

同泰开泰混合型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：同泰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2020 年 3 月 31 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。本年度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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 20 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。

本报告期自 2019 年 8 月 28 日起至 2019 年 12 月 31 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.....	5
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
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.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 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
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.6 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

8.7 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
8.8 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	53
8.9 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	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12 投资组合报告附注	53
§ 9 基金份额持有人信息	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.3 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的情况	55
§ 10 开放式基金份额变动	56
§ 11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
11.2 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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8 其他重大事件	58
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	60
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 13 备查文件目录	61
13.1 备查文件目录	61
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	同泰开泰混合型证券投资基金	
基金简称	同泰开泰混合	
基金主代码	007770	
交易代码	007770	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 8 月 28 日	
基金管理人	同泰基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	136,083,210.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C
下属分级基金的交易代码:	007770	007771
报告期末下属分级基金的份额总额	99,112,936.38 份	36,970,273.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。
投资策略	本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过自上而下的分析，形成对不同大类资产市场的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定固定收益类资产、权益类资产和现金等的配置比例，并随着市场运行状况以及各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，力争有效控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价（总值）指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期平均风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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		同泰基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘文灿	李帅帅
	联系电话	0755-23537886	0755-25878287
	电子邮箱	liuwc@tongtaiamc.com	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-830-1666	95511-3
传真		0755-23537801	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城（南区）T2 栋 41 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		深圳市福田区华富街道莲花一	深圳市福田区益田路 5023 号平安

	村社区皇岗路 5001 号深业上城（南区）T2 栋 41 层	金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	518033	518001
法定代表人	马俊生	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.tongtaiamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼
注册登记机构	同泰基金管理有限公司	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 41 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2019 年 8 月 28 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日	
	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C
本期已实现收益	3,165,253.39	1,811,799.78
本期利润	9,375,657.07	2,679,628.10
加权平均基金份额本期利润	0.0651	0.0133
本期加权平均净值利润率	6.49%	1.33%
本期基金份额净值增长率	7.13%	6.90%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	
期末可供分配利润	2,744,693.23	944,284.74
期末可供分配基金份额利润	0.0277	0.0255
期末基金资产净值	106,179,038.96	39,522,678.43
期末基金份额净值	1.0713	1.0690
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	
基金份额累计净值增长率	7.13%	6.90%

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、对期末可供分配利润，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）。

3、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

4、本基金合同于 2019 年 8 月 28 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

同泰开泰混合 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
过去三个月	9.51%	0.88%	4.67%	0.44%	4.84%	0.44%
自基金合同生效起至今	7.13%	0.82%	4.57%	0.45%	2.56%	0.37%

同泰开泰混合 C

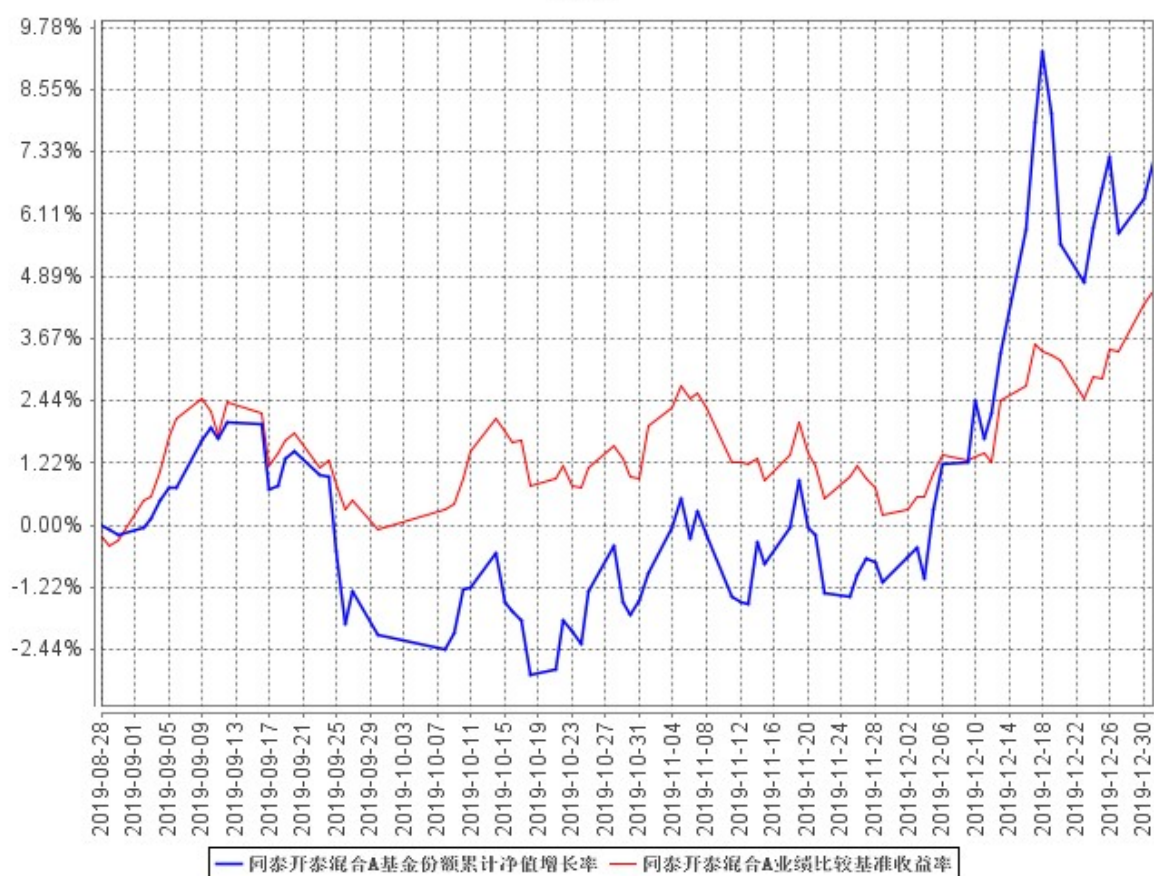
阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

	长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	收益率标准 差④		
过去三个月	9.32%	0.88%	4.67%	0.44%	4.65%	0.44%
自基金合同 生效起至今	6.90%	0.82%	4.57%	0.45%	2.33%	0.37%

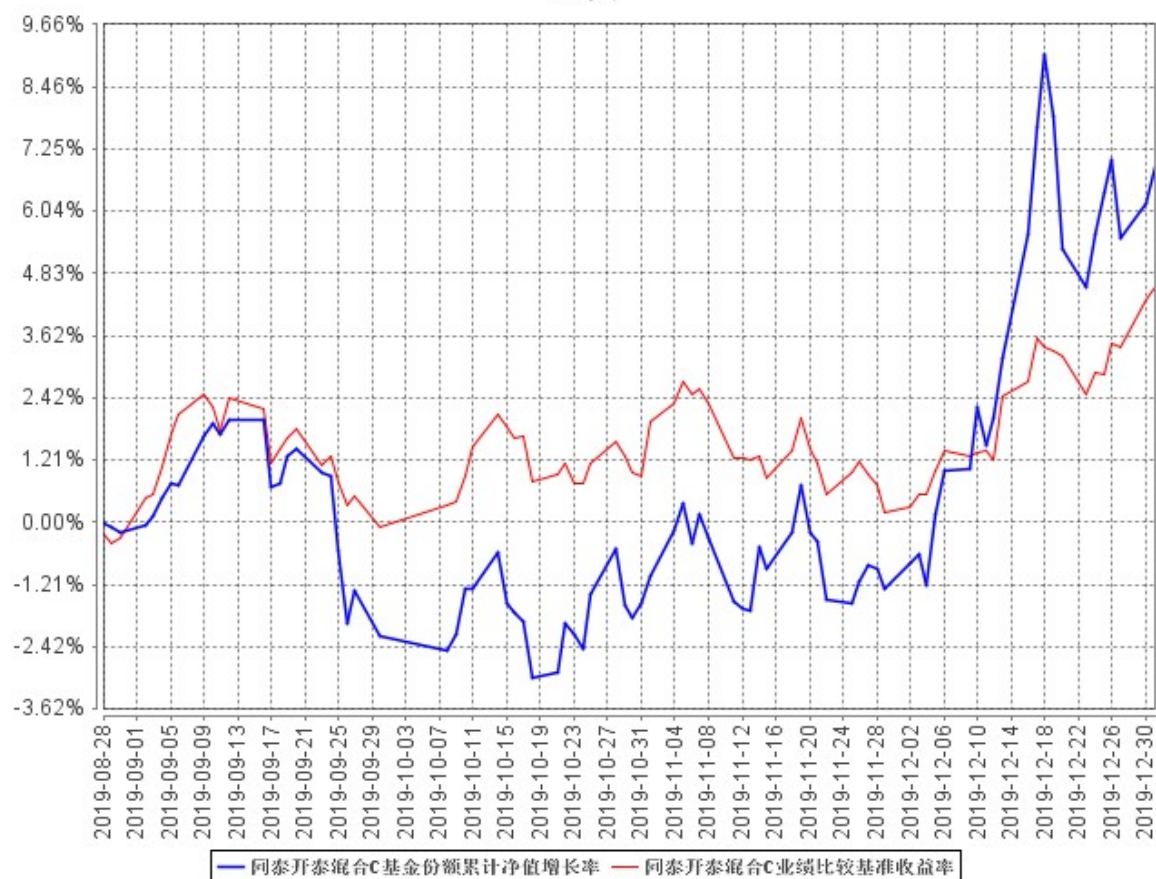
注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%，每日进行再平衡过程。

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

同泰开泰混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



同泰开泰混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

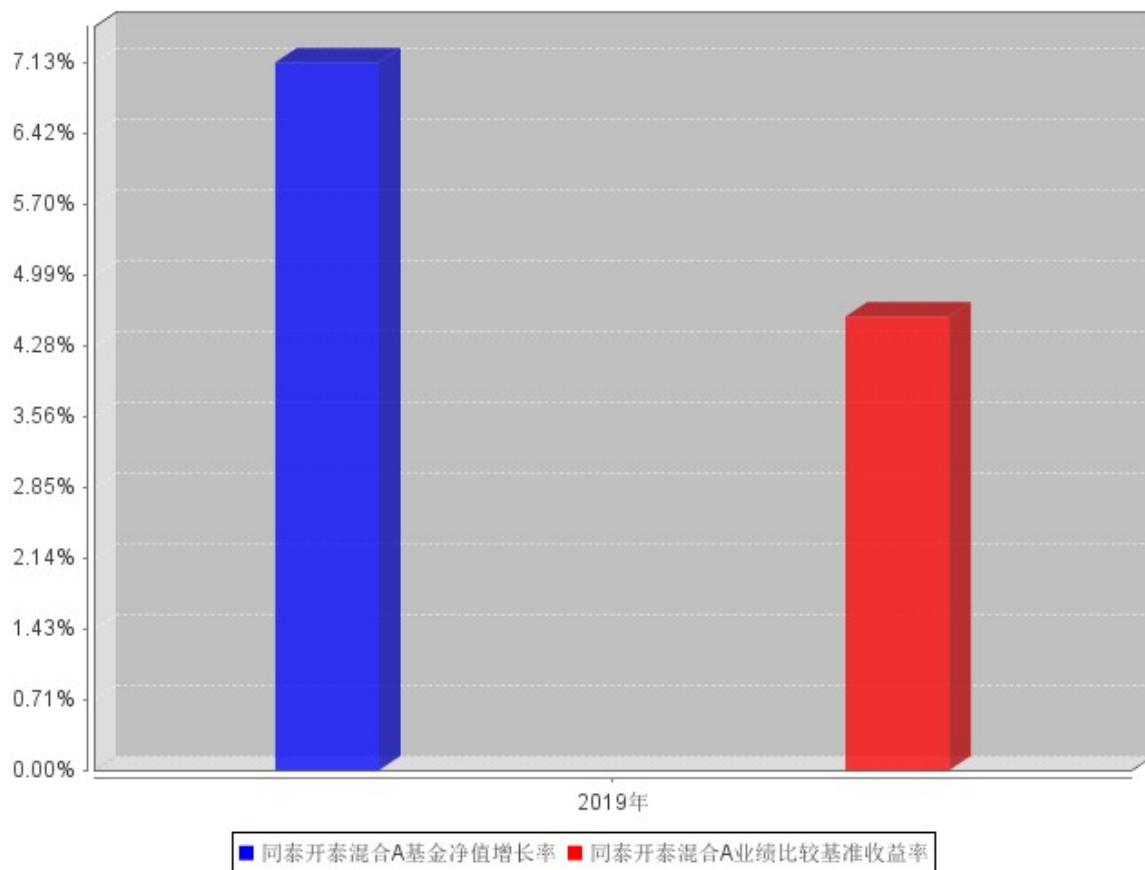


注：1、本基金合同生效日为 2019 年 8 月 28 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未滿 1 年。

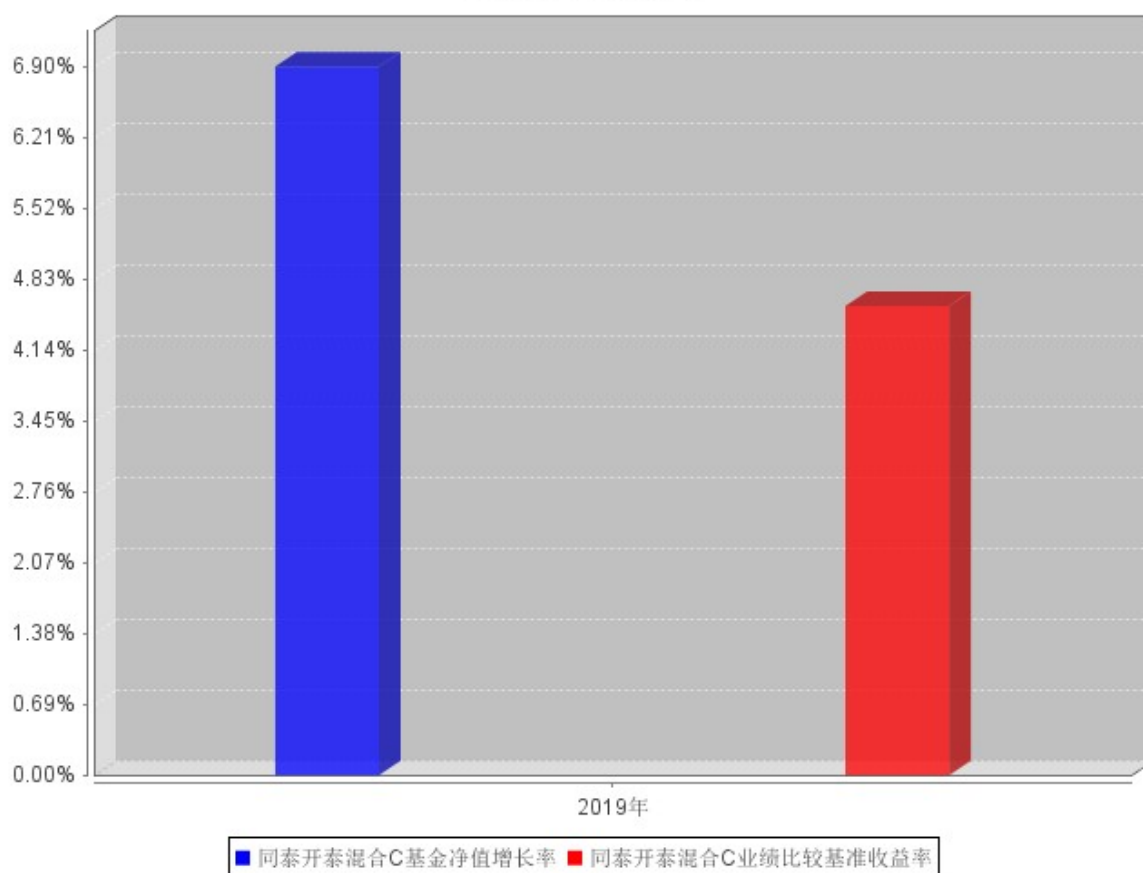
2、本基金建仓期为基金合同生效之日起的 6 个月，截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

同泰开泰混合A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



同泰开泰混合C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2019 年 8 月 28 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同生效日为 2019 年 8 月 28 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金未进行利润分配。

§ 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

本基金基金管理人为同泰基金管理有限公司，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[2018]1497号文批准设立，于2018年10月11日在深圳注册成立，注册资本1亿元人民币，并于2019年3月15日取得中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》。目前，公司股东及其出资比例为：刘文灿先生38.2%，刘韞芬女士32%，上海蓝尚投资管理中心（有限合伙）20%，马俊生先生4.9%，王雪梅女士4.9%。截止本报告期末，本基金管理人共管理了4只开放式基金。

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		
杨喆	同泰开泰混合、同泰慧盈混合基金经理、投资研究部总监	2019年8月28日	-	17	杨喆先生，中国国籍，硕士。2001年9月至2005年8月任国富投资管理有限公司研究员；2005年8月至2006年4月任瑞泰人寿股份有限公司投资经理；2006年5月至2014年12月先后任中信证券股份有限公司研究员、策略组负责人、投资主办人；2014年12月至2019年6月任银河金汇证券资产管理有限公司权益及量化投资部总经理、研究部总经理、投资主办人。
高春梅	本基金的基金经理	2019年8月28日	-	7	高春梅女士，中国国籍，硕士。2007年8月至2010年8月任君维诚信信用评估有限公司项目经理；2010年9月至2012年7月于北京大学光华管理学院攻读全

					日制硕士；2012 年 8 月至 2014 年 4 月任生命保险资产管理有限公司信用研究员；2014 年 4 月至 2014 年 8 月任平安证券股份有限公司信用研究员；2014 年 9 月至 2018 年 8 月先后任东莞证券股份有限公司信用研究员、投资经理助理、债券投资经理。
--	--	--	--	--	--

1、上表“任职日期”均为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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，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，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《同泰基金管理有限公司公平交易管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且不存在其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

本基金成立于 2019 年 8 月 28 日，权益投资范围是全市场配置，不局限于特定的行业与风格。管理人通过对宏观经济、政策、产业、上市公司的分析，先进行大类资产配置，再细化管理股票、债券的组合，力争实现超越比较基准的收益。

2019 年 8 月下旬到年底，经济基本面数据偏弱但体现了足够的韧性，宏观政策不断发力进行逆周期调节，力争实现“六个稳”的目标。经济局部不乏结构与细分行业的亮点，上市公司整体盈利水平逐季度趋稳，部分行业营收与利润水平开始回升。债市受到宏观数据和货币政策的影响，在 10 月底附近结束调整，开始持续走强。

股市全年经历了“冲高回落-横盘震荡-再上行”三个阶段，本基金经历了后两个阶段。在本基金成立后的数月之内是股指的横盘过程，本基金多数时间保持了股债均衡的配置，12 月逐步提高股票仓位、降低固收资产权重。权益投资重点配置了电子、通讯、基建装备、建材、金融、化工等，贡献了一定的净收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰开泰混合 A 基金份额净值为 1.0713 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.13%，同期业绩比较基准收益率为 4.57%；截至本报告期末同泰开泰混合 C 基金份额净值为 1.0690 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.90%，同期业绩比较基准收益率为 4.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年 1 月开始，新冠疫情逐渐对全球资本市场和宏观经济都产生了显著影响，股、债、汇、商品市场剧烈波动。国内经济本已在去库存的末段，但疫情会对补库存周期的开始带来一定延缓，随着宏观政策保持逆周期调节、货币稳健偏宽松、财政政策积极，我们预期几个月之后国内经济依然会进入温和补库存周期，在国际经济体中体现更好的韧性和长期发展空间。权益市场有持续的结构性的机会，固收市场有阶段性机会。中长期看，国内经济可能保持相对平缓增长，波幅较低。随着资本市场改革的深化，资本市场战略定位将进一步提升；融资政策的放宽也会让资源配置的效率更高，真正优秀的公司通过融资实现快速发展。

2020 年权益机会至少来自两方面：一方面看中观，部分景气反转上行、技术升级与突破、新

技术导致供给创造了需求的行业会有不错的机会，如 5G 投资与消费电子产品、内容消费、传媒、新能源车、线上教育与办公等；一方面是库存周期温和复苏、竞争结构不错的行业低估值修复、长线国内外资金配置型总量积累带来的低估值与行业龙头股的再定价机会。本基金将持续关注这些领域，对组合进行动态管理，尽量获取更多收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，在公司业务发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，致力于合规与内控机制的建立健全，积极推动主动合规风控管理，加强业务风险的控制与防范，确保各项法规政策和公司管理制度的落实，保障公司各项业务的合法合规。

（一）落实法律法规，培养合规文化

一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法。二是继续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等专项培训和员工合规测试等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和 risk 的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效的得到落实。

（二）建立制度机制，提高运作效率

一是建立健全制度体系。报告期为基金管理人及基金正式运作的第一年，公司积极贯彻落实法律法规和监管要求，结合公司业务发展实际情况，进行各项公司制度、流程的制定、更新和完善，建立了较为完善的公司内控制度体系。二是建立全流程合规风控机制。（1）严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。（2）严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性。公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工控制。（3）及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决。通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内。

（三）开展稽核审计，强化风险管理

通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改

进情况，向监管机构报送监察稽核报告。二是针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算岗与基金托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程；监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期末未实施利润分配。

4.9 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

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满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，平安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。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字（2020）第 1408 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	同泰开泰混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了同泰开泰混合型证券投资基金（以下简称“同泰开泰混合基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表、基金净值变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附同泰开泰混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《同泰开泰混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了同泰开泰混合基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于同泰开泰混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系同泰开泰混合基金管理人同泰基金管理有限公司（以下简称“管理人”）管理层根据《同泰开泰混合型证券</p>

	<p>投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人管理层提供同泰开泰混合基金份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用（如需），不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人管理层对其他信息负责。其他信息包括同泰开泰混合基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理人管理层负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《同泰开泰混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理人管理层负责评估同泰开泰混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>管理人治理层负责监督同泰开泰混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p>

	<p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>3、评价管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>4、对管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对同泰开泰混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致同泰开泰混合基金不能持续经营。</p> <p>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理人治理层就同泰开泰混合基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	杨小磊 杨桂丽
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 层
审计报告日期	2020 年 3 月 20 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：同泰开泰混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	13,512,968.20
结算备付金		3,711,771.77
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	133,393,758.95
其中：股票投资		127,667,922.16
基金投资		-
债券投资		5,725,836.79
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	152,266.71
应收股利		-
应收申购款		139,592.22
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		150,910,357.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		4,805,965.39
应付管理人报酬		258,403.48
应付托管费		34,453.79
应付销售服务费		25,638.80
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		936.59
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	83,242.41
负债合计		5,208,640.46
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	136,083,210.27
未分配利润	7.4.7.10	9,618,507.12
所有者权益合计		145,701,717.39
负债和所有者权益总计		150,910,357.85

注：1、报告截止日 2019 年 12 月 31 日，同泰开泰混合 A 基金份额净值 1.0713 元，基金份额总额 99,112,936.38 份；同泰开泰混合 C 基金份额净值 1.0690 元，基金份额总额 36,970,273.89 份。同泰开泰混合份额总额合计为 136,083,210.27 份。

2、本基金合同生效日为 2019 年 8 月 28 日，2019 年度实际报告期间为 2019 年 8 月 28 日至 2019 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：同泰开泰混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 8 月 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2019 年 8 月 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		15,879,044.57
1.利息收入		1,857,035.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	137,513.19
债券利息收入		825,627.09
资产支持证券利息收入		261,996.73
买入返售金融资产收入		631,897.99
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,709,934.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,673,553.40
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	125,962.83
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-239,051.84
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-275,780.00
股利收益	7.4.7.16	425,250.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7,078,232.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	233,843.18
减：二、费用		3,823,759.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,820,140.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	242,685.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	286,745.04
4. 交易费用	7.4.7.19	1,394,492.75
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3,296.01
7. 其他费用	7.4.7.20	76,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,055,285.17
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,055,285.17

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：同泰开泰混合型证券投资基金

本报告期：2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31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）	506,717,319.90	-	506,717,319.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,055,285.17	12,055,285.17
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）	-370,634,109.63	-2,436,778.05	-373,070,887.68
其中：1. 基金申购款	8,459,883.29	360,311.48	8,820,194.77
2. 基金赎回款	-379,093,992.92	-2,797,089.53	-381,891,082.45
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）	136,083,210.27	9,618,507.12	145,701,717.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>马俊生</u>	<u>马俊生</u>	<u>刘韞芬</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

同泰开泰混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1334号《关于准予同泰开泰混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人同泰基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2019年8月28日正式生效，首次设立募集规模为506,717,319,90份基金份额。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为同泰基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券正逆回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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）。

股票资产占基金资产的比例为50%-95%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中债综合全价（总值）指数收益率×40%。

7.4.2 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》、《同泰开泰混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2019 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

7.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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的控制。

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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）。

7.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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。

7.4.4.10 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逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的相关交易费用在发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他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。

其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额计入当期费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	494,858.24
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	13,018,109.96
合计：	13,512,968.20

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	120,579,808.16	127,667,922.16	7,088,114.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,735,718.79	5,725,836.79
	银行间市场	-	-
	合计	5,735,718.79	5,725,836.79
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	126,315,526.95	133,393,758.95	7,078,232.00

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应收活期存款利息	126.49
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,157.09
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	150,983.13
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	152,266.71

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,242.41
预提费用	76,000.00

合计	83,242.41
----	-----------

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

同泰开泰混合 A		
项目	本期 2019 年 8 月 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	157,781,887.84	157,781,887.84
本期申购	5,728,865.79	5,728,865.79
本期赎回 (以“-”号填列)	-64,397,817.25	-64,397,817.25
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	99,112,936.38	99,112,936.38

金额单位：人民币元

同泰开泰混合 C		
项目	本期 2019 年 8 月 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	348,935,432.06	348,935,432.06
本期申购	2,731,017.50	2,731,017.50
本期赎回 (以“-”号填列)	-314,696,175.67	-314,696,175.67
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	36,970,273.89	36,970,273.89

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额；

(2) 本基金自 2019 年 8 月 1 日至 2019 年 8 月 23 日止期间公开发售。同泰开泰混合 A 类基金份额已收到首次募集的有效净认购资金 157,735,181.50 元，折合 157,735,181.50 份 A 类基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 46,706.34 元，折合 46,706.34 份 A 类基金份额；以上收到的实收认购款共计人民币 157,781,887.84 元，折合 157,781,887.84 份 A 类基金份额。同泰开泰混合 C 类基金份额已收到首次募集的有效净认购资金 348,864,358.49 元，折合 348,864,358.49 份 C 类基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 71,073.57 元，

折合 71,073.57 份 C 类基金份额；以上收到的实收认购款共计人民币 348,935,432.06 元，折合 348,935,432.06 类基金份额。同泰开泰混合 A 类基金份额和 C 类基金份额收到的认购资金合计人民币 506,717,319.90 元，合计折合 506,717,319.90 份同泰开泰混合基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

同泰开泰混合 A			
项目	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	3,165,253.39	6,210,403.68	9,375,657.07
本期基金份额交易产生的变动数	-420,560.16	-1,888,994.33	-2,309,554.49
其中：基金申购款	60,727.97	184,344.81	245,072.78
基金赎回款	-481,288.13	-2,073,339.14	-2,554,627.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,744,693.23	4,321,409.35	7,066,102.58

单位：人民币元

同泰开泰混合 C			
项目	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	1,811,799.78	867,828.32	2,679,628.10
本期基金份额交易产生的变动数	-867,515.04	740,291.48	-127,223.56
其中：基金申购款	15,941.27	99,297.43	115,238.70
基金赎回款	-883,456.31	640,994.05	-242,462.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	944,284.74	1,608,119.80	2,552,404.54

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 8 月 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	19,418.95
定期存款利息收入	84,972.22
其他存款利息收入	33,122.02
结算备付金利息收入	-
其他	-

合计	137,513.19
----	------------

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年8月28日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
卖出股票成交总额	464,743,738.02
减：卖出股票成本总额	458,070,184.62
买卖股票差价收入	6,673,553.40

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年8月28日(基金合同生效日)至 2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	125,962.83
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	125,962.83

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年8月28日(基金合同生效日)至 2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	132,932,372.23
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	129,928,788.61
减：应收利息总额	2,877,620.79
买卖债券差价收入	125,962.83

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年 12月31日
----	---

卖出资产支持证券成交总额	25,131,984.00
减：卖出资产支持证券成本总额	24,239,051.84
减：应收利息总额	1,131,984.00
资产支持证券投资收益	-239,051.84

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日
股指期货-投资收益	-275,780.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	425,250.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	425,250.00

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	7,078,232.00
——股票投资	7,088,114.00
——债券投资	-9,882.00
——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	7,078,232.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年8月28日(基金合同生效日)至2019 年12月31日
基金赎回费收入	233,843.18
合计	233,843.18

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	1,394,492.75
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,394,492.75

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年8月28日(基金合同生效日)至2019 年12月31日
审计费用	26,000.00
信息披露费	50,000.00
其他费用	400.00
合计	76,400.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
同泰基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海蓝尚投资管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
刘文灿	基金管理人的股东
马俊生	基金管理人的股东
刘韞芬	基金管理人的股东
王雪梅	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内没有发生应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,820,140.25
其中：支付销售机构的客户维护费	572,961.57

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	242,685.35

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 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		
	2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C	合计
同泰基金管理有限公司	0.00	59,463.25	59,463.25
平安银行股份有限公司	0.00	8,954.88	8,954.88
合计	0.00	68,418.13	68,418.13

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C
基金合同生效日(2019年8月28日)持有的基金份额	20,000,277.77	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	20,000,277.77	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	20.1793%	0.0000%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

同泰开泰混合 A		
关联方名称	本期末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
刘韞芬	34,920.39	0.0352%

份额单位：份

同泰开泰混合 C

关联方名称	本期末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
刘韞芬	10.01	0.0000%

7.4.10.5 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 2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行	494,858.24	19,418.95

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601916	浙商 银行	2019年11 月18日	2020年5 月26日	新股锁 定	4.94	4.66	294,420	1,454,434.8	1,371,997.2	-
688138	清溢 光电	2019年11 月13日	2020年5 月20日	新股锁 定	8.78	13.89	10,066	88,379.48	139,816.74	
688258	卓易 信息	2019年11 月28日	2020年6 月9日	新股锁 定	26.49	70.05	3,465	91,787.85	242,723.25	
688299	长阳 科技	2019年10 月28日	2020年5 月6日	新股锁 定	13.71	15.74	11,341	155,485.11	178,507.34	
688399	硕世 生物	2019年11 月27日	2020年6 月5日	新股锁 定	46.78	54.51	2,290	107,126.2	124,827.9	
688081	兴图	2019年12	2020年1	新股未	28.21	28.21	3,184	89,820.64	89,820.64	

	新科	月 26 日	月 6 日	上市						
688181	八亿时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股未上市	43.98	43.98	2,272	99,922.56	99,922.56	
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113029	明阳转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 7 日	新债未上市	100	100	1,090	108,997.13	108,997.13	-
113554	仙鹤转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 10 日	新债未上市	100	100	250	24,999.51	24,999.51	
113558	日月转债	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 14 日	新债未上市	100	100	10	999.96	999.96	
128085	鸿达转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 8 日	新债未上市	100	100	690	68,998.19	68,998.19	

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理架构由董事会下的风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、监察稽核部、以及各个业务部门组成。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些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信用风险管理流程，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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.14%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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，并于开放日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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，本基金所持的证券均能及时变现，资产变现能力强。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%。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理。

本报告期内，未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,512,968.20	-	-	-	13,512,968.20
结算备付金	3,711,771.77	-	-	-	3,711,771.77
交易性金融资产	5,725,836.79	-	-	127,667,922.16	133,393,758.95
应收利息	-	-	-	152,266.71	152,266.71
应收申购款	-	-	-	139,592.22	139,592.22
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,950,576.76	-	-	127,959,781.09	150,910,357.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,805,965.39	4,805,965.39
应付管理人报酬	-	-	-	258,403.48	258,403.48
应付托管费	-	-	-	34,453.79	34,453.79
应付销售服务费	-	-	-	25,638.80	25,638.80
应交税费	-	-	-	936.59	936.59
其他负债	-	-	-	83,242.41	83,242.41

负债总计	-	-	-	5,208,640.46	5,208,640.46
利率敏感度缺口	22,950,576.76	-	-	122,751,140.63	145,701,717.39

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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，无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	127,667,922.16	87.62
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	127,667,922.16	87.62

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数收益率以外的其他市场价格变量保持不变	
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(2019年12月31日)

沪深 300 指数收益率上升 5%	8,394,435.99
沪深 300 指数收益率下降 5%	-8,394,435.99

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 125,413,728.49 元，划分为第二层次的余额为人民币 7,980,030.46 元，无划分为第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、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或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金本期未发生第三层次公允价值转入（转出）的情况。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	127,667,922.16	84.60
	其中：股票	127,667,922.16	84.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,725,836.79	3.79
	其中：债券	5,725,836.79	3.79
	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	17,224,739.97	11.41
8	其他各项资产	291,858.93	0.19
9	合计	150,910,357.85	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	872,000.00	0.60
C	制造业	94,683,989.90	64.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,154,000.00	1.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,648,923.25	12.80
J	金融业	7,344,670.97	5.04
K	房地产业	2,418,000.00	1.66
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	1,546,338.04	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	127,667,922.16	87.62

8.2.2 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通过港股通交易机制投资的港股。

8.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	601231	环旭电子	700,913	13,478,556.99	9.25
2	002384	东山精密	500,000	11,575,000.00	7.94
3	600406	国电南瑞	490,000	10,378,200.00	7.12
4	002001	新和成	400,000	9,304,000.00	6.39
5	300383	光环新网	400,000	8,028,000.00	5.51
6	000338	潍柴动力	480,000	7,622,400.00	5.23
7	600346	恒力石化	323,000	5,193,840.00	3.56
8	002241	歌尔股份	250,000	4,980,000.00	3.42
9	000951	中国重汽	210,000	4,725,000.00	3.24
10	002142	宁波银行	160,721	4,524,296.15	3.11
11	600352	浙江龙盛	300,000	4,341,000.00	2.98
12	002745	木林森	300,000	4,083,000.00	2.80
13	600216	浙江医药	300,000	4,005,000.00	2.75
14	300003	乐普医疗	100,000	3,308,000.00	2.27
15	002456	欧菲光	200,000	3,120,000.00	2.14
16	002074	国轩高科	200,000	2,910,000.00	2.00
17	600703	三安光电	150,000	2,754,000.00	1.89
18	603605	珀莱雅	30,000	2,641,500.00	1.81
19	002138	顺络电子	100,000	2,310,000.00	1.59
20	600029	南方航空	300,000	2,154,000.00	1.48
21	002635	安洁科技	100,000	1,667,000.00	1.14
22	300070	碧水源	202,600	1,539,760.00	1.06
23	600919	江苏银行	200,000	1,448,000.00	0.99
24	600340	华夏幸福	50,000	1,435,000.00	0.98

25	601916	浙商银行	294,499	1,372,374.82	0.94
26	600867	通化东宝	100,000	1,265,000.00	0.87
27	601012	隆基股份	50,000	1,241,500.00	0.85
28	600585	海螺水泥	20,000	1,096,000.00	0.75
29	002146	荣盛发展	100,000	983,000.00	0.67
30	603993	洛阳钼业	200,000	872,000.00	0.60
31	002440	闰土股份	72,300	809,760.00	0.56
32	603650	彤程新材	40,000	696,800.00	0.48
33	000970	中科三环	50,000	537,500.00	0.37
34	002050	三花智控	20,000	346,600.00	0.24
35	688258	卓易信息	3,465	242,723.25	0.17
36	688299	长阳科技	11,341	178,507.34	0.12
37	688138	清溢光电	10,066	139,816.74	0.10
38	688399	硕世生物	2,290	124,827.90	0.09
39	688181	八亿时空	2,272	99,922.56	0.07
40	688081	兴图新科	3,184	89,820.64	0.06
41	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
42	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
43	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601231	环旭电子	22,950,830.94	15.75
2	600352	浙江龙盛	21,891,092.06	15.02
3	002456	欧菲光	21,641,906.98	14.85
4	002384	东山精密	18,354,144.75	12.60
5	601688	华泰证券	16,057,500.00	11.02
6	603328	依顿电子	15,545,044.29	10.67
7	002745	木林森	15,489,668.00	10.63
8	600216	浙江医药	15,447,216.00	10.60
9	002440	闰土股份	13,552,175.00	9.30
10	002129	中环股份	12,876,688.00	8.84
11	002236	大华股份	12,633,105.00	8.67
12	300070	碧水源	11,926,990.00	8.19

13	300383	光环新网	11,897,362.00	8.17
14	000826	启迪环境	11,824,896.12	8.12
15	600406	国电南瑞	11,594,477.77	7.96
16	002299	圣农发展	10,561,571.75	7.25
17	601601	中国太保	9,990,877.00	6.86
18	000876	新希望	9,530,347.00	6.54
19	600109	国金证券	9,417,621.00	6.46
20	600332	白云山	9,413,061.00	6.46
21	600867	通化东宝	9,410,431.60	6.46
22	002146	荣盛发展	9,386,646.26	6.44
23	600346	恒力石化	9,172,399.60	6.30
24	600703	三安光电	8,971,105.80	6.16
25	002110	三钢闽光	8,540,142.74	5.86
26	002001	新和成	8,497,264.00	5.83
27	000066	中国长城	8,272,126.00	5.68
28	000338	潍柴动力	7,370,174.00	5.06
29	600887	伊利股份	7,301,549.00	5.01
30	600584	长电科技	7,300,477.00	5.01
31	600340	华夏幸福	7,185,835.00	4.93
32	600183	生益科技	7,094,670.00	4.87
33	600036	招商银行	7,062,000.00	4.85
34	600426	华鲁恒升	6,705,951.94	4.60
35	002241	歌尔股份	6,663,771.00	4.57
36	000977	浪潮信息	6,330,557.68	4.34
37	002291	星期六	5,833,128.00	4.00
38	600958	东方证券	5,499,977.00	3.77
39	002655	共达电声	5,370,267.00	3.69
40	002191	劲嘉股份	4,928,429.00	3.38
41	600068	葛洲坝	4,782,000.00	3.28
42	600837	海通证券	4,618,171.40	3.17
43	002426	胜利精密	4,528,929.00	3.11
44	002142	宁波银行	4,274,030.50	2.93
45	002368	太极股份	4,232,869.00	2.91
46	000725	京东方 A	4,158,000.00	2.85
47	603816	顾家家居	4,063,027.00	2.79
48	600195	中牧股份	4,024,391.80	2.76

49	000951	中国重汽	3,899,767.92	2.68
50	000703	恒逸石化	3,788,320.00	2.60
51	600801	华新水泥	3,722,194.00	2.55
52	603799	华友钴业	3,648,890.00	2.50
53	600011	华能国际	3,637,299.44	2.50
54	002493	荣盛石化	3,493,810.00	2.40
55	600315	上海家化	3,461,821.00	2.38
56	300003	乐普医疗	3,349,556.00	2.30
57	002635	安洁科技	3,151,652.00	2.16
58	002714	牧原股份	3,125,096.00	2.14
59	601111	中国国航	3,119,500.00	2.14
60	600886	国投电力	3,074,423.00	2.11
61	603605	珀莱雅	3,024,203.00	2.08
62	601186	中国铁建	2,997,000.00	2.06
63	002081	金螳螂	2,963,100.00	2.03
64	600025	华能水电	2,947,351.00	2.02

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

8.4.2 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	002456	欧菲光	22,272,822.22	15.29
2	601688	华泰证券	16,089,719.82	11.04
3	600352	浙江龙盛	15,970,922.34	10.96
4	603328	依顿电子	14,971,817.00	10.28
5	601231	环旭电子	14,968,071.00	10.27
6	002129	中环股份	13,343,245.35	9.16
7	002236	大华股份	12,539,754.00	8.61
8	600216	浙江医药	11,823,082.00	8.11
9	002745	木林森	11,676,939.00	8.01
10	002440	闰土股份	11,437,074.30	7.85
11	000876	新希望	11,118,900.00	7.63
12	000826	启迪环境	10,873,917.56	7.46
13	002291	星期六	10,412,481.00	7.15
14	300070	碧水源	10,104,733.00	6.94

15	000066	中国长城	9,964,969.00	6.84
16	002299	圣农发展	9,899,142.10	6.79
17	601601	中国太保	9,428,500.80	6.47
18	600109	国金证券	9,102,375.00	6.25
19	600584	长电科技	9,050,949.92	6.21
20	600332	白云山	8,754,439.86	6.01
21	002110	三钢闽光	8,397,207.20	5.76
22	002146	荣盛发展	8,120,740.86	5.57
23	002384	东山精密	7,614,253.00	5.23
24	600036	招商银行	7,484,124.00	5.14
25	600887	伊利股份	7,025,200.00	4.82
26	600703	三安光电	6,834,559.00	4.69
27	600183	生益科技	6,661,422.20	4.57
28	600426	华鲁恒升	6,508,803.34	4.47
29	000977	浪潮信息	5,959,088.00	4.09
30	600340	华夏幸福	5,543,784.48	3.80
31	002655	共达电声	5,481,533.00	3.76
32	600958	东方证券	5,201,500.00	3.57
33	600867	通化东宝	5,000,191.40	3.43
34	002191	劲嘉股份	4,973,025.00	3.41
35	600068	葛洲坝	4,754,906.98	3.26
36	600837	海通证券	4,701,500.00	3.23
37	002368	太极股份	4,464,557.00	3.06
38	000725	京东方 A	4,284,000.00	2.94
39	603816	顾家家居	4,215,300.00	2.89
40	600346	恒力石化	4,165,537.00	2.86
41	603799	华友钴业	4,097,733.30	2.81
42	000703	恒逸石化	4,055,989.13	2.78
43	002426	胜利精密	3,957,000.00	2.72
44	600801	华新水泥	3,923,175.20	2.69
45	002714	牧原股份	3,849,853.00	2.64
46	300383	光环新网	3,669,293.33	2.52
47	600195	中牧股份	3,604,959.60	2.47
48	600315	上海家化	3,467,691.00	2.38
49	002493	荣盛石化	3,352,436.00	2.30
50	600011	华能国际	3,292,984.76	2.26
51	601111	中国国航	2,978,160.00	2.04

注：本项的“卖出金额”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。

8.4.3 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	578,649,992.78
卖出股票收入（成交）总额	464,743,738.02

注：本项的“买入股票成本”、“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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,521,842.00	3.79
	其中：政策性金融债	5,521,842.00	3.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	203,994.79	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,725,836.79	3.93

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108602	国开 1704	54,900	5,521,842.00	3.79
2	113029	明阳转债	1,090	108,997.13	0.07
3	128085	鸿达转债	690	68,998.19	0.05
4	113554	仙鹤转债	250	24,999.51	0.02
5	113558	日月转债	10	999.96	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，届时将根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。

8.11.2 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投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.12.3 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	152,266.71
5	应收申购款	139,592.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	291,858.93

8.12.4 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。

8.12.5 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的情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
同泰开泰混合 A	1,393	71,150.71	30,002,472.21	30.27%	69,110,464.17	69.73%
同泰开泰混合 C	861	42,938.76	6,010,320.07	16.26%	30,959,953.82	83.74%
合计	2,254	60,374.10	36,012,792.28	26.46%	100,070,417.99	73.54%

9.2 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	同泰开泰混合 A	2,709,113.09	2.7334%
	同泰开泰混合 C	211,336.36	0.5716%
	合计	2,920,449.45	2.1461%

9.3 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的情况

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	同泰开泰混合 A	>100
	同泰开泰混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	同泰开泰混合 A	>100
	同泰开泰混合 C	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C
基金合同生效日（2019 年 8 月 28 日）基金份额总额	157,781,887.84	348,935,432.06
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,728,865.79	2,731,017.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	64,397,817.25	314,696,175.67
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	99,112,936.38	36,970,273.89

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2019 年 12 月 7 日发布公告，经同泰基金管理有限公司董事会审议通过，聘任杨伍先生担任本公司首席信息官。

2、本基金管理人于 2019 年 12 月 25 日发布公告，经同泰基金管理有限公司董事会审议通过，同意徐京利女士辞去本公司督察长一职，由董事长刘文灿先生代为履行本公司督察长职务。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内应支付给上会会计师事务所审计费用人民币 26,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
招商证券	2	1,035,604,259.56	100.00%	857,907.00	100.00%	-

注：1、本基金使用券商结算模式。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准主要包括：公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

11.7.2 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	
	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
招商证券	249,249,969.88	100.00%	5,976,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 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	同泰开泰混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定的媒介	2019年7月26日
2	同泰开泰混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定的媒介	2019年7月26日
3	同泰开泰混合型证券投资基金基金合同内容摘要	中国证监会指定的媒介	2019年7月26日
4	同泰开泰混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定的媒介	2019年7月26日
5	同泰开泰混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定的媒介	2019年7月26日
6	关于同泰开泰混合型证券投资基金参与代销机构费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019年8月1日
7	关于新增同泰开泰混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证监会指定的媒介	2019年8月1日
8	关于同泰基金管理有限公司旗下基金参与代销机构费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019年8月6日
9	同泰基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019年8月7日
10	同泰开泰混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定的媒介	2019年8月29日
11	同泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	中国证监会指定的媒介	2019年8月29日
12	同泰开泰混合基金开放日常	中国证监会指定的媒介	2019年9月24日

	申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告		
13	关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 9 月 26 日
14	关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 10 月 9 日
15	关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 10 月 16 日
16	关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 10 月 17 日
17	关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 11 月 4 日
18	同泰基金管理有限公司关于旗下基金估值调整的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 12 月 11 日
19	关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 12 月 24 日
20	同泰基金管理有限公司关于开通银联通直销网上交易和费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 8 月 1 日
21	同泰基金管理有限公司行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 12 月 7 日
22	同泰基金管理有限公司关于董事长代为履行公司督察长职务的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 12 月 25 日
23	同泰基金管理有限公司关于提示投资者及时上传身份证照片并持续完善、更新身份信息的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《同泰开泰混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《同泰开泰混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、报告期内同泰开泰混合型证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人网站 (<http://www.tongtaiamc.com>) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人住所免费查阅。

同泰基金管理有限公司

2020年3月31日