

关于中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金 基金财产清算及基金合同终止的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及《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》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，已触发《基金合同》终止条款。本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止《基金合同》，此事项无需召开基金份额持有人大会审议。

截至 2021 年 7 月 26 日日终，本基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元，触发基金合同终止条款。本基金的最后运作日为 2021 年 7 月 26 日，并于 2021 年 7 月 27 日进入基金财产清算程序。现将相关事项公告如下：

一、本基金基本信息

基金名称：中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

A 类基金份额简称：中泰中证可转债及可交债指数 A

A 类基金份额代码：008402

C 类基金份额简称：中泰中证可转债及可交债指数 C

C 类基金份额代码：008403

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2020 年 1 月 19 日

基金管理人名称：中泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人名称：兴业银行股份有限公司

二、基金合同终止事由

本基金《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”约定：“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当按照《基金合同》约定的程序进行清算并直接终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议。”

截至 2021 年 7 月 26 日日终，本基金已连续 50 个工作日出现基金资产净值低于 5,000 万元情形，本基金根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

根据《基金合同》约定，本基金基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日，基金合同终止。

三、基金财产清算

自 2021 年 7 月 27 日起，本基金进入清算程序。本基金进入清算程序后，不再办理申购、赎回、转换和定期定额投资等业务，并停止收取基金管理费、基金托管费、销售服务费。

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

6、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

7、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

8、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告,基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上,并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

9、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存20年以上,法律法规另有规定的从其规定。

四、其他需要提示的事项

1、本基金进入清算程序后不再办理申购、赎回、转换和定期定额投资等业务。敬请投资者予以关注。本公司承诺在清算过程中以诚实信用、勤勉尽责的原则履行相关职责。

2、进入清算程序后,如因所持证券处于锁定期、停牌等流动性受限情形暂时无法变现的,本基金将可能无法及时完成全部资产清算,且基金资产在相关证券变现处置过程中亦可能进一步产生收益或损失。

3、投资者可拨打本公司的客户服务电话:400-821-0808或登陆本公司网站www.ztzqzg.com了解相关情况。

特此公告。

中泰证券(上海)资产管理有限公司

2021年7月27日