

同泰恒利纯债债券型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：同泰基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 年 2 月 18 日（基金合同生效日）起至 06 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 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 其他指标..... | 10 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| §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的真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 41 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 42 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 43 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 44 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 44 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 44 |
| 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的情况..... | 44 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 45 |
| §10 重大事件揭示..... | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 46 |
| 10.8 其他重大事件..... | 47 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 49 |
| 11.1 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..... | 49 |

| | |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| §12 备查文件目录..... | 50 |
| 12.1 备查文件目录..... | 50 |
| 12.2 存放地点..... | 50 |
| 12.3 查阅方式..... | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金名称 | 同泰恒利纯债债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 同泰恒利纯债 | |
| 基金主代码 | 008728 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 2 月 18 日 | |
| 基金管理人 | 同泰基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 浙商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 100,337,158.79 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 同泰恒利纯债 A | 同泰恒利纯债 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 008728 | 008729 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 117,235.76 份 | 100,219,923.03 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收益。 |
| 投资策略 | 本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，长期平均风险与预期收益率高于货币市场基金，但低于混合型基金、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 | 同泰基金管理有限公司 | 浙商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 滕大江 |
| | 联系电话 | 0755-23537876 |
| | 电子邮箱 | tengdj@tongtaiamc.com |
| 客户服务电话 | 400-830-1666 | 95527 |
| 传真 | 0755-23537801 | 0571-88268688 |
| 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 | 杭州市延安路 368 号 |
| 办公地址 | 深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号 | 杭州市萧山区鸿宁路 1788 号 |

| | | |
|-------|-------------------|--------|
| | 深业上城（南区）T2 栋 41 层 | |
| 邮政编码 | 518033 | 310006 |
| 法定代表人 | 马俊生 | 沈仁康 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.tongtaiamc.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |
|--------|------------|---|
| 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

| 基金级别 | 同泰恒利纯债 A | 同泰恒利纯债 C |
|---------------|------------------------------|------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020年2月18日 - 2020年6月30日) | 报告期(2020年2月18日 - 2020年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 744,110.60 | 691,976.06 |
| 本期利润 | 253,989.25 | 123,519.81 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0029 | 0.0012 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.29% | 0.12% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.19% | 0.11% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -474.08 | -478,174.73 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0040 | -0.0048 |
| 期末基金资产净值 | 116,761.68 | 99,741,748.30 |
| 期末基金份额净值 | 0.9960 | 0.9952 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.19% | 0.11% |

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。

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

同泰恒利纯债 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 | -0.48% | 0.13% | -0.94% | 0.12% | 0.46% | 0.01% |
| 过去三个月 | -0.38% | 0.10% | -1.04% | 0.12% | 0.66% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.19% | 0.09% | -0.32% | 0.11% | 0.51% | -0.02% |

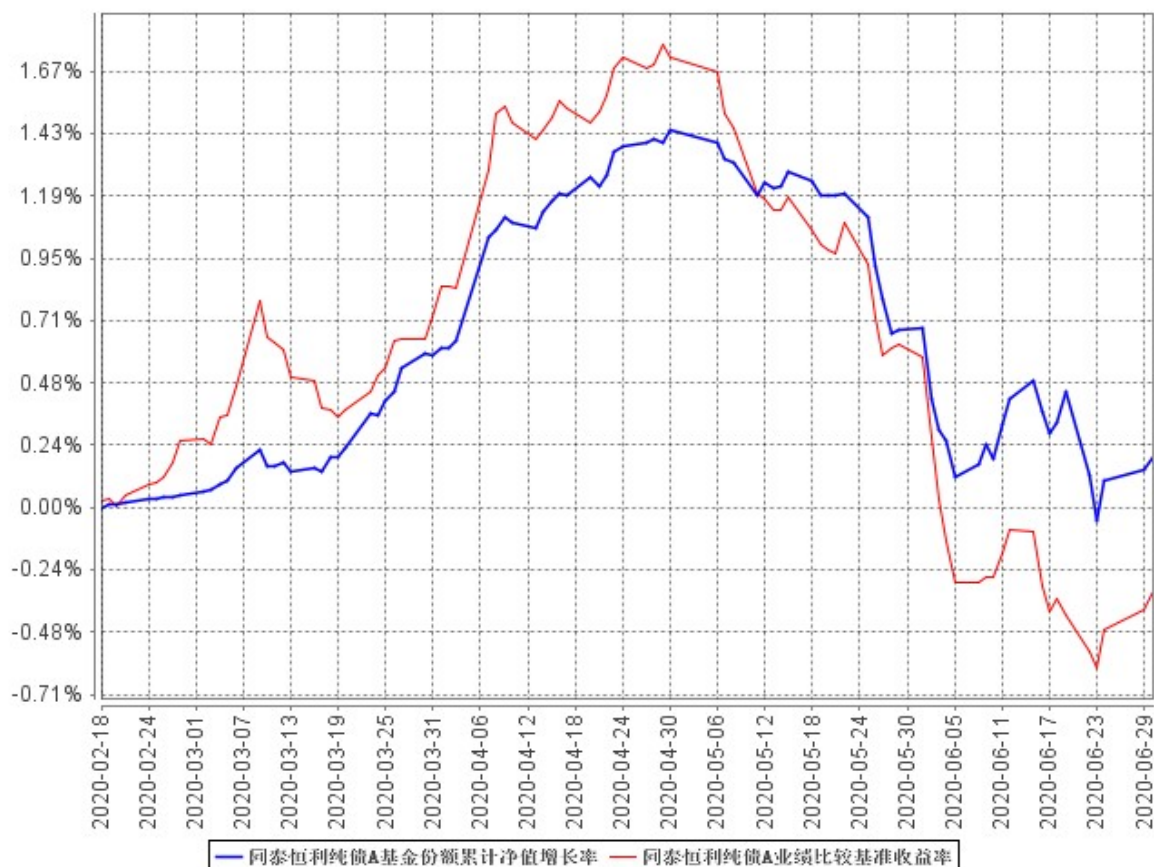
同泰恒利纯债 C

| 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 | -0.50% | 0.13% | -0.94% | 0.12% | 0.44% | 0.01% |
| 过去三个月 | -0.43% | 0.10% | -1.04% | 0.12% | 0.61% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.11% | 0.09% | -0.32% | 0.11% | 0.43% | -0.02% |

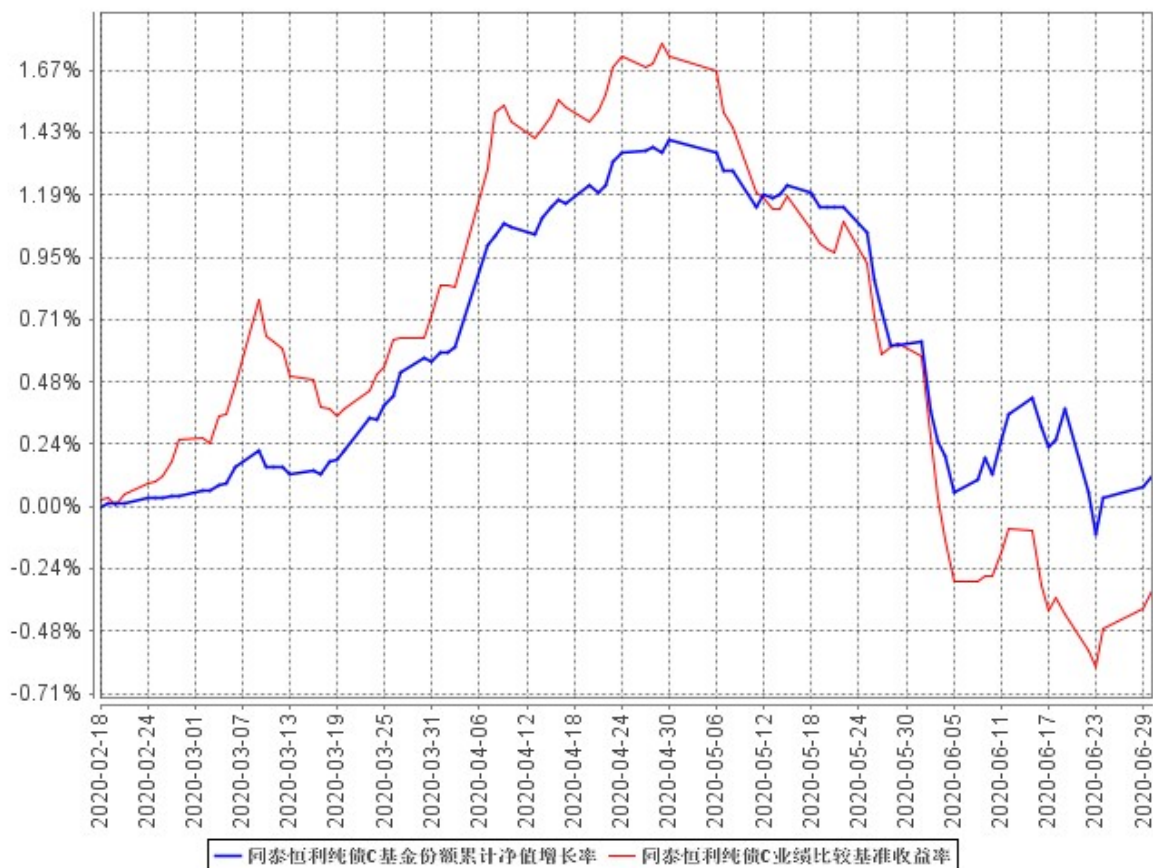
注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率，每日进行再平衡过程。

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

同泰恒利纯债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



同泰恒利纯债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 2020 年 2 月 18 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未及 1 年。

2、本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，至本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.3 其他指标

无。

§ 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7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 | | |
| 高春梅 | 本基金的基金经理 | 2020年2月18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。 |

注：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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，无此情况。

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，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。

4.3.2 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非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

2020 年上半年，疫情冲击引发一系列经济、政策和市场变化，债市也因此走出宽幅震荡行情。其中，疫情冲击和货币政策操作及其对资金供需的影响成为上半年最重要的主线。

上半年债市经历了三次上涨和三次回调。三次上涨：首先是 2020 年 2 月 3 日的大幅跳涨，收益率一步下行到位，反映春节期间国内疫情的情况。其次是从 2020 年 2 月 21 日起，十年期国债收益率从 2.88% 起步，最低下行至 2.52%，反映海外疫情、原油动荡的情况，逻辑是全球避险情绪的蔓延。最后，2020 年 3 月中下旬到 4 月，主要是资金面宽松主导：由于 2020 年一季度央行投放大量流动性且大部分未实际流出，造成流动性一定程度上堆积在银行间，形成“衰退式宽松”。虽然政策未实际落地，但央行 OMO 利率下调 20BP 且超出市场预期调降超储利率，进一步打开了利率走廊的下限。三次回调：2020 年 4 月上旬，资金面的宽松已由一年期的短端传导至三年期和五年期的中等期限，利率曲线重回陡峭。五一假期前最后一个交易日，债券市场开始调整。根本原因是疫情对市场情绪扰动最大的阶段已过，经济逐步恢复常态，央行货币政策总量宽松逐步回归结构宽松，打击资金套利叠加一级市场的天量供给。从 4 月 30 日至 5 月 19 日，6 月初至 23 日两个阶段几乎是一轮没有回头的单边熊市。

上半年，本基金以 1-3 年国开债为主要投资标的，灵活调整组合久期和杠杆，并适度把握波段性交易机会，上半年获取了较为稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰恒利纯债 A 基金份额净值为 0.9960 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.19%；截至本报告期末同泰恒利纯债 C 基金份额净值为 0.9952 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.11%；同期业绩比较基准收益率为-0.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，基本面走势和货币政策仍是决定债市中长期趋势的关键。货币政策重新转向的概率不大，依然以结构宽松为主，经济恢复的节奏和市场预期的变化成为主要影响因素。结构性政策支持下，经济恢复斜率将成为市场定价的关键，特别关注非政策驱动的主动恢复的经济分项，包括外需变化、制造业投资和消费等数据的恢复情况。

虽然当前利率水平已一定程度提前反映基本面，但预期差带来高波动难以避免，尤其是长端利率仍会处于宽幅震荡阶段，更多的是交易性机会。债市短期暂无趋势性机会，本基金仍会以中短久期策略为主，但亦会根据市场情况动态调整仓位和久期以获得资本利得收益。

4.6 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。

4.7 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。

同泰恒利纯债 A 本报告期内实施 1 次收益分配，累计分配 601,544.22 元，每 10 份基金份额分红 0.06 元；同泰恒利纯债 C 本报告期内实施 1 次收益分配，累计分配 601,759.59 元，每 10 份基金份额分红 0.06 元。

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

本基金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

本报告期内，本基金托管人在对同泰恒利纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，同泰恒利纯债债券型证券投资基金的管理人——同泰基金管理有限公司在同泰恒利纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对同泰基金管理有限公司编制和披露的同泰恒利纯债债券型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：同泰恒利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 787,244.99 |
| 结算备付金 | | - |
| 存出保证金 | | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 115,896,851.43 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 115,896,851.43 |
| 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 | - |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,100,550.07 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 118,784,646.49 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 18,799,812.00 |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 120.27 |
| 应付管理人报酬 | | 32,762.70 |
| 应付托管费 | | 10,920.91 |
| 应付销售服务费 | | 16,370.11 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 2,942.72 |
| 应交税费 | | - |

| | | |
|---------------|----------|----------------|
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 63,207.80 |
| 负债合计 | | 18,926,136.51 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 100,337,158.79 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -478,648.81 |
| 所有者权益合计 | | 99,858,509.98 |
| 负债和所有者权益总计 | | 118,784,646.49 |

注：1、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，同泰恒利纯债 A 基金份额净值 0.9960 元，基金份额总额 117,235.76 份；同泰恒利纯债 C 基金份额净值 0.9952 元，基金份额总额 100,219,923.03 份。同泰恒利纯债份额总额合计为 100,337,158.79 份。

2、本基金合同于 2020 年 2 月 18 日生效，故无上年度可比期间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：同泰恒利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 |
|-----------------------|------------|---|
| | | 2020 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 892,081.30 |
| 1.利息收入 | | 1,645,509.38 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 14,471.31 |
| 债券利息收入 | | 1,175,426.61 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 455,611.46 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 305,137.10 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 305,137.10 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -1,058,577.60 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 12.42 |

| | | |
|---------------------|------------|------------|
| 减：二、费用 | | 514,572.24 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 203,236.67 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 67,745.58 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 73,189.25 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 71,389.89 |
| 5. 利息支出 | | 34,363.05 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 34,363.05 |
| 6. 税金及附加 | | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 64,647.80 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 377,509.06 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 377,509.06 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：同泰恒利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年6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) | 200,561,449.38 | - | 200,561,449.38 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | - | 377,509.06 | 377,509.06 |
| 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) | -100,224,290.59 | 347,145.94 | -99,877,144.65 |
| 其中：1.基金申购款 | 73,931.97 | 928.86 | 74,860.83 |
| 2.基金赎回款 | -100,298,222.56 | 346,217.08 | -99,952,005.48 |
| 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) | - | -1,203,303.81 | -1,203,303.81 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 100,337,158.79 | -478,648.81 | 99,858,509.98 |

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：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>马俊生</u> | <u>马俊生</u> | <u>刘蕴芬</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 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

同泰恒利纯债债券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]2685号《关于准予同泰恒利纯债债券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2020年2月18日正式生效，首次设立募集规模为200,561,449.38份基金份额。

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债券（包括国债、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、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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、存出保证金及应收申购款等。

本基金不直接投资于股票，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票等。因上述原因持有的股票，本基金将在其可交易之日起10个交易日内卖出。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度和中期报告〉》及其他中

中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票、债券和衍生工具等投资。

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、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为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；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资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。

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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。

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 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 495,075.46 |
| 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 | 292,169.53 |
| 合计: | 787,244.99 |

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 106,639,929.03 | 105,696,851.43 |
| | 银行间市场 | 10,315,500.00 | 10,200,000.00 |
| | 合计 | 116,955,429.03 | 115,896,851.43 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 116,955,429.03 | 115,896,851.43 | -1,058,577.60 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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从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 2020 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 91.08 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |

| | |
|------------|--------------|
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | 2,100,430.31 |
| 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 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 28.68 |
| 合计 | 2,100,550.07 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,942.72 |
| 合计 | 2,942.72 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 63,207.80 |
| 合计 | 63,207.80 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 同泰恒利纯债 A | | |
|----------|--------------------------------------|------|
| 项目 | 本期 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年6月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| | | |

| | | |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日 | 100,275,112.63 | 100,275,112.63 |
| 本期申购 | 52,397.11 | 52,397.11 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -100,210,273.98 | -100,210,273.98 |
| - 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 | 117,235.76 | 117,235.76 |

金额单位：人民币元

| 同泰恒利纯债 C | | |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年6月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 100,286,336.75 | 100,286,336.75 |
| 本期申购 | 21,534.86 | 21,534.86 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -87,948.58 | -87,948.58 |
| - 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 | 100,219,923.03 | 100,219,923.03 |

注：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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 同泰恒利纯债 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 | 744,110.60 | -490,121.35 | 253,989.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -142,374.93 | 489,455.82 | 347,080.89 |
| 其中：基金申购款 | 299.28 | 378.86 | 678.14 |
| 基金赎回款 | -142,674.21 | 489,076.96 | 346,402.75 |
| 本期已分配利润 | -601,544.22 | - | -601,544.22 |
| 本期末 | 191.45 | -665.53 | -474.08 |

单位：人民币元

| 同泰恒利纯债 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 | 691,976.06 | -568,456.25 | 123,519.81 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -24.58 | 89.63 | 65.05 |
| 其中：基金申购款 | 102.49 | 148.23 | 250.72 |
| 基金赎回款 | -127.07 | -58.60 | -185.67 |
| 本期已分配利润 | -601,759.59 | - | -601,759.59 |
| 本期末 | 90,191.89 | -568,366.62 | -478,174.73 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 7,860.40 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | 6,610.91 |
| 合计 | 14,471.31 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年 6月30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 | 305,137.10 |
| 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 | 305,137.10 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年 6月30日 |
|-------------------------|--|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 124,404,279.84 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 122,949,017.99 |
| 减：应收利息总额 | 1,150,124.75 |
| 买卖债券差价收入 | 305,137.10 |

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020 年6月30日 |
|----------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | -1,058,577.60 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -1,058,577.60 |
| ——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 | -1,058,577.60 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|--|
| 基金赎回费收入 | 12.42 |
| 合计 | 12.42 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 71,214.89 |
| 银行间市场交易费用 | 175.00 |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 71,389.89 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|--|
| 审计费用 | 16,855.86 |
| 信息披露费 | 46,351.94 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 1,040.00 |
| 其他费用 | 400.00 |
| 合计 | 64,647.80 |

6.4.7.21 分部报告

无。

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，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告送出口，本基金无须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 |
|------------|-----------------------|
| 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 |
| 浙商银行股份有限公司 | 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

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

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 |
|-----------------|--------------------------------|
| | 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 203,236.67 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 242.13 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|--------------------------------|
| | 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 67,745.58 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 同泰恒利纯债 A | 同泰恒利纯债 C | 合计 |
| 同泰基金管理有限公司 | - | 73,002.06 | 73,002.06 |
| 合计 | - | 73,002.06 | 73,002.06 |

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 0.20%，按前

一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

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

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

本基金本报告期末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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方进行证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方进行证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

6.4.10.6 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 2020年2月18日(基金合同生效日)至2020年6月30日 | |
|------------|--------------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 浙商银行股份有限公司 | 495,075.46 | 7,860.40 |

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

同泰恒利纯债 A

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | 每 10 份 基金份额分红 数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润分 配 合计 | 备注 |
|----|--------------------|-----------------|-----------------------|--------------|---------------|------------------|----|
| 1 | 2020 年 5 月 20 日 | 2020 年 5 月 20 日 | 0.0600 | 601,203.24 | 340.98 | 601,544.22 | |
| 合计 | - | - | 0.0600 | 601,203.24 | 340.98 | 601,544.22 | |

同泰恒利纯债 C

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | 每 10 份 基金份额分红 数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润分 配 合计 | 备注 |
|----|--------------------|-----------------|-----------------------|--------------|---------------|------------------|----|
| 1 | 2020 年 5 月 20 日 | 2020 年 5 月 20 日 | 0.0600 | 601,605.01 | 154.58 | 601,759.59 | |
| 合计 | - | - | 0.0600 | 601,605.01 | 154.58 | 601,759.59 | |

6.4.12 期末（2020 年 6 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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额

18,799,812.00 元，于 2020 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制（如有）外，本基金所持的证券均能及时变现。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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020年6月 30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|----------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 787,244.99 | - | - | - | 787,244.99 |
| 交易性金融资产 | 4,961,500.00 | 95,800,031.43 | 15,135,320.00 | - | 115,896,851.43 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,100,550.07 | 2,100,550.07 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 5,748,744.99 | 95,800,031.43 | 15,135,320.00 | 2,100,550.07 | 118,784,646.49 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 18,799,812.00 | - | - | - | 18,799,812.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 120.27 | 120.27 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 32,762.70 | 32,762.70 |
| 应付托管费 | - | - | - | 10,920.91 | 10,920.91 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 16,370.11 | 16,370.11 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 2,942.72 | 2,942.72 |
| 其他负债 | - | - | - | 63,207.80 | 63,207.80 |
| 负债总计 | 18,799,812.00 | - | - | 126,324.51 | 18,926,136.51 |
| 利率敏感度缺口 | -13,051,067.01 | 95,800,031.43 | 15,135,320.00 | 1,974,225.56 | 99,858,509.98 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | |
|----|--------------------|--|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2020年6月30日） |
| | 市场利率下降25个基点 | 880,900.30 |
| | 市场利率上升25个基点 | -861,036.35 |

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，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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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。

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 2020年6月30日 | |
|---------------|-------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 115,896,851.43 | 116.06 |
| 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 | 115,896,851.43 | 116.06 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大市场价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 115,896,851.43 | 97.57 |
| | 其中：债券 | 115,896,851.43 | 97.57 |
| | 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 | 787,244.99 | 0.66 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,100,550.07 | 1.77 |
| 9 | 合计 | 118,784,646.49 | 100.00 |

7.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

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通过港股通交易机制投资的港股。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 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 | 4,935,523.58 | 4.94 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 110,961,327.85 | 111.12 |
| | 其中：政策性金融债 | 110,961,327.85 | 111.12 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 115,896,851.43 | 116.06 |

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

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 | 018010 | 国开 1902 | 639,990 | 64,363,794.30 | 64.45 |
| 2 | 108604 | 国开 1805 | 310,173 | 31,436,033.55 | 31.48 |
| 3 | 190210 | 19 国开 10 | 100,000 | 10,200,000.00 | 10.21 |
| 4 | 108609 | 开贴 2002 | 50,000 | 4,961,500.00 | 4.97 |
| 5 | 019547 | 16 国债 19 | 52,000 | 4,935,320.00 | 4.94 |

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国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内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。

7.11.2 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。

7.11.3 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 | 2,100,550.07 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,100,550.07 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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 |
| 同泰恒利纯债 A | 107 | 1,095.66 | - | - | 117,235.76 | 100.00% |
| 同泰恒利纯债 C | 267 | 375,355.52 | 100,019,805.55 | 99.80% | 200,117.48 | 0.20% |
| 合计 | 374 | 268,281.17 | 100,019,805.55 | 99.68% | 317,353.24 | 0.32% |

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 | 同泰恒利纯债 A | 2,311.40 | 1.97% |
| | 同泰恒利纯债 C | 352.59 | 0.00% |
| | 合计 | 2,663.99 | 0.00% |

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 | 同泰恒利纯债 A | 0~10 |
| | 同泰恒利纯债 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 同泰恒利纯债 A | 0 |
| | 同泰恒利纯债 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 同泰恒利纯债 A | 同泰恒利纯债 C |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020 年 2 月 18 日）基金份额总额 | 100,275,112.63 | 100,286,336.75 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 52,397.11 | 21,534.86 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 100,210,273.98 | 87,948.58 |
| 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 | 117,235.76 | 100,219,923.03 |

§ 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

基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 5 月 22 日发布公告，经同泰基金管理有限公司董事会审议通过，聘任滕大江同志为公司督察长，任职日期为 5 月 21 日，同时，董事长刘文灿先生不再代为履行督察长职务。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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

本报告期内无涉及本基金管理人、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改变。

10.5 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）。

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等情况。

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 | |
| 平安证券 | 2 | - | - | 116,883.60 | 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。

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 | |
|------|----------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 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 |
| 平安证券 | 352,843,102.11 | 100.00% | 733,900,000.00 | 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 | 同泰恒利纯债债券型证券投资基金暂停接受个人投资者申购、定期定额投资业务的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年6月10日 |
| 2 | 同泰恒利纯债债券型证券投资基金 2020 年第一次分红公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年5月19日 |
| 3 | 同泰恒利纯债债券型证券投资基金暂停大额申购业务的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年5月19日 |
| 4 | 同泰恒利纯债债券型证券投资基金开放日常赎回业务的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年5月15日 |
| 5 | 同泰恒利纯债债券型证券投资基金开放日常申购及定期定额投资业务的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年4月17日 |
| 6 | 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-唐鼎耀华 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年3月5日 |
| 7 | 同泰恒利纯债债券型证券投资基金-基金合同生效公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年2月19日 |
| 8 | 同泰恒利纯债债券型证券投资基金提前结束募集的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年2月13日 |
| 9 | 关于新增同泰恒利纯债债券型证券投资基金代销机构的公告-北京汇成 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年2月5日 |
| 10 | 关于新增同泰恒利纯债债券型证券投资基金代销机构的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020年1月15日 |

| | | | |
|----|---------------------------------------|------------|-----------------|
| 11 | 同泰恒利纯债债券型证券投资基金-基金份额发售公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020 年 1 月 10 日 |
| 12 | 同泰基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020 年 1 月 8 日 |
| 13 | 同泰基金关于旗下部分开放式基金开通基金转换业务的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020 年 2 月 17 日 |
| 14 | 同泰基金管理有限公司关于开通网上直销汇款交易业务并实施费率优惠的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020 年 4 月 28 日 |
| 15 | 同泰基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2020 年 5 月 22 日 |
| 16 | 同泰基金管理有限公司关于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 | 2020 年 6 月 8 日 |
| 17 | 同泰基金管理有限公司关于旗下部分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 | 2020 年 6 月 8 日 |
| 18 | 同泰基金管理有限公司关于旗下部分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 | 2020 年 6 月 15 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|--------------------------|------|----------------|----------------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20200218-20200630 | 0.00 | 100,019,805.55 | - | 100,019,805.55 | 99.68% |
| | 2 | 20200218-20200609 | 0.00 | 100,018,166.66 | 100,018,166.66 | 0.00 | - |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动等风险。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《同泰恒利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《同泰恒利纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、报告期内同泰恒利纯债债券型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

12.3 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 8 月 31 日