

同泰开泰混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 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

报告送出日期：2020 年 10 月 28 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	同泰开泰混合
场内简称	-
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
报告期末基金份额总额	59,674,177.10 份
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。
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

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
下属分级基金的场内简称	-	-
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	51,486,159.59 份	8,188,017.51 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年7月1日—2020年9月30日）	
	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C
1. 本期已实现收益	19,311,142.75	4,665,007.74
2. 本期利润	9,402,460.52	2,124,700.04
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1501	0.1470
4. 期末基金资产净值	61,633,234.66	9,751,526.60
5. 期末基金份额净值	1.1971	1.1910

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、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

同泰开泰混合 A

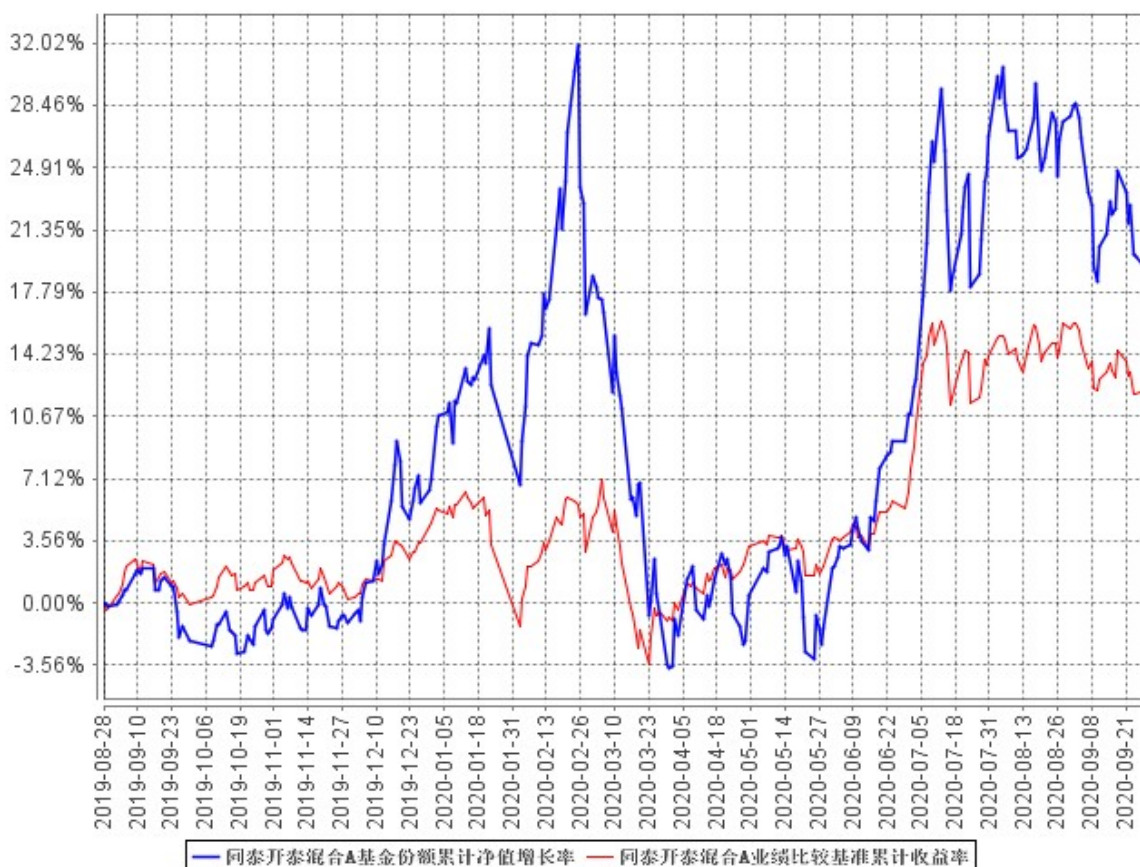
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.02%	1.78%	5.58%	0.95%	2.44%	0.83%
过去六个月	24.34%	1.57%	13.19%	0.78%	11.15%	0.79%
过去一年	22.37%	1.66%	12.34%	0.82%	10.03%	0.84%
自基金合同生效起至今	19.71%	1.59%	12.24%	0.80%	7.47%	0.79%

同泰开泰混合 C

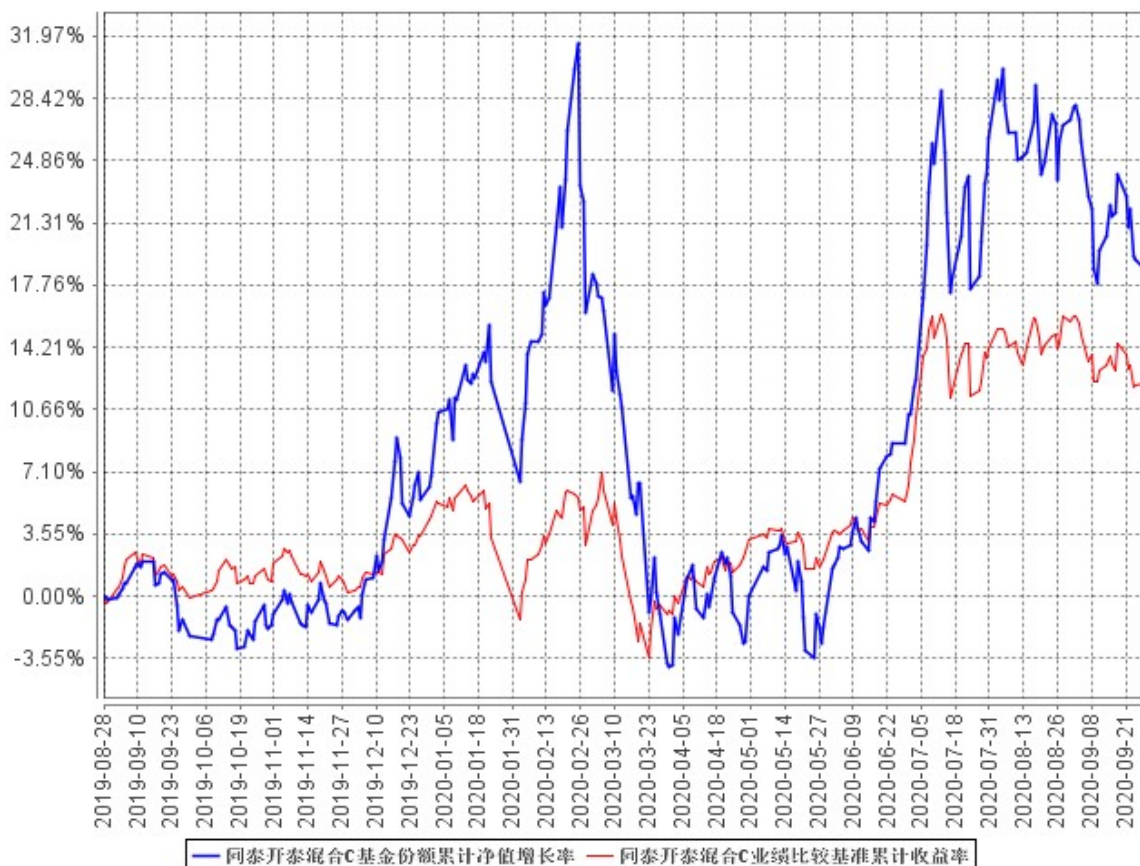
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.91%	1.77%	5.58%	0.95%	2.33%	0.82%
过去六个月	24.09%	1.57%	13.19%	0.78%	10.90%	0.79%
过去一年	21.79%	1.66%	12.34%	0.82%	9.45%	0.84%
自基金合同生效起至今	19.10%	1.59%	12.24%	0.80%	6.86%	0.79%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨喆	本基金的基金经理、投资研究部总监	2019 年 8 月 28 日	-	19	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	-	8	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。

1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

3、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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年三季度，国内经济持续回暖，内需和外贸态势向好，货币政策灵活适度，国内股市上台阶后区间运行，新股发行节奏较快，债市持续偏弱。随着上市公司中报不断披露，宏观复苏在微观主体能够验证，股强债弱是合理表现。

本基金保持了偏高的权益仓位，组合做了一定调整：部分减持和兑现了电子、医药、消费等板块，增加配置了顺周期的部分化工与建材和景气周期上行的新能源装备、军工等板块。本产品坚持配置中长期看好方向的优质公司，如电子制造、新能源车、太阳能、医药、国内消费等。三季度组合净值上涨，净值基本体现了组合配置的思路。

4.5 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 1.1971 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.02%；截至本报告期末同泰开泰混合 C 基金份额净值为 1.1910 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.91%；同期业绩比较基准收益率为 5.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	51,410,979.76	71.64
	其中：股票	51,410,979.76	71.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	156,113.20	0.22
	其中：债券	156,113.20	0.22
	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	9,000,000.00	12.54
	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	11,138,845.21	15.52
8	其他资产	52,668.34	0.07
9	合计	71,758,606.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	38,536,758.28	53.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,755.84	0.01
F	批发和零售业	16,793.79	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,162,276.40	3.03
H	住宿和餐饮业	887,500.00	1.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	752,498.01	1.05
J	金融业	2,989,600.00	4.19
K	房地产业	1,411,800.00	1.98
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	719,750.00	1.01

N	水利、环境和公共设施管理业	3,158,916.74	4.43
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	768,330.70	1.08
S	综合	-	-
	合计	51,410,979.76	72.02

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002007	华兰生物	68,000	3,875,320.00	5.43
2	600438	通威股份	130,000	3,455,400.00	4.84
3	002142	宁波银行	80,000	2,518,400.00	3.53
4	300070	碧水源	260,000	2,262,000.00	3.17
5	300737	科顺股份	90,000	2,101,500.00	2.94
6	002286	保龄宝	139,951	1,959,314.00	2.74
7	600115	东方航空	389,200	1,922,648.00	2.69
8	601012	隆基股份	25,000	1,875,250.00	2.63
9	300829	金丹科技	20,000	1,866,400.00	2.61
10	002601	龙蟠佰利	80,000	1,863,200.00	2.61

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	33,289.20	0.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	122,824.00	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	156,113.20	0.22

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113038	隆 20 转债	800	122,824.00	0.17
2	019547	16 国债 19	360	33,289.20	0.05

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,101.59
5	应收申购款	51,566.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,668.34

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 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
报告期期初基金份额总额	86,550,017.53	21,100,318.91
报告期期间基金总申购份额	4,133,425.29	2,004,898.78
减：报告期期间基金总赎回份额	39,197,283.23	14,917,200.18
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	51,486,159.59	8,188,017.51

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	20,000,277.77
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	15,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,277.77
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	8.38

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2020年7月8日	5,000,000.00	6,176,500.00	0.00%
2	赎回	2020年7月29日	4,000,000.00	4,964,000.00	0.00%
3	赎回	2020年8月24日	6,000,000.00	7,686,000.00	0.00%
合计			15,000,000.00	18,826,500.00	

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20200730-20200930	17,018,977.11	-	-	17,018,977.11	28.52%
个人	1	20200807-20200930	14,999,958.33	-	-	14,999,958.33	25.14%
-	-	-	-	-	-	-	-
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

9.3 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 (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 10 月 28 日