	224,564.90	0.39
45	128095	恩捷转债	222,170.70	0.38
46	132005	15国资EB	220,559.50	0.38
47	113543	欧派转债	220,235.40	0.38
48	113508	新风转债	217,541.00	0.37
49	110057	现代转债	216,212.00	0.37
50	110068	龙净转债	215,835.20	0.37
51	110041	蒙电转债	206,576.80	0.36
52	110063	鹰19转债	204,594.00	0.35
53	113025	明泰转债	201,362.50	0.35
54	128029	太阳转债	197,047.50	0.34
55	132017	19新钢EB	194,880.00	0.34
56	113555	振德转债	188,639.10	0.32
57	110056	亨通转债	185,371.20	0.32
58	128034	江银转债	185,020.40	0.32
59	113545	金能转债	173,166.00	0.30
60	128097	奥佳转债	171,524.80	0.30
61	110064	建工转债	170,465.40	0.29

62	110034	九州转债	168,417.90	0.29
63	110052	贵广转债	161,685.00	0.28
64	113017	吉视转债	152,097.30	0.26
65	127011	中鼎转2	135,929.68	0.23
66	123036	先导转债	135,476.10	0.23
67	123029	英科转债	134,222.20	0.23
68	113516	苏农转债	133,692.90	0.23
69	128096	奥瑞转债	131,503.60	0.23
70	110033	国贸转债	129,686.20	0.22
71	110060	天路转债	129,277.40	0.22
72	113534	鼎胜转债	128,773.40	0.22
73	127007	湖广转债	127,492.47	0.22
74	128078	太极转债	127,365.40	0.22
75	128028	赣锋转债	126,972.00	0.22
76	128019	久立转2	126,636.02	0.22
77	128013	洪涛转债	126,067.50	0.22
78	120002	18中原EB	123,079.00	0.21
79	113562	璞泰转债	117,164.00	0.20
80	128046	利尔转债	113,409.18	0.20
81	128075	远东转债	113,174.26	0.19
82	110058	永鼎转债	111,715.20	0.19
83	128074	游族转债	109,463.90	0.19
84	110055	伊力转债	106,803.40	0.18
85	127013	创维转债	103,094.40	0.18
86	128032	双环转债	102,582.42	0.18
87	127003	海印转债	99,930.40	0.17
88	113571	博特转债	98,940.00	0.17
89	123035	利德转债	97,173.24	0.17
90	128083	新北转债	95,812.17	0.16
91	128065	雅化转债	95,549.49	0.16
92	113563	柳药转债	93,464.90	0.16
93	128023	亚太转债	92,954.24	0.16
94	113549	白电转债	92,785.40	0.16

95	113550	常汽转债	92,547.10	0.16
96	128026	众兴转债	91,584.00	0.16
97	128018	时达转债	88,861.80	0.15
98	128099	永高转债	88,487.14	0.15
99	123004	铁汉转债	86,347.17	0.15
100	113504	艾华转债	86,209.20	0.15
101	128017	金禾转债	85,396.00	0.15
102	113016	小康转债	84,633.60	0.15
103	128064	司尔转债	83,834.40	0.14
104	123044	红相转债	82,070.00	0.14
105	128100	搜特转债	81,306.80	0.14
106	128022	众信转债	80,267.70	0.14
107	128015	久其转债	77,746.90	0.13
108	113505	杭电转债	74,620.60	0.13
109	128071	合兴转债	73,631.00	0.13
110	113519	长久转债	73,535.20	0.13
111	113027	华钰转债	72,632.70	0.12
112	113542	好客转债	71,665.80	0.12
113	128058	拓邦转债	71,548.22	0.12
114	113537	文灿转债	70,352.80	0.12
115	110038	济川转债	69,402.80	0.12
116	128057	博彦转债	68,658.00	0.12
117	128063	未来转债	66,854.60	0.11
118	128044	岭南转债	65,325.00	0.11
119	113527	维格转债	65,210.90	0.11
120	113530	大丰转债	64,108.00	0.11
121	113557	森特转债	63,661.00	0.11
122	113528	长城转债	63,587.20	0.11
123	128087	孚日转债	63,341.25	0.11
124	127014	北方转债	61,976.10	0.11
125	113525	台华转债	60,387.60	0.10
126	123023	迪森转债	60,203.60	0.10
127	123046	天铁转债	59,978.10	0.10

128	128021	兄弟转债	59,665.00	0.10
129	128037	岩土转债	57,859.01	0.10
130	113559	永创转债	57,530.00	0.10
131	123022	长信转债	55,869.30	0.10
132	128093	百川转债	55,296.12	0.10
133	123028	清水转债	53,817.60	0.09
134	113012	骆驼转债	53,530.00	0.09
135	128010	顺昌转债	53,060.00	0.09
136	128090	汽模转2	53,038.00	0.09
137	128066	亚泰转债	52,712.96	0.09
138	113553	金牌转债	52,205.40	0.09
139	113569	科达转债	51,724.20	0.09
140	128033	迪龙转债	51,561.00	0.09
141	113509	新泉转债	50,335.50	0.09
142	123002	国祯转债	50,319.30	0.09
143	123033	金力转债	49,110.30	0.08
144	113535	大业转债	49,034.30	0.08
145	123017	寒锐转债	48,945.00	0.08
146	113532	海环转债	46,944.00	0.08
147	113556	至纯转债	46,668.40	0.08
148	123010	博世转债	46,061.40	0.08
149	123027	蓝晓转债	44,610.52	0.08
150	128042	凯中转债	43,902.80	0.08
151	123030	九洲转债	43,572.00	0.07
152	128049	华源转债	43,477.20	0.07
153	128056	今飞转债	42,523.20	0.07
154	113541	荣晟转债	38,700.80	0.07
155	128082	华锋转债	37,746.80	0.06
156	113565	宏辉转债	37,222.40	0.06
157	123025	精测转债	37,119.00	0.06
158	113564	天目转债	35,777.30	0.06
159	128050	钧达转债	33,972.90	0.06
160	113568	新春转债	33,798.40	0.06

161	128014	永东转债	33,785.40	0.06
162	113524	奇精转债	33,545.60	0.06
163	128051	光华转债	33,486.30	0.06
164	113030	东风转债	32,741.00	0.06
165	123007	道氏转债	32,407.62	0.06
166	123045	雷迪转债	32,169.20	0.06
167	128069	华森转债	32,097.00	0.06
168	128073	哈尔转债	31,953.56	0.05
169	128101	联创转债	31,717.30	0.05
170	113561	正裕转债	30,937.20	0.05
171	128053	尚荣转债	30,913.00	0.05
172	128025	特一转债	30,722.60	0.05
173	128094	星帅转债	30,299.40	0.05
174	113526	联泰转债	29,936.00	0.05
175	113570	百达转债	29,923.60	0.05
176	123026	中环转债	29,729.80	0.05
177	123047	久吾转债	29,690.00	0.05
178	113548	石英转债	29,456.70	0.05
179	128072	翔鹭转债	29,394.40	0.05
180	113521	科森转债	27,670.50	0.05
181	123039	开润转债	25,567.49	0.04
182	123011	德尔转债	25,438.35	0.04
183	123034	通光转债	25,030.40	0.04
184	128040	华通转债	25,005.20	0.04
185	123038	联得转债	24,327.60	0.04
186	113546	迪贝转债	24,177.60	0.04
187	128070	智能转债	24,023.50	0.04
188	128079	英联转债	23,816.00	0.04
189	113567	君禾转债	23,587.20	0.04
190	128091	新天转债	23,393.70	0.04
191	123043	正元转债	23,134.00	0.04
192	113572	三祥转债	22,972.00	0.04
193	123032	万里转债	22,676.40	0.04

194	123024	岱勒转债	22,472.10	0.04
195	128039	三力转债	22,354.00	0.04
196	128076	金轮转债	22,190.04	0.04
197	132016	19东创EB	22,021.00	0.04
198	113566	翔港转债	21,980.00	0.04
199	113536	三星转债	21,924.10	0.04
200	123018	溢利转债	21,440.10	0.04
201	127004	模塑转债	21,281.00	0.04
202	128030	天康转债	20,826.30	0.04
203	128036	金农转债	19,224.80	0.03
204	110044	广电转债	18,697.70	0.03
205	113502	嘉澳转债	18,160.20	0.03
206	123042	银河转债	17,120.00	0.03
207	123031	晶瑞转债	16,622.20	0.03
208	123012	万顺转债	15,293.19	0.03
209	113520	百合转债	15,120.80	0.03
210	123014	凯发转债	14,272.50	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	113,669,648.72	158,720,687.88
报告期期间基金总申购份额	36,496.93	127,259.12
减：报告期期间基金总赎回份额	78,297,174.69	136,236,464.80
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	35,408,970.96	22,611,482.20

§ 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	3,000,000.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	6,999,450.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	19.77	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	赎回	2020-09-24	3,000,000.00	-3,018,878.10	0.001
合计			3,000,000.00	-3,018,878.10	

§ 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规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10月28日