

中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金 清算报告

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

清算报告出具日:2021年8月24日

清算报告公告日:2021年9月8日

§ 1 重要提示

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号文《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》准予注册,于2020年1月19日成立并正式运作。

《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》”)“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。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2021年7月27日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

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1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	
最后运作日（2021年7月26日）基金份额总额	3,668,622.13份	
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
最后运作日（2021年7月26日）下属分级基金的份额总额	1,833,249.28份	1,835,372.85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	

	<p>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。</p> <p>本基金属于指数基金，采用抽样复制和动态最优化策略，跟踪中证可转债及可交换债券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。</p>
--	---

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2019]2361号文《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》准予注册，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《基金合同》负责公开募集。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。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

鉴于本基金已连续50个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元，触发基金合同终止条款，基金管理人依据《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》和《基金合同》的有关规定，在上述事由出现后终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。本基金最后运作日为2021年7月26日，自2021年7月27日起进入清算程序。

§4 财务报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

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7月26日

单位：人民币元

资 产	2021年7月26日 (基金最后运作日)
资 产:	
银行存款	5,722,014.63

交易性金融资产	-
其中：债券投资	-
应收利息	595.35
应收申购款	10.00
资产总计	5,722,619.98
负债和所有者权益	
负 债：	
卖出回购金融资产款	-
应付赎回款	1,629,496.41
应付管理人报酬	5,139.25
应付托管费	428.28
应付销售服务费	1,034.92
应交税费	87.37
应付利息	-
其他负债	104,831.29
负债合计	1,741,017.52
所有者权益：	
实收基金	3,668,622.13
未分配利润	312,980.33
所有者权益合计	3,981,602.46
负债和所有者权益总计	5,722,619.98

注：

1. 报告截止日2021年7月26日(基金最后运作日)，基金份额总额3,668,622.13份，其中中泰中证可转债及可交债指数A基金份额总额1,833,249.28份，中泰中证可转债及可交债指数C基金份额总额1,835,372.85份；中泰中证可转债及可交债指数A基金份额净值为1.0881元，中泰中证可转债及可交债指数C基金份额净值为1.0825元。
2. 本财务报表的实际编制期间为2021年1月1日至2021年7月26日(基金最后运作日)止期间。
3. 本财务报表已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师张振波、金诗涛签字出具了普华永道中天特审字(2021)第2900号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自2021年7月27日至2021年8月24日止为清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产负债清算情况

5.1.1 本基金最后运作日存放在开立于本基金结算机构中泰证券的证券资金账户内的银行存款为人民币20,697.61元，截至证券资金账户销户日2021年8月5日应收利息180.03元，已于2021年8月5日调回托管账户20,877.64元。

5.1.2 于2021年7月26日(基金最后运作日)，本基金确认申购款项10.00元已于2021年7月27日收到。于2021年7月27日，本基金经登记系统确认的基金申购款项10,589.97元，均为于2021年7月26日(基金最后运作日)提出申请并于2021年7月27日确认的基金申购款项，已于2021年7月28日收回。

5.1.3 于2021年7月26日(基金最后运作日)，本基金确认赎回款项1,629,496.41元(不含赎回费)，其中385,281.25元和1,244,215.16元已分别于2021年7月27日和2021年7月28日划付完毕。于2021年7月27日，本基金经登记系统确认的基金赎回款项219,011.75元(不含赎回费)，均为于2021年7月26日(基金最后运作日)提出申请并于2021年7月27日确认的基金赎回款项，已于2021年7月29日划付完毕。

5.1.4 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币5,139.25元，应付托管费为人民币428.28元，应付销售服务费为人民币1,034.92元，已于2021年8月3日支付。

5.1.5 本基金最后运作日应交税费为人民币87.37元，该款项已于2021年8月6日支付。

5.1.6 本基金最后运作日其他负债为人民币104,831.29元，包括应付赎回费、应付指数使用费、预提审计费、预提律师费、预提信息披露费。其中应付赎回费人民币2.83元，该款项已于2021年7月27日支付；应付指数使用费人民币25,128.46元，该款项已于2021年8月2日支付；预提审计费人民币23,000.00元，该款项已于2021年8月2日支付；预提律师费人民币10,000.00元，该款项已于2021年8月6日支付；预提信息披露费人民币46,700.00元，该款项已于2021年8月11日支付。

5.2 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年7月27日至2021年8月24日止清算期间
一、清算收益	1,092.83

利息收入（注 1）	1,092.83
二、清算费用	578.65
其他费用（注 2）	578.65
三、清算期间净收益	514.18

注：1. 利息收入系计提的自 2021 年 7 月 27 日至 2021 年 8 月 24 日止清算期间的银行存款利息。

2. 其他费用系银行划款手续费。

5.3 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2021 年 7 月 26 日基金净资产	3,981,602.46
加：清算期间净收益	514.18
加：清算期间基金份额交易产生的净值影响 (净值减少以“-”号填列)	-208,421.78
二、清算结束日 2021 年 8 月 24 日基金剩余净资产	3,773,694.86

注：本基金最后运作日为 2021 年 7 月 26 日，最后运作日交易申请的确认日为 2021 年 7 月 27 日。

截至本次清算期结束日 2021 年 8 月 24 日，本基金剩余财产 3,773,694.86 元。根据本基金的《基金合同》约定，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。

清算结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清算速度，基金管理人届时将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清算分配使用，待结息日回款后再返还给基金管理人。

5.4 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时分配。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金基金清算财务报告及审计报告；
- 2、关于《中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金清算报告》的法律意见。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

客户服务中心电话：400-821-0808

中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金
基金财产清算小组
2021年8月24日