

中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

2021年第2季度报告

2021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:2021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	5
§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	8
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	11
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	12
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	12
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	12
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	13
§6 开放式基金份额变动	23
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	23
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	23
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	23
§8 影响投资者决策的其他重要信息	24
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	24
§9 备查文件目录	24
9.1 备查文件目录	24
9.2 存放地点	25
9.3 查阅方式	25

§ 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7月19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	14, 548, 109. 12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	<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。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</p>

	和逐步调整建仓。 当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。	
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	9,238,297.29份	5,309,811.83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04月01日 - 2021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	405,579.17	261,217.35
2. 本期利润	906,145.73	578,337.26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0368	0.0386
4. 期末基金资产净值	9,726,782.97	5,566,336.71
5. 期末基金份额净值	1.0529	1.0483

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	3.26%	0.32%	3.85%	0.29%	-0.59%	0.03%
过去六个月	2.55%	0.47%	3.89%	0.43%	-1.34%	0.04%
过去一年	8.55%	0.58%	10.16%	0.54%	-1.61%	0.04%
自基金合同生效起至今	5.29%	0.58%	7.90%	0.56%	-2.61%	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	3.18%	0.32%	3.85%	0.29%	-0.67%	0.03%
过去六个月	2.40%	0.47%	3.89%	0.43%	-1.49%	0.04%
过去一年	8.22%	0.57%	10.16%	0.54%	-1.94%	0.03%
自基金合同生效起至今	4.83%	0.58%	7.90%	0.56%	-3.07%	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换指数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06月30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06月30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66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日起至今担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日起至今担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。2020年11月23日起至今担任中泰青月安盈66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

二季度，权益市场整体走势仍在震荡中上行。主要股指均出现较大涨幅，6月30日，上证综指收于3591点，二季度累计上涨4.34%；深证成指收于15162点，二季度累计上涨10.04%；创业板指收于3477点，二季度累计上涨26.05%。展望三季度，在企业盈利未有明显变化及流动性相对宽松的环境下，权益市场大幅下跌的可能性不大，大概率会呈现震荡向上的趋势。

二季度，利率债方面，4、5月份在“资金面平稳偏宽松”的主导下债市走出慢牛行情，10年期国债收益率一路下行，一度跌破3.10%，创年内新低。6月初，临近半年末，资金面开始紧平衡，10年期国债收益率因此震荡回升至3.14%附近，6月中下旬，在央行维护半年末资金面平稳后，10年期国债收益率下行至3.08%附近。整个二季度，10年期国债收益率从一季度末的3.19%下行11BP到二季度末的3.08%。信用债方面，收益率整体下行，中低等级和短融下行幅度更大。展望三季度，全球经济整体复苏的力度和持续性尚需观察，债券市场的核心矛盾仍然是资金面，目前来看，资金维持中性偏宽松的条件尚未破坏。

二季度，转债市场跟随权益市场整体上涨，但仍在4月中旬和6月中旬出现过比较明显的回调。整个二季度涨幅超过10%的转债标的有89支，其中化工（18支）、电气设备（11支）、电子（9支）、有色（8支）、机械设备（7支）和汽车（7支）行业个券表现最好。6月30日，中证可转债及可交换债券指数收于406点，二季度累计上涨4.05%。2021年三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1.0529元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.26%，同期业绩比较基准收益率为3.85%；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1.0483元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.18%，同期业绩比较基准收益率为3.85%。

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，本基金发生连续三十二个工作日（2021年5月17日至2021年6月30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	15,281,479.39	60.67
	其中：债券	15,281,479.39	60.67
	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	9,850,315.62	39.11
8	其他资产	57,480.03	0.23
9	合计	25,189,275.04	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	870,000.00	5.69
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）	14,411,479.39	94.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,281,479.39	99.92

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	9,310	953,623.30	6.24
2	019640	20国债10	8,700	870,000.00	5.69
3	113021	中信转债	7,450	786,496.50	5.14
4	132015	18中油EB	6,070	620,657.50	4.06
5	113044	大秦转债	5,960	613,343.60	4.01

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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责等原因，多次受到监管机构的处罚。

2、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

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	53,300.03
5	应收申购款	4,180.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	57,480.03

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	953,623.30	6.24
2	113021	中信转债	786,496.50	5.14
3	132015	18中油EB	620,657.50	4.06
4	113044	大秦转债	613,343.60	4.01
5	113011	光大转债	521,265.80	3.41
6	110053	苏银转债	451,459.20	2.95
7	132018	G三峡EB1	446,846.40	2.92
8	110075	南航转债	366,212.20	2.39
9	132009	17中油EB	312,816.00	2.05
10	132004	15国盛EB	182,094.00	1.19
11	110073	国投转债	160,487.90	1.05
12	113026	核能转债	153,308.50	1.00
13	113013	国君转债	146,653.00	0.96
14	127018	本钢转债	127,101.60	0.83
15	127005	长证转债	108,471.64	0.71
16	127012	招路转债	100,608.20	0.66
17	128129	青农转债	99,379.80	0.65
18	132020	19蓝星EB	97,171.20	0.64
19	132007	16凤凰EB	97,036.20	0.63
20	110061	川投转债	95,622.70	0.63
21	113037	紫银转债	86,662.80	0.57
22	110051	中天转债	84,974.20	0.56

23	132014	18中化EB	80,922.60	0.53
24	127020	中金转债	77,887.00	0.51
25	113043	财通转债	75,749.90	0.50
26	128081	海亮转债	67,088.90	0.44
27	110048	福能转债	65,454.20	0.43
28	128136	立讯转债	64,907.25	0.42
29	110062	烽火转债	61,723.60	0.40
30	110045	海澜转债	61,396.50	0.40
31	110043	无锡转债	60,847.20	0.40
32	113014	林洋转债	60,704.00	0.40
33	110072	广汇转债	57,789.90	0.38
34	113024	核建转债	57,383.20	0.38
35	127025	冀东转债	56,159.25	0.37
36	110067	华安转债	55,858.40	0.37
37	113611	福20转债	55,068.80	0.36
38	127027	靖远转债	52,020.80	0.34
39	113009	广汽转债	51,591.90	0.34
40	128107	交科转债	51,023.20	0.33
41	128095	恩捷转债	50,486.80	0.33
42	128048	张行转债	50,416.00	0.33
43	113034	滨化转债	50,117.80	0.33
44	113508	新风转债	49,327.80	0.32
45	132008	17山高EB	49,171.40	0.32
46	110047	山鹰转债	49,001.40	0.32
47	132021	19中电EB	48,163.50	0.31
48	128035	大族转债	47,779.20	0.31
49	128134	鸿路转债	47,260.50	0.31
50	127022	恒逸转债	45,927.20	0.30
51	127006	敖东转债	45,255.62	0.30
52	132011	17浙报EB	45,225.00	0.30
53	113534	鼎胜转债	44,171.60	0.29
54	128128	齐翔转2	43,408.40	0.28
55	132017	19新钢EB	42,142.00	0.28

56	110063	鹰19转债	40,116.60	0.26
57	128109	楚江转债	39,796.12	0.26
58	113040	星宇转债	39,667.60	0.26
59	113025	明泰转债	39,360.30	0.26
60	113602	景20转债	39,194.10	0.26
61	110077	洪城转债	37,946.70	0.25
62	110068	龙净转债	37,236.80	0.24
63	113016	小康转债	36,991.20	0.24
64	110041	蒙电转债	36,876.00	0.24
65	110076	华海转债	36,199.80	0.24
66	128034	江银转债	34,716.00	0.23
67	113033	利群转债	34,068.00	0.22
68	110057	现代转债	33,543.00	0.22
69	113545	金能转债	32,932.70	0.22
70	110056	亨通转债	32,886.40	0.22
71	128114	正邦转债	31,704.00	0.21
72	110064	建工转债	30,603.20	0.20
73	110034	九州转债	30,307.20	0.20
74	113605	大参转债	30,040.40	0.20
75	127024	盈峰转债	29,702.70	0.19
76	128032	双环转债	29,465.24	0.19
77	128141	旺能转债	28,610.40	0.19
78	128135	洽洽转债	28,435.80	0.19
79	128029	太阳转债	28,421.75	0.19
80	110052	贵广转债	28,338.80	0.19
81	113017	吉视转债	28,309.80	0.19
82	120002	18中原EB	28,062.50	0.18
83	113615	金诚转债	27,785.60	0.18
84	127011	中鼎转2	26,796.25	0.18
85	128131	崇达转2	26,728.00	0.17
86	110033	国贸转债	26,555.80	0.17
87	127016	鲁泰转债	26,000.00	0.17
88	113607	伟20转债	25,467.20	0.17

89	113516	苏农转债	25,428.00	0.17
90	128130	景兴转债	23,748.90	0.16
91	128013	洪涛转债	23,469.60	0.15
92	128026	众兴转债	23,296.80	0.15
93	128097	奥佳转债	23,127.00	0.15
94	127007	湖广转债	22,833.93	0.15
95	113527	维格转债	22,365.90	0.15
96	113582	火炬转债	22,096.00	0.14
97	128140	润建转债	22,072.00	0.14
98	128108	蓝帆转债	22,005.75	0.14
99	128046	利尔转债	21,876.38	0.14
100	128119	龙大转债	21,618.00	0.14
101	123070	鹏辉转债	21,595.59	0.14
102	127017	万青转债	21,272.40	0.14
103	128078	太极转债	20,984.60	0.14
104	113596	城地转债	20,068.40	0.13
105	128023	亚太转债	19,699.26	0.13
106	127015	希望转债	19,591.20	0.13
107	123085	万顺转2	19,519.40	0.13
108	113609	永安转债	19,306.90	0.13
109	128022	众信转债	18,990.00	0.12
110	127013	创维转债	18,945.00	0.12
111	113614	健20转债	18,583.50	0.12
112	123077	汉得转债	18,435.60	0.12
113	123035	利德转债	18,429.81	0.12
114	123049	维尔转债	18,336.20	0.12
115	123078	飞凯转债	18,316.50	0.12
116	113543	欧派转债	18,121.50	0.12
117	123083	朗新转债	18,061.89	0.12
118	128064	司尔转债	18,027.00	0.12
119	128127	文科转债	17,665.20	0.12
120	128083	新北转债	17,266.13	0.11
121	128113	比音转债	17,192.00	0.11

122	113603	东缆转债	17,106.00	0.11
123	110066	盛屯转债	16,981.80	0.11
124	113549	白电转债	16,854.40	0.11
125	128105	长集转债	16,684.36	0.11
126	128017	金禾转债	16,657.62	0.11
127	128133	奇正转债	16,492.50	0.11
128	123076	强力转债	16,139.20	0.11
129	113563	柳药转债	16,084.50	0.11
130	128096	奥瑞转债	15,957.50	0.10
131	113504	艾华转债	15,691.00	0.10
132	123086	海兰转债	15,512.00	0.10
133	123004	铁汉转债	15,441.26	0.10
134	128132	交建转债	15,364.80	0.10
135	128074	游族转债	15,143.70	0.10
136	128142	新乳转债	15,142.40	0.10
137	123071	天能转债	15,120.30	0.10
138	123050	聚飞转债	15,072.20	0.10
139	132022	20广版EB	15,040.50	0.10
140	128124	科华转债	14,819.10	0.10
141	113505	杭电转债	14,596.40	0.10
142	127019	国城转债	14,579.20	0.10
143	123087	明电转债	14,297.40	0.09
144	123079	运达转债	14,284.60	0.09
145	110060	天路转债	14,089.40	0.09
146	128137	洁美转债	14,056.90	0.09
147	128121	宏川转债	14,032.20	0.09
148	127026	超声转债	13,994.50	0.09
149	113599	嘉友转债	13,958.10	0.09
150	110071	湖盐转债	13,925.60	0.09
151	113528	长城转债	13,879.20	0.09
152	127003	海印转债	13,702.00	0.09
153	123063	大禹转债	13,608.00	0.09
154	128093	百川转债	13,446.00	0.09

155	113519	长久转债	13,319.80	0.09
156	123064	万孚转债	12,903.00	0.08
157	128063	未来转债	12,685.20	0.08
158	113604	多伦转债	12,630.00	0.08
159	110038	济川转债	12,596.40	0.08
160	113612	永冠转债	12,578.00	0.08
161	128057	博彦转债	12,316.00	0.08
162	128087	孚日转债	12,313.20	0.08
163	123091	长海转债	12,308.00	0.08
164	113530	大丰转债	12,297.60	0.08
165	128100	搜特转债	12,202.50	0.08
166	113550	常汽转债	12,198.90	0.08
167	128116	瑞达转债	12,156.00	0.08
168	128037	岩土转债	12,139.59	0.08
169	128139	祥鑫转债	12,013.20	0.08
170	123068	弘信转债	11,948.20	0.08
171	113542	好客转债	11,941.60	0.08
172	123075	贝斯转债	11,933.90	0.08
173	113584	家悦转债	11,821.20	0.08
174	123081	精研转债	11,805.20	0.08
175	128111	中矿转债	11,702.80	0.08
176	128075	远东转债	11,575.76	0.08
177	123067	斯莱转债	11,497.50	0.08
178	128044	岭南转债	11,476.80	0.08
179	113039	嘉泽转债	11,451.00	0.07
180	123056	雪榕转债	11,378.40	0.07
181	113012	骆驼转债	11,287.80	0.07
182	128106	华统转债	11,147.00	0.07
183	113600	新星转债	10,877.90	0.07
184	113610	灵康转债	10,787.00	0.07
185	113588	润达转债	10,785.00	0.07
186	123090	三诺转债	10,714.50	0.07
187	113526	联泰转债	10,574.80	0.07

188	123089	九洲转2	10,514.70	0.07
189	123044	红相转债	10,467.00	0.07
190	113589	天创转债	10,445.60	0.07
191	123033	金力转债	10,437.60	0.07
192	113591	胜达转债	10,406.00	0.07
193	110074	精达转债	10,381.20	0.07
194	127021	特发转2	10,376.00	0.07
195	113601	塞力转债	10,147.00	0.07
196	113036	宁建转债	10,136.00	0.07
197	123082	北陆转债	9,965.70	0.07
198	113525	台华转债	9,925.20	0.06
199	123023	迪森转债	9,895.00	0.06
200	113569	科达转债	9,700.00	0.06
201	123053	宝通转债	9,625.50	0.06
202	110055	伊力转债	9,613.00	0.06
203	128066	亚泰转债	9,297.00	0.06
204	123066	赛意转债	9,285.00	0.06
205	123092	天壕转债	9,273.60	0.06
206	132016	19东创EB	9,135.00	0.06
207	128018	时达转债	9,130.40	0.06
208	113535	大业转债	9,090.00	0.06
209	113532	海环转债	9,018.00	0.06
210	123054	思特转债	8,998.50	0.06
211	113608	威派转债	8,850.40	0.06
212	128042	凯中转债	8,586.40	0.06
213	123007	道氏转债	8,537.88	0.06
214	123048	应急转债	8,503.34	0.06
215	123025	精测转债	8,483.40	0.06
216	128125	华阳转债	8,144.00	0.05
217	123028	清水转债	8,124.80	0.05
218	123069	金诺转债	8,122.80	0.05
219	123010	博世转债	8,058.40	0.05
220	123073	同和转债	8,055.60	0.05

221	128138	侨银转债	7,892.50	0.05
222	123060	苏试转债	7,788.00	0.05
223	128033	迪龙转债	7,768.20	0.05
224	113593	沪工转债	7,679.00	0.05
225	123059	银信转债	7,366.10	0.05
226	128049	华源转债	7,161.70	0.05
227	128101	联创转债	7,098.04	0.05
228	128117	道恩转债	7,095.20	0.05
229	113578	全筑转债	7,063.70	0.05
230	128025	特一转债	6,936.60	0.05
231	113568	新春转债	6,832.80	0.04
232	113594	淳中转债	6,721.80	0.04
233	123074	隆利转债	6,689.40	0.04
234	123022	长信转债	6,649.20	0.04
235	128090	汽模转2	6,590.40	0.04
236	113598	法兰转债	6,473.40	0.04
237	113597	佳力转债	6,447.00	0.04
238	128073	哈尔转债	6,447.00	0.04
239	128071	合兴转债	6,388.80	0.04
240	128069	华森转债	6,334.80	0.04
241	128014	永东转债	6,280.80	0.04
242	113524	奇精转债	6,246.60	0.04
243	128051	光华转债	6,238.00	0.04
244	128123	国光转债	6,119.40	0.04
245	128118	瀛通转债	6,115.20	0.04
246	128072	翔鹭转债	6,016.80	0.04
247	128094	星帅转债	5,886.50	0.04
248	113027	华钰转债	5,868.60	0.04
249	123061	航新转债	5,822.00	0.04
250	110070	凌钢转债	5,783.50	0.04
251	113585	寿仙转债	5,643.20	0.04
252	128122	兴森转债	5,598.50	0.04
253	113030	东风转债	5,514.00	0.04

254	113537	文灿转债	5,484.30	0.04
255	123084	高澜转债	5,454.00	0.04
256	123002	国祯转债	5,433.00	0.04
257	123080	海波转债	5,405.00	0.04
258	128021	兄弟转债	5,258.00	0.03
259	123011	德尔转债	5,252.00	0.03
260	110058	永鼎转债	5,177.50	0.03
261	113595	花王转债	5,143.80	0.03
262	128053	尚荣转债	5,108.00	0.03
263	113606	荣泰转债	5,008.00	0.03
264	113576	起步转债	4,642.00	0.03
265	127014	北方转债	4,474.40	0.03
266	113509	新泉转债	4,436.60	0.03
267	123046	天铁转债	4,431.40	0.03
268	123057	美联转债	4,419.60	0.03
269	123039	开润转债	4,351.33	0.03
270	123065	宝莱转债	4,317.20	0.03
271	113565	宏辉转债	4,299.20	0.03
272	128076	金轮转债	4,232.40	0.03
273	128039	三力转债	4,232.40	0.03
274	113574	华体转债	4,105.60	0.03
275	128030	天康转债	3,804.60	0.02
276	113541	荣晟转债	3,708.00	0.02
277	113577	春秋转债	3,686.10	0.02
278	113579	健友转债	3,603.60	0.02
279	128036	金农转债	3,573.90	0.02
280	123038	联得转债	3,486.30	0.02
281	113536	三星转债	3,438.30	0.02
282	113548	石英转债	3,339.60	0.02
283	123012	万顺转债	2,804.34	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	31,999,810.59	18,132,730.94
报告期期间基金总申购份额	42,094.53	159,862.19
减：报告期期间基金总赎回份额	22,803,607.83	12,982,781.30
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	9,238,297.29	5,309,811.83

§ 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	3,999,450.00	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	3,999,450.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份 额	0.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例 (%)	0.00	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	2021-06-29	3,999,450.00	-4,238,617.11	0.00
合计			3,999,450.00	-4,238,617.11	

§ 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4月1日至2021年5月16日	11,632,573.92	0.00	11,632,573.92	0.00	0.00%
	2	2021年6月28日	4,868,549.17	0.00	4,868,549.17	0.00	0.00%
	3	2021年6月29日至2021年6月30日	4,999,225.00	0.00	1,000,000.00	3,999,225.00	27.49%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>							

§ 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07月20日