

中泰双利债券型证券投资基金

2023年第2季度报告

2023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:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2023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	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	10
4.5 报告期内基金的业绩表现	11
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	11
§5 投资组合报告	11
5.1 报告期末基金资产组合情况	11
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	12
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	12
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	13
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	13
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	13
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	14
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	14
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	14
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	14
5.11 投资组合报告附注	14
§6 开放式基金份额变动	15
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	16
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	16
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	16
§8 备查文件目录	16
8.1 备查文件目录	16
8.2 存放地点	16
8.3 查阅方式	16

§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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023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2023年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中泰双利债券
基金主代码	015727
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年09月27日
报告期末基金份额总额	51,499,857.93份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在充分考虑基金资产的安全性、收益性、流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。在具体细分品类投资策略上，本基金投资策略主要分为资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略和国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7%+恒生指数收益率×3%
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期风险与收益理论上高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。本基金投资于港股通标的股票时，会面临港股通机

	制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中泰双利债券A	中泰双利债券C
下属分级基金的交易代码	015727	015728
报告期末下属分级基金的份额总额	15,041,088.45份	36,458,769.48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(2023年04月01日 - 2023年06月30日)	
	中泰双利债券A	中泰双利债券C
1.本期已实现收益	103,632.95	241,557.94
2.本期利润	137,572.29	337,845.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0089	0.0080
4.期末基金资产净值	15,289,073.72	36,942,642.17
5.期末基金份额净值	1.0165	1.0133

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

中泰双利债券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	0.88%	0.02%	0.27%	0.09%	0.61%	-0.07%
过去六个月	1.88%	0.02%	0.97%	0.09%	0.91%	-0.07%

自基金合同生效起至今	1.65%	0.03%	0.72%	0.11%	0.93%	-0.08%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

中泰双利债券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	0.78%	0.02%	0.27%	0.09%	0.51%	-0.07%
过去六个月	1.69%	0.02%	0.97%	0.09%	0.72%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.33%	0.03%	0.72%	0.11%	0.61%	-0.08%

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

中泰双利债券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

(2022年09月27日-2023年06月30日)



注：

(1) 本基金基金合同生效日期为 2022 年 9 月 27 日，至本报告期末本基金成立未满 1 年。

(2) 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。截至本报告期末，本基金已建仓完毕，且建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

中泰双利债券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

(2022年09月27日-2023年06月30日)



注：

(1) 本基金基金合同生效日期为 2022 年 9 月 27 日，至本报告期末本基金成立未满 1 年。

(2) 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。截至本报告期末，本基金已建仓完毕，且建仓期结束时，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		
姜诚	本基金基金经理；中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；中泰兴诚价值一年持有期混合型证	2022-09-27	-	17	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司资产管理总部研究员、投资经理；安信基金管理有限责任公司研究部副总经理、基金投资部总经理；2016年4月加入

	券投资基金基金经理；中泰兴为价值精选混合型证券投资基金基金经理；中泰红利价值一年持有期混合型发起式证券投资基金基金经理；中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券投资基金基金经理；中泰元和价值精选混合型证券投资基金基金经理；基金业务部总经理。				中泰证券（上海）资产管理有限公司任基金业务部总经理。2018年12月5日起至今担任中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年3月20日起至今担任中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年9月6日至2021年3月22日期间担任中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021年2月8日起至今担任中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2022年1月18日起至今担任中泰兴为价值精选混合型证券投资基金基金经理。2022年3月24日起至今担任中泰红利价值一年持有期混合型发起式证券投资基金和中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券投资基金基金经理。2022年9月27日起至今担任中泰双利债券型证券投资基金基金经理。2023年2月17日起至今担任中泰元和价值精选混合型证券投资基金基金经理。
商园波	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；中泰稳固周周购12周滚	2022-09-27	-	10	国籍：中国。学历：上海财经大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任上海银行理财产品交易员、投资经理；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；

	<p>动持有债券型证券投资基金基金经理；中泰锦泉汇金货币市场基金基金经理；中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金基金经理；基金业务部副总经理。</p>			<p>2014年8月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司金融市场部任副总经理、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。2021年7月21日起至今担任中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理。2022年2月28日起至今担任中泰锦泉汇金货币市场基金基金经理。2022年9月27日起至今担任中泰双利债券型证券投资基金基金经理。2022年10月18日起至今担任中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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。公司管理产品买卖法规、产品管理合同、交易制度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。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在收盘前15分钟的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过15%，则认定为交易时间异常型异常交易。产品在连续竞价阶段委托价格超过最新价格的3%，则作为交易价格异

常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在交易当日的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过30%，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

二季度外部环境更趋复杂严峻，发达国家通胀仍处高位，美联储紧缩效应持续显现，国际金融市场波动有所加剧；国内经济运行呈现恢复期的特点，经济修复斜率有所放缓，内生修复动能仍需加强。中国制造业PMI在4、5月再次回落至荣枯线下方，6月反弹至49.0；建筑业和服务业表现较好，拉动6月非制造业PMI指数上行至58.2。与3月末相比，5月经济数据走势分化，消费仍具备韧性：工业增加值当月同比增速由3.9%回落至3.5%，固定资产投资完成额累计同比增速由5.1%回落至4.0%，出口金额累计同比增速由0.5%小幅回落至0.3%，社会消费品零售总额累计同比增速由5.8%回升至9.3%。

在经济修复动能转弱的背景下，二季度货币政策及时加大了逆周期调节力度，全力支持实体经济的恢复。6月13日，中国人民银行公布7天逆回购操作利率下调10bp至1.9%，时隔近10个月来首次调降。6月20日贷款市场报价利率（LPR）1年期为3.55%，5年期以上LPR为4.2%，均较上月下调10个基点。

债市对经济复苏和流动性的预期表现为“弱现实、宽松预期”的组合。二季度长端国债利率下行幅度小于短端，10-1年国债曲线利差由3月末的62bp回升至6月末的76bp，反映债市对三季度稳增长政策出台的溢价。具体来看，1年国债收益率由2.23%，下行至6月末的1.87%，10年国债收益率由2.85%回落至2.64%。

债券方面，本季度本基金一方面继续增配一些绝对收益率较好的个券，以提高组合静态收益。另一方面，也通过实施利率债和金融债的交易波段，来为组合增厚收益。由于二季度整体处于利率下行阶段，这两个策略都取得了较好的效果。权益方面，本基金从二季度开始增配权益仓位，标的主要集中于行业龙头或具有较好分红率的大蓝筹。

后续策略上，债券方面，本基金继续以信用债为底仓，并加以利率债或金融债的交易波段操作来增厚收益。信用债尽可能寻找到期收益率较高的个券，努力提高组合的静态收益率。不过随着信用债绝对收益率重回低位水平，“价值洼地”的个券越来越难以找到。另外，积极寻找利率债或金融债的交易波段机会，在资金面持续宽松的格局下，预期存在较多的交易空间。

权益方面，本基金定位为低波动混合二级债基，因此将严格控制权益仓位，同时以绝对收益率为追求目标，努力为投资者创造良好的业绩表现。本基金将充分利用管理人研究人员对个股的研究成果，判断个股是否具有投资价值，并结合宏观环境和行业景气度情况，自上而下进行择股。权益投资部分的作用为增厚收益，为避免该部分资产成为产品业绩的拖累项，因此在遵循价值投资的同时，本基金也将注重择时，注重热点板块轮动，设立止损线和锁高，通过交易波段来尽可能地组合增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰双利债券A基金份额净值为1.0165元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.88%，同期业绩比较基准收益率为0.27%；截至报告期末中泰双利债券C基金份额净值为1.0133元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.78%，同期业绩比较基准收益率为0.27%。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	357,566.00	0.51
	其中：股票	357,566.00	0.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	67,436,978.85	97.10
	其中：债券	67,436,978.85	97.10
	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	1,656,544.93	2.39
8	其他资产	839.52	0.00

9	合计	69,451,929.30	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	56,295.00	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,505.00	0.00
E	建筑业	63,140.00	0.12
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	47,184.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	189,442.00	0.36
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	357,566.00	0.68

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	33,100	159,542.00	0.31
2	601668	中国建筑	11,000	63,140.00	0.12
3	603733	仙鹤股份	2,700	56,295.00	0.11
4	600377	宁沪高速	4,800	47,184.00	0.09
5	601998	中信银行	5,000	29,900.00	0.06
6	600674	川投能源	100	1,505.00	0.00

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	3,265,717.15	6.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,070,819.67	19.28
	其中：政策性金融债	10,070,819.67	19.28
4	企业债券	8,302,727.01	15.90
5	企业短期融资券	4,048,515.85	7.75
6	中期票据	41,749,199.17	79.93
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	67,436,978.85	129.11

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

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	230210	23国开10	100,000	10,070,819.67	19.28
2	101901515	19南京国投MTN001	50,000	5,242,631.78	10.04
3	102101874	21诚通控股MTN005	50,000	5,175,993.97	9.91
4	102101862	21东龙控股MTN001	50,000	5,157,517.81	9.87
5	101900749	19山东出版MTN001	50,000	5,095,110.38	9.75

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**

本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市 值(元)	公允价值变 动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					-1,760.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，并较好地实现了套期保值的功能。

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、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
5	应收申购款	839.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	839.52

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

	中泰双利债券A	中泰双利债券C
报告期期初基金份额总额	16,972,658.31	45,613,970.33
报告期期间基金总申购份额	1,404,854.06	5,505,726.83
减：报告期期间基金总赎回份额	3,336,423.92	14,660,927.68
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	15,041,088.45	36,458,769.48

§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

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中泰双利债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰双利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰双利债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰双利债券型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；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

8.2 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。

8.3 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。

中泰证券（上海）资产管理有限公司
2023年07月20日