

同泰开泰混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：2021 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 2021 年 3 月 26 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 2020 年 01 月 01 日起至 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.....	8
3.3 其他指标.....	10
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.....	15
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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	16
4.10 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	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59

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	60
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	60
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	60
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	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	61
§ 9 基金份额持有人信息	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	63
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	66
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 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	
场内简称	-	
基金主代码	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	48,323,450.68 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
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	41,656,407.46 份	6,667,043.22 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。	
	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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	滕大江	李帅帅
	联系电话	0755-23537892	0755-25878287

	电子邮箱	tengdj@tongtaiamc.com	LISHUAISHUAI130@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村社区皇岗路 5001 号深业上城（南区）T2 栋 41 层	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
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	2020 年		2019 年 8 月 28 日 (基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日		2018 年	
	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C	同泰开泰混合 A	同泰开泰混合 C
本期已实现收益	20,493,730.79	5,309,855.66	3,165,253.39	1,811,799.78	-	-
本期利润	18,336,815.68	4,582,681.81	9,375,657.07	2,679,628.10	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.2531	0.2547	0.0651	0.0133	-	-
本期加权平均净值利润率	22.21%	22.63%	6.49%	1.33%	-	-
本期基金份额净值增长率	24.48%	23.99%	7.13%	6.90%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	13,895,849.47	2,169,476.11	2,744,693.23	944,284.74	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.3336	0.3254	0.0277	0.0255	-	-
期末基金资产净值	55,552,256.93	8,836,519.33	106,179,038.96	39,522,678.43	-	-
期末基金份额净值	1.3336	1.3254	1.0713	1.0690	-	-
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	33.36%	32.54%	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。

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	11.40%	1.48%	8.30%	0.59%	3.10%	0.89%
过去六个月	20.34%	1.63%	14.35%	0.80%	5.99%	0.83%
过去一年	24.48%	1.76%	16.24%	0.85%	8.24%	0.91%
自基金合同生效起至今	33.36%	1.57%	21.56%	0.76%	11.80%	0.81%

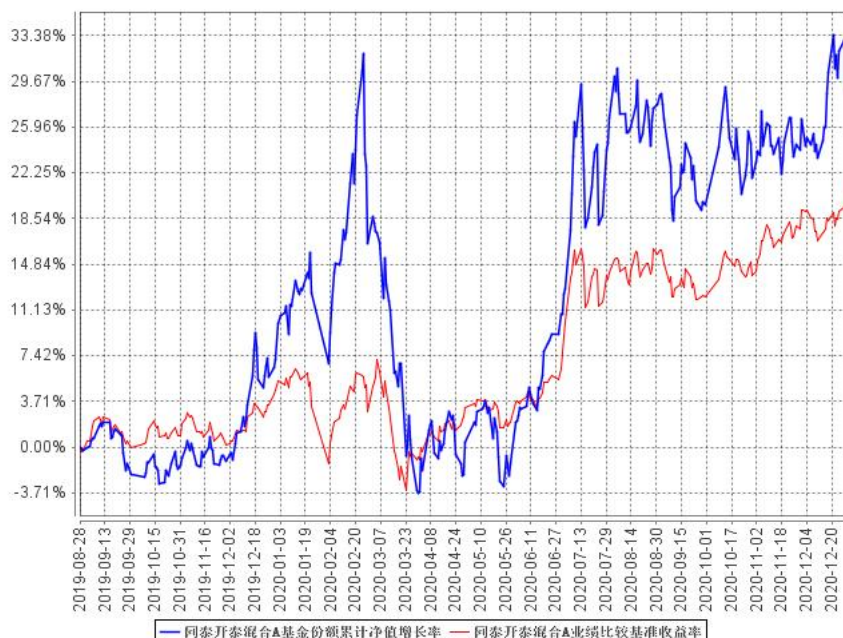
同泰开泰混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.28%	1.47%	8.30%	0.59%	2.98%	0.88%
过去六个月	20.09%	1.63%	14.35%	0.80%	5.74%	0.83%
过去一年	23.99%	1.76%	16.24%	0.85%	7.75%	0.91%
自基金合同生效起至今	32.54%	1.57%	21.56%	0.76%	10.98%	0.81%

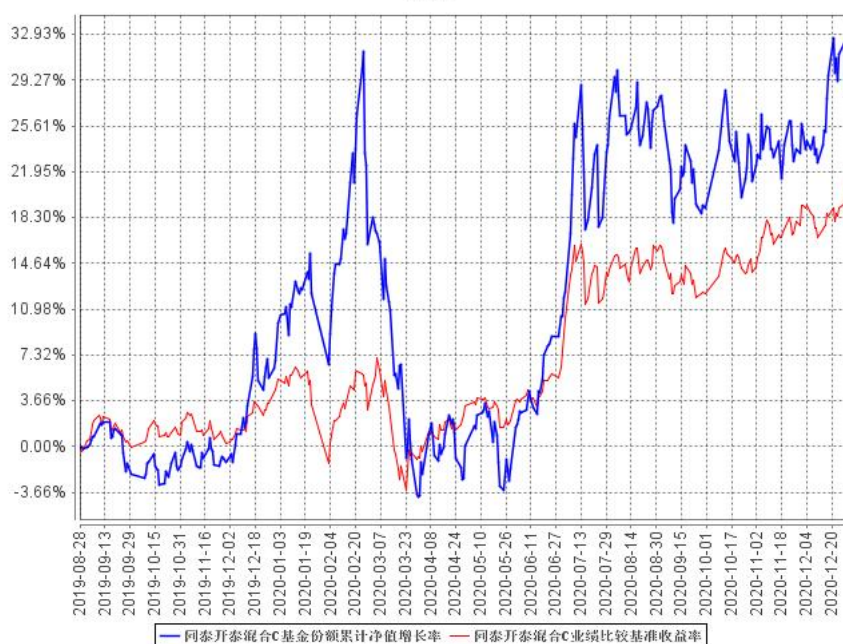
注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%，每日进行再平衡过程。

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



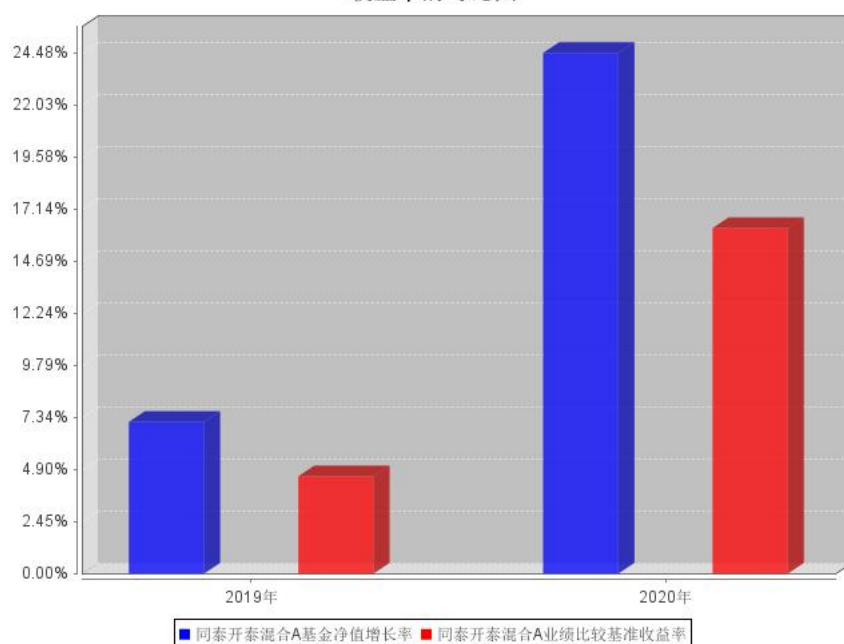
同泰开泰混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



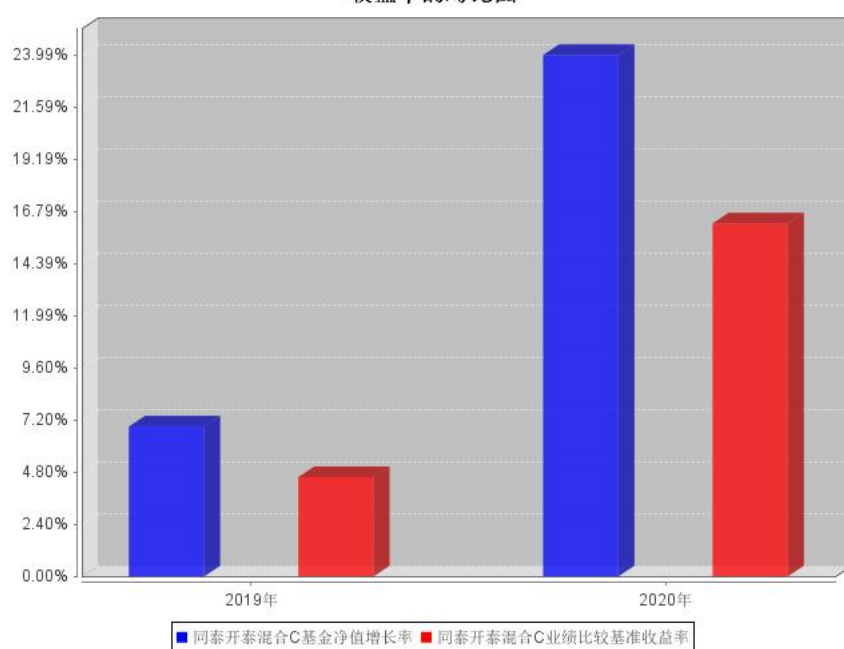
注：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

3.2.3 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

本基金自 2019 年 8 月 28 日（基金合同生效日）起至报告期期末未进行利润分配。

§ 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9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	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。

4.1.3 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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，不存在本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，不存在本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 年是经济与资本市场波动剧烈的一年，一季度本已进入温和补库存阶段的国内经济被新冠疫情打断，疫情不断蔓延。好在国内的有力管控带来了良好效果，国内经济在三季度开始持续复苏。而国际各国的管控路径选择差别显著，国际市场一季度经历了严重的流动性危机，之后在货币大放水条件下迅速反弹，各国利率显著下行；但国际经济的秩序远没有中国恢复得这么快、这么好。到第四季度，国际贸易订单完全投向了拥有完整产业链、在持续开工的中国。

本基金 2020 年度的业绩并不理想，总结原因有两个，一是在疫情全球蔓延之后对风险研判不足，组合之前重配了景气度较高的电子、新基建投资两个成长方向，这两个方向本身是高 Beta 属性，疫情蔓延之前收益体现较快；但在全球流动性危机、美股熔断期间，国内股市跟随调整，本基金净值回撤过快，是对风险的预判和管控不足。二是在年中对医药成长、全球医疗器械和检测方向配置过少，导致净值反弹较慢；虽然下半年重点配置了太阳能、新能源车、内需消费等方

向，但年中缺失的一段有效配置导致了全年的收益不够理想。

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 1.3336 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.48%；截至本报告期末同泰开泰混合 C 基金份额净值为 1.3254 元，本报告期基金份额净值增长率为 23.99%；同期业绩比较基准收益率为 16.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们中长期坚定看好国内经济与资本市场的前景，也坚定看好部分子行业的成长性和优质公司的发展空间。我国经济受益于国内防控良好和全球贸易需求拉动，中国经济也会是今年全球复苏的火车头。随着疫苗接种、国际货币充裕延续、利率低位，全球的需求复苏会带动资源品和上游工业品景气高涨，中期看会从 PPI 向 CPI 部分传导。下半年到明年，国际市场的货币政策可能会随着全面复苏而逐步转向，这也会带来不同类型资产的波动。

本产品持续关注两类方向，一是从中长期视角自下而上选择消费、医疗服务、金融等长期增长类行业，同时注重估值的合理性；二是阶段配置新兴领域或技术突破的优势公司、阶段受益于经济复苏的行业等。2021 年上半年我们看好复苏受益的资源品如工业金属、国内化工品、银行、房地产下游等，随后看好利率上行、估值下行之后的成长板块，如医疗服务、新能源、消费品牌等。另外，债市在上半年会逐步迎来阶段配置机会。

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，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益的落脚点出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，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，确保各项法规和管理制度的落实。

公司监察稽核部按照规定的权限和程序，通过合规审查、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，会计师事务所对当期财务会计报告出具的是标准审计报告。

4.10 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，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(2021)第 1958 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 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	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。
强调事项	-
其他事项	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投资基金业协会及其派出机构报送使用(如需),不得用于其他目的。
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 2020 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</p>

	<p>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</p>

	<p>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	2021 年 3 月 26 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,595,232.01	13,512,968.20
结算备付金		2,650,080.93	3,711,771.77
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	57,451,486.33	133,393,758.95
其中：股票投资		57,309,800.93	127,667,922.16
基金投资		-	-
债券投资		141,685.40	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	1,114.53	152,266.71
应收股利		-	-
应收申购款		18,026.05	139,592.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		64,715,939.85	150,910,357.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 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		21,677.31	4,805,965.39
应付管理人报酬		81,565.21	258,403.48
应付托管费		10,875.36	34,453.79
应付销售服务费		3,035.71	25,638.80
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		0.42	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	210,009.58	83,242.41
负债合计		327,163.59	5,208,640.46
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	48,323,450.68	136,083,210.27
未分配利润	7.4.7.10	16,065,325.58	9,618,507.12
所有者权益合计		64,388,776.26	145,701,717.39
负债和所有者权益总计		64,715,939.85	150,910,357.85

报告截止日 2020 年 12 月 31 日，同泰开泰混合 A 基金份额净值 1.3336 元，基金份额总额 41,656,407.46 份；同泰开泰混合 C 基金份额净值 1.3254 元，基金份额总额 6,667,043.22 份。同泰开泰混合份额总额合计为 48,323,450.68 份。

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 8 月 28 日(基 金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		26,997,938.19	15,879,044.57
1.利息收入		129,720.01	1,857,035.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	55,683.07	137,513.19
债券利息收入		60,783.89	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		13,253.05	631,897.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		29,519,715.09	6,709,934.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	26,933,947.73	6,673,553.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	286,839.57	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	1,476,969.93	-275,780.00
股利收益	7.4.7.16	821,957.86	425,250.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,884,088.96	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	232,592.05	233,843.18
减：二、费用		4,078,440.70	3,823,759.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,550,125.34	1,820,140.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	206,683.35	242,685.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	81,936.99	286,745.04
4. 交易费用	7.4.7.19	2,050,831.14	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		13,463.88	3,296.01
7. 其他费用	7.4.7.20	175,400.00	76,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,919,497.49	12,055,285.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,919,497.49	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：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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）	136,083,210.27	9,618,507.12	145,701,717.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,919,497.49	22,919,497.49
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）	-87,759,759.59	-16,472,679.03	-104,232,438.62
其中：1. 基金申购款	62,832,511.81	8,047,588.11	70,880,099.92
2. 基金赎回款	-150,592,271.40	-24,520,267.14	-175,112,538.54
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）	48,323,450.68	16,065,325.58	64,388,776.26
	上年度可比期间		
	2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日		
项目	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(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]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混合型基金。基金存续期限为不定期。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。

本基金主要投资于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以及存托凭证)、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(含存托凭证)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 \times 60%+中债综合全价(总值)指数收益率 \times 40%。

7.4.2 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》、《公开募集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。

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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。

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

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。

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

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

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。

7.4.4.8 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）”。

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。

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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	770,876.28	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	3,824,355.73	13,018,109.96
合计：	4,595,232.01	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 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	53,152,474.00	57,309,800.93	4,157,326.93
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	104,869.29	141,685.40
	银行间市场	-	-
	合计	104,869.29	141,685.40

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	53,257,343.29	57,451,486.33	4,194,143.04
项目	上年度末 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

无。

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	35.42	126.49
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	615.67	1,157.09
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	440.36	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	23.08	-

应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	1,114.53	152,266.71

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

无。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	9.58	7,242.41
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	210,000.00	76,000.00
合计	210,009.58	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 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	99,112,936.38	99,112,936.38
本期申购	45,922,743.75	45,922,743.75
本期赎回（以“-”号填列）	-103,379,272.67	-103,379,272.67
- 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	41,656,407.46	41,656,407.46

金额单位：人民币元

同泰开泰混合 C

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	36,970,273.89	36,970,273.89
本期申购	16,909,768.06	16,909,768.06
本期赎回(以“-”号填列)	-47,212,998.73	-47,212,998.73
- 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	6,667,043.22	6,667,043.22

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。

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
上年度末	2,744,693.23	4,321,409.35	7,066,102.58
本期利润	20,493,730.79	-2,156,915.11	18,336,815.68
本期基金份额交易产生的变动数	-8,293,324.76	-3,213,744.03	-11,507,068.79
其中：基金申购款	5,651,387.70	638,638.12	6,290,025.82
基金赎回款	-13,944,712.46	-3,852,382.15	-17,797,094.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,945,099.26	-1,049,249.79	13,895,849.47

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
上年度末	944,284.74	1,608,119.80	2,552,404.54
本期利润	5,309,855.66	-727,173.85	4,582,681.81
本期基金份额交易产生的变动数	-3,917,318.06	-1,048,292.18	-4,965,610.24
其中：基金申购款	1,412,206.12	345,356.17	1,757,562.29
基金赎回款	-5,329,524.18	-1,393,648.35	-6,723,172.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,336,822.34	-167,346.23	2,169,476.11

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年 12月31日	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	7,755.23	19,418.95
定期存款利息收入	-	84,972.22
其他存款利息收入	30,497.16	33,122.02
结算备付金利息收入	17,370.08	-
其他	60.60	-
合计	55,683.07	137,513.19

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年8月28日(基金合同生 效日)至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	26,933,947.73	6,673,553.40
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	26,933,947.73	6,673,553.40

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 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	772,614,443.42	464,743,738.02
减：卖出股票成本总额	745,680,495.69	458,070,184.62
买卖股票差价收入	26,933,947.73	6,673,553.40

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 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	286,839.57	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	286,839.57	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 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 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	10,274,610.30	132,932,372.23
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	9,746,011.25	129,928,788.61
减：应收利息总额	241,759.48	2,877,620.79
买卖债券差价收入	286,839.57	125,962.83

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 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

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

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	上年度可比期间收益金额
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年8月28日(基金合同生效日)至2019年12月31日
国债期货投资收益	18,834.95	-
股指期货-投资收益	1,458,134.98	-275,780.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	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	821,957.86	425,250.00
其中：证券出借权益补偿收入	-	-

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	821,957.86	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 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 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	-2,884,088.96	7,078,232.00
——股票投资	-2,930,787.07	7,088,114.00
——债券投资	46,698.11	-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	-2,884,088.96	7,078,232.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 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	232,467.58	233,843.18
转换费收入 007770	124.47	-
合计	232,592.05	233,843.18

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 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	2,050,831.14	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	2,050,831.14	1,394,492.75

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年8月28日(基金合同 生效日)至2019年12月31日
审计费用	40,000.00	26,000.00
信息披露费	120,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
中债登账户维护费	15,000.00	-
开户费	400.00	-
其他费用	-	400.00
合计	175,400.00	76,400.00

7.4.7.21 分部报告

无。

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

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

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	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	1,550,125.34	1,820,140.25
其中：支付销售机构的客户维护费	269,104.50	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	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	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	206,683.35	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		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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	-	28,535.60	28,535.60
平安银行股份有限公司	-	11,322.79	11,322.79
合计	-	39,858.39	39,858.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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	-	59,463.25	59,463.25
平安银行股份有限公司	-	8,954.88	8,954.88
合计	-	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

无。

7.4.10.4 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**7.4.10.4.1 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**

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020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	-
报告期初持有的基金份额	20,000,277.77	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	20,000,277.77	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-

项目	上年度可比期间 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	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	20,000,277.77	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	20.18%	-

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。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

同泰开泰混合 A				
关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
自然人股东	42,070.54	0.09%	34,920.39	0.04%

份额单位：份

同泰开泰混合 C				
关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
自然人股东	0.00	0.00%	10.01	0.00%

7.4.10.6 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 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
平安银行	770,876.28	7,755.23	494,858.24	19,418.95

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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（2020 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
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	138.02	126.67	45	6,210.90	5,700.15	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	43.76	51.10	138	6,038.88	7,051.80	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	新股流通受限	71.71	90.85	54	3,872.34	4,905.90	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年3月3日	新股流通受限	19.34	31.97	390	7,542.60	12,468.30	-
300872	天阳科技	2020年8月14日	2021年2月25日	新股流通受限	21.34	37.84	203	4,332.02	7,681.52	-
300876	蒙泰高新	2020年8月14日	2021年2月25日	新股流通受限	20.09	36.62	214	4,299.26	7,836.68	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	新股流通受限	30.54	50.85	165	5,039.10	8,390.25	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	新股流通受限	41.34	48.72	121	5,002.14	5,895.12	-
300879	大叶	2020年	2021	新股流	10.58	27.12	280	2,962.40	7,593.60	-

	股份	8 月 25 日	年 3 月 1 日	通受限						
300882	万胜智能	2020 年 8 月 27 日	2021 年 3 月 10 日	新股流通受限	10.33	25.79	284	2,933.72	7,324.36	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股流通受限	16.95	16.95	469	7,949.55	7,949.55	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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 0.17%。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期不适用。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期不适用。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期不适用。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期不适用。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期不适用。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期不适用。

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，本基金所持的大部分证券均能及时变现，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 2020 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	4,595,232.01	-	-	-	4,595,232.01
结算备付金	2,650,080.93	-	-	-	2,650,080.93
交易性金融资产	108,227.00	-	33,458.40	57,309,800.93	57,451,486.33
应收利息	-	-	-	1,114.53	1,114.53
应收申购款	-	-	-	18,026.05	18,026.05
资产总计	7,353,539.94	-	33,458.40	57,328,941.51	64,715,939.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,677.31	21,677.31
应付管理人报酬	-	-	-	81,565.21	81,565.21
应付托管费	-	-	-	10,875.36	10,875.36
应付销售服务费	-	-	-	3,035.71	3,035.71
应交税费	-	-	-	0.42	0.42
其他负债	-	-	-	210,009.58	210,009.58
负债总计	-	-	-	327,163.59	327,163.59
利率敏感度缺口	7,353,539.94	-	33,458.40	57,001,777.92	64,388,776.26
上年度末 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。

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 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	57,309,800.93	89.01	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	141,685.40	0.22	-	-
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	57,451,486.33	89.23	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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	沪深300指数收益率上升5%	3,702,354.63	8,394,435.99
	沪深300指数收益率下降5%	-3,702,354.63	-8,394,435.99

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金本报告期不适用。

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 57,322,034.81 元，划分为第二层次的余额为人民币 129,451.52 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	57,309,800.93	88.56
	其中：股票	57,309,800.93	88.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	141,685.40	0.22
	其中：债券	141,685.40	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	-	-
	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	7,245,312.94	11.20
8	其他各项资产	19,140.58	0.03
9	合计	64,715,939.85	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	3,505,100.00	5.44
C	制造业	47,563,450.08	73.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	657,300.00	1.02
F	批发和零售业	680,220.12	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	11,405.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,087,251.38	3.24
J	金融业	2,304,400.00	3.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	494,974.20	0.77
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	5,700.15	0.01
S	综合	-	-
	合计	57,309,800.93	89.01

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	600438	通威股份	80,000	3,075,200.00	4.78
2	002074	国轩高科	60,000	2,347,200.00	3.65
3	300274	阳光电源	27,000	1,951,560.00	3.03
4	601899	紫金矿业	210,000	1,950,900.00	3.03
5	000651	格力电器	30,000	1,858,200.00	2.89
6	002601	龙蟠佰利	60,000	1,846,200.00	2.87
7	601012	隆基股份	20,000	1,844,000.00	2.86
8	000858	五粮液	6,000	1,751,100.00	2.72
9	603313	梦百合	50,000	1,621,000.00	2.52
10	000933	神火股份	200,000	1,596,000.00	2.48
11	000807	云铝股份	210,000	1,581,300.00	2.46
12	000799	酒鬼酒	10,000	1,565,000.00	2.43
13	300433	蓝思科技	50,000	1,530,500.00	2.38
14	300082	奥克股份	140,000	1,458,800.00	2.27
15	000661	长春高新	3,000	1,346,730.00	2.09
16	300438	鹏辉能源	50,000	1,314,000.00	2.04
17	002286	保龄宝	110,000	1,254,000.00	1.95
18	002555	三七互娱	40,000	1,249,200.00	1.94
19	300035	中科电气	100,000	1,225,000.00	1.90
20	300568	星源材质	40,000	1,210,800.00	1.88
21	600926	杭州银行	80,000	1,193,600.00	1.85
22	688599	天合光能	50,000	1,157,500.00	1.80
23	002675	东诚药业	50,000	995,500.00	1.55
24	002385	大北农	100,000	966,000.00	1.50

25	601233	桐昆股份	45,000	926,550.00	1.44
26	300118	东方日升	30,000	864,900.00	1.34
27	600196	复星医药	15,000	809,850.00	1.26
28	300448	浩云科技	90,000	793,800.00	1.23
29	600985	淮北矿业	70,000	783,300.00	1.22
30	601666	平煤股份	130,000	770,900.00	1.20
31	000703	恒逸石化	60,000	768,000.00	1.19
32	603799	华友钴业	9,500	753,350.00	1.17
33	600426	华鲁恒升	20,000	746,000.00	1.16
34	300206	理邦仪器	40,000	730,000.00	1.13
35	002142	宁波银行	20,000	706,800.00	1.10
36	603108	润达医疗	60,000	670,800.00	1.04
37	002759	天际股份	40,000	664,800.00	1.03
38	002081	金螳螂	70,000	657,300.00	1.02
39	300737	科顺股份	30,000	643,800.00	1.00
40	605099	共创草坪	20,000	621,000.00	0.96
41	300207	欣旺达	20,000	614,200.00	0.95
42	002241	歌尔股份	16,000	597,120.00	0.93
43	300567	精测电子	10,000	549,400.00	0.85
44	000869	张裕 A	11,000	479,600.00	0.74
45	603688	石英股份	20,000	470,400.00	0.73
46	300373	扬杰科技	10,000	444,200.00	0.69
47	002007	华兰生物	10,000	422,400.00	0.66
48	601009	南京银行	50,000	404,000.00	0.63
49	688608	恒玄科技	900	297,900.00	0.46
50	600745	闻泰科技	3,000	297,000.00	0.46
51	300132	青松股份	15,000	281,850.00	0.44
52	603612	索通发展	20,000	273,400.00	0.42
53	600323	瀚蓝环境	10,000	248,100.00	0.39
54	000895	双汇发展	5,000	234,700.00	0.36
55	603916	苏博特	10,000	229,700.00	0.36
56	300070	碧水源	30,000	229,500.00	0.36
57	600276	恒瑞医药	2,000	222,920.00	0.35
58	000625	长安汽车	10,000	218,800.00	0.34
59	000021	深科技	10,000	190,100.00	0.30
60	603686	龙马环卫	10,000	160,800.00	0.25
61	002709	天赐材料	1,000	103,800.00	0.16
62	002064	华峰化学	10,000	100,900.00	0.16
63	300014	亿纬锂能	1,000	81,500.00	0.13

64	600893	航发动力	1,000	59,350.00	0.09
65	003029	吉大正元	1,399	36,569.86	0.06
66	003022	联泓新科	2,304	35,665.92	0.06
67	003028	振邦智能	842	35,102.98	0.05
68	002389	航天彩虹	1,000	33,250.00	0.05
69	003016	欣贺股份	1,681	15,784.59	0.02
70	300867	圣元环保	390	12,468.30	0.02
71	605179	一鸣食品	699	12,344.34	0.02
72	688658	悦康药业	500	12,185.00	0.02
73	603565	中谷物流	500	11,405.00	0.02
74	003020	立方制药	274	9,420.12	0.01
75	300877	金春股份	165	8,390.25	0.01
76	605277	新亚电子	469	7,949.55	0.01
77	300876	蒙泰高新	214	7,836.68	0.01
78	300872	天阳科技	203	7,681.52	0.01
79	300879	大叶股份	280	7,593.60	0.01
80	300882	万胜智能	284	7,324.36	0.01
81	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
82	300861	美畅股份	138	7,051.80	0.01
83	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01
84	300878	维康药业	121	5,895.12	0.01
85	300860	锋尚文化	45	5,700.15	0.01
86	300864	南大环境	54	4,905.90	0.01

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300136	信维通信	14,009,617.95	9.62
2	000021	深科技	13,299,120.60	9.13
3	002174	游族网络	12,541,852.00	8.61
4	002709	天赐材料	12,338,581.00	8.47
5	600183	生益科技	11,443,696.00	7.85
6	000625	长安汽车	11,282,296.00	7.74
7	002074	国轩高科	11,201,910.86	7.69
8	600160	巨化股份	9,260,245.46	6.36

9	300037	新宙邦	8,964,209.00	6.15
10	002384	东山精密	8,781,328.04	6.03
11	002396	星网锐捷	8,573,478.00	5.88
12	002241	歌尔股份	8,460,975.74	5.81
13	600438	通威股份	7,841,795.00	5.38
14	002456	欧菲光	7,759,857.50	5.33
15	300014	亿纬锂能	7,594,506.80	5.21
16	000636	风华高科	7,590,743.36	5.21
17	601012	隆基股份	7,505,803.00	5.15
18	603079	圣达生物	7,385,480.64	5.07
19	002600	领益智造	7,333,852.00	5.03
20	600801	华新水泥	7,139,447.72	4.90
21	300408	三环集团	6,949,282.00	4.77
22	300133	华策影视	6,932,909.00	4.76
23	002146	荣盛发展	6,744,051.00	4.63
24	002555	三七互娱	6,537,365.64	4.49
25	300118	东方日升	6,460,479.00	4.43
26	300438	鹏辉能源	6,453,823.50	4.43
27	002036	联创电子	6,202,093.37	4.26
28	601138	工业富联	6,190,099.00	4.25
29	600131	国网信通	6,096,271.00	4.18
30	002626	金达威	5,984,495.40	4.11
31	002129	中环股份	5,970,194.00	4.10
32	300433	蓝思科技	5,961,787.00	4.09
33	000100	TCL 科技	5,927,075.00	4.07
34	000050	深天马 A	5,877,595.00	4.03
35	000553	安道麦 A	5,761,770.00	3.95
36	002286	保龄宝	5,566,460.65	3.82
37	002402	和而泰	5,422,262.00	3.72
38	002117	东港股份	5,399,103.40	3.71
39	300054	鼎龙股份	5,387,161.00	3.70
40	601231	环旭电子	5,337,090.00	3.66
41	600378	昊华科技	5,270,846.80	3.62
42	300829	金丹科技	5,195,129.22	3.57
43	600637	东方明珠	5,011,439.39	3.44
44	002343	慈文传媒	4,925,835.00	3.38

45	601872	招商轮船	4,919,018.00	3.38
46	300274	阳光电源	4,771,836.03	3.28
47	300073	当升科技	4,754,276.00	3.26
48	002460	赣锋锂业	4,707,533.36	3.23
49	002138	顺络电子	4,549,952.00	3.12
50	002876	三利谱	4,489,142.00	3.08
51	000002	万科 A	4,484,200.00	3.08
52	000401	冀东水泥	4,373,706.22	3.00
53	002601	龙蟒佰利	4,360,807.00	2.99
54	600496	精工钢构	4,348,129.00	2.98
55	603636	南威软件	4,341,097.90	2.98
56	002815	崇达技术	4,161,756.00	2.86
57	300623	捷捷微电	3,995,420.00	2.74
58	002081	金螳螂	3,982,842.00	2.73
59	002497	雅化集团	3,969,305.00	2.72
60	002001	新和成	3,961,109.00	2.72
61	300003	乐普医疗	3,954,600.00	2.71
62	000603	盛达资源	3,920,400.00	2.69
63	002326	永太科技	3,794,838.31	2.60
64	000858	五粮液	3,516,059.00	2.41
65	603659	璞泰来	3,493,540.00	2.40
66	300326	凯利泰	3,468,368.00	2.38
67	300059	东方财富	3,437,170.00	2.36
68	600900	长江电力	3,423,035.00	2.35
69	002007	华兰生物	3,420,145.95	2.35
70	603160	汇顶科技	3,419,901.00	2.35
71	600026	中远海能	3,312,920.00	2.27
72	002142	宁波银行	3,279,838.00	2.25
73	300035	中科电气	3,271,601.00	2.25
74	002123	梦网科技	3,269,829.00	2.24
75	002368	太极股份	3,259,477.00	2.24
76	603650	彤程新材	3,236,962.00	2.22
77	600977	中国电影	3,215,753.00	2.21
78	300737	科顺股份	3,206,082.00	2.20
79	300206	理邦仪器	3,170,382.00	2.18
80	300082	奥克股份	3,095,179.00	2.12

81	300336	新文化	3,092,061.00	2.12
82	300142	沃森生物	3,062,934.71	2.10
83	300132	青松股份	3,056,502.00	2.10
84	600529	山东药玻	3,048,000.00	2.09
85	600196	复星医药	3,028,920.00	2.08
86	603686	龙马环卫	2,935,473.20	2.01

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002384	东山精密	21,320,240.26	14.63
2	601231	环旭电子	20,551,757.40	14.11
3	002709	天赐材料	15,330,473.00	10.52
4	002241	歌尔股份	15,028,709.57	10.31
5	000021	深科技	14,252,625.60	9.78
6	300136	信维通信	13,766,756.20	9.45
7	002074	国轩高科	13,708,626.78	9.41
8	002001	新和成	13,596,155.43	9.33
9	000625	长安汽车	12,379,368.32	8.50
10	002174	游族网络	12,241,886.00	8.40
11	600183	生益科技	11,609,451.60	7.97
12	002456	欧菲光	11,439,955.15	7.85
13	600406	国电南瑞	9,777,299.12	6.71
14	300014	亿纬锂能	9,616,639.40	6.60
15	601012	隆基股份	9,323,062.73	6.40
16	300037	新宙邦	8,608,792.84	5.91
17	300383	光环新网	8,569,790.01	5.88
18	002396	星网锐捷	8,125,099.00	5.58
19	600160	巨化股份	7,854,278.55	5.39
20	002600	领益智造	7,658,465.00	5.26
21	300408	三环集团	7,311,408.79	5.02
22	300003	乐普医疗	7,206,632.71	4.95
23	002138	顺络电子	7,198,655.00	4.94
24	600346	恒力石化	7,090,406.38	4.87
25	002146	荣盛发展	7,048,776.00	4.84

26	002142	宁波银行	7,025,269.39	4.82
27	300133	华策影视	6,991,622.00	4.80
28	000338	潍柴动力	6,734,830.00	4.62
29	600438	通威股份	6,733,968.00	4.62
30	000636	风华高科	6,721,804.30	4.61
31	600801	华新水泥	6,599,386.01	4.53
32	002626	金达威	6,579,570.50	4.52
33	300118	东方日升	6,538,998.00	4.49
34	002286	保龄宝	6,531,565.48	4.48
35	600216	浙江医药	6,446,607.00	4.42
36	300054	鼎龙股份	6,437,322.27	4.42
37	600131	国网信通	6,176,478.00	4.24
38	002129	中环股份	6,165,136.00	4.23
39	300829	金丹科技	6,135,118.60	4.21
40	002036	联创电子	6,045,073.00	4.15
41	601138	工业富联	5,788,015.98	3.97
42	000050	深天马 A	5,712,501.38	3.92
43	300438	鹏辉能源	5,626,734.00	3.86
44	000100	TCL 科技	5,613,152.00	3.85
45	603079	圣达生物	5,554,869.00	3.81
46	000553	安道麦 A	5,496,747.58	3.77
47	600637	东方明珠	5,215,428.35	3.58
48	600378	昊华科技	5,213,667.94	3.58
49	002460	赣锋锂业	5,146,803.00	3.53
50	300274	阳光电源	5,119,074.00	3.51
51	600703	三安光电	5,000,647.00	3.43
52	002402	和而泰	4,921,373.00	3.38
53	002555	三七互娱	4,774,273.00	3.28
54	000002	万科 A	4,541,245.00	3.12
55	300073	当升科技	4,501,495.00	3.09
56	002815	崇达技术	4,437,122.00	3.05
57	603650	彤程新材	4,403,183.00	3.02
58	603659	璞泰来	4,293,594.00	2.95
59	002117	东港股份	4,270,481.75	2.93
60	002745	木林森	4,257,824.00	2.92
61	000951	中国重汽	4,250,593.00	2.92
62	002497	雅化集团	4,185,551.00	2.87
63	300433	蓝思科技	4,156,635.00	2.85

64	300623	捷捷微电	4,155,807.60	2.85
65	601872	招商轮船	4,108,405.00	2.82
66	002326	永太科技	4,091,416.03	2.81
67	600352	浙江龙盛	4,080,037.00	2.80
68	600496	精工钢构	4,059,692.00	2.79
69	002876	三利谱	3,944,373.00	2.71
70	000401	冀东水泥	3,849,369.00	2.64
71	300326	凯利泰	3,727,837.00	2.56
72	300070	碧水源	3,703,722.21	2.54
73	002343	慈文传媒	3,659,779.00	2.51
74	002601	龙蟠佰利	3,618,754.00	2.48
75	300132	青松股份	3,569,480.79	2.45
76	603636	南威软件	3,555,013.10	2.44
77	600900	长江电力	3,496,050.00	2.40
78	600585	海螺水泥	3,344,219.00	2.30
79	000603	盛达资源	3,319,448.00	2.28
80	002123	梦网科技	3,308,067.00	2.27
81	603133	碳元科技	3,118,921.00	2.14
82	300059	东方财富	3,088,257.00	2.12
83	002368	太极股份	3,062,000.00	2.10
84	603686	龙马环卫	3,054,304.00	2.10
85	600529	山东药玻	3,051,697.00	2.09
86	603160	汇顶科技	2,962,358.03	2.03
87	603605	珀莱雅	2,952,299.00	2.03
88	002081	金螳螂	2,946,737.00	2.02

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	678,253,161.53
卖出股票收入（成交）总额	772,614,443.42

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	33,458.40	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）	108,227.00	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	141,685.40	0.22

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	113041	紫金转债	700	108,227.00	0.17
2	019547	16 国债 19	360	33,458.40	0.05

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

无。

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

无。

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

无。

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					1,458,134.98
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					18,834.95
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

8.11.3 本期国债期货投资评价

在报告期内，本基金认为利率债收益率会阶段下行，所以用国债期货的套期保值功能进行了买入套期保值，实现了一定的收益。

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

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。

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	1,114.53
5	应收申购款	18,026.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,140.58

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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	669	62,266.68	17,018,977.11	40.86%	24,637,430.35	59.14%
同泰开泰混合 C	552	12,077.98	-	-	6,667,043.22	100.00%
合计	1,221	39,576.95	17,018,977.11	35.22%	31,304,473.57	64.78%

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	1,446,568.21	3.47%
	同泰开泰混合 C	12,991.03	0.19%
	合计	1,459,559.24	3.02%

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	0~10
	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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 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
本报告期期初基金份额总额	99,112,936.38	36,970,273.89
本报告期基金总申购份额	45,922,743.75	16,909,768.06
减:本报告期基金总赎回份额	103,379,272.67	47,212,998.73
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,656,407.46	6,667,043.22

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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：

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

截至本报告期末，上会会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 2 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 4 万元。

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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	1,164,656,861.62	80.47%	839,633.21	80.67%	-
万联证券	2	282,653,596.68	19.53%	201,128.67	19.33%	-

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	8,356,566.72	97.54%	40,000,000.00	32.81%	-	-
万联证券	210,621.54	2.46%	81,900,000.00	67.19%	-	-

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
2	同泰基金管理有限公司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
3	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——唐鼎耀华	中国证监会指定的媒介	2020年3月5日
4	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——光大银行	中国证监会指定的媒介	2020年3月9日
5	同泰开泰混合型证券投资基金 2020 年第一季度报告	中国证监会指定的媒介	2020年4月21日
6	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
7	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——中信华南	中国证监会指定的媒介	2020年5月6日

8	同泰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定的媒介	2020年5月22日
9	同泰基金管理有限公司关于旗下基金参与销售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
10	同泰开泰混合型证券投资基金 2020 年第二季度报告	中国证监会指定的媒介	2020年7月21日
11	同泰开泰混合型证券投资基金托管协议（更新）	中国证监会指定的媒介	2020年8月20日
12	同泰开泰混合型证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会指定的媒介	2020年8月20日
13	同泰开泰混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定的媒介	2020年8月25日
14	同泰开泰混合型证券投资基金招募说明书摘要（更新）	中国证监会指定的媒介	2020年8月25日
15	同泰开泰混合型证券投资基金 2020 年中期报告	中国证监会指定的媒介	2020年8月31日
16	同泰开泰混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定的媒介	2020年8月31日
17	同泰基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证监会指定的媒介	2020年10月16日
18	同泰开泰混合型证券投资基金托管协议（更新）	中国证监会指定的媒介	2020年10月17日
19	同泰开泰混合型证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会指定的媒介	2020年10月17日
20	同泰基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同的公告	中国证监会指定的媒介	2020年10月17日
21	同泰开泰混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定的媒介	2020年10月21日
22	同泰开泰混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定的媒介	2020年10月21日
23	同泰开泰混合型证券投资基金 2020 年第三季度报告	中国证监会指定的媒介	2020年10月28日
24	同泰基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会指定的媒介	2020年12月9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

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	20200730-20201231	17,018,977.11	-	-	17,018,977.11	35.22%
个人	1	20200807-20201231	14,999,958.33	-	-	14,999,958.33	31.04%
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。							

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/或基金托管人的住所或办公场所。

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 (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

2021 年 3 月 31 日