

中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	9
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	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	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	45
7.1	期末基金资产组合情况	45
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12	投资组合报告附注	53
§ 8	基金份额持有人信息	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54

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.....	55
§ 9 开放式基金份额变动.....	55
§ 10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§ 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	中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中泰开阳价值优选混合	
基金主代码	007549	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年09月06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	1,151,511,463.75份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰开阳价值优选混合A	中泰开阳价值优选混合C
下属分级基金的交易代码	007549	011437
报告期末下属分级基金的份额总额	881,863,502.38份	269,647,961.37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	基金管理人主要采取自下而上的选股策略，通过财务数据的定量分析筛选可选标的以提升选股效率，再通过对企业核心竞争力、竞争格局、竞争优势、盈利模式等定性分析精选个股，深入研究、多方验证、持续跟踪，力争在控制风险的前提下获得可观收益。在选择个股时，主要关注两类标的，一是估值具有足够安全边际、竞争优势明确的白马股，二是估值合理具有明确成长性的成长股。
业绩比较基准	中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率

	× 40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益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	李申
	联系电话	021-20521199	021-60637102
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-821-0808	021-60637111
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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	中泰开阳价值优选混合A	中泰开阳价值优选混合C
本期已实现收益	94,240,174.05	18,571,938.28
本期利润	124,749,287.03	16,553,005.58
加权平均基金份额本期利润	0.2867	0.1609
本期加权平均净值利润率	13.84%	7.55%
本期基金份额净值增长率	19.52%	16.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	中泰开阳价值优选混合A	中泰开阳价值优选混合C
期末可供分配利润	660,729,748.27	201,319,533.96
期末可供分配基金份额利润	0.7492	0.7466
期末基金资产净值	1,919,402,668.81	586,193,432.86
期末基金份额净值	2.1765	2.1739
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	中泰开阳价值优选混合A	中泰开阳价值优选混合C
基金份额累计净值增长率	117.65%	16.88%

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）。

4、本基金自2021年2月1日起增加C类基金份额。

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

中泰开阳价值优选混合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	-0.58%	0.78%	-0.78%	0.46%	0.20%	0.32%
过去三个月	7.26%	0.92%	3.02%	0.53%	4.24%	0.39%
过去六个月	19.52%	1.19%	1.50%	0.73%	18.02%	0.46%
过去一年	68.46%	1.21%	13.75%	0.77%	54.71%	0.44%
自基金合同 生效起至今	117.65%	1.22%	20.20%	0.77%	97.45%	0.45%

中泰开阳价值优选混合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	-0.61%	0.78%	-0.78%	0.46%	0.17%	0.32%
过去三个月	7.16%	0.92%	3.02%	0.53%	4.14%	0.39%
自基金合同 生效起至今	16.88%	1.16%	0.25%	0.71%	16.63%	0.45%

本基金自 2021 年 2 月 1 日起增设 C 类基金份额。上表中 C 类基金份额净值表现相关数据均为 2021 年 2 月 1 日以来的数据。

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

中泰开阳价值优选混合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

(2019年09月06日-2021年06月30日)



中泰开阳价值优选混合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

(2021年02月01日-2021年06月30日)



本基金自 2021 年 2 月 1 日起增设 C 类基金份额。上表中 C 类基金份额净值表现相关数据均为 2021 年 2 月 1 日以来的数据。

§ 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		
田瑀	本基金基金经理；中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金基金经理；中泰星宇价值成长一年封闭运作混合型证券投资基金经理；基金业务部副总经理。	2019-09-06	-	9	国籍：中国。学历：复旦大学原子与分子物理专业硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任安信基金管理有限责任公司研究员、投资经理。2016年4月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司权益投资部任高级

					投资经理、现任基金业务部副总经理。2019年4月19日至2021年3月22日期间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日起至今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。2021年6月2日起至今担任中泰星宇价值成长一年封闭运作混合型证券投资基金基金经理。
姜诚	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；基金业务部总经理。	2019-09-06	2021-03-22	15	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；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；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日至今担任中泰星元灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年3月20日至今担任中泰玉衡价值优选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期持有期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合规守信情况的说明

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

2021年上半年市场整体波动较大，市场结构性的分化在一季度出现了较大幅度的收敛后再度放大，表现的板块和前期较为一致。目前市场的主要关注点逐步由宏观环境及货币政策转移到了产业发展的结构性分化，短期高景气的赛道再度遭到追捧，同时新冠变种病毒对于整体免疫情况的挑战也对市场造成了一定的波动。2021年上半年，二季度仓位相对于一季度有了一些下降，这是由于我们所持有的一些品种上涨幅度较大，同时有些个股经历了一些基本面的变化，我们经过价值再评估后也作出了相应的调整，但我们整体的仓位仍处于较高的位置，这一定程度上可以反映目前市场符合我们标准的标的大多处于我们认为较为合理的位置，以长期风险报酬比来衡量买入卖出的决策是我们一直以来坚守的基本原则，未来也仍将如此。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末中泰开阳价值优选混合A基金份额净值为2.1765元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为19.52%，同期业绩比较基准收益率为1.50%；截至报告期末中泰开阳价值优选混合C基金份额净值为2.1739元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为16.88%，同期业绩比较基准收益率为0.25%（C类份额净值数据计算时间段为2021年2月1日至2021年6月30日）。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

针对目前的市场来说，我们的长期观点没有任何变化，我们是乐观的，特别是中国的情况可能要更加好一些，在某些领域的扩张上，可能进入了加速期，我们筛选出的很多行业具有护城河的公司都在我们预期的发展道路上，虽然有些经历了短期利润层面的波动，但是在护城河的层面，让我们看到了很多积极的变化，我们是乐于看到这样的局面的，因为这会给我们的组合带来长期的较为确定的回报。短期而言，未来的财政政策、货币政策以及国际环境可能会出现一些变化，市场的波动可能会加大。

在对于组合波动的控制，我们仍然诉诸风险源多样化这个工具，在风格上较为均衡，这是我们对风险源管理的原则，未来我们仍将坚持风险源的多样性，构建均衡的组合。

反观我们的组合，我们仍然较有信心，组合的估值水平所对应的长期回报率仍然可观，我们将对所持有品种进行持续的深入跟踪，同时不断的寻找新的机会，不断的去做组合的再平衡。

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、投资管理人负责人、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，本基金未实施利润分配。

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

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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金

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	353,463,989.96	49,381,499.50
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,804,529,929.39	368,052,996.01
其中：股票投资		1,804,529,929.39	368,052,996.01
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	402,301,005.75	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	107,088.70	5,911.02
应收股利		-	-
应收申购款		16,817,834.10	358,499.27
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,577,219,847.90	417,798,905.80
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		67,912,801.47	2,333,171.55
应付管理人报酬		2,910,754.47	510,003.58
应付托管费		485,125.76	85,000.60
应付销售服务费		183,864.80	-
应付交易费用	6.4.7.6	-	-
应交税费		10,174.86	47.21
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	121,024.87	183,506.08
负债合计		71,623,746.23	3,111,729.02
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	1,151,511,463.75	227,707,806.41
未分配利润	6.4.7.9	1,354,084,637.92	186,979,370.37
所有者权益合计		2,505,596,101.67	414,687,176.78
负债和所有者权益总计		2,577,219,847.90	417,798,905.80

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额1,151,511,463.75份，其中中泰开阳价值优选混合A类份额881,863,502.38份，中泰开阳价值优选混合C类份额269,647,961.37份。A类份额净值2.1765元，C类份额净值2.1739元。

6.2 利润表

会计主体：中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金

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01日至202 0年06月30日
一、收入		154,328,071.23	15,097,895.87
1. 利息收入		957,496.77	89,608.68
其中：存款利息收入	6.4.7.10	566,984.75	39,083.92
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		390,512.02	50,524.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		121,560,871.83	20,758,704.28
其中：股票投资收益	6.4.7.11	107,702,840.06	19,300,285.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
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	13,858,031.77	1,458,418.76
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	28,490,180.28	-6,046,361.51
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	3,319,522.35	295,944.42
减：二、费用		13,025,778.62	1,490,431.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	7,924,100.76	865,218.57
2. 托管费	6.4.10.2.	1,320,683.47	144,203.05

	2		
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	350, 044. 57	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 17	3, 337, 820. 86	387, 631. 99
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1, 405. 84	181. 91
7. 其他费用	6. 4. 7. 18	91, 723. 12	93, 195. 85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		141, 302, 292. 61	13, 607, 464. 50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		141, 302, 292. 61	13, 607, 464. 50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金

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）	227, 707, 806. 41	186, 979, 370. 37	414, 687, 176. 78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	141, 302, 292. 61	141, 302, 292. 61
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）	923, 803, 657. 34	1, 025, 802, 974. 94	1, 949, 606, 632. 28
其中：1. 基金申购款	1, 353, 153, 991. 70	1, 496, 785, 815. 49	2, 849, 939, 807. 19

2. 基金赎回款	-429,350,334.36	-470,982,840.55	-900,333,174.91
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）	1,151,511,463.75	1,354,084,637.92	2,505,596,101.67
项 目	上年度可比期间 2020年01月01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）	156,723,192.89	16,589,250.73	173,312,443.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,607,464.50	13,607,464.50
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）	-83,359,729.53	-8,775,384.33	-92,135,113.86
其中：1. 基金申购款	41,302,662.25	5,895,070.59	47,197,732.84
2. 基金赎回款	-124,662,391.78	-14,670,454.92	-139,332,846.70
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）	73,363,463.36	21,421,330.90	94,784,794.26

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

中泰开阳价值优选灵活配置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[2019]1007号《关于准予中泰开阳价值优选灵活配置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《中泰开阳价值优选灵活配置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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币296,644,749.69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(2019)第0523号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2019年9月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为296,656,344.89份基金份额,其中认购资金利息折合11,595.20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。

2021年2月1日,本基金增加C类基金份额,原份额转为A类基金份额。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《中泰开阳价值优选灵活配置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(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(含国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换公司债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债等)、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相关规定。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。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%;本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计

不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×60%+ 中债综合指数收益率×40%。

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》、《中泰开阳价值优选灵活配置混合型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	300,307,254.30
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	53,156,735.66
合计	353,463,989.96

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		1,739,684,876.16	1,804,529,929.39	64,845,053.23
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		1,739,684,876.16	1,804,529,929.39	64,845,053.23

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	402,301,005.75	-
银行间市场	-	-
合计	402,301,005.75	-

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	32,819.49
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	47,826.77
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	26,442.44
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	107,088.70

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	31,439.32
预提费用	89,260.15
其他应付	325.40
合计	121,024.87

6.4.7.8 实收基金

6.4.7.8.1 中泰开阳价值优选混合A

金额单位：人民币元

项目 (中泰开阳价值优选混合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	227,707,806.41	227,707,806.41
本期申购	951,501,463.01	951,501,463.01
本期赎回（以“-”号填列）	-297,345,767.04	-297,345,767.04
本期末	881,863,502.38	881,863,502.38

6.4.7.8.2 中泰开阳价值优选混合C

金额单位：人民币元

项目 (中泰开阳价值优选混合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	-	-
本期申购	401,652,528.69	401,652,528.69
本期赎回（以“-”号填列）	-132,004,567.32	-132,004,567.32
本期末	269,647,961.37	269,647,961.37

6.4.7.9 未分配利润

6.4.7.9.1 中泰开阳价值优选混合A

单位：人民币元

项目 (中泰开阳价值优选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	120,724,878.98	66,254,491.39	186,979,370.37
本期利润	94,240,174.05	30,509,112.98	124,749,287.03
本期基金份额交易产生的变动数	445,764,695.24	280,045,813.79	725,810,509.03
其中：基金申购款	651,162,081.53	398,024,396.73	1,049,186,478.26
基金赎回款	-205,397,386.29	-117,978,582.94	-323,375,969.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	660,729,748.27	376,809,418.16	1,037,539,166.43

6.4.7.9.2 中泰开阳价值优选混合C

单位：人民币元

项目 (中泰开阳价值优选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	18,571,938.28	-2,018,932.70	16,553,005.58
本期基金份额交易产生的变动数	182,747,595.68	117,244,870.23	299,992,465.91
其中：基金申购款	275,052,545.15	172,546,792.08	447,599,337.23
基金赎回款	-92,304,949.47	-55,301,921.85	-147,606,871.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	201,319,533.96	115,225,937.53	316,545,471.49

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	130,269.24
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	436,715.51
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	566,984.75

6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	861,272,548.45
减：卖出股票成本总额	753,569,708.39
买卖股票差价收入	107,702,840.06

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	13,858,031.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,858,031.77

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	28,490,180.28

——股票投资	28,490,180.28
——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	28,490,180.28

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	3,314,815.77
转换费收入	4,706.58
合计	3,319,522.35

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	3,337,820.86
银行间市场交易费用	—
合计	3,337,820.86

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	2,462.97
合计	91,723.12

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

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

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01日至2020年06月30日
-------	-------------------------------	------------------------------------

	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中泰证券	3,012,936,925.69	100.00%	260,233,785.18	100.00%

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01日至2020年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
中泰证券	4,236,600,000.00	100.00%	384,200,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 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	2,188,411.55	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01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	189,179.03	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01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,924,100.76	865,218.57
其中：支付销售机构的客户维护费	2,677,728.88	296,066.54

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,320,683.47	144,203.05

注：支付基金托管人中国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	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

名称	中泰开阳价值优选混合A	中泰开阳价值优选混合C	合计
中泰证券 (上海)资 产管理有 限公司	0.00	7,005.63	7,005.63
中泰证券 股份有限 公司	0.00	2,215.09	2,215.09
合计	0.00	9,220.72	9,220.72

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0.40%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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01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
建设银行	300,307,254.30	130,269.24	2,672,142.00	21,958.16
中泰证券	53,156,735.66	436,715.51	5,230,059.75	17,125.76

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。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

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年06月30日					
关联 方名 称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：张/股）	总金额
中泰 证券	688662. SH	富信科技	首次公开发行	2,556	39,899.16
中泰 证券	688663. SH	新风光	首次公开发行	3,279	47,479.92
中泰 证券	688383. SH	新益昌	首次公开发行	2,701	52,885.58
中泰 证券	605296. SH	神农集团	首次公开发行	569	31,909.52
中泰 证券	300996. SZ	普联软件	首次公开发行	2,410	50,152.10

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

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	可流通日	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
002372	伟星新材	2021-05- 28	2021-11- 29	大宗交易 流通受限	21.09	19.37	500,000	10,545,000.00	9,685,000.00	-

中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

688269	凯立新材	2021-06-01	2021-12-09	限售股	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688183	生益电子	2021-02-10	2021-08-25	限售股	12.42	14.19	12,998	161,435.16	184,441.62	-
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	限售股	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-
688097	博众精工	2021-04-29	2021-11-12	限售股	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	限售股	47.33	251.96	372	17,606.76	93,729.12	-
688628	优利德	2021-01-22	2021-08-02	限售股	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	限售股	24.60	163.00	485	11,931.00	79,055.00	-
688468	科美诊断	2021-03-31	2021-10-11	限售股	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	限售股	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	限售股	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	限售股	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	限售股	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	限售股	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2022-01-07	限售股	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	限售股	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	限售股	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	限售股	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	限售股	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	限售股	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	限售股	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	限售股	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	限售股	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	限售股	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	限售股	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	限售股	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	限售股	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	限售股	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	限售股	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	限售股	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	限售股	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	限售股	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	限售股	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	限售股	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	限售股	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	限售股	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	限售股	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	限售股	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	限售股	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	限售股	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	限售股	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	限售股	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	限售股	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-

中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	限售股	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	限售股	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	限售股	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	限售股	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	限售股	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	限售股	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	限售股	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	限售股	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	限售股	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	限售股	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	限售股	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	限售股	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	限售股	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	限售股	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	限售股	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	限售股	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	限售股	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	限售股	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	限售股	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	限售股	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	限售股	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

5、以上可流通日的日期为预估日期，实际流通日期以上市公司公告为准。

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，除卖出回购金融资产将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约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，因此账面余额约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和买入返售金融资产等。

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	353,463,989.96	-	-	-	-	-	353,463,989.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,804,529,929.39	1,804,529,929.39
买入返售金融资产	402,301,005.75	-	-	-	-	-	402,301,005.75
应收利息	-	-	-	-	-	107,088.70	107,088.70

中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

应收申购款	-	-	-	-	-	16,817,834.10	16,817,834.10
资产总计	755,764,995.71	-	-	-	-	1,821,454,852.19	2,577,219,847.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	67,912,801.47	67,912,801.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,910,754.47	2,910,754.47
应付托管费	-	-	-	-	-	485,125.76	485,125.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	183,864.80	183,864.80
应交税费	-	-	-	-	-	10,174.86	10,174.86
其他负债	-	-	-	-	-	121,024.87	121,024.87
负债总计	-	-	-	-	-	71,623,746.23	71,623,746.23
利率敏感度缺口	755,764,995.71	-	-	-	-	1,749,831,105.96	2,505,596,101.67
上年度末 2020年12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	49,381,499.50	-	-	-	-	-	49,381,499.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	368,052,996.01	368,052,996.01
应收利息	-	-	-	-	-	5,911.02	5,911.02
应收申购款	-	-	-	-	-	358,499.27	358,499.27
资产总计	49,381,499.50	-	-	-	-	368,417,406.30	417,798,905.80
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,333,171.55	2,333,171.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	510,003.58	510,003.58
应付托管费	-	-	-	-	-	85,000.60	85,000.60
应交税费	-	-	-	-	-	47.21	47.21
其他负债	-	-	-	-	-	183,506.08	183,506.08
负债总计	-	-	-	-	-	3,111,729.02	3,111,729.02
利率敏感度缺口	49,381,499.50	-	-	-	-	365,305,677.28	414,687,176.78

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。

基金管理人主要采取自下而上的选股策略，通过财务数据的定量分析筛选可选标的以提升选股效率，再通过对企业核心竞争力、竞争格局、竞争优势、盈利模式等定性分析精选个股，深入研究、多方验证、持续跟踪，力争在控制风险的前提下获得可观收益。

本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%-95%；本基金保持不低于基金资产净值的5%的现金或者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 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 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,804,529,929.39	72.02	368,052,996.01	88.75
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	1,804,529,929.39	72.02	368,052,996.01	88.75

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	比较基准上升5%	84,257,256.60	17,528,995.27
	比较基准下降5%	-84,257,256.60	-17,528,995.27

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1,793,039,696.33元，属于第二层次的余额为11,490,233.06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366,980,225.97元，第二层次的余额为1,072,770.04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。

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。

(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	1,804,529,929.39	70.02
	其中：股票	1,804,529,929.39	70.02
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	402,301,005.75	15.61
	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	353,463,989.96	13.71
8	其他各项资产	16,924,922.80	0.66
9	合计	2,577,219,847.90	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

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,033,221,995.05	41.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	111,115,346.41	4.43
F	批发和零售业	46,404.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	305,567,953.36	12.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	253,691,727.89	10.13
J	金融业	34,721.10	0.00
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	44,438.33	0.00
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	100,783,032.00	4.02
S	综合	-	-
	合计	1,804,529,929.39	72.02

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

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	603444	吉比特	478,554	253,633,620.00	10.12
2	600176	中国巨石	16,338,843	253,415,454.93	10.11
3	603885	吉祥航空	16,431,101	250,738,601.26	10.01
4	002078	太阳纸业	18,121,596	241,923,306.60	9.66
5	002271	东方雨虹	2,183,928	120,814,896.96	4.82
6	600486	扬农化工	1,052,012	117,583,381.24	4.69
7	601117	中国化学	12,681,504	111,089,975.04	4.43
8	300144	宋城演艺	5,998,990	100,783,032.00	4.02
9	002332	仙琚制药	4,773,850	59,864,079.00	2.39
10	601100	恒立液压	661,806	56,862,371.52	2.27
11	601021	春秋航空	963,609	54,829,352.10	2.19
12	000661	长春高新	135,578	52,468,686.00	2.09
13	688196	卓越新能	848,918	50,238,967.24	2.01
14	002372	伟星新材	2,005,828	40,810,464.76	1.63
15	601677	明泰铝业	1,905,731	37,257,041.05	1.49
16	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
17	688183	生益电子	12,998	184,441.62	0.01
18	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.01
19	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.00
20	300957	贝泰妮	372	93,729.12	0.00
21	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.00
22	300985	致远新能	2,945	83,877.45	0.00
23	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
24	300919	中伟股份	485	79,055.00	0.00

25	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
26	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
27	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
28	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
29	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
30	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
31	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
32	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.00
33	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
34	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
35	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
36	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
37	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
38	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
39	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
40	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
41	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
42	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
43	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
44	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
45	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
46	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
47	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
48	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
49	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
50	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
51	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
52	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
53	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
54	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00

55	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
56	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
57	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
58	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
59	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
60	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
61	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
62	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
63	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
64	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
65	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
66	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
67	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
68	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
69	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
70	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
71	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
72	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
73	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
74	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
75	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
76	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
77	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
78	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
79	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
80	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
81	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
82	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
83	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
84	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00

85	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
86	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
87	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
88	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
89	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
90	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
91	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600176	中国巨石	266,736,190.10	64.32
2	002078	太阳纸业	260,907,611.54	62.92
3	603885	吉祥航空	226,304,169.35	54.57
4	603444	吉比特	191,435,225.60	46.16
5	600486	扬农化工	190,698,816.30	45.99
6	002304	洋河股份	121,421,012.88	29.28
7	002271	东方雨虹	105,025,855.29	25.33
8	300144	宋城演艺	96,806,984.29	23.34
9	000661	长春高新	75,155,187.65	18.12
10	601117	中国化学	74,942,189.81	18.07
11	300815	玉禾田	61,163,522.00	14.75
12	600660	福耀玻璃	54,526,383.36	13.15
13	601100	恒立液压	51,078,274.88	12.32
14	688196	卓越新能	48,687,943.26	11.74
15	601677	明泰铝业	37,924,969.85	9.15
16	601668	中国建筑	37,885,976.80	9.14
17	601021	春秋航空	37,554,473.07	9.06
18	002332	仙琚制药	33,659,589.34	8.12

19	002372	伟星新材	31,975,356.86	7.71
20	300809	华辰装备	31,313,487.00	7.55
21	601636	旗滨集团	28,271,465.32	6.82
22	603589	口子窖	25,001,445.00	6.03
23	600352	浙江龙盛	12,800,379.80	3.09
24	002912	中新赛克	9,220,203.89	2.22
25	002318	久立特材	8,958,878.00	2.16
26	600885	宏发股份	8,313,691.00	2.00

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	002304	洋河股份	159,131,075.07	38.37
2	300815	玉禾田	80,726,133.00	19.47
3	600486	扬农化工	68,457,473.24	16.51
4	600660	福耀玻璃	66,370,650.60	16.00
5	002271	东方雨虹	49,595,163.30	11.96
6	600176	中国巨石	42,884,100.70	10.34
7	300809	华辰装备	40,935,853.00	9.87
8	601668	中国建筑	37,932,115.64	9.15
9	601636	旗滨集团	30,730,497.46	7.41
10	603444	吉比特	29,431,395.88	7.10
11	601117	中国化学	29,002,514.00	6.99
12	603885	吉祥航空	28,573,492.54	6.89
13	603589	口子窖	25,996,436.00	6.27
14	002318	久立特材	18,607,394.10	4.49
15	000661	长春高新	18,329,104.00	4.42
16	601021	春秋航空	17,594,176.00	4.24
17	002311	海大集团	14,118,181.80	3.40

18	002372	伟星新材	12,996,089.75	3.13
19	600352	浙江龙盛	11,091,420.00	2.67
20	600885	宏发股份	9,617,097.00	2.32
21	002352	顺丰控股	9,004,246.18	2.17
22	002912	中新赛克	8,826,008.00	2.13

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	2,161,556,461.49
卖出股票收入（成交）总额	861,272,548.45

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 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	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	107,088.70
5	应收申购款	16,817,834.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	16,924,922.80

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
中泰开阳价值优选混合A	101,734	8,668.33	407,049,981.30	46.16%	474,813,521.08	53.84%
中泰开阳价值优选混合C	44,171	6,104.64	94,224,873.19	34.94%	175,423,088.18	65.06%
合计	145,905	7,892.20	501,274,854.49	43.53%	650,236,609.26	56.47%

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	中泰开阳价值优选混合A	6,491,295.90	0.7361%
	中泰开阳价值优选混合C	67,120.74	0.0249%
	合计	6,558,416.64	0.5695%

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	中泰开阳价值优选混合A	>100
	中泰开阳价值优选混合C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中泰开阳价值优选混合A	50~100
	中泰开阳价值优选混合C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰开阳价值优选混合A	中泰开阳价值优选混合C
基金合同生效日(2019年09月06日)基金份额总额	296,656,344.89	—
本报告期期初基金份额总额	227,707,806.41	—
本报告期基金总申购份额	951,501,463.01	401,652,528.69
减：本报告期基金总赎回份额	297,345,767.04	132,004,567.32
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	881,863,502.38	269,647,961.37

§ 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	3,012,936,925.69	100.00%	2,188,411.55	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	-	-	4,236,600,000.00	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	中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会规定网站	2021-01-21
2	中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定网站	2021-01-27
3	中泰开阳价值优选灵活配置混合型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	2021-01-27
4	中泰开阳价值优选灵活配置混合型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	2021-01-27
5	中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定网站	2021-01-27
6	关于中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金增设C类基金份额以及投资范围增加存托凭证并相应修订法律文件的公告	《证券日报》、中国证监会规定网站	2021-01-27
7	关于中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额新增部分销售机构的公告	《证券日报》、中国证监会规定网站	2021-01-29

8	中泰开阳价值优选灵活配置 混合型证券投资基金基金经 理变更公告	《证券日报》、中国证监会 规定网站	2021-03-25
9	中泰开阳价值优选灵活配置 混合型证券投资基金招募说 明书（更新）2021年第2号	中国证监会规定网站	2021-03-26
10	中泰证券（上海）资产管理 有限公司关于旗下部分基金 投资关联方承销期内承销证 券的公告	《证券日报》、中国证监会 规定网站	2021-03-26
11	中泰开阳价值优选灵活配置 混合型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	2021-03-26
12	中泰开阳价值优选灵活配置 混合型证券投资基金2020年 年度报告	中国证监会规定网站	2021-03-29
13	中泰证券（上海）资产管理 有限公司关于旗下部分基金 投资关联方承销期内承销证 券的公告	《证券日报》、中国证监会 规定网站	2021-04-07
14	中泰开阳价值优选灵活配置 混合型证券投资基金2021年 第1季度报告	中国证监会规定网站	2021-04-21
15	中泰证券（上海）资产管理 有限公司关于旗下部分基金 投资关联方承销期内承销证 券的公告	《证券日报》、中国证监会 规定网站	2021-04-22
16	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	《证券日报》、中国证监会 规定网站	2021-05-07
17	中泰证券（上海）资产管理	《证券日报》、中国证监会	2021-05-24

	有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定网站	
18	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《证券日报》、中国证监会规定网站	2021-05-27
19	关于中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额新增光大证券股份有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、中国证监会规定网站	2021-06-07
20	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投证券股份有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、中国证监会规定网站	2021-06-10
21	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销期内承销证券的公告	《证券日报》、中国证监会规定网站	2021-06-15
22	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金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	《证券日报》、中国证监会规定网站	2021-06-23

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰开阳价值优选灵活配置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、营业执照和公司章程；

6、报告期内中泰开阳价值优选灵活配置混合型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

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
二〇二一年八月二十七日