

中泰证券（上海）资产管理有限公司

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）摘要

2020 年第 1 号

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

2020 年 4 月

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会 2019 年 11 月 15 日证监许可【2019】2361 号文注册募集。本基金基金合同于 2020 年 1 月 19 日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有的基金份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：由于经济、政治、社会等环境因素的变化对证券价格造成的市场风险，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信用风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的运作管理风险，流动性风险，本基金的特定风险，本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险，其他风险等。

本基金采用证券公司交易模式和结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易并由选定的证券经营机构作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易结算模式可能存在信息系统风险、操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等风险。

本基金为债券型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金，低于股票

型基金和混合型基金，属于较低预期风险和较低预期收益的证券投资基金产品。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。

本基金可投资资产支持证券，存在与基础资产相关的风险、与资产支持证券相关的风险、与专项计划管理相关的风险和其他风险。

《基金合同》生效后，连续 50 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，基金管理人将按照《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。投资人将面临基金合同可能自动终止的不确定性风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本基金招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》实施之日起一年后开始执行。

本基金招募说明书所载内容截至 2020 年 3 月 31 日，基金投资组合报告和基金业绩表现截至 2020 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：中泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区延安东路 175 号 24 楼 05 室

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

成立时间：2014 年 8 月 13 日

法定代表人：章飏

注册资本：16,666.0000 万元人民币

联系电话：021-20521111

股权结构如下：

股东名称	持股比例
中泰证券股份有限公司	60%
深圳派特纳投资管理企业(有限合伙)	24%
深圳前海山小投资管理企业(有限合伙)	16%

中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监许可[2014]355 号文批准，由齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资设立的资产管理子公司。2017 年 9 月，因公司发展需要，公司名称由“齐鲁证券(上海)资产管理有限公司”变更为“中泰证券(上海)资产管理有限公司”。

2017 年 12 月，根据中国证监会证监许可[2017]2342 号文批准，本公司获得开展公开募集证券投资基金管理业务资格。

二、主要人员情况

1、董事会和监事成员

章飏先生，博士研究生，董事长，2014 年 8 月起履行董事长职务。曾任安徽财经大学计算机老师，国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程部研究员、新产品开发小组组长、衍生产品部总经理、资产管理部总经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司总裁、首席执行官，中泰证券股份有限公司顾问。现任中泰证券(上海)资产管理有限公司董事长。

张晖女士，硕士研究生，董事，2016 年 4 月起履行董事职务。曾任山东省国际信托投资公司上海证券业务部交易部经理、总经理助理、副总经理、总经理；齐鲁证券经纪有限公司经纪业务总部总经理；中泰证券股份有限公司党群工作部主任、部长，企业文化部总经理，信访办公室主任（兼），女职工委员会主任，党务工作部部长，纪委副书记。现任中泰证券股份有限公司工会副主席、董事会秘书。

王丽敏女士，本科学历，硕士学位，董事，2014 年 9 月起履行董事职务。曾任山东齐鲁信托投资有限公司证券部财务部业务经理，中泰证券股份有限公司计划财务总部业务主管、副总经理，机构业务部总经理。现任中泰证券股份有限公司审计稽核部总经理。

叶展先生，大学本科，董事。2018 年 2 月起履行董事职务。曾任上海证券报记者、编辑、机构部主任，上海国泰君安证券资产管理有限公司市场部总经理、市场总监，上海泽熙投资管理有限公司总经理助理，中泰证券（上海）资产管理有限公司总经理助理、副总经理。现任中泰证券（上海）资产管理有限公司首席执行官。

孙海昕女士，本科学历，硕士学位，监事，2014 年 9 月起履行监事职务。曾任山东银行学校实验银行职员；山东省国际信托投资公司展业证券营业部财务部经理，证券总部财务部副经理；中泰证券股份有限公司财务总部副总经理，登记结算部副总经理。现任中泰证券股份有限公司登记结算部总经理。

2、高级管理人员

叶展先生，公司首席执行官，2018 年 9 月至今，担任目前职务。简历请参见上述关于董事的介绍。

徐建东先生，大学本科，公司总经理。曾任泰安市信托投资公司上海证券业务部交易员，泰安市信托投资公司证券业务部副经理，中泰证券股份有限公司上海赤峰路营业部总经理、济南山大路营业部总经理、莱芜管理总部总经理、济南第二管理总部总经理、泰安管理总部总经理、经纪业务总部总经理、北京证券资产管理分公司董事、总经理，中泰证券（上海）资产管理有限公司拟任副总经理、副总经理。2018 年 4 月至今，担任目前职务。

王洪懿先生，大学本科，公司合规总监兼首席风险官兼督察长兼董事会秘书。

曾任华星塑料制品有限公司职员，天同证券有限责任公司职员，中泰证券股份有限公司高级业务经理，万家基金管理有限公司财务总监，中泰证券(上海)资产管理有限公司拟任副总经理、副总经理兼董事会秘书。2018 年 7 月至今，担任目前职务。

黄文卿先生，硕士研究生，公司副总经理。曾任国泰君安证券股份有限公司证券分析研究员、衍生产品部投资经理、资产管理总部固定收益业务投资经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司总经理助理兼固定收益部总经理兼金融市场部总经理，中泰证券(上海)资产管理有限公司拟任副总经理。2015 年 3 月至今，担任目前职务。

应晨奇先生，硕士研究生，公司副总经理兼首席信息官。曾任光大证券股份有限公司清算中心清算员、资产管理总部风控经理、清算中心主任、登记结算中心副总经理（主持工作）、运营管理总部董事副总经理、资产管理总部董事副总经理，上海光大证券资产管理有限公司运营总监，中泰证券(上海)资产管理有限公司拟任副总经理、副总经理兼合规总监兼首席风险官。2019 年 6 月至今，担任目前职务。

3、本基金基金经理

朱未一先生，中国人民大学经济学硕士，基金业务部基金经理。曾任交通银行嘉兴平湖支行对公客户经理、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、金融市场部投资经理，中泰证券（上海）资产管理有限公司固定收益部投资经理。2019 年 12 月至今任现职。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。

张蓓蓓女士，硕士研究生，基金业务部副总经理。曾任国泰基金管理有限公司交易管理部交易员、负责人，上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益投资经理、高级投资经理、首席投资经理。中泰证券（上海）资产管理有限公司固定收益投资经理、副总经理。2018 年 1 月至今，担任目前职务。2019 年 4 月 26 日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。

4、本公司投资决策委员会成员

叶展先生，简历请参见上述关于董事会和监事成员的介绍。

黄文卿先生，简历请参见上述关于高级管理人员的介绍。

应晨奇先生，简历请参见上述关于高级管理人员的介绍。

王洪懿先生，简历请参见上述关于高级管理人员的介绍。

姜诚先生，基金业务部总经理，研究部总经理。

5、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市银城路 167 号

法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职责）

成立时间：1988 年 8 月 22 日

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

二、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2018 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 6.71 万亿元，实现营业收入 1582.87 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 606.20 亿元。

三、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托

资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

四、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2020 年 3 月 31 日，我行共托管证券投资基金 293 只，托管基金的基金资产净值合计 13616.94 亿元，基金份额合计 13270.30 亿份。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

名称：中泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区延安东路 175 号 24 楼 05 室

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

法定代表人：章飏

电话：021-20521010

传真：021-68883772

网址：www.ztzqzg.com

2、其他销售机构

（1）中泰证券股份有限公司

住所：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn>

（2）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：刘秋明

网址：www.ebscn.com

客服电话：95525

（3）兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：福建省福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

网址：www.cib.com.cn

客服电话:95561

（4）平安银行股份有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

网址：bank.pingan.com

客服电话：95511 转 3

（5）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

网址：www.1234567.com.cn

客服电话：95021 或 400-1818-188

（6）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：王之光

网址：www.lufunds.com

客服电话：400-821-9031

（7）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

网址：www.howbuy.com

客服电话：400-700-9665

（8）北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区显龙山路 19 号 1 幢 4 层 1 座 401

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座

法定代表人：江卉

网址：kenterui.jd.com

客服电话：400-098-8511

（9）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东路 1 号保利国际广场南塔
1201-1203

法定代表人：肖雯

网址：www.yingmi.cn

客服电话：020-89629066

（10）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

网址：www.66liantai.com

客服电话：400-166-6788

（11）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 1 号楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 1 号楼

法定代表人：冯轶明

网址：www.zhengtongfunds.com

客服电话：400-820-1515

(12) 诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

网址：www.noah-fund.com

客服电话：400-821-5399

(13) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市西直门外大街 1 号 西环广场 T2 19C13

网址：www.hcjijin.com

客服电话：400-619-9059

(14) 和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼
503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5
楼 503

法定代表人：王旋

网址：www.hgccpb.com

客服电话：4000-555-671

(15) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：吴强

网址：www.5ifund.cn

客服电话：952555

(16) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

网址：www.erichfund.com

客服电话：400-820-2899

（17）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

网址：www.danjuanapp.com/

客服电话：400-061-8518

（18）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

网址：www.snjjjin.com

客服电话：95177

（19）上海陆享基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场二楼 16 楼

法定代表人：陈志英

网址：www.luxxfund.com

客服电话：400-168-1235

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，具体名单详见基金管理人网站。

二、注册登记机构

名称：中泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区延安东路 175 号 24 楼 05 室

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

法定代表人：章飏

传真：021-50933716

客户服务专线：021-20521115

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507

单元 01 室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：金诗涛

经办注册会计师：张振波、金诗涛

第四部分 基金的名称

中泰中证可转债及可交换债券指数证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式债券型证券投资基金

第六部分 基金的投资目标

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。

第七部分 基金的投资范围

本基金主要投资于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。

第八部分 基金的投资策略

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。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。

1、债券指数化投资策略

（1）债券投资组合的构建策略

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和逐步调整建仓。

划分可转债及可交换债券层级：本基金根据可转债及可交换债券的不同特征（例如信用等级、久期、发行人所属行业、发行人企业性质等）将标的指数成份券划分层级，按照分层抽样的原理，确定各层级成份券及其权重。

筛选目标组合成份券分层完成后，本基金在各层级成份券内利用动态最优化或随机抽样等方法筛选出与各层级总体风险收益特征（例如久期、凸性等）相近，且流动性较好（主要考虑发行规模、当前债券余额、日均成交金额、近 1 月换手率、近 1 月交易天数等指标）的个券组合，并使目标组合的投资比例与各层级的权重相似。

逐步建仓：根据市场实际流动性情况和投资机会，进一步调整和优化组合并逐步建仓。

（2）债券投资组合的调整策略

定期调整：基金管理人将基于久期、权重、信用等级、期限分布匹配的基础，综合考虑样本券流动性、交易规模等因素，对债券投资组合进行动态抽样调整，以期实现对标的指数的有效跟踪。

不定期调整：当发生较大的申购赎回、组合中可转债及可交换债派息、可转债转股、可转债及可交换债到期以及市场波动剧烈等情况，导致投资组合与标的指数出现偏离，本基金将综合考虑市场流动性、交易成本、偏离程度等因素，对投资组合进行不定期的动态调整以缩小跟踪误差。

（3）替代性策略

当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备

选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他可转债及可交换债券构建替代组合，对标的指数进行跟踪复制。替代组合的构建将以可转债及可交换债券的流动性为约束条件，按照与被替代的可转债及可交换债券久期相近、信用评级相似、转股溢价率及剩余期限基本匹配、发行人所属行业相近、发行人企业性质相近为主要原则，控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。构建替代组合的方法如下：

按照与被替代的可转债及可交换债券久期、信用评级、发行人所属行业相似、转股溢价率接近的原则，在其他可投资标的中选择成份券替代券；

根据成份券替代券过去较长一段时间的历史数据，分析其与被替代的可转债及可交换债券的相关性，选择正相关度较高的债券进一步考察；

分析上述可转债及可交换债券替代券的流动性，综合流动性和相关度两个指标挑选替代券，从而使得替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

2、其他投资策略

为了在一定程度上弥补基金费用，基金管理人还可以在控制风险的前提下，使用其他投资策略。例如，基金管理人可以使用事件驱动策略，即通过分析重大事件发生对投资标的定价的影响而进行套利；也可以使用公允价值策略，即通过对债券市场价格与模型价格偏离度的研究，采取相应的增/减仓操作等。

3、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、底层资产的构成和质量等因素，坚持风险调整后收益最大化的原则，通过信用资质研究和流动性管理，在严格控制投资风险的基础上选择投资对象，确保本金相对安全和基金资产具有良好流动性，以期获得稳定收益。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准=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）

中证可转债及可交换债券指数样本券由沪深交易所上市的可转换公司债券和可交换公司债券组成。标的指数采用市值加权计算，以反映沪深交易所可转换

公司债券和可交换公司债券的整体表现，可较为科学、合理的评价本基金的业绩表现。

本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

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。

第十一部分 基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2020 年第 1 季度报告，所载数据截至 2020 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	343,545,675.53	93.75
	其中：债券	343,545,675.53	93.75

	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	22,341,018.57	6.10
8	其他资产	560,460.61	0.15
9	合计	366,447,154.71	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(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。

(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。

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。

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	-	-
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）	343,545,675.53	93.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	343,545,675.53	93.83

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	320,060	33,996,773.20	9.29
2	113021	中信转债	256,060	27,782,510.00	7.59
3	113011	光大转债	192,020	22,485,542.00	6.14
4	110053	苏银转债	128,020	14,360,003.40	3.92
5	132018	G 三峡 EB1	128,020	14,039,953.40	3.83

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

10、 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

11、 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期无立案调查。

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未受到公开谴责。

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：

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编制日前一年内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

2) 中信转债（证券代码：113021.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内因违规经营、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

3) 光大转债（证券代码：113011.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

4) 苏银转债（证券代码：110053.SH）

根据发布的相关公告，该证券发行人江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

5) 18 中油 EB（证券代码：132015.SH）

2019 年 6 月，国家市场监督管理总局发布行政处罚决定书，因违法收取 587.03 万元供气手续费，该证券发行人中国石油天然气股份有限公司的天然气销售川渝分公司被罚 587.03 万元。

6) 17 宝武 EB（证券代码：132013.SH）

2019 年 9 月，该证券发行人宝山钢铁股份有限公司未采取相应防范措施，造成工业固体废物渗漏，违反《中华人民共和国固体废物污染环境防治法》第十六条规定，受到上海市生态环境局的处罚。

7) 东财转 2（证券代码：123041.SH）

2020 年 2 月，根据上海证监局公告，该证券发行人东方财富信息股份有限公司的全资子公司上海东方财富证券研究所有限公司因投顾业务违规被采取责令改正监督管理措施。

8) 国君转债（证券代码：113013.SH）

2019 年 9 月，该证券发行人国泰君安证券股份有限公司的四平中央西路证券营业部因未依法履行职责，被监管责令改正。

2019 年 11 月，该证券发行人国泰君安证券股份有限公司因科创板项目信息披露不当，被上交所出具监管工作函。

2020 年 3 月，该证券发行人国泰君安证券股份有限公司的深圳红荔西路证券营业部因未依法履行职责，被监管出具警示函。

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。

(2) 本基金本报告期末投资股票。

(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	560,460.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	560,460.61

(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	113021	中信转债	27,782,510.00	7.59
2	113011	光大转债	22,485,542.00	6.14
3	110053	苏银转债	14,360,003.40	3.92
4	132015	18 中油 EB	12,880,366.20	3.52
5	132013	17 宝武 EB	9,791,040.00	2.67
6	132009	17 中油 EB	6,447,360.00	1.76
7	113013	国君转债	5,268,647.70	1.44
8	113026	核能转债	5,250,691.60	1.43
9	127005	长证转债	3,728,754.40	1.02
10	127012	招路转债	3,461,327.28	0.95
11	132007	16 凤凰 EB	3,264,000.00	0.89
12	113008	电气转债	3,213,189.10	0.88

13	132004	15 国盛 EB	3,213,120.00	0.88
14	110051	中天转债	2,981,388.60	0.81
15	113022	浙商转债	2,590,596.00	0.71
16	113020	桐昆转债	2,580,332.50	0.70
17	132014	18 中化 EB	2,406,161.70	0.66
18	110048	福能转债	2,123,397.50	0.58
19	110043	无锡转债	2,065,843.40	0.56
20	113014	林洋转债	2,042,967.40	0.56
21	113024	核建转债	2,024,353.10	0.55
22	110045	海澜转债	1,938,598.40	0.53
23	128048	张行转债	1,878,984.90	0.51
24	113009	广汽转债	1,866,192.40	0.51
25	110042	航电转债	1,801,888.20	0.49
26	110031	航信转债	1,786,982.40	0.49
27	113028	环境转债	1,748,889.90	0.48
28	132006	16 皖新 EB	1,736,284.50	0.47
29	127006	敖东转债	1,669,764.96	0.46
30	110047	山鹰转债	1,664,096.00	0.45
31	132008	17 山高 EB	1,658,070.00	0.45
32	128045	机电转债	1,650,607.52	0.45
33	113019	玲珑转债	1,601,691.70	0.44
34	128035	大族转债	1,586,001.06	0.43
35	132011	17 浙报 EB	1,515,482.00	0.41
36	113508	新风转债	1,478,318.40	0.40
37	132005	15 国资 EB	1,412,096.00	0.39
38	110041	蒙电转债	1,364,222.20	0.37
39	110056	亨通转债	1,350,204.00	0.37
40	113025	明泰转债	1,327,233.60	0.36

41	132012	17 巨化 EB	1,308,417.00	0.36
42	128034	江银转债	1,245,243.40	0.34
43	110057	现代转债	1,209,294.00	0.33
44	128046	利尔转债	1,191,442.62	0.33
45	113543	欧派转债	1,166,844.00	0.32
46	110052	贵广转债	1,160,187.50	0.32
47	110034	九州转债	1,114,166.20	0.30
48	113017	吉视转债	1,069,556.60	0.29
49	127007	湖广转债	995,719.20	0.27
50	128029	太阳转债	971,117.75	0.27
51	128074	游族转债	935,676.80	0.26
52	127011	中鼎转 2	907,230.36	0.25
53	113516	苏农转债	892,485.00	0.24
54	123029	英科转债	872,298.00	0.24
55	110033	国贸转债	867,986.70	0.24
56	113534	鼎胜转债	867,801.40	0.24
57	113518	顾家转债	836,994.60	0.23
58	113544	桃李转债	806,313.90	0.22
59	127013	创维转债	803,253.50	0.22
60	128013	洪涛转债	788,659.20	0.22
61	128053	尚荣转债	787,781.80	0.22
62	128019	久立转 2	769,237.28	0.21
63	128059	视源转债	761,764.80	0.21
64	128028	赣锋转债	740,182.60	0.20
65	110058	永鼎转债	710,704.50	0.19
66	128032	双环转债	662,915.22	0.18
67	128075	远东转债	652,021.90	0.18
68	127003	海印转债	648,273.20	0.18

69	128023	亚太转债	648,170.64	0.18
70	128026	众兴转债	630,688.80	0.17
71	110055	伊力转债	623,214.90	0.17
72	128018	时达转债	607,262.00	0.17
73	128065	雅化转债	584,854.02	0.16
74	123004	铁汉转债	583,794.90	0.16
75	113016	小康转债	580,142.00	0.16
76	113537	文灿转债	579,256.20	0.16
77	113515	高能转债	577,124.80	0.16
78	128062	亚药转债	559,761.70	0.15
79	128064	司尔转债	554,383.90	0.15
80	113504	艾华转债	534,024.40	0.15
81	113505	杭电转债	526,325.20	0.14
82	128015	久其转债	525,639.00	0.14
83	113527	维格转债	494,183.20	0.13
84	113519	长久转债	494,083.50	0.13
85	128063	未来转债	483,992.00	0.13
86	110050	佳都转债	476,086.50	0.13
87	128022	众信转债	469,878.50	0.13
88	128044	岭南转债	468,825.60	0.13
89	110038	济川转债	467,238.20	0.13
90	128017	金禾转债	463,948.80	0.13
91	128067	一心转债	457,796.56	0.13
92	123020	富祥转债	456,917.50	0.12
93	113542	好客转债	448,792.80	0.12
94	120002	18 中原 EB	448,187.80	0.12
95	128058	拓邦转债	445,450.32	0.12
96	113027	华钰转债	442,701.60	0.12

97	113530	大丰转债	440,279.20	0.12
98	128057	博彦转债	437,464.00	0.12
99	113528	长城转债	431,406.00	0.12
100	128071	合兴转债	415,807.00	0.11
101	123031	晶瑞转债	415,797.90	0.11
102	123023	迪森转债	406,752.50	0.11
103	128021	兄弟转债	406,393.20	0.11
104	128037	岩土转债	405,735.48	0.11
105	123002	国祯转债	398,215.40	0.11
106	123022	长信转债	372,289.05	0.10
107	113525	台华转债	371,451.30	0.10
108	128033	迪龙转债	353,412.90	0.10
109	113012	骆驼转债	352,534.40	0.10
110	123028	清水转债	352,187.60	0.10
111	113509	新泉转债	349,689.60	0.10
112	128066	亚泰转债	347,711.24	0.09
113	113535	大业转债	347,643.00	0.09
114	128010	顺昌转债	347,012.40	0.09
115	123017	寒锐转债	337,848.00	0.09
116	123010	博世转债	321,785.60	0.09
117	113532	海环转债	315,873.60	0.09
118	123025	精测转债	307,152.00	0.08
119	128042	凯中转债	294,954.90	0.08
120	123018	溢利转债	288,804.00	0.08
121	113531	百姓转债	287,679.00	0.08
122	128049	华源转债	281,932.80	0.08
123	127004	模塑转债	276,119.40	0.08
124	128056	今飞转债	269,639.00	0.07

125	128050	钧达转债	263,886.00	0.07
126	123027	蓝晓转债	258,989.50	0.07
127	128025	特一转债	252,880.00	0.07
128	128073	哈尔转债	237,962.82	0.06
129	113541	荣晟转债	234,620.40	0.06
130	123030	九洲转债	233,739.00	0.06
131	128069	华森转债	233,088.00	0.06
132	128030	天康转债	230,968.80	0.06
133	113524	奇精转债	227,073.00	0.06
134	128014	永东转债	227,061.50	0.06
135	123007	道氏转债	216,932.80	0.06
136	128072	翔鹭转债	205,004.60	0.06
137	123011	德尔转债	196,885.50	0.05
138	128051	光华转债	189,168.00	0.05
139	128070	智能转债	179,346.40	0.05
140	128036	金农转债	176,653.50	0.05
141	128039	三力转债	176,619.60	0.05
142	113511	千禾转债	173,401.00	0.05
143	113521	科森转债	172,729.60	0.05
144	113526	联泰转债	172,652.00	0.05
145	123026	中环转债	170,910.00	0.05
146	128040	华通转债	167,773.00	0.05
147	123024	岱勒转债	153,886.50	0.04
148	113503	泰晶转债	153,672.10	0.04
149	128043	东音转债	150,368.40	0.04
150	128054	中宠转债	149,219.84	0.04
151	113536	三星转债	145,545.90	0.04
152	123014	凯发转债	137,484.60	0.04

153	113520	百合转债	133,915.20	0.04
154	113502	嘉澳转债	133,637.00	0.04
155	127008	特发转债	114,303.20	0.03
156	132016	19 东创 EB	113,926.50	0.03
157	123012	万顺转债	112,719.23	0.03
158	128041	盛路转债	88,932.20	0.02
159	110044	广电转债	85,255.80	0.02
160	128052	凯龙转债	82,320.50	0.02
161	113514	威帝转债	80,465.10	0.02
162	123015	蓝盾转债	80,032.00	0.02
163	123013	横河转债	53,380.00	0.01

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) 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。

(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。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下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。本基金基金合同生效日 2020 年 1 月 19 日，基金业绩截止日 2020 年 3 月 31 日。

本基金自基金合同生效以来的业绩表现如下：

一、本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	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
2020年1月19日（基金合同生效日）至2020年3月31日	-1.41%	0.77%	-0.63%	0.81%	-0.78%	-0.04%

中泰中证可转债及可交债指数C:

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
2020年1月19日（基金合同生效日）至2020年3月31日	-1.46%	0.77%	-0.63%	0.81%	-0.83%	-0.04%

二、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债指数 A:

中泰中证可转债及可交债指数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-2020年03月31日)



中泰中证可转债及可交债指数 C:

中泰中证可转债及可交债指数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-2020年03月31日)



第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C 类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对无误后，由基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对无误后，由基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.3% 的年费率计提。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对无误后，由基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人代收后再按照相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

4、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计算指数许可使用费。

指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.015% 年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币贰万伍千元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

指数许可使用费的支付方式为每季度支付一次。自基金合同生效日起，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月，支付上一季度的指数许可使用费。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式

等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类”中第 5—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费，C 类基金份额不收取申购费。申购费不列入基金财产。投资人可多次申购本基金，申购费用按每笔申购申请单独计算。

本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	0.35%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.15%
M ≥ 500 万元	每笔 1,000 元

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，在投资人申购 A 类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

本基金的赎回费用由赎回相应类别基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金赎回费率按基金份额持有人持有基金份额类别的不同分别设定，并随赎回基金份额持有时间的增加而递减。本基金对持续持有期少于 30 日的基金份

额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于 30 日但少于 365 日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产。赎回费中未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率具体如下：

赎回申请份额持有时间（N）	A 类基金份额赎回费率	C 类基金份额赎回费率
N<7 日	1.50%	1.50%
7 日≤N<30 日	0.30%	0.10%
30 日≤N<365 日	0.10%	0
N≥365 日	0	0

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在注册登记机构的登记日开始计算。）

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以对基金销售费用实行一定的优惠。

五、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、C 类基金份额的销售服务费率等相关费率。调整基金管理费率、基金托管费率和提高 C 类基金份额的销售服务费率须召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指

定媒体公告。

六、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

- 一、 更新了“重要提示”相关内容。
- 二、 更新了“第三部分、基金管理人”相关内容。
- 三、 更新了“第四部分、基金托管人”相关内容。
- 四、 更新了“第五部分、相关服务机构”相关内容。
- 五、 更新了“第六部分、基金的募集”相关内容。
- 六、 更新了“第七部分、基金合同的生效”相关内容。
- 七、 更新了“第八部分、基金份额的申购与赎回”相关内容。
- 八、 更新了“第九部分、基金的投资”章节，新增了“基金投资组合报告”相关内容。
- 九、 增加了“第十一部分、基金的业绩”相关内容，后续相应章节序号随之调整
- 十、 更新了“第二十一部分、其他应披露事项”相关内容。

中泰证券（上海）资产管理有限公司

2020 年 4 月