

中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

2021 年中期报告

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

送出日期:2021 年 08 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告由董事长签发。

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8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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6月30日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4	报表附注	21
§ 7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6	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	45
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8	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贵金属投资明细	45
7.9	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	45
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12	投资组合报告附注	46
§ 8	基金份额持有人信息	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	58
§ 9 开放式基金份额变动.....	58
§ 10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
11.1 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.....	61
§ 12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
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	
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	
报告期末基金份额总额	14,548,109.12份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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	$95\% \times \text{中证可转债及可交换债券指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$
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。
--	--------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中泰证券（上海）资产管理有 限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王洪懿	吴玉婷
	联系电话	021-20521199	021-52629999
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	xywyt@cib.com.cn
客户服务电话		400-821-0808	95561
传真		021-50933716	021-62535823
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号 24楼05室	福州市湖东路154号
办公地址		上海市浦东新区银城中路488 号太平金融大厦1002-1003室	上海市银城路167号
邮政编码		200120	200041
法定代表人		黄文卿	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ztzqzg.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中泰证券（上海）资产管理有 限公司	上海市浦东新区银城中路488号太平 金融大厦1002-1003室

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01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
本期已实现收益	557,011.84	313,516.91
本期利润	833,192.59	498,046.89
加权平均基金份额本期利润	0.0330	0.0332
本期加权平均净值利润率	3.21%	3.23%
本期基金份额净值增长率	2.55%	2.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	488,485.68	256,524.88
期末可供分配基金份额利润	0.0529	0.0483
期末基金资产净值	9,726,782.97	5,566,336.71
期末基金份额净值	1.0529	1.0483
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	5.29%	4.83%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.43%	0.40%	0.12%	0.33%	-0.55%	0.07%
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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.46%	0.39%	0.12%	0.33%	-0.58%	0.06%
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份额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债券指数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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年8月13日。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准齐鲁证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]355号）批准，是齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资设立的证券资产管理子公司。2017年12月，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]2342号）批准，公司获得开展公募基金业务资格。目前公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2021年6月30日，公司作为基金管理人共管理中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰蓝月短债债券型证券投资基金、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰青月中短债债券型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金、中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金、中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金、中泰兴诚价值一年期持有期混合型证券投资基金和中泰星宇价值成长一年封闭运作混合型证券投资基金共十一只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年的一季度，权益市场以2月18日为“分水岭”走出“先冲高后回落”的行情，二季度则整体在震荡中上行。上半年主要股指均出现较大涨幅，6月30日，上证指数收于3591点，上半年累计上涨3.40%；深证成指收于15162点，上半年累计上涨4.78%；创业板指收于3477点，上半年累计上涨17.22%。钢铁、电气设备和化工三个板块涨幅居前。

展望下半年，在企业盈利没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。

上半年，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，4月份和5月份在“资金面平稳偏宽松”的主导下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。上半年，10年期国债收益率从一季度末的3.14%下行6BP到上半年末的3.08%。信用债方面，收益率整体呈下行趋势，中低等级和短融下行幅度更大。展望下半年，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。

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。

4.4.2 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2.55%，同期业绩比较基准收益率为3.89%；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2.40%，同期业绩比较基准收益率为3.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，转债市场走出了“先回落后冲高”的行情。上半年共计发行60支公募可转债，发行总规模约1485亿元，其中大盘转债有上银转债、南银转债、杭银转债和苏行转债。上半年共有33支公募可转债退市，平均存续期限为1.8年。6月30日，中证可转债及可交换债券指数收于406点，上半年累计上涨4.08%，在主要指数中仅次于创业板指和深证成指，跑赢上证指数和沪深300。当前转债价格中位数在112元左右，基本回到年初水平，2021年下半年可转债的整体表现主要取决于权益市场的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，形成估值委员会决议。运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,850,315.62	1,863,291.25
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	15,281,479.39	57,819,643.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		15,281,479.39	57,819,643.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	53,300.03	175,572.47
应收股利		-	-
应收申购款		4,180.00	1,301,019.65
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		25,189,275.04	61,159,526.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	7,499,981.25
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,763,164.25	1,510,412.54
应付管理人报酬		14,679.56	25,770.67
应付托管费		1,223.31	2,147.57
应付销售服务费		2,733.91	4,439.20
应付交易费用	6.4.7.6	-	-
应交税费		279.86	539.97
应付利息		-	-2,510.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	114,074.47	209,825.35
负债合计		9,896,155.36	9,250,606.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	14,548,109.12	50,606,606.85
未分配利润	6.4.7.9	745,010.56	1,302,313.66
所有者权益合计		15,293,119.68	51,908,920.51
负债和所有者权益总计		25,189,275.04	61,159,526.95

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额14,548,109.12份，其中中泰中证可转债及可交债指数A类份额9,238,297.29份，中泰中证可转债及可交债指数C类份额5,309,811.83份。A类份额净值1.0529元，C类份额净值1.0483元。

6.2 利润表

会计主体：中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月19日(基金 合同生效日)至2020 年06月30日
一、收入		1,638,506.53	-8,840,622.05
1. 利息收入		158,501.40	1,019,472.59
其中：存款利息收入	6.4.7.10	5,089.07	166,231.61
债券利息收入		149,082.50	832,587.30
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		4,329.83	20,653.68
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		987,416.23	-1,857,218.26
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	987,416.23	-1,857,218.26
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	460,710.73	-8,404,828.09
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	31,878.17	401,951.71
减：二、费用		307,267.05	1,419,597.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	122,440.39	909,446.83

2. 托管费	6.4.10.2. 2	10,203.39	75,787.20
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	22,662.27	277,095.36
4. 交易费用	6.4.7.17	5,546.10	23,902.81
5. 利息支出		25,358.00	-
其中：卖出回购金融资产支出		25,358.00	-
6. 税金及附加		264.00	2,062.46
7. 其他费用	6.4.7.18	120,792.90	131,302.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,331,239.48	-10,260,219.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,331,239.48	-10,260,219.49

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	50,606,606.85	1,302,313.66	51,908,920.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,331,239.48	1,331,239.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-36,058,497.73	-1,888,542.58	-37,947,040.31

其中: 1. 基金申购款	26,517,562.56	787,291.07	27,304,853.63
2. 基金赎回款	-62,576,060.29	-2,675,833.65	-65,251,893.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	14,548,109.12	745,010.56	15,293,119.68
项 目	上年度可比期间 2020年01月19日(基金合同生效日)至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	371,479,287.62	-	371,479,287.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,260,219.49	-10,260,219.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-99,088,951.02	1,870,748.31	-97,218,202.71
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-99,088,951.02	1,870,748.31	-97,218,202.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	272,390,336.60	-8,389,471.18	264,000,865.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄文卿

应晨奇

陈勇

—————

—————

—————

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2361号《关于准予中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金注册的批复》注册,由中泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币371,406,432.73元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0007号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2020年1月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为371,479,287.62份基金份额,其中认购资金利息折合72,854.89份基金份额。本基金的基金管理人为中泰证券(上海)资产管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《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》和《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》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,本基金的投资范围为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(含可转换公司债券(含分离交易可转债纯债部分)、可交换公司债券、国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债)、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。本基金不直接从二级市场买入股票等权益类资产，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。本基金可以持有因可转换公司债券转股所形成的股票和因可交换公司债券换股所形成的股票，但是须在达到可交易状态日起10个交易日内卖出。在建仓完成后，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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证可转债及可交换债券指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司于2021年8月25日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	9,849,955.79
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	359.83
合计	9,850,315.62

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	14,896,654.81	15,281,479.39	384,824.58
	银行间市场	-	-	-
	合计	14,896,654.81	15,281,479.39	384,824.58
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	14,896,654.81	15,281,479.39	384,824.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	156.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	81.31
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	53,062.48
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	53,300.03

6.4.7.6 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.10
预提费用	64,007.37
其他应付	50,066.00
合计	114,074.47

6.4.7.8 实收基金

6.4.7.8.1 中泰中证可转债及可交债指数A

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证可转债及可交债指 数A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	34,178,637.68	34,178,637.68
本期申购	16,563,213.38	16,563,213.38
本期赎回(以“-”号填列)	-41,503,553.77	-41,503,553.77
本期末	9,238,297.29	9,238,297.29

6.4.7.8.2 中泰中证可转债及可交债指数C

金额单位：人民币元

项目 (中泰中证可转债及可交债指 数C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	16,427,969.17	16,427,969.17
本期申购	9,954,349.18	9,954,349.18
本期赎回(以“-”号填列)	-21,072,506.52	-21,072,506.52
本期末	5,309,811.83	5,309,811.83

6.4.7.9 未分配利润

6.4.7.9.1 中泰中证可转债及可交债指数A

单位：人民币元

项目 (中泰中证可转债及可 交债指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,769,642.86	-857,112.51	912,530.35
本期利润	557,011.84	276,180.75	833,192.59
本期基金份额交易产 生的变动数	-1,535,650.09	278,412.83	-1,257,237.26
其中：基金申购款	951,228.05	-434,572.55	516,655.50
基金赎回款	-2,486,878.14	712,985.38	-1,773,892.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	791,004.61	-302,518.93	488,485.68

6.4.7.9.2 中泰中证可转债及可交债指数C

单位：人民币元

项目 (中泰中证可转债及可 交债指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	801,253.94	-411,470.63	389,783.31
本期利润	313,516.91	184,529.98	498,046.89
本期基金份额交易产 生的变动数	-684,699.80	53,394.48	-631,305.32
其中：基金申购款	537,848.43	-267,212.86	270,635.57
基金赎回款	-1,222,548.23	320,607.34	-901,940.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	430,071.05	-173,546.17	256,524.88

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	1,509.57

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,579.50
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	5,089.07

6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	987,416.23
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	987,416.23

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	93,225,568.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	91,975,963.62
减：应收利息总额	262,188.50
买卖债券差价收入	987,416.23

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	460,710.73
——股票投资	-
——债券投资	460,710.73
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	460,710.73

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	31,877.59
转换费收入	0.58
合计	31,878.17

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	5,546.10
银行间市场交易费用	-
合计	5,546.10

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
汇划手续费	2,285.53
账户维护费	9,000.00
指数使用费	50,000.00
合计	120,792.90

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“中泰资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（以下简称“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月19日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中泰证券	141,767,224.27	100.00%	626,168,586.62	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月19日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回	成交金额	占当期 债券回

		购成交 总额的 比例		购成交 总额的 比例
中泰证券	253,500,000.00	100.00%	260,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	4,357.36	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月19日（基金合同生效日）至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	17,232.77	100.00%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 管理人从关联方获得的服务包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年01月19日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	122,440.39	909,446.83
其中：支付销售机构的客户维护费	29,075.62	256,694.67

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年06月30日	2020年01月19日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,203.39	75,787.20

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	1,709.01	1,709.01
中泰证券股份有限公司	0.00	8,602.08	8,602.08
中泰证券（上海）资产管理有限公司	0.00	4,866.82	4,866.82
合计	0.00	15,177.91	15,177.91
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2020年01月19日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

名称	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	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	30,918.66	30,918.66
中泰证券股份有限公司	0.00	160,276.95	160,276.95
中泰证券（上海）资产管理有限公司	0.00	53,524.99	53,524.99
合计	0.00	244,720.60	244,720.60

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中泰证券（上海）资产管理有限公司，再由中泰证券（上海）资产管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中泰中证可转债及可交债指数A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年06 月30日	上年度可比期间 2020年01月19日（基金 合同生效日）至2020年0 6月30日
基金合同生效日（2020年01月19日）持有的基金份额	9,999,450.00	9,999,450.00

报告期初持有的基金份额	6,999,450.00	9,999,450.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	6,999,450.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	9,999,450.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	8.80%

中泰中证可转债及可交债指数C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年06 月30日	上年度可比期间 2020年01月19日（基金 合同生效日）至2020年0 6月30日
基金合同生效日（2020年01月19日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月19日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

兴业银行	9,849,955.79	1,509.57	8,700,594.33	97,633.75
中泰证券	359.83	3,579.50	16,343,166.64	68,597.86

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。本基金的其他存款由基金结算机构中泰证券保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金未因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

事前控制流程包括：投资与研究部门根据宏观经济形势、财政与货币政策趋势、行业景气度、证券市场走势，提出资产配置策略建议，构建备选库。专业投资委员会根据投资与研究部门的研究成果，确立股票池、债券库和策略库的建立和调整方案，决定本

委员会下属的各项资产管理产品的资产配置策略或者交易策略；评估本委员会下属的各项资产管理产品的风险。风险控制委员会负责建立公司全面风险管理体系，对公司重大业务和管理工作的风险进行评估并对重大风险的处理方案进行审核。风险管理部根据专业投资委员会制定的投资策略和资产配置方案，协助专业投资委员会进行投资策略的风险检验，以及制定相应的投资风险控制标准。

事中控制流程包括：风险管理部根据本基金资产实际投资运作状况，实时测算各种风险指标，并监测本基金资产各项风险控制指标的变化，识别、分析和评价相关业务的风险状况，出具业务风险评估报告，提出风险预警。如在风险监测中发现异常现象或存在重大隐患时，需要立即对风险进行识别，明确风险种类并对其进行度量，测算该风险的危害程度，及时向专业投资委员会提出处理措施，控制风险程度的上升。

事后控制流程包括：在风险处理措施实施以后，风险管理部实时监控处理效果并提出阶段性总结报告，进一步提出改善整体和局部风险管理的建议。此外，对本基金资产的投资组合风险状况进行定期或不定期分析和总结，定期或不定期编写风险管理报告提交风险控制委员会和专业投资委员会及投资决策委员会。风险管理部应根据市场环境的变化对投资组合的风险进行情景分析或模拟分析，在估计可能产生重大风险隐患时，及时通报专业投资委员会和投资决策委员会，并提出降低风险的建议。当市场环境的变化导致风险控制模型的适用性降低时，风险管理部应及时对所使用的风险控制模型进行重新检验和修正，包括但不限于压力测试、敏感性分析等。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了全面风险管理体系。公司业务的风险管理体系共分四个层次：第一层次为董事会，董事会是公司风险管理的最高决策机构，风险控制委员会为董事会风险管理的专门工作机构，负责制订公司风险管理总体目标和政策，审批公司风险管理的制度、流程与指标，并对公司重大经营及决策进行风险评估并提出意见；第二层次为行政办公会，行政办公会是公司风险管理的决策监督机构，风险控制执行委员会为行政办公会风险管理的常设机构，承担日常风险管理决策职责，负责提出公司业务经营管理过程中风险防范的指导意见、制定风险管理策略、对公司风险状况和风险管理能力进行评估、监督风控措施执行情况；第三层次为风险管理部及相关职能部门。风险管理部是公司风险管理的专职日常工作机构，在首席风险官领导下监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门的风险管理工作；第四层次为各业务部门的一线风险管理。各业务部门承担一线的风控职能，执行具体的风险管理制度，并承担风险管理有效性的直接责任。公司建立了完善的内部控制制度，交易部门、投资管理部门以及风险管理部门互相独立、互相制约。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。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。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券和上市公司的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人处，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了证券及交易对手库管理办法，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化组合投资以分散信用风险；管理人实行交易对手白名单制度，并根据交易对手的资信状况分别限定交易额度。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	8,274,372.14	30,951,986.06
AAA以下	6,137,107.25	23,871,557.52
未评级	-	-
合计	14,411,479.39	54,823,543.58

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险包括两类。一是指在市场中的投资操作由于市场的深度限制或由于市场剧烈波动而导致投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现，从而可能为基金带来投资损失的风险。二是指开放式基金由于申购赎回要求可能导致流动资金不足的风险。

基金管理人将密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况，评估各类资产及投资标的占基金资产的比例并进行动态调整，以满足基金运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,850,315.62	-	-	-	-	-	9,850,315.62
交易性金融资产	1,679,091.44	574,611.46	11,201,477.94	1,826,298.55	-	-	15,281,479.39
应收利息	-	-	-	-	-	53,300.03	53,300.03
应收申购款	-	-	-	-	-	4,180.00	4,180.00
资产总计	11,529,407.06	574,611.46	11,201,477.94	1,826,298.55	-	57,480.03	25,189,275.04
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,763,164.25	9,763,164.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,679.56	14,679.56
应付托管费	-	-	-	-	-	1,223.31	1,223.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,733.91	2,733.91
应交税费	-	-	-	-	-	279.86	279.86
其他负债	-	-	-	-	-	114,074.47	114,074.47
负债总计	-	-	-	-	-	9,896,155.36	9,896,155.36
利率敏感度缺口	11,529,407.06	574,611.46	11,201,477.94	1,826,298.55	-	-9,838,675.33	15,293,119.68
上年度 末 2020年1 2月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,863,291.25	-	-	-	-	-	1,863,291.25
交易性金融资产	604,395.50	752,560.00	3,630,081.30	33,273,580.21	19,559,026.67	-	57,819,643.68
应收利息	-	-	-	-	-	175,572.47	175,572.47
应收申购	-	-	-	-	-	1,301,019.65	1,301,019.65

中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金 2021 年中期报告

款							
资产总计	2,467,686.75	752,560.00	3,630,081.30	33,273,580.21	19,559,026.67	1,476,592.12	61,159,527.05
负债							
卖出回购金融资产款	7,499,981.25	-	-	-	-	-	7,499,981.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,510,412.54	1,510,412.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,770.67	25,770.67
应付托管费	-	-	-	-	-	2,147.57	2,147.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,439.20	4,439.20
应交税费	-	-	-	-	-	539.97	539.97
应付利息	-	-	-	-	-	-2,510.11	-2,510.11
其他负债	-	-	-	-	-	209,825.35	209,825.35
负债总计	7,499,981.25	-	-	-	-	1,750,625.19	9,250,606.44
利率敏感度缺口	-5,032,294.50	752,560.00	3,630,081.30	33,273,580.21	19,559,026.67	-274,033.07	51,908,920.61

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金仅持有交易所可转换公司债券及可交换公司债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	15,281,479.39	99.92	57,819,643.58	111.39
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,281,479.39	99.92	57,819,643.58	111.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性权益投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为12,205,602.24元，属于第二层次的余额为3,075,877.15元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次的余额为47,364,171.22元，第二层次的余额为10,455,472.36元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	57,480.03	0.23
9	合计	25,189,275.04	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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、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。

7.12.2 本基金本报告期末投资股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,480.03

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中泰中证可转债及可交债指数A	137	67,432.83	1,952,831.93	21.14%	7,285,465.36	78.86%
中泰中证可转债及可交债指数C	239	22,216.79	700,000.00	13.18%	4,609,811.83	86.82%
合计	376	38,691.78	2,652,831.93	18.23%	11,895,277.19	81.77%

本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中泰中证可转债及可 交债指数A	1,992.05	0.0216%
	中泰中证可转债及可 交债指数C	9.75	0.0002%
	合计	2,001.80	0.0138%

本表列示“占基金总份额比例”中,对下属分级基金,为占各自级别份额的比例;对合计数,为占期末基金份额总额的比例。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	中泰中证可转债及 可交债指数A	0
	中泰中证可转债及 可交债指数C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	中泰中证可转债及 可交债指数A	0
	中泰中证可转债及 可交债指数C	0
	合计	0

注: 1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2、期末本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 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

基金合同生效日(2020年01月19日)基金份额总额	143,789,298.46	227,689,989.16
本报告期期初基金份额总额	34,178,637.68	16,427,969.17
本报告期基金总申购份额	16,563,213.38	9,954,349.18
减:本报告期基金总赎回份额	41,503,553.77	21,072,506.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	9,238,297.29	5,309,811.83

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金管理人原董事王丽敏离任。根据基金管理人2021年第2次股东会议所有股东选举结果,胡开南当选为第二届董事会董事,该项任职于2021年4月22日生效。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	-	-	4,357.36	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中泰证券	141,767,224.27	100.00%	253,500,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会规定网站	2021-01-21
2	中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定网站	2021-03-29
3	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	中国证监会规定网站	2021-04-16
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（更新）2021年第1号	中国证监会规定网站	2021-04-16
5	中泰中证可转债及可交换债	中国证监会规定网站	2021-04-16

	券指数证券投资基金托管协议		
6	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	中国证监会规定网站	2021-04-16
7	关于中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金增加侧袋机制并根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引》修订法律文件的公告	《证券时报》、中国证监会规定网站	2021-04-16
8	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	中国证监会规定网站	2021-04-21
9	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会规定网站	2021-05-07
10	关于中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金连续30个工作日基金资产净值低于5000万元的提示性公告	《证券时报》、中国证监会规定网站	2021-06-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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4月1日	0.00	11,632,573.92	11,632,573.92	0.00	0.00%
	2	2021年6月28日	0.00	4,868,549.17	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

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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
二〇二一年八月二十七日