

# 中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

2021 年第 1 季度报告

2021 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:2021 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遵规守信情况的说明 .....	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 .....	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 .....	21
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 .....	22
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 .....	22
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 .....	22
§8 影响投资者决策的其他重要信息 .....	22
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	22
§9 备查文件目录 .....	23
9.1 备查文件目录 .....	23
9.2 存放地点 .....	23
9.3 查阅方式 .....	23

## § 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2021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2021年1月1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	50,132,541.53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	31,999,810.59份	18,132,730.94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(2021年01月01日 - 2021年03月31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	151,432.67	52,299.56
2. 本期利润	-72,953.14	-80,290.37
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0028	-0.0053
4. 期末基金资产净值	32,630,863.61	18,423,109.56
5. 期末基金份额净值	1.0197	1.0160

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	-0.68%	0.58%	0.04%	0.55%	-0.72%	0.03%
过去六个月	1.69%	0.52%	2.13%	0.48%	-0.44%	0.04%
过去一年	3.43%	0.58%	4.56%	0.56%	-1.13%	0.02%

自基金合同生效起至今	1.97%	0.62%	3.90%	0.60%	-1.93%	0.02%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

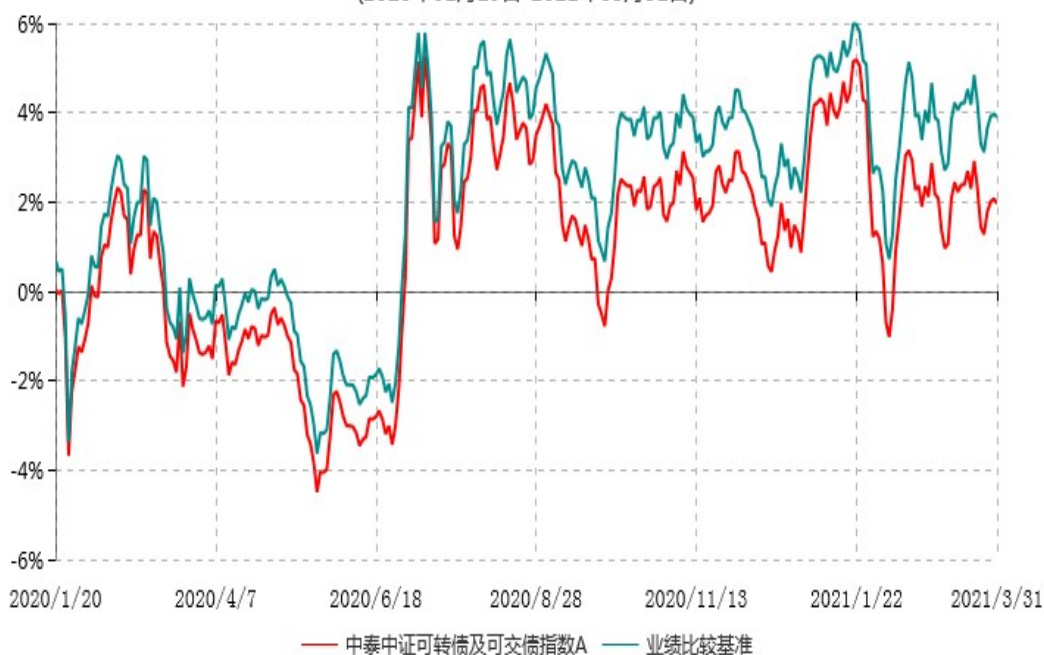
## 中泰中证可转债及可交债指数C净值表现

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	-0.75%	0.58%	0.04%	0.55%	-0.79%	0.03%
过去六个月	1.53%	0.52%	2.13%	0.48%	-0.60%	0.04%
过去一年	3.11%	0.58%	4.56%	0.56%	-1.45%	0.02%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.62%	3.90%	0.60%	-2.30%	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

(2020年01月19日-2021年03月31日)



注：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。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  
(2020年01月19日-2021年03月31日)



注：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。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	-	11	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。
Phoebe Zhang (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；中泰青月安盈6个月定期开放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	-	14	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。2020年11月23日起任中泰青月安盈6个月定期开放债券型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

一季度，权益市场以2月18日为“分水岭”走出“先冲高后回落”的行情。万得数据显示，截止2021年3月末，A股共37%的个股上涨，63%的个股下跌，市场整体涨少跌多。一季度，A股各大主要指数均出现较大跌幅，3月31日，上证综指收于3442点，一季度累计下跌0.90%；深证成指收于13779点，一季度累计下跌4.78%；创业板指收于2759点，一季度累计下跌7%。展望二季度，市场短期有望迎来由核心资产引领的一季报反弹行情，长期来看，随着疫苗在全球的广泛使用，新冠疫情将得到进一步控制，全球经济真正开始复苏，这对A股市场是一个支撑。

一季度，利率债方面，1月份10年期国债收益率在3.15%附近窄幅震荡，2月份由于资金面紧张10年期国债收益率先上行到3.28%后回落到3.26%附近震荡，3月份由于资金面宽松10年期国债收益率总体下行。整个一季度，10年期国债收益率从去年年末的3.14%上行5BP到今年一季度末的3.19%，总体上冲高回落，收益率波动不大。信用债方面，收益率总体呈下行态势。

一季度权益市场的下跌，也带来了转债市场的不景气，但相比权益市场，转债表现出了明显的抗跌性。3月31日，中证可转债及可交换债券指数收于390点，一季度累计上涨0.03%。2021年二季度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1.0197元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.68%，同期业绩比较基准收益率为0.04%；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1.0160元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.75%，同期业绩比较基准收益率为0.04%。

#### 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，本基金发生连续二十九个工作日(2021年1月6日至2021年2月22日)基金资产净值低于五千万元的情形。

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	49,383,944.89	96.39
	其中：债券	49,383,944.89	96.39
	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	759,653.53	1.48
8	其他资产	1,089,761.58	2.13
9	合计	51,233,360.00	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	2,848,860.00	5.58
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）	46,535,084.89	91.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,383,944.89	96.73

### 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	34,790	3,572,933.00	7.00
2	113021	中信转债	27,840	2,930,716.80	5.74
3	019640	20国债10	28,500	2,848,860.00	5.58
4	113044	大秦转债	22,270	2,283,565.80	4.47
5	113011	光大转债	16,840	2,052,796.00	4.02

### 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）、  
大秦铁路股份有限公司（大秦转债）、  
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）、  
中国南方航空股份有限公司（南航转债）、  
中国石油天然气集团有限公司（17中油EB、18中油EB）、  
上海银行股份有限公司（上银转债）。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责的情形。

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未按专营部门制规定开展同业业务、同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目、延迟支付同业投资资金吸收存款、为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保、未按规定进行贷款资金支付管理与控制、个人消费贷款贷后管理未尽职等原因，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客户信息保护体制机制不健全、违反反洗钱相关规定等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 3、大秦转债（证券代码113044.SH）

根据发布的相关公告，证券发行人大秦铁路股份有限公司旗下公司曹妃甸港港铁物流有限公司因环境违法行为受到行政处罚。曹妃甸港港铁物流有限公司被处以罚款1.65万元。

#### 4、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个人消费贷款业务违规、未办妥抵押（预告）登记即发放个人住房抵押贷款等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 5、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向项目资本金未达规定比例的房地产企业发放贷款、信贷资金用途管理不到位、为非标准债权资产提供隐性担保等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 6、南航转债（证券代码110075.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人中国南方航空股份有限公司在报告期内因违反《大型飞机公共航空运输承运人运行合格审定规则》相关条款，多次受到监管机构的处罚。

#### 7、上银转债（证券代码113042.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人上海银行股份有限公司在报告期内因员工行为管理不到位、绩效考核管理严重违反审慎经营规则等原因，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	960,000.00

3	应收股利	-
4	应收利息	129,751.58
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,089,761.58

#### 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	3,572,933.00	7.00
2	113021	中信转债	2,930,716.80	5.74
3	113011	光大转债	2,052,796.00	4.02
4	132018	G三峡EB1	1,700,574.40	3.33
5	110053	苏银转债	1,569,340.80	3.07
6	132015	18中油EB	1,409,994.60	2.76
7	132009	17中油EB	710,268.00	1.39
8	110073	国投转债	584,905.70	1.15
9	113026	核能转债	575,471.40	1.13
10	113013	国君转债	540,667.40	1.06
11	127005	长证转债	399,948.78	0.78
12	127018	本钢转债	388,806.00	0.76
13	132020	19蓝星EB	386,220.00	0.76
14	128129	青农转债	373,717.20	0.73
15	127012	招路转债	372,325.20	0.73
16	110061	川投转债	363,899.70	0.71
17	132007	16凤凰EB	360,528.00	0.71
18	110051	中天转债	330,151.20	0.65
19	113037	紫银转债	319,009.60	0.62
20	132004	15国盛EB	317,428.80	0.62
21	127020	中金转债	286,149.60	0.56
22	110043	无锡转债	256,589.30	0.50
23	132014	18中化EB	244,416.00	0.48
24	110048	福能转债	238,882.20	0.47

25	128126	赣锋转2	238,625.10	0.47
26	110065	淮矿转债	232,512.00	0.46
27	110062	烽火转债	227,620.50	0.45
28	128128	齐翔转2	227,572.80	0.45
29	128108	蓝帆转债	225,592.82	0.44
30	128081	海亮转债	222,832.50	0.44
31	113024	核建转债	217,569.00	0.43
32	110067	华安转债	212,589.00	0.42
33	113014	林洋转债	209,480.70	0.41
34	110045	海澜转债	204,836.00	0.40
35	128048	张行转债	192,948.60	0.38
36	128107	交科转债	190,008.00	0.37
37	113009	广汽转债	187,807.80	0.37
38	110072	广汇转债	187,671.00	0.37
39	110047	山鹰转债	186,736.00	0.37
40	132008	17山高EB	181,499.40	0.36
41	128035	大族转债	180,721.62	0.35
42	113508	新风转债	180,165.00	0.35
43	110031	航信转债	176,702.70	0.35
44	132006	16皖新EB	168,697.80	0.33
45	127006	敖东转债	168,220.12	0.33
46	132011	17浙报EB	166,649.30	0.33
47	123029	英科转债	164,438.10	0.32
48	113025	明泰转债	161,782.80	0.32
49	113034	滨化转债	158,481.80	0.31
50	132021	19中电EB	157,680.00	0.31
51	110063	鹰19转债	153,101.00	0.30
52	113602	景20转债	142,414.00	0.28
53	110068	龙净转债	141,557.60	0.28
54	110041	蒙电转债	138,723.00	0.27
55	113545	金能转债	137,393.30	0.27
56	132017	19新钢EB	134,875.00	0.26
57	128109	楚江转债	134,368.92	0.26

58	128034	江银转债	130,146.30	0.25
59	128029	太阳转债	127,368.30	0.25
60	113033	利群转债	125,075.00	0.24
61	128114	正邦转债	122,932.50	0.24
62	110056	亨通转债	119,916.30	0.23
63	110057	现代转债	117,836.40	0.23
64	110034	九州转债	114,233.60	0.22
65	110064	建工转债	112,392.40	0.22
66	128130	景兴转债	104,450.40	0.20
67	110052	贵广转债	104,367.80	0.20
68	113017	吉视转债	102,460.00	0.20
69	128095	恩捷转债	99,794.80	0.20
70	127016	鲁泰转债	96,282.20	0.19
71	128131	崇达转2	95,894.20	0.19
72	113516	苏农转债	95,031.00	0.19
73	127011	中鼎转2	94,243.71	0.18
74	113039	嘉泽转债	94,166.80	0.18
75	123058	欣旺转债	92,640.60	0.18
76	110033	国贸转债	91,137.00	0.18
77	110069	瀚蓝转债	90,728.10	0.18
78	128013	洪涛转债	86,872.80	0.17
79	113543	欧派转债	83,805.20	0.16
80	127007	湖广转债	82,912.83	0.16
81	127017	万青转债	81,298.00	0.16
82	128046	利尔转债	79,842.78	0.16
83	113534	鼎胜转债	79,270.80	0.16
84	113557	森特转债	77,989.80	0.15
85	127015	希望转债	76,830.60	0.15
86	128119	龙大转债	76,777.80	0.15
87	128032	双环转债	75,844.68	0.15
88	128078	太极转债	75,794.88	0.15
89	113596	城地转债	72,769.20	0.14
90	123049	维尔转债	71,180.80	0.14



91	110066	盛屯转债	70,124.30	0.14
92	128017	金禾转债	69,130.54	0.14
93	113582	火炬转债	68,869.20	0.13
94	113603	东缆转债	66,908.80	0.13
95	128023	亚太转债	66,669.84	0.13
96	128097	奥佳转债	66,116.60	0.13
97	123035	利德转债	65,827.84	0.13
98	128113	比音转债	65,395.20	0.13
99	127013	创维转债	65,280.00	0.13
100	128127	文科转债	63,914.40	0.13
101	128083	新北转债	62,292.32	0.12
102	113016	小康转债	62,109.60	0.12
103	128026	众兴转债	61,958.40	0.12
104	113563	柳药转债	60,984.00	0.12
105	113549	白电转债	60,548.60	0.12
106	128105	长集转债	58,917.90	0.12
107	128096	奥瑞转债	58,677.50	0.11
108	128064	司尔转债	58,665.60	0.11
109	110074	精达转债	57,739.00	0.11
110	128133	奇正转债	57,640.80	0.11
111	128132	交建转债	57,348.00	0.11
112	123004	铁汉转债	56,391.72	0.11
113	110060	天路转债	54,889.80	0.11
114	123050	聚飞转债	54,791.80	0.11
115	113504	艾华转债	54,132.00	0.11
116	128033	迪龙转债	54,078.50	0.11
117	113505	杭电转债	52,088.40	0.10
118	113599	嘉友转债	51,345.00	0.10
119	128121	宏川转债	50,429.80	0.10
120	127019	国城转债	49,495.10	0.10
121	128124	科华转债	49,260.40	0.10
122	110071	湖盐转债	49,120.00	0.10
123	123064	万孚转债	48,577.20	0.10

124	127003	海印转债	48,330.10	0.09
125	113542	好客转债	48,186.60	0.09
126	123063	大禹转债	47,775.20	0.09
127	113519	长久转债	46,780.80	0.09
128	127014	北方转债	46,688.00	0.09
129	128100	搜特转债	46,480.00	0.09
130	110038	济川转债	45,526.80	0.09
131	128106	华统转债	45,128.90	0.09
132	128074	游族转债	45,058.90	0.09
133	113584	家悦转债	45,040.50	0.09
134	128063	未来转债	44,281.60	0.09
135	120002	18中原EB	44,244.00	0.09
136	128075	远东转债	44,025.60	0.09
137	113530	大丰转债	43,560.00	0.09
138	113527	维格转债	43,331.60	0.08
139	128116	瑞达转债	43,272.00	0.08
140	113559	永创转债	43,182.00	0.08
141	113526	联泰转债	43,140.50	0.08
142	128057	博彦转债	42,962.40	0.08
143	113528	长城转债	42,838.40	0.08
144	123056	雪榕转债	42,635.90	0.08
145	113012	骆驼转债	42,462.00	0.08
146	128087	孚日转债	41,737.50	0.08
147	128037	岩土转债	41,597.82	0.08
148	113579	健友转债	41,079.50	0.08
149	128044	岭南转债	40,976.80	0.08
150	113588	润达转债	40,568.80	0.08
151	123044	红相转债	39,307.20	0.08
152	113600	新星转债	38,646.60	0.08
153	113591	胜达转债	38,212.20	0.07
154	127021	特发转2	37,722.60	0.07
155	113036	宁建转债	36,689.20	0.07
156	128093	百川转债	36,396.00	0.07

157	113601	塞力转债	36,210.20	0.07
158	123053	宝通转债	36,113.00	0.07
159	128111	中矿转债	35,944.80	0.07
160	123023	迪森转债	35,579.20	0.07
161	113589	天创转债	35,267.40	0.07
162	123033	金力转债	34,611.00	0.07
163	113535	大业转债	33,138.00	0.06
164	113569	科达转债	32,853.60	0.06
165	113525	台华转债	32,802.00	0.06
166	128022	众信转债	32,585.60	0.06
167	128066	亚泰转债	32,541.40	0.06
168	113532	海环转债	31,862.40	0.06
169	110070	凌钢转债	31,709.90	0.06
170	113550	常汽转债	30,446.00	0.06
171	128125	华阳转债	29,809.10	0.06
172	123067	斯莱转债	29,519.10	0.06
173	128042	凯中转债	29,481.40	0.06
174	123010	博世转债	29,235.00	0.06
175	113593	沪工转债	29,159.20	0.06
176	123028	清水转债	28,693.60	0.06
177	123066	赛意转债	28,582.40	0.06
178	110055	伊力转债	28,545.00	0.06
179	128018	时达转债	28,543.20	0.06
180	123025	精测转债	27,497.80	0.05
181	123059	银信转债	27,213.30	0.05
182	113564	天目转债	27,154.00	0.05
183	123048	应急转债	26,247.08	0.05
184	113578	全筑转债	26,173.80	0.05
185	128049	华源转债	25,773.80	0.05
186	113598	法兰转债	25,562.20	0.05
187	123060	苏试转债	25,427.60	0.05
188	113594	淳中转债	24,710.40	0.05
189	128014	永东转债	24,422.40	0.05

190	128117	道恩转债	24,385.00	0.05
191	128090	汽模转2	23,117.60	0.05
192	128123	国光转债	23,084.60	0.05
193	113027	华钰转债	22,956.30	0.04
194	113524	奇精转债	22,868.90	0.04
195	113568	新春转债	22,553.80	0.04
196	123022	长信转债	22,489.25	0.04
197	113541	荣晟转债	22,102.70	0.04
198	128071	合兴转债	21,911.40	0.04
199	123007	道氏转债	21,783.00	0.04
200	113030	东风转债	21,428.40	0.04
201	113597	佳力转债	21,403.80	0.04
202	128101	联创转债	21,394.88	0.04
203	128094	星帅转债	21,160.30	0.04
204	128073	哈尔转债	21,126.00	0.04
205	113576	起步转债	20,998.00	0.04
206	128118	瀛通转债	20,847.20	0.04
207	113577	春秋转债	20,797.80	0.04
208	113595	花王转债	20,729.90	0.04
209	128025	特一转债	20,531.70	0.04
210	128069	华森转债	20,489.70	0.04
211	128021	兄弟转债	20,282.50	0.04
212	128072	翔鹭转债	20,254.50	0.04
213	128122	兴森转债	19,986.00	0.04
214	113585	寿仙转债	19,608.00	0.04
215	132016	19东创EB	19,570.00	0.04
216	123002	国祯转债	19,553.40	0.04
217	128030	天康转债	19,352.90	0.04
218	128051	光华转债	18,744.20	0.04
219	123054	思特转债	17,867.60	0.03
220	110058	永鼎转债	17,274.60	0.03
221	123039	开润转债	17,144.89	0.03
222	113537	文灿转债	17,059.00	0.03

223	113565	宏辉转债	16,611.20	0.03
224	123065	宝莱转债	16,486.40	0.03
225	123011	德尔转债	16,224.80	0.03
226	123061	航新转债	16,123.20	0.03
227	113509	新泉转债	15,558.40	0.03
228	128053	尚荣转债	15,379.00	0.03
229	128039	三力转债	15,339.00	0.03
230	113574	华体转债	14,820.00	0.03
231	123057	美联转债	14,656.50	0.03
232	128076	金轮转债	14,314.50	0.03
233	128036	金农转债	14,176.80	0.03
234	113536	三星转债	12,388.20	0.02
235	123038	联得转债	12,006.50	0.02
236	123046	天铁转债	11,758.60	0.02
237	113548	石英转债	11,663.10	0.02
238	123012	万顺转债	10,421.32	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	34,178,637.68	16,427,969.17
报告期期间基金总申购份额	16,521,118.85	9,794,486.99
减：报告期期间基金总赎回份额	18,699,945.94	8,089,725.22
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	31,999,810.59	18,132,730.94

## § 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	6,999,450.00	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	3,999,450.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例 (%)	12.50	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	2021-01-12	2,000,000.00	-2,072,125.80	0.001
2	赎回	2021-01-19	1,000,000.00	-1,046,900.00	0
合计			3,000,000.00	-3,119,025.80	

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例 达到或者超过20%的 时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021年2月23日至 2021年3月31日	0.00	11,632,573.92	0.00	11,632,573.92	23.20%

## 产品特有风险

当本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况时，可能会引发以下风险：

- (1) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险。
- (2) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。
- (3) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动。
- (4) 基金合同提前终止的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产净值连续五十个工作日低于5000万元，本基金可能面临基金合同提前终止等情形。

(5) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

(6) 份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

本基金管理人将通过完善的风险管理机制，有效管理上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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。

### 9.2 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。

### 9.3 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

2021年04月21日