

中泰元和价值精选混合型证券投资基金

2023 年中期报告

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:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 29 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月28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2023年2月17日（基金合同生效日）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	13
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	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	18
6.3	净资产（基金净值）变动表	20
6.4	报表附注	21
§ 7	投资组合报告	49
7.1	期末基金资产组合情况	49
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12	投资组合报告附注	55
§ 8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9	开放式基金份额变动	58
§ 10	重大事件揭示	58
10.1	基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
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	59
§ 11	备查文件目录	59
11.1	备查文件目录	59
11.2	存放地点	60
11.3	查阅方式	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中泰元和价值精选混合型证券投资基金	
基金简称	中泰元和价值精选混合	
基金主代码	017415	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年02月17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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,038,848,055.31份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰元和价值精选混合A	中泰元和价值精选混合C
下属分级基金的交易代码	017415	017416
报告期末下属分级基金的份额总额	1,560,921,886.65份	477,926,168.66份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过紧密跟踪中国经济发展方向和周期变动特征，挖掘各个行业具有领先指标和发展潜力的上市公司，分享中国经济持续快速增长的成果，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对上市公司基本面的深入研究作为投资基础，精选具有高成长性的优质成长性企业。一方面，本基金将通过分析上市公司的公司治理结构、经营模式、自主创新等多方面的运营管理能力，判断公司的核心价值与成长能力，选择投资具有清晰的成长战略、良好经营状况并且在技术、品牌、产品或服务等方面具备领先优势的上市公司的股票。另一方面，本基金将通过分析上市公司的盈利能力、成长和股本扩张能力以及现金流管理水平的定量分析，选择优良财务状况且具备宽阔护城河的上市公司的股票。
业绩比较基准	中证800指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%

	+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险与收益理论上高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王洪懿	王小飞
	联系电话	021-20521199	021-60637103
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-821-0808	021-60637228
传真		021-50933716	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号 24楼05室	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		黄文卿	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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 (2023年02月17日（基金合同生效日）-2023年06月30日)	
	中泰元和价值精选混合A	中泰元和价值精选混合C
本期已实现收益	21,796,498.41	5,826,470.17
本期利润	-80,622,616.31	-26,558,445.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0486	-0.0508
本期加权平均净值利润率	-4.99%	-5.22%
本期基金份额净值增长率	-4.76%	-4.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-74,352,750.96	-23,595,251.30
期末可供分配基金份额利润	-0.0476	-0.0494
期末基金资产净值	1,486,569,135.69	454,330,917.36
期末基金份额净值	0.9524	0.9506
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-4.76%	-4.94%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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）。

4、本基金基金合同在当期生效，生效日为2023年2月17日。

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

中泰元和价值精选混合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	3.75%	1.14%	1.18%	0.77%	2.57%	0.37%
过去三个月	-1.38%	0.96%	-4.37%	0.68%	2.99%	0.28%
自基金合同生效起至今	-4.76%	0.94%	-5.14%	0.71%	0.38%	0.23%

中泰元和价值精选混合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	3.70%	1.14%	1.18%	0.77%	2.52%	0.37%
过去三个月	-1.51%	0.96%	-4.37%	0.68%	2.86%	0.28%
自基金合同生效起至今	-4.94%	0.94%	-5.14%	0.71%	0.20%	0.23%

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

中泰元和价值精选混合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
(2023年02月17日-2023年06月30日)



注：

- (1) 本基金基金合同生效日期为2023年2月17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。

中泰元和价值精选混合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
(2023年02月17日-2023年06月30日)



注：

- (1) 本基金基金合同生效日期为2023年2月17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2023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、中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金、中泰星宇价值成长混合型证券投资基金、中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金、中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金、中泰安睿债券型证券投资基金、中泰安益利率债债券型证券投资基金、中泰锦泉汇金货币市场基金、中泰兴为价值精选混合型证券投资基金、中泰红利价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券投资基金、中泰星汇优选平衡三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、中泰双利债券型证券投资基金、中泰安悦6个月定期开放债券型证券投资基金、中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金、中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金、中泰元和价值精选混合型证券投资基金、中泰天择稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）共二十五只证券投资基金。

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		
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；中泰双利债券型证券投资基金基金经理；中泰兴为价	2023-02-17	-	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

	值精选混合型证券投资基金；基金业务部总经理。			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。
--	------------------------	--	--	--

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 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，各项公平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。

本报告期内，我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。

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

上半年股票市场经历了由乐观转为悲观的过程，年初期待的基本面强复苏未落地，上市公司业绩不达预期是主旋律，在缺乏基本面主线的背景下，个别主题成为资金避风港，此消彼长之下几家欢喜几家愁。

在我们的框架中，市场是拿来应对的，不是用来预测的。因为价值的决定因素是长期变量，而非短期变量，所以股价涨未来潜在回报率就下降，反之则反。进而我们的操作也呈现出“被动交易”的特征，跌了就多买点。因此，报告期末我们的股票总持仓比例达到了历史较高位，也表达了我们对长期回报的信心。

但基金经理个人信心的强弱又与未来回报无关，所以在作决策前就不仅要判断一只股票的价值，还要判断自己的判断。在方法上我们引入了安全边际，不以好公司的价格去买自认为的好公司，因为一来自己的判断会错，二来即便以好公司的价格买到了真的好公司，超额收益也无从说起。所以我们的持仓往往非主流，且对估值较苛刻，这背后不是刻意标新立异，只是出于谨慎和对不确定性的敬畏。未来我们也会一如既往地谨慎，研究对象不止于股票，还包括我们自己。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰元和价值精选混合A基金份额净值为0.9524元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.76%，同期业绩比较基准收益率为-5.14%；截至报告期末中泰元和价值精选混合C基金份额净值为0.9506元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.94%，同期业绩比较基准收益率为-5.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对我们来说，股市的阶段性涨跌不可预测，但一些长期宏观的判断可以尝试，因为有历史数据表明的先验概率来支撑。

首先，我们对中国经济的长期前景乐观。这种乐观不以经济高速增长为前提，而是以高质量增长为前提。新兴行业驱动的产业升级为其一，传统行业的提质增效为其二。

其次，以上一点为基础，叠加中国股市当前较低的估值水平，我们对A股未来总体回报乐观。背后的基本原理是，一国股市的长期回报不取决于GDP增速，而取决于上市公司未来的盈利能力和当前的估值水平。

再次，无论是新兴的成长型企业还是传统的价值型企业，只要竞争优势明确且长期可持续，加之价格合适，就都能提供好的长期回报，跟股票的风格以及所属行业无关，所以做风格和行业层面的配置决策必要性不高。

最后，真正优秀的企业很少，长期优秀的更少，不能因宏观上的乐观来放弃微观上的谨慎。在具体投资决策中，我们将对基本面和价格都保持苛刻，一要擦亮眼睛，二要管住手。

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。

基金管理人设立了估值委员会，由公司总经理、主管基金运营的公司高管、合规负责人及投资管理、风险管理、基金运营等方面的专业人员担任委员。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 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中泰元和价值精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	138,843,990.58
结算备付金		-

存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,800,161,939.05
其中：股票投资		1,800,161,939.05
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		6,804,820.27
应收申购款		433,674.60
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		1,946,244,424.50
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30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		-
应付清算款		83.74
应付赎回款		2,238,648.23

应付管理人报酬		2,421,001.00
应付托管费		403,500.14
应付销售服务费		189,728.21
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.5	91,410.13
负债合计		5,344,371.45
净资产：		
实收基金	6.4.7.6	2,038,848,055.31
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.7	-97,948,002.26
净资产合计		1,940,900,053.05
负债和净资产总计		1,946,244,424.50

注：1、报告截止日2023年6月30日，基金份额总额2,038,848,055.31份，其中A类份额1,560,921,886.65份，C类份额477,926,168.66份。A类份额净值0.9524元，C类份额净值0.9506元。

2、本财务报表的实际编制期间为2023年2月17日(基金合同生效日)至2023年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体：中泰元和价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年02月17日 (基金合同生效 日)至2023年06月3 0日
一、营业总收入		-92,613,292.65
1.利息收入		583,584.26

其中：存款利息收入	6.4.7.8	583,584.26
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		41,214,537.07
其中：股票投资收益	6.4.7.9	1,298,810.88
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.10	-
资产支持证券投资		-
收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.11	-
股利收益	6.4.7.12	39,915,726.19
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-134,804,030.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	392,616.46
减：二、营业总支出		14,567,769.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,614,309.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,935,718.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	926,677.17
4. 投资顾问费		-

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.15	91,064.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-107,181,061.86
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-107,181,061.86
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-107,181,061.86

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中泰元和价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日

项目	本期 2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,218,453,688.38	-	-	2,218,453,688.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-179,605,633.07	-	-97,948,002.26	-277,553,635.33

(一)、综合收益总额	-	-	-107,181,061.86	-107,181,061.86
(二)、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)	-179,605,633.07	-	9,233,059.60	-170,372,573.47
其中：1.基金申购款	27,075,154.94	-	-1,605,153.89	25,470,001.05
2.基金赎回款	-206,680,788.01	-	10,838,213.49	-195,842,574.52
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,038,848,055.31	-	-97,948,002.26	1,940,900,053.05

单位：人民币元

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

中泰元和价值精选混合型证券投资基金(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[2022]2769号《关于准予中泰元和价值精选混合型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《中泰元和价值精选混合型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2,217,779,384.04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(2023)第0065号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中泰元和价值精选混合型证券投资基金基金合同》于2023年2月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,218,453,688.38份,其中认购资金利息折合674,304.34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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中泰元和价值精选混合型证券投资基金基金合同》和《中泰元和价值精选混合型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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰元和价值精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会允许发行上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、公开发行的次级债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具(包括国债期货、股指期货、股票期权)、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)。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。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。本基金的投资组合比例为:股票资产(含存托凭证)的投资比例为基金资产的60%-95%,其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%;每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例应当符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为中证800指数收益率 \times 60%+恒生指数收益率 \times 20%+中债综合指数收益率 \times 20%。

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2023年8月28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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《中泰元和价值精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、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2023年2月17日(基金合同生效日)至2023年6月30日止期间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2023年6月30日的财务状况以及2023年2月17日(基金合同生效日)至2023年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2023年2月17日(基金合同生效日)至2023年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只

有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566号《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2023年06月30日
活期存款	6,893,054.05
等于：本金	6,891,521.61
加：应计利息	1,532.44
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	131,950,936.53
等于：本金	131,923,998.13
加：应计利息	26,938.40
减：坏账准备	-
合计	138,843,990.58

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 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,934,965,969.49	-	1,800,161,939.05	-134,804,030.44

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,934,965,969.49	-	1,800,161,939.05	-134,804,030.44

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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,919.21
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	42,138.98
预提费用-信息披露费	46,351.94

合计	91,410.13
----	-----------

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 中泰元和价值精选混合A

金额单位：人民币元

项目 (中泰元和价值精选混合A)	本期 2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,684,171,637.36	1,684,171,637.36
本期申购	23,674,498.69	23,674,498.69
本期赎回（以“-”号填列）	-146,924,249.40	-146,924,249.40
本期末	1,560,921,886.65	1,560,921,886.65

6.4.7.6.2 中泰元和价值精选混合C

金额单位：人民币元

项目 (中泰元和价值精选混合C)	本期 2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	534,282,051.02	534,282,051.02
本期申购	3,400,656.25	3,400,656.25
本期赎回（以“-”号填列）	-59,756,538.61	-59,756,538.61
本期末	477,926,168.66	477,926,168.66

注：1、本基金自2023年1月16日至2023年2月15日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币2,217,779,384.04元，折合为2,217,779,384.04份基金份额(其中A类基金份额1,683,652,562.78份，C类基金份额534,126,821.26份)。根据《中泰元和价值精选混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币674,304.34元在本基金成立后，折合为674,304.34份基金份额(其中A类基金份额519,074.58份，C类基金份额155,229.76份)，划入基金份额持有人账户。

2、根据《中泰元和价值精选混合型证券投资基金基金合同》、《中泰元和价值精选混合型证券投资基金招募说明书》和《中泰元和价值精选混合型证券投资基金开放日常申

购、赎回、转换和定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于2023年5月17日起每个开放日办理日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 中泰元和价值精选混合A

单位：人民币元

项目 (中泰元和价值精选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	21,796,498.41	-102,419,114.72	-80,622,616.31
本期基金份额交易产生的变动数	-670,953.99	6,940,819.34	6,269,865.35
其中：基金申购款	140,177.86	-1,546,188.20	-1,406,010.34
基金赎回款	-811,131.85	8,487,007.54	7,675,875.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,125,544.42	-95,478,295.38	-74,352,750.96

6.4.7.7.2 中泰元和价值精选混合C

单位：人民币元

项目 (中泰元和价值精选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,826,470.17	-32,384,915.72	-26,558,445.55
本期基金份额交易产生的变动数	-218,513.41	3,181,707.66	2,963,194.25
其中：基金申购款	16,055.23	-215,198.78	-199,143.55
基金赎回款	-234,568.64	3,396,906.44	3,162,337.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,607,956.76	-29,203,208.06	-23,595,251.30

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日
活期存款利息收入	84,460.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	499,123.48
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	583,584.26

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日
卖出股票成交总额	739,570,745.18
减：卖出股票成本总额	733,710,373.22
减：交易费用	4,561,561.08
买卖股票差价收入	1,298,810.88

6.4.7.10 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	39,915,726.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	39,915,726.19

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-134,804,030.44
——股票投资	-134,804,030.44
——债券投资	-
——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	-134,804,030.44

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日
基金赎回费收入	392,472.20
基金转换费收入	144.26
合计	392,616.46

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日
审计费用	42,138.98
信息披露费	46,351.94

汇划手续费	2,573.44
合计	91,064.36

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
中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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 2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,614,309.42
其中：支付销售机构的客户维护费	5,284,680.34

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1.50%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×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,935,718.26

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/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 2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰元和价值精选混合A	中泰元和价值精选混合C	合计
中国建设银行	0.00	48,298.88	48,298.88
中泰证券	0.00	790,132.36	790,132.36
中泰资管	0.00	355.52	355.52

合计	0.00	838,786.76	838,786.76
----	------	------------	------------

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中泰资管，再由中泰资管计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值 X 0.50%/ 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

本报告期基金管理人未持有本基金。

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 2023年02月17日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	6,893,054.05	84,460.78

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

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——固定净值型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（2023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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023-06-30	5个交易日	新股未上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	科创板打新股	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个交易日	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板打新股	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301202	朗威股份	2023-06-28	5个交易日	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个交易日	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	科创板打新股	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	创业板打新股	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	科创板打新股	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股锁定	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688352	顾中科技	2023-04-11	6个月	科创板打新股	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	创业板打新股	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	创业板打新股	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板打新股	11.10	17.04	1,392	15,451.20	23,719.68	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	创业板打新股	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	创业板打新股	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	创业板打新股	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	科创板打新股	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	科创板打新股	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6个月	科创板打新股	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-

688620	安凯微	2023-06-15	6个月	科创板打 新限售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	创业板打 新限售	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	创业板打 新限售	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	科创板打 新限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	创业板打 新限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	科创板打 新限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	科创板打 新限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	创业板打 新限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	创业板打 新限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	创业板打 新限售	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	创业板打 新限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	创业板打 新限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	创业板打 新限售	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	科创板打 新限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	创业板打 新限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6个月	创业板打 新限售	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	科创板打 新限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	创业板打 新限售	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	创业板打 新限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	创业板打 新限售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	科创板打 新限售	39.99	36.71	138	5,518.62	5,065.98	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	科创板打 新限售	26.66	31.50	149	3,972.34	4,693.50	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-

001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

注：本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

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。

于本报告期末，本基金无债券投资。

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

市场风险是指由于经济、政治、社会等环境因素的变化对证券价格造成的影响，其主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险、再投资风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年 06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	138,843,990.58	-	-	-	-	-	138,843,990.58
交易性	-	-	-	-	-	1,800,161,939.05	1,800,161,939.05

金融资产							
应收股利	-	-	-	-	-	6,804,820.27	6,804,820.27
应收申购款	-	-	-	-	-	433,674.60	433,674.60
资产总计	138,843,990.58	-	-	-	-	1,807,400,433.92	1,946,244,424.50
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	83.74	83.74
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,238,648.23	2,238,648.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,421,001.00	2,421,001.00
应付托管费	-	-	-	-	-	403,500.14	403,500.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	189,728.21	189,728.21
其他负债	-	-	-	-	-	91,410.13	91,410.13
负债总计	-	-	-	-	-	5,344,371.45	5,344,371.45
利率敏感度缺口	138,843,990.58	-	-	-	-	1,802,056,062.47	1,940,900,053.05

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	379,241,785.86	-	379,241,785.86
应收股利	-	6,804,820.27	-	6,804,820.27
资产合计	-	386,046,606.13	-	386,046,606.13
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	386,046,606.13	-	386,046,606.13

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023年06月30日
	港币相对人民币升值5%	18,962,089.29
	港币相对人民币贬值5%	-18,962,089.29

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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

基金管理人通过对上市公司基本面的深入研究作为投资基础，精选具有高成长性的优质成长性企业。一方面，本基金将通过分析上市公司的公司治理结构、经营模式、自主创新等多方面的运营管理能力，判断公司的核心价值与成长能力，选择投资具有清晰的成长战略、良好经营状况并且在技术、品牌、产品或服务等方面具备领先优势的上市公司的股票。另一方面，本基金将通过分析上市公司的盈利能力、成长和股本扩张能力以及现金流管理水平的定量分析，选择优良财务状况且具备宽阔护城河的上市公司的股票。

本基金的投资组合中股票资产（含存托凭证）的投资比例为基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%；每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的管理人通过风险敞口指标、风险价值指标、敏感性分析指标、集中度指标、压力测试指标、情景分析指标等方法进行市场风险度量、跟踪和控制。

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 2023年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	1,800,161,939.05	92.75
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	1,800,161,939.05	92.75

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假设基金的市场价格风险主要源于系统性风险，公司采用beta系数来衡量股票投资的系统性风险，股票基准值为沪深300指数；2、假设除比较基准变动外，影响基金资产净值的其他价格风险变量保持不变；3、假设比较基准变动5%，采用线性回归法分析，因而业绩比较基准的变化对基金的净值影响线性相关。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023年06月30日
	比较基准上升5%	79,003,620.51
	比较基准下降5%	-79,003,620.51

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日
第一层次	1,798,721,109.97
第二层次	622,660.86
第三层次	818,168.22
合计	1,800,161,939.05

6.4.14.2.2 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	1,800,161,939.05	92.49
	其中：股票	1,800,161,939.05	92.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	138,843,990.58	7.13
8	其他各项资产	7,238,494.87	0.37
9	合计	1,946,244,424.50	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为379,241,785.86元，占期末资产净值比例为19.54%。

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

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	766,437,515.38	39.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	187,106,533.65	9.64

F	批发和零售业	117,746,471.20	6.07
G	交通运输、仓储和邮政业	85,445,284.39	4.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,834.40	0.00
J	金融业	264,083,889.36	13.61
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	14,394.48	0.00
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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,420,920,153.19	73.21

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
基础材料	45,230,457.96	2.33
工业	142,152,655.82	7.32
地产业	191,858,672.08	9.89
合计	379,241,785.86	19.54

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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

金额单位：人民币元

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	002078	太阳纸业	17,968,220	192,080,271.80	9.90
2	00688	中国海外发展	12,183,500	191,858,672.08	9.89

3	601668	中国建筑	32,595,125	187,096,017.50	9.64
4	600036	招商银行	4,553,736	149,180,391.36	7.69
5	600426	华鲁恒升	4,402,742	134,855,987.46	6.95
6	600153	建发股份	10,786,200	117,677,442.00	6.06
7	601398	工商银行	23,838,900	114,903,498.00	5.92
8	00390	中国中铁	20,249,000	96,519,624.51	4.97
9	002032	苏泊尔	1,911,410	95,570,500.00	4.92
10	601000	唐山港	24,205,463	85,445,284.39	4.40
11	000333	美的集团	1,295,529	76,332,568.68	3.93
12	600486	扬农化工	869,447	76,007,056.74	3.92
13	600585	海螺水泥	2,843,007	67,492,986.18	3.48
14	600060	海信视像	2,390,200	59,157,450.00	3.05
15	600176	中国巨石	3,577,800	50,661,648.00	2.61
16	00753	中国国航	8,870,000	45,633,031.31	2.35
17	03323	中国建材	10,178,000	45,230,457.96	2.33
18	002064	华峰化学	1,897,700	13,018,222.00	0.67
19	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
20	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
21	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
22	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
23	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
24	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
25	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
26	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
27	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
28	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
29	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
30	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
31	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
32	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
33	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00

34	688472	阿特斯	1,392	23,719.68	0.00
35	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
36	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
37	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
38	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
39	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
40	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
41	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
42	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
43	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
44	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
45	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
46	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
47	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
48	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
49	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
50	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
51	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
52	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
53	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
54	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
55	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
56	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
57	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
58	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
59	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
60	688484	南芯科技	138	5,065.98	0.00
61	688433	华曙高科	149	4,693.50	0.00
62	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
63	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
64	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00

65	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
66	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
67	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
68	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
69	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	275,513,992.46	14.20
2	002078	太阳纸业	262,256,797.27	13.51
3	00688	中国海外发展	254,403,765.39	13.11
4	600426	华鲁恒升	184,822,057.76	9.52
5	600036	招商银行	182,673,029.53	9.41
6	600153	建发股份	174,342,778.66	8.98
7	601398	工商银行	146,721,351.00	7.56
8	002032	苏泊尔	122,433,253.18	6.31
9	00390	中国中铁	114,966,773.96	5.92
10	601000	唐山港	106,835,440.63	5.50
11	600486	扬农化工	104,454,939.05	5.38
12	000333	美的集团	102,331,653.87	5.27
13	600585	海螺水泥	91,948,369.05	4.74
14	000002	万科A	88,731,822.06	4.57
15	02202	万科企业	87,311,453.13	4.50
16	00914	海螺水泥	86,296,897.80	4.45
17	600176	中国巨石	75,706,761.76	3.90
18	03323	中国建材	69,427,174.22	3.58
19	00753	中国国航	66,334,698.93	3.42

20	600060	海信视像	49,425,672.00	2.55
----	--------	------	---------------	------

注："买入金额"按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	97,073,885.00	5.00
2	000002	万科A	84,950,627.55	4.38
3	00914	海螺水泥	81,731,474.68	4.21
4	02202	万科企业	81,288,021.05	4.19
5	601398	工商银行	48,143,046.00	2.48
6	601000	唐山港	46,205,770.50	2.38
7	00390	中国中铁	44,574,814.00	2.30
8	000333	美的集团	36,913,782.20	1.90
9	00688	中国海外发展	36,148,032.90	1.86
10	600153	建发股份	35,897,098.00	1.85
11	002078	太阳纸业	34,245,888.17	1.76
12	600426	华鲁恒升	23,152,533.88	1.19
13	600176	中国巨石	18,768,978.00	0.97
14	002032	苏泊尔	15,292,662.00	0.79
15	600036	招商银行	12,615,564.60	0.65
16	00753	中国国航	10,601,696.26	0.55
17	600486	扬农化工	10,228,741.00	0.53
18	600060	海信视像	7,851,988.00	0.40
19	600585	海螺水泥	3,246,400.00	0.17
20	03323	中国建材	1,969,285.84	0.10

注："卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,668,676,342.71
卖出股票收入（成交）总额	739,570,745.18

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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。

7.12.2 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。

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	应收清算款	-
3	应收股利	6,804,820.27
4	应收利息	-
5	应收申购款	433,674.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,238,494.87

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
中泰元和价值精选混合A	15,198	102,705.74	67,759,695.25	4.34%	1,493,162,191.40	95.66%
中泰元和价值精	6,055	78,930.83	21,153,605.68	4.43%	456,772,562.98	95.57%

选混合C						
合计	21,253	95,932.25	88,913,300.93	4.36%	1,949,934,754.38	95.64%

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	中泰元和价值精选混合A	708,664.51	0.05%
	中泰元和价值精选混合C	400,306.70	0.08%
	合计	1,108,971.21	0.05%

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	中泰元和价值精选混合A	0
	中泰元和价值精选混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中泰元和价值精选混合A	0
	中泰元和价值精选混合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

	中泰元和价值精选混合 A	中泰元和价值精选混合 C
基金合同生效日(2023年02月17日)基金份额总额	1,684,171,637.36	534,282,051.02
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	23,674,498.69	3,400,656.25
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	146,924,249.40	59,756,538.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,560,921,886.65	477,926,168.66

§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、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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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	
东方证券	2	3,400,239,105.89	100.00%	2,543,214.62	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

本基金本报告期内未通过证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	中泰元和价值精选混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、中国证监会规定网站	2023-02-18
2	中泰元和价值精选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	中国证券报、中国证监会规定网站	2023-05-15
3	关于中泰元和价值精选混合型证券投资基金开展直销渠道申购费率优惠活动的公告	中国证券报、中国证监会规定网站	2023-05-15

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中泰元和价值精选混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰元和价值精选混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《中泰元和价值精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰元和价值精选混合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。

11.2 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。

11.3 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
二〇二三年八月二十九日