同泰慧盈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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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遵规守信情况声明 17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 52
8.1 期末基金资产组合情况 52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 52
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 53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 64

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 65
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 65
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 65
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 65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 66
8.12 投资组合报告附注 66
§9 基金份额持有人信息 68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 68
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 68
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 68
§10 开放式基金份额变动 69
§11 重大事件揭示 70
11.1 基金份额持有人大会决议 70
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 70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 70
11.4 基金投资策略的改变 70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 70
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 70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 70
11.8 其他重大事件 71
§12 影响投资者决策的其他重要信息 73
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 73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 73
§13 备查文件目录 74
13.1 备查文件目录 74
13.2 存放地点 74
13.3 查阅方式 74

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	同泰慧盈混合型证券投资基金	
基金简称	同泰慧盈混合	
场内简称	-	
基金主代码	008178	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 11 月 26 日	
基金管理人	同泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	159,113,585.43 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：	同泰慧盈混合 A	同泰慧盈混合 C
下属分级基金的场内简称：	-	-
下属分级基金的交易代码：	008178	008179
报告期末下属分级基金的份额总额	45,529,749.62 份	113,583,835.81 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×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%	
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。	
	同泰慧盈混合 A	同泰慧盈混合 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	滕大江	石立平
	联系电话	0755-23537892	010-63639180

	电子邮箱	tengdj@tongtaiamc.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-830-1666	95595
传真		0755-23537801	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		518033	100033
法定代表人		马俊生	李晓鹏

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 11 月 26 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日		2018 年	
	同泰慧盈混合 A	同泰慧盈混合 C	同泰慧盈混合 A	同泰慧盈混合 C	同泰慧盈混合 A	同泰慧盈混合 C
本期已实现收益	4,524,620.45	26,678,351.46	118,626.26	553,542.87	-	-
本期利润	10,622,340.51	38,622,591.79	214,607.41	1,056,709.35	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.3811	0.3512	0.0063	0.0059	-	-
本期加权平均净值利润率	32.32%	30.60%	0.63%	0.59%	-	-
本期基金份额净值增长率	42.20%	41.63%	0.63%	0.59%	-	-
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	17,075,901.88	41,915,677.72	118,626.26	553,542.87	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.3750	0.3690	0.0035	0.0031	-	-
期末基金资产净值	65,154,364.19	161,828,331.45	34,124,435.52	178,866,528.48	-	-
期末基金份额净值	1.4310	1.4247	1.0063	1.0059	-	-
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	43.10%	42.47%	0.63%	0.59%	-	-

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

同泰慧盈混合 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	12.36%	0.77%	9.61%	0.69%	2.75%	0.08%
过去六个月	38.34%	1.16%	17.00%	0.94%	21.34%	0.22%
过去一年	42.20%	1.30%	18.99%	0.99%	23.21%	0.31%
自基金合同生效起至今	43.10%	1.23%	23.86%	0.96%	19.24%	0.27%

同泰慧盈混合 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	12.24%	0.77%	9.61%	0.69%	2.63%	0.08%
过去六个月	38.07%	1.16%	17.00%	0.94%	21.07%	0.22%
过去一年	41.63%	1.30%	18.99%	0.99%	22.64%	0.31%
自基金合同生效起至今	42.47%	1.23%	23.86%	0.96%	18.61%	0.27%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%，每日进行再平衡过程。

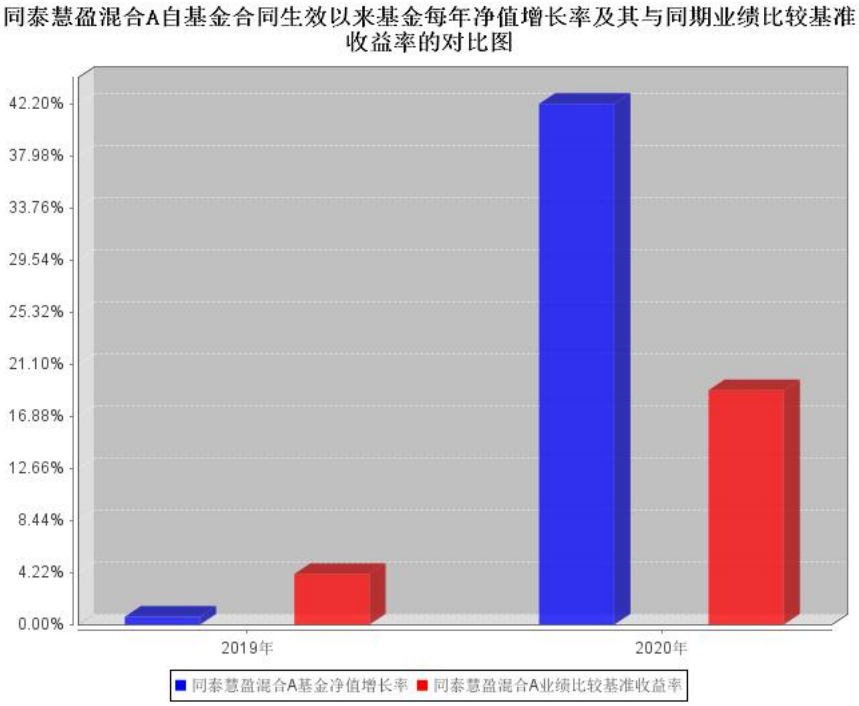
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

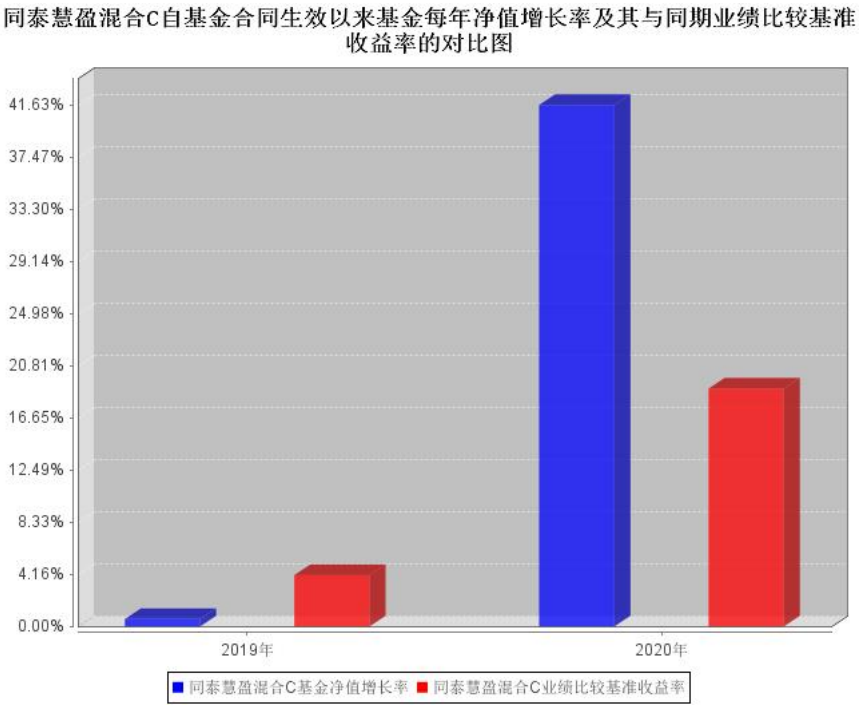
同泰慧盈混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

同泰慧盈混合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





注：本基金合同生效日为 2019 年 11 月 26 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 11 月 26 日（基金合同生效日）起至报告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%，刘韫芬女士 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11月26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。
李莘泰	本基金的基金经理助理、研究员	2020 年 8 月 18 日	-	4	李莘泰先生，中国国籍，硕士。曾任渤海证券分析师。2019 年 4 月加入同泰基金管理有限公司，现任投资研究部研究

					员兼基金经理助理。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 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。

本基金全年保持了偏高的权益仓位，组合结构比较均衡，持有太阳能、医药、消费、新能源车等成长板块，也持有内需消费、建材、汽车、金融地产等板块。组合精选多领域的优质公司，针对沪深 300 做了适当增强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰慧盈混合 A 基金份额净值为 1.4310 元，本报告期基金份额净值增长率为 42.20%；截至本报告期末同泰慧盈混合 C 基金份额净值为 1.4247 元，本报告期基金份额净值增长率为 41.63%；同期业绩比较基准收益率为 18.99%。

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。

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。本基金基于产业长期竞争力的视角，结合估值的合理性，进

行组合配置。我们中长期积极乐观地看待国内权益市场，也会持续把超越沪深 300 作为产品的组合目标。

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。

本基金本报告期未进行利润分配。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在同泰慧盈混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《同泰慧盈混合型证券投资基金 2020 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§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 1961 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	同泰慧盈混合型证券投资基金全体份额持有人
审计意见	我们审计了同泰慧盈混合型证券投资基金(以下简称“同泰慧盈混合基金”)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。 我们认为，后附同泰慧盈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》、《同泰慧盈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，公允反映了同泰慧盈混合基金 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。
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，我们独立于同泰慧盈混合基金，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慧盈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《同泰慧盈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于其他用途。本报告仅供管理人管理层提供同泰慧盈混合基金份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用（如需），不得用于其他目的。
其他信息	管理人管理层对其他信息负责。其他信息包括同泰慧盈混合基金 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。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他

	信息发表任何形式的鉴证结论。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	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》、《同泰慧盈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。 在编制财务报表时，管理人管理层负责评估同泰慧盈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。 管理人治理层负责监督同泰慧盈混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： 1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗

	漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 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。 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。 4、对管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对同泰慧盈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慧盈混合基金不能持续经营。 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。 我们与管理人治理层就同泰慧盈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。	
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：同泰慧盈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	8,421,586.92	5,826,913.22
结算备付金		4,000,000.00	1,528,679.40
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	214,940,067.21	55,342,773.95
其中：股票投资		201,107,450.72	34,417,476.00
基金投资		-	-
债券投资		13,832,616.49	20,925,297.95
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	-	149,995,519.99
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	214,336.73	633,659.29
应收股利		-	-
应收申购款		3,017.97	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		227,579,008.83	213,327,545.85
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		94,750.22	-
应付管理人报酬		223,524.17	216,263.94
应付托管费		37,254.02	36,043.97
应付销售服务费		53,275.00	60,540.09
应付交易费用	7.4.7.7	7,482.10	859.89
应交税费		0.10	2,873.96
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,027.58	20,000.00
负债合计		596,313.19	336,581.85
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	159,113,585.43	211,719,647.24
未分配利润	7.4.7.10	67,869,110.21	1,271,316.76
所有者权益合计		226,982,695.64	212,990,964.00
负债和所有者权益总计		227,579,008.83	213,327,545.85

报告截止日 2020 年 12 月 31 日，同泰慧盈混合 A 基金份额净值 1.4310 元，基金份额总额 45,529,749.62 份；同泰慧盈混合 C 基金份额净值 1.4247 元，基金份额总额 113,583,835.81 份。同泰慧盈混合份额总额合计为 159,113,585.43 份。

7.2 利润表

会计主体：同泰慧盈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 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		54,234,439.01	1,677,480.97
1.利息收入		1,303,255.15	725,381.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	137,888.41	16,973.19
债券利息收入		679,661.16	264,204.37
资产支持证券利息收入		49,155.34	16,580.91
买入返售金融资产收入		436,550.24	427,622.59
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		34,763,690.41	352,952.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	30,091,037.59	468,948.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,391,458.10	-148,537.30
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-2,630.14	4,269.60
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	2,007,344.00	28,271.84
股利收益	7.4.7.16	1,276,480.86	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	18,041,960.39	599,147.63
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	125,533.06	-
减：二、费用		4,989,506.71	406,164.21
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	1,928,570.43	244,091.78
2．托管费	7.4.10.2.2	321,428.44	40,681.94
3．销售服务费	7.4.10.2.3	509,937.16	68,330.33
4．交易费用	7.4.7.19	1,805,740.38	32,343.53
5．利息支出		219,491.37	-
其中：卖出回购金融资产支出		219,491.37	-
6．税金及附加		9,951.23	316.63
7．其他费用	7.4.7.20	194,387.70	20,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		49,244,932.30	1,271,316.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,244,932.30	1,271,316.76

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：同泰慧盈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）	211,719,647.24	1,271,316.76	212,990,964.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,244,932.30	49,244,932.30
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）	-52,606,061.81	17,352,861.15	-35,253,200.66
其中：1.基金申购款	187,096,693.19	49,965,070.65	237,061,763.84
2.基金赎回款	-239,702,755.00	-32,612,209.50	-272,314,964.50
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）	159,113,585.43	67,869,110.21	226,982,695.64

项目	上年度可比期间 2019 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	211,719,647.24	-	211,719,647.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,271,316.76	1,271,316.76
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	211,719,647.24	1,271,316.76	212,990,964.00

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：

马俊生	马俊生	刘韫芬
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

同泰慧盈混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1955 号《关于准予同泰慧盈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 11 月 26 日正式生效，首次设立募集规模为 211,719,647.24 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要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

监会核准或注册上市的股票以及存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、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及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券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、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%。

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；

（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	134,284.03	1,214,976.74
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	8,287,302.89	4,611,936.48
合计：	8,421,586.92	5,826,913.22

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	182,469,174.40	201,107,450.72	18,638,276.32
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	13,829,784.79	13,832,616.49	2,831.70
	银行间市场	-	-	-
	合计	13,829,784.79	13,832,616.49	2,831.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		196,298,959.19	214,940,067.21	18,641,108.02
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		33,739,172.74	34,417,476.00	678,303.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	21,004,453.58	20,925,297.95	-79,155.63
	银行间市场	-	-	-
	合计	21,004,453.58	20,925,297.95	-79,155.63
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		54,743,626.32	55,342,773.95	599,147.63

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

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	70,000,000.00	-
银行间市场	79,995,519.99	-
合计	149,995,519.99	-

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	42.84	167.32
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	970.73	1,237.94
应收结算备付金利息	28,336.45	-
应收债券利息	183,922.42	511,586.56
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	120,667.47
应收申购款利息	1,064.29	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	214,336.73	633,659.29

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

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
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	7,482.10	859.89
合计	7,482.10	859.89

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	27.58	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	20,000.00
合计	180,027.58	20,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

同泰慧盈混合 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	33,909,828.11	33,909,828.11
本期申购	46,408,469.71	46,408,469.71
本期赎回（以“-”号填列）	-34,788,548.20	-34,788,548.20
- 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	45,529,749.62	45,529,749.62

金额单位：人民币元

同泰慧盈混合 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	177,809,819.13	177,809,819.13
本期申购	140,688,223.48	140,688,223.48
本期赎回（以“-”号填列）	-204,914,206.80	-204,914,206.80
- 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	113,583,835.81	113,583,835.81

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

同泰慧盈混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	118,626.26	95,981.15	214,607.41
本期利润	4,524,620.45	6,097,720.06	10,622,340.51
本期基金份额交易产生的变动数	12,432,655.17	-3,644,988.52	8,787,666.65
其中：基金申购款	15,093,419.99	-1,920,247.75	13,173,172.24

基金赎回款	-2,660,764.82	-1,724,740.77	-4,385,505.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,075,901.88	2,548,712.69	19,624,614.57

单位：人民币元

同泰慧盈混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	553,542.87	503,166.48	1,056,709.35
本期利润	26,678,351.46	11,944,240.33	38,622,591.79
本期基金份额交易产生的变动数	14,683,783.39	-6,118,588.89	8,565,194.50
其中：基金申购款	36,467,234.33	324,664.08	36,791,898.41
基金赎回款	-21,783,450.94	-6,443,252.97	-28,226,703.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,915,677.72	6,328,817.92	48,244,495.64

7.4.7.11 存款利息收入

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 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	19,212.98	10,010.04
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	53,974.39	6,963.15
结算备付金利息收入	63,631.45	-
其他	1,069.59	-
合计	137,888.41	16,973.19

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 11 月 26 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	30,091,037.59	468,948.14
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	30,091,037.59	468,948.14

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 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	616,583,521.98	1,866,517.00
减：卖出股票成本总额	586,492,484.39	1,397,568.86
买卖股票差价收入	30,091,037.59	468,948.14

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11月26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	1,391,458.10	-148,537.30
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	1,391,458.10	-148,537.30

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11月26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	112,770,776.24	21,449,100.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	109,178,792.07	20,916,224.87

减：应收利息总额	2,200,526.07	681,412.47
买卖债券差价收入	1,391,458.10	-148,537.30

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11月26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	15,048,000.00	20,072,049.32
减：卖出资产支持证券成本总额	15,000,000.00	20,010,140.27
减：应收利息总额	50,630.14	57,639.45
资产支持证券投资收益	-2,630.14	4,269.60

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2019 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	17,961.16	-
股指期货-投资收益	1,989,382.84	28,271.84

7.4.7.16 股利收益

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 11 月 26 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	1,276,480.86	-
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	1,276,480.86	-

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 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	18,041,960.39	599,147.63
——股票投资	17,959,973.06	678,303.26
——债券投资	81,987.33	-79,155.63
——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	18,041,960.39	599,147.63

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 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	125,233.06	-
其他收入	300.00	-
合计	125,533.06	-

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 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,804,590.38	32,343.53
银行间市场交易费用	1,150.00	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,805,740.38	32,343.53

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 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	-
信息披露费	120,000.00	20,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	6,087.70	-
上清所账户查询费	900.00	-
其他费用	400.00	400.00
中债登账户维护费	13,500.00	-
上清所账户维护费	13,500.00	-
合计	194,387.70	20,400.00

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
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	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
刘韫芬	基金管理人的股东
王雪梅	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

–

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 11 月 26 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	1,928,570.43	244,091.78
其中：支付销售机构的客户维护费	485,342.78	97,691.63

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.20%÷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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 11 月 26 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	321,428.44	40,681.94

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×0.20%÷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

	同泰慧盈混合 A	同泰慧盈混合 C	合计
同泰基金管理有限公司	-	182,020.33	182,020.33
光大银行	-	303,754.07	303,754.07
合计	-	485,774.40	485,774.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 11 月 26 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		
	同泰慧盈混合 A	同泰慧盈混合 C	合计
同泰基金管理有限公司	-	42.81	42.81
光大银行	-	68,025.20	68,025.20
合计	-	68,068.01	68,068.01

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×0.40%÷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

无。

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

无。

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 11 月 26 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
中国光大银行股份有限公司	134,284.03	19,212.98	1,214,976.74	10,010.04

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

本基金本报告期未进行利润分配。

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
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	74.46	74.46	903	67,237.38	67,237.38	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	10.76	10.76	3,584	38,563.84	38,563.84	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	13.39	13.39	2,164	28,975.96	28,975.96	-
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	507	8,593.65	8,593.65	-

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	-
688256	寒武纪	2020年7月10日	2021年1月20日	新股流通受限	64.39	143.54	1,103	71,022.17	158,324.62	-
688060	云涌科技	2020年7月3日	2021年1月11日	新股流通受限	44.47	81.69	1,200	53,364.00	98,028.00	-
688488	艾迪药业	2020年7月9日	2021年1月20日	新股流通受限	13.99	24.48	3,449	48,251.51	84,431.52	-
688129	东来技术	2020年10月15日	2021年4月23日	新股流通受限	15.22	16.34	5,033	76,602.26	82,239.22	-
688308	欧科亿	2020年12月3日	2021年6月10日	新股流通受限	23.99	23.41	2,457	58,943.43	57,518.37	-
688286	敏芯股份	2020年7月31日	2021年2月10日	新股流通受限	62.67	117.33	486	30,457.62	57,022.38	-
688155	先惠技术	2020年8月3日	2021年2月18日	新股流通受限	38.77	67.26	841	32,605.57	56,565.66	-
688336	三生国健	2020年7月15日	2021年1月22日	新股流通受限	28.18	24.29	2,198	61,939.64	53,389.42	-
688618	三旺通信	2020年12月23日	2021年6月30日	新股流通受限	34.08	46.16	1,117	38,067.36	51,560.72	-
688550	瑞联新材	2020年8月24日	2021年3月2日	新股流通受限	113.72	84.08	356	40,484.32	29,932.48	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股流通受限	17.87	33.16	808	14,438.96	26,793.28	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股流通受限	29.57	40.67	381	11,266.17	15,495.27	-
300925	C法本	2020年12月21	2021年6月	新股流通受限	20.08	37.33	386	7,750.88	14,409.38	-

		日	30 日							
300910	瑞丰新材	2020 年 11 月 20 日	2021 年 5 月 27 日	新股流通受限	30.26	47.87	296	8,956.96	14,169.52	-
300902	国安达	2020 年 10 月 22 日	2021 年 4 月 29 日	新股流通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股流通受限	39.74	60.44	217	8,623.58	13,115.48	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股流通受限	24.35	33.06	375	9,131.25	12,397.50	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股流通受限	18.78	31.94	316	5,934.48	10,093.04	-
300918	南山智尚	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 22 日	新股流通受限	4.97	8.94	1,087	5,402.39	9,717.78	-
300922	天秦装备	2020 年 12 月 18 日	2021 年 6 月 25 日	新股流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-

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 0.01%。

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 7.4.12 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。

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	8,421,586.92	-	-	-	8,421,586.92
结算备付金	4,000,000.00	-	-	-	4,000,000.00
交易性金融资产	13,832,616.49	-	-	201,107,450.72	214,940,067.21
应收利息	-	-	-	214,336.73	214,336.73
应收申购款	-	-	-	3,017.97	3,017.97
资产总计	26,254,203.41	-	-	201,324,805.42	227,579,008.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	94,750.22	94,750.22
应付管理人报酬	-	-	-	223,524.17	223,524.17
应付托管费	-	-	-	37,254.02	37,254.02
应付销售服务费	-	-	-	53,275.00	53,275.00
应付交易费用	-	-	-	7,482.10	7,482.10
应交税费	-	-	-	0.10	0.10
其他负债	-	-	-	180,027.58	180,027.58
负债总计	-	-	-	596,313.19	596,313.19
利率敏感度缺口	26,254,203.41	-	-	200,728,492.23	226,982,695.64
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	5,826,913.22	-	-	-	5,826,913.22
结算备付金	1,528,679.40	-	-	-	1,528,679.40
交易性金融资产	20,925,297.95	-	-	34,417,476.00	55,342,773.95

买入返售金融资产	149,995,519.99	-	-	-	149,995,519.99
应收利息	-	-	-	633,659.29	633,659.29
资产总计	178,276,410.56	-	-	35,051,135.29	213,327,545.85
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	216,263.94	216,263.94
应付托管费	-	-	-	36,043.97	36,043.97
应付销售服务费	-	-	-	60,540.09	60,540.09
应付交易费用	-	-	-	859.89	859.89
应交税费	-	-	-	2,873.96	2,873.96
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	336,581.85	336,581.85
利率敏感度缺口	178,276,410.56	-	-	34,714,553.44	212,990,964.00

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	公允价值	占基金资产净值比

		值比例（%）		例（%）
交易性金融资产-股票投资	201,107,450.72	88.60	34,417,476.00	16.16
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	13,832,616.49	6.09	20,925,297.95	9.82
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	214,940,067.21	94.69	55,342,773.95	25.98

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%	10,327,712.64	1,975,365.39
	沪深 300 指数收益率下降 5%	-10,327,712.64	-1,975,365.39

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 200,095,249.53 元，划分为第二层次的余额为人民币 14,844,817.68 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	201,107,450.72	88.37
	其中：股票	201,107,450.72	88.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,832,616.49	6.08
	其中：债券	13,832,616.49	6.08
	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	12,421,586.92	5.46
8	其他各项资产	217,354.70	0.10
9	合计	227,579,008.83	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	2,078,636.00	0.92
B	采矿业	4,542,107.00	2.00
C	制造业	105,674,884.22	46.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,016,628.00	1.33
E	建筑业	3,076,859.00	1.36
F	批发和零售业	1,650,591.12	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	5,097,870.00	2.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,688,266.94	2.95
J	金融业	52,475,248.40	23.12
K	房地产业	5,962,736.04	2.63
L	租赁和商务服务业	4,145,946.00	1.83
M	科学研究和技术服务业	2,036,040.00	0.90

N	水利、环境和公共设施管理业	183,812.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	249,423.00	0.11
Q	卫生和社会工作	3,231,397.00	1.42
R	文化、体育和娱乐业	997,006.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	201,107,450.72	88.60

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	600519	贵州茅台	5,200	10,389,600.00	4.58
2	000858	五粮液	21,700	6,333,145.00	2.79
3	601318	中国平安	69,200	6,019,016.00	2.65
4	000333	美的集团	50,000	4,922,000.00	2.17
5	600036	招商银行	108,700	4,777,365.00	2.10
6	600276	恒瑞医药	39,700	4,424,962.00	1.95
7	601166	兴业银行	148,500	3,099,195.00	1.37
8	000651	格力电器	49,200	3,047,448.00	1.34
9	600030	中信证券	103,200	3,034,080.00	1.34
10	601888	中国中免	10,300	2,909,235.00	1.28
11	600887	伊利股份	64,000	2,839,680.00	1.25
12	002475	立讯精密	49,500	2,777,940.00	1.22
13	601601	中国太保	72,200	2,772,480.00	1.22
14	601012	隆基股份	27,900	2,572,380.00	1.13
15	601336	新华保险	42,300	2,452,131.00	1.08
16	600031	三一重工	62,500	2,186,250.00	0.96
17	300059	东方财富	68,000	2,108,000.00	0.93
18	000002	万科 A	72,000	2,066,400.00	0.91
19	000725	京东方 A	339,400	2,036,400.00	0.90
20	000001	平安银行	102,500	1,982,350.00	0.87
21	002415	海康威视	39,500	1,916,145.00	0.84
22	002594	比亚迪	9,600	1,865,280.00	0.82
23	601398	工商银行	370,500	1,848,795.00	0.81
24	603259	药明康德	13,300	1,791,776.00	0.79

25	600900	长江电力	92,900	1,779,964.00	0.78
26	000568	泸州老窖	7,800	1,764,048.00	0.78
27	002304	洋河股份	6,500	1,533,935.00	0.68
28	600309	万华化学	16,500	1,502,160.00	0.66
29	002352	顺丰控股	16,500	1,455,795.00	0.64
30	300015	爱尔眼科	18,400	1,377,976.00	0.61
31	601899	紫金矿业	145,200	1,348,908.00	0.59
32	000661	长春高新	3,000	1,346,730.00	0.59
33	600048	保利地产	84,700	1,339,954.00	0.59
34	600585	海螺水泥	25,400	1,311,148.00	0.58
35	600837	海通证券	101,900	1,310,434.00	0.58
36	601328	交通银行	290,200	1,300,096.00	0.57
37	600809	山西汾酒	3,400	1,275,986.00	0.56
38	002142	宁波银行	36,000	1,272,240.00	0.56
39	002027	分众传媒	125,300	1,236,711.00	0.54
40	002714	牧原股份	15,800	1,218,180.00	0.54
41	000157	中联重科	122,800	1,215,720.00	0.54
42	600000	浦发银行	124,100	1,201,288.00	0.53
43	600016	民生银行	224,800	1,168,960.00	0.51
44	600690	海尔智家	40,000	1,168,400.00	0.51
45	600926	杭州银行	75,400	1,124,968.00	0.50
46	601688	华泰证券	62,100	1,118,421.00	0.49
47	601668	中国建筑	221,600	1,101,352.00	0.49
48	600438	通威股份	27,200	1,045,568.00	0.46
49	300124	汇川技术	11,100	1,035,630.00	0.46
50	603501	韦尔股份	4,400	1,016,840.00	0.45
51	000100	TCL 科技	143,000	1,012,440.00	0.45
52	300122	智飞生物	6,800	1,005,788.00	0.44
53	000063	中兴通讯	28,600	962,390.00	0.42
54	601288	农业银行	303,500	952,990.00	0.42
55	600570	恒生电子	8,800	923,120.00	0.41
56	600999	招商证券	39,100	912,594.00	0.40
57	600104	上汽集团	37,000	904,280.00	0.40
58	002241	歌尔股份	24,100	899,412.00	0.40
59	300347	泰格医药	5,500	888,855.00	0.39
60	603288	海天味业	4,432	888,793.28	0.39
61	600406	国电南瑞	32,400	860,868.00	0.38
62	300498	温氏股份	47,200	860,456.00	0.38
63	600436	片仔癀	3,200	856,032.00	0.38

64	601211	国泰君安	47,600	834,428.00	0.37
65	002460	赣锋锂业	8,200	829,840.00	0.37
66	601229	上海银行	105,100	823,984.00	0.36
67	000338	潍柴动力	50,600	798,974.00	0.35
68	300014	亿纬锂能	9,700	790,550.00	0.35
69	600009	上海机场	10,200	771,732.00	0.34
70	600588	用友网络	17,300	758,951.00	0.33
71	601169	北京银行	156,500	757,460.00	0.33
72	002410	广联达	9,600	755,904.00	0.33
73	600660	福耀玻璃	15,000	720,750.00	0.32
74	603986	兆易创新	3,600	711,000.00	0.31
75	601988	中国银行	222,500	707,550.00	0.31
76	600196	复星医药	12,900	696,471.00	0.31
77	601628	中国人寿	17,700	679,503.00	0.30
78	002271	东方雨虹	17,450	677,060.00	0.30
79	002230	科大讯飞	16,300	666,181.00	0.29
80	600703	三安光电	23,800	642,838.00	0.28
81	600763	通策医疗	2,300	635,996.00	0.28
82	600919	江苏银行	115,780	632,158.80	0.28
83	601088	中国神华	34,900	628,549.00	0.28
84	300601	康泰生物	3,600	628,200.00	0.28
85	002555	三七互娱	20,100	627,723.00	0.28
86	601919	中远海控	51,300	626,373.00	0.28
87	600346	恒力石化	22,300	623,731.00	0.27
88	000538	云南白药	5,400	613,440.00	0.27
89	002049	紫光国微	4,500	602,145.00	0.27
90	603799	华友钴业	7,300	578,890.00	0.26
91	600028	中国石化	141,500	570,245.00	0.25
92	600893	航发动力	9,600	569,760.00	0.25
93	600019	宝钢股份	94,100	559,895.00	0.25
94	002311	海大集团	8,500	556,750.00	0.25
95	300413	芒果超媒	7,500	543,750.00	0.24
96	002812	恩捷股份	3,800	538,764.00	0.24
97	000768	中航飞机	14,600	535,528.00	0.24
98	002007	华兰生物	12,300	519,552.00	0.23
99	601009	南京银行	63,400	512,272.00	0.23
100	002493	荣盛石化	18,500	510,785.00	0.23
101	000776	广发证券	31,300	509,564.00	0.22
102	002821	凯莱英	1,700	508,538.00	0.22

103	000166	申万宏源	95,300	503,184.00	0.22
104	600584	长电科技	11,800	502,326.00	0.22
105	000895	双汇发展	10,600	497,564.00	0.22
106	002129	中环股份	19,200	489,600.00	0.22
107	601633	长城汽车	12,900	487,749.00	0.21
108	600741	华域汽车	16,600	478,412.00	0.21
109	601100	恒立液压	4,200	474,600.00	0.21
110	002371	北方华创	2,600	469,924.00	0.21
111	002050	三花智控	18,900	465,885.00	0.21
112	603993	洛阳钼业	74,500	465,625.00	0.21
113	002001	新和成	13,600	458,048.00	0.20
114	002179	中航光电	5,800	454,082.00	0.20
115	600547	山东黄金	19,200	453,504.00	0.20
116	601390	中国中铁	86,000	453,220.00	0.20
117	601901	方正证券	43,400	450,058.00	0.20
118	001979	招商蛇口	33,700	447,873.00	0.20
119	601877	正泰电器	11,400	446,424.00	0.20
120	601939	建设银行	70,800	444,624.00	0.20
121	600958	东方证券	37,900	440,777.00	0.19
122	600050	中国联通	98,300	438,418.00	0.19
123	601377	兴业证券	49,500	429,660.00	0.19
124	300433	蓝思科技	14,000	428,540.00	0.19
125	601857	中国石油	102,600	425,790.00	0.19
126	002736	国信证券	30,700	418,748.00	0.18
127	002202	金风科技	29,300	417,525.00	0.18
128	300408	三环集团	11,100	413,475.00	0.18
129	688012	中微公司	2,600	409,734.00	0.18
130	000625	长安汽车	18,700	409,156.00	0.18
131	601006	大秦铁路	62,900	406,334.00	0.18
132	600015	华夏银行	65,000	406,250.00	0.18
133	600745	闻泰科技	4,100	405,900.00	0.18
134	600176	中国巨石	20,300	405,188.00	0.18
135	601989	中国重工	96,300	403,497.00	0.18
136	600109	国金证券	24,400	396,988.00	0.17
137	601225	陕西煤业	42,300	395,082.00	0.17
138	000860	顺鑫农业	5,400	391,716.00	0.17
139	002008	大族激光	9,000	384,750.00	0.17
140	601186	中国铁建	48,700	384,730.00	0.17
141	603369	今世缘	6,700	384,446.00	0.17

142	688008	澜起科技	4,600	381,248.00	0.17
143	603019	中科曙光	11,005	376,701.15	0.17
144	002236	大华股份	18,900	375,921.00	0.17
145	600352	浙江龙盛	27,600	375,912.00	0.17
146	600872	中炬高新	5,600	373,240.00	0.16
147	300003	乐普医疗	13,200	358,776.00	0.16
148	000786	北新建材	8,900	356,445.00	0.16
149	000066	中国长城	18,700	355,113.00	0.16
150	603899	晨光文具	4,000	354,240.00	0.16
151	000596	古井贡酒	1,300	353,600.00	0.16
152	600760	中航沈飞	4,500	351,810.00	0.15
153	000783	长江证券	40,900	343,560.00	0.15
154	600183	生益科技	12,100	340,736.00	0.15
155	002601	龙蟒佰利	10,900	335,393.00	0.15
156	601108	财通证券	26,500	335,225.00	0.15
157	601155	新城控股	9,600	334,368.00	0.15
158	002044	美年健康	29,000	328,570.00	0.14
159	601555	东吴证券	32,900	324,394.00	0.14
160	600383	金地集团	24,000	324,000.00	0.14
161	601985	中国核电	65,700	323,244.00	0.14
162	002384	东山精密	12,400	322,400.00	0.14
163	002841	视源股份	2,800	322,084.00	0.14
164	600600	青岛啤酒	3,200	318,080.00	0.14
165	601669	中国电建	80,900	313,892.00	0.14
166	000938	紫光股份	15,200	310,840.00	0.14
167	000069	华侨城 A	43,300	306,997.00	0.14
168	002624	完美世界	10,300	303,850.00	0.13
169	600111	北方稀土	23,100	302,379.00	0.13
170	002024	苏宁易购	39,200	302,232.00	0.13
171	300136	信维通信	8,400	301,392.00	0.13
172	300144	宋城演艺	16,600	294,152.00	0.13
173	000977	浪潮信息	10,900	292,992.00	0.13
174	601933	永辉超市	40,300	289,354.00	0.13
175	000876	新希望	12,900	288,960.00	0.13
176	601138	工业富联	21,000	287,490.00	0.13
177	300033	同花顺	2,300	285,154.00	0.13
178	600522	中天科技	26,100	282,924.00	0.12
179	600010	包钢股份	240,300	281,151.00	0.12
180	600795	国电电力	124,600	280,350.00	0.12

181	688599	天合光能	12,015	278,147.25	0.12
182	300529	健帆生物	4,100	278,062.00	0.12
183	600029	南方航空	46,600	277,736.00	0.12
184	002938	鹏鼎控股	5,500	273,185.00	0.12
185	601800	中国交建	37,200	270,072.00	0.12
186	000425	徐工机械	49,600	266,352.00	0.12
187	002456	欧菲光	20,000	263,600.00	0.12
188	600161	天坛生物	6,200	258,540.00	0.11
189	603833	欧派家居	1,900	255,550.00	0.11
190	002600	领益智造	21,200	254,188.00	0.11
191	601600	中国铝业	69,300	251,559.00	0.11
192	000728	国元证券	27,960	250,521.60	0.11
193	000703	恒逸石化	19,500	249,600.00	0.11
194	002607	中公教育	7,100	249,423.00	0.11
195	600886	国投电力	28,800	248,832.00	0.11
196	600705	中航资本	56,800	248,784.00	0.11
197	600061	国投资本	17,900	247,557.00	0.11
198	000963	华东医药	9,300	247,008.00	0.11
199	601838	成都银行	23,000	245,410.00	0.11
200	300676	华大基因	1,900	244,264.00	0.11
201	002463	沪电股份	12,900	242,391.00	0.11
202	600066	宇通客车	14,100	238,572.00	0.11
203	002414	高德红外	5,700	237,975.00	0.10
204	601111	中国国航	31,600	236,684.00	0.10
205	601607	上海医药	12,200	234,240.00	0.10
206	601066	中信建投	5,400	226,800.00	0.10
207	002157	正邦科技	13,300	226,632.00	0.10
208	002602	世纪华通	31,700	225,387.00	0.10
209	600606	绿地控股	38,600	225,038.00	0.10
210	601878	浙商证券	14,500	221,850.00	0.10
211	601021	春秋航空	4,000	221,720.00	0.10
212	600115	东方航空	47,300	221,364.00	0.10
213	601162	天风证券	35,200	214,720.00	0.09
214	600340	华夏幸福	16,600	214,638.00	0.09
215	688608	恒玄科技	646	213,826.00	0.09
216	600177	雅戈尔	29,500	212,105.00	0.09
217	300628	亿联网络	2,900	212,048.00	0.09
218	002422	科伦药业	10,900	211,896.00	0.09
219	002508	老板电器	5,100	207,978.00	0.09

220	600011	华能国际	46,300	207,424.00	0.09
221	601618	中国中冶	75,800	206,934.00	0.09
222	600118	中国卫星	6,400	205,952.00	0.09
223	603658	安图生物	1,400	203,252.00	0.09
224	600362	江西铜业	10,100	201,495.00	0.09
225	600845	宝信软件	2,900	200,042.00	0.09
226	002120	韵达股份	12,400	194,680.00	0.09
227	600068	葛洲坝	29,400	193,452.00	0.09
228	601198	东兴证券	14,500	193,140.00	0.09
229	600369	西南证券	35,300	189,914.00	0.08
230	002673	西部证券	18,700	189,618.00	0.08
231	002396	星网锐捷	8,100	186,786.00	0.08
232	601872	招商轮船	32,700	184,755.00	0.08
233	600498	烽火通信	7,500	180,600.00	0.08
234	300925	C 法本	3,853	177,705.08	0.08
235	003816	中国广核	62,700	176,814.00	0.08
236	601216	君正集团	35,700	176,715.00	0.08
237	601816	京沪高铁	31,200	176,592.00	0.08
238	002368	太极股份	6,700	174,937.00	0.08
239	000961	中南建设	19,600	173,068.00	0.08
240	600489	中金黄金	19,600	172,676.00	0.08
241	601881	中国银河	13,600	170,136.00	0.07
242	600018	上港集团	36,600	167,262.00	0.07
243	600390	五矿资本	23,900	166,822.00	0.07
244	601998	中信银行	32,300	165,053.00	0.07
245	002739	万达电影	8,800	159,104.00	0.07
246	002252	上海莱士	21,500	159,100.00	0.07
247	688256	寒武纪	1,103	158,324.62	0.07
248	600004	白云机场	11,100	156,843.00	0.07
249	000656	金科股份	21,900	155,271.00	0.07
250	603939	益丰药房	1,700	153,323.00	0.07
251	601117	中国化学	26,100	153,207.00	0.07
252	002958	青农商行	29,500	150,155.00	0.07
253	600271	航天信息	11,800	148,680.00	0.07
254	601319	中国人保	22,500	147,825.00	0.07
255	600998	九州通	8,100	147,096.00	0.06
256	600655	豫园股份	16,400	145,796.00	0.06
257	603195	公牛集团	700	143,703.00	0.06
258	600918	中泰证券	7,700	142,450.00	0.06

259	002032	苏泊尔	1,800	140,382.00	0.06
260	603156	养元饮品	5,400	139,536.00	0.06
261	601658	邮储银行	28,400	135,752.00	0.06
262	002773	康弘药业	2,800	134,820.00	0.06
263	601231	环旭电子	6,900	133,446.00	0.06
264	600150	中国船舶	7,500	132,675.00	0.06
265	300896	爱美客	200	131,004.00	0.06
266	601238	广汽集团	9,800	130,242.00	0.06
267	600848	上海临港	6,500	130,130.00	0.06
268	002939	长城证券	9,900	127,413.00	0.06
269	600297	广汇汽车	42,700	122,122.00	0.05
270	600482	中国动力	6,800	121,856.00	0.05
271	002146	荣盛发展	18,600	121,458.00	0.05
272	000671	阳光城	17,400	113,448.00	0.05
273	002558	巨人网络	6,500	113,295.00	0.05
274	002153	石基信息	3,500	108,815.00	0.05
275	601577	长沙银行	11,000	104,720.00	0.05
276	300070	碧水源	13,600	104,040.00	0.05
277	000627	天茂集团	20,900	101,783.00	0.04
278	603392	万泰生物	500	100,765.00	0.04
279	600989	宝丰能源	8,600	100,620.00	0.04
280	688060	云涌科技	1,200	98,028.00	0.04
281	601916	浙商银行	23,100	94,248.00	0.04
282	603087	甘李药业	700	92,554.00	0.04
283	000723	美锦能源	13,000	86,840.00	0.04
284	688488	艾迪药业	3,449	84,431.52	0.04
285	002028	思源电气	4,200	84,252.00	0.04
286	000708	中信特钢	3,800	82,802.00	0.04
287	688129	东来技术	5,033	82,239.22	0.04
288	601808	中海油服	6,400	81,728.00	0.04
289	000967	盈峰环境	9,800	79,772.00	0.04
290	601698	中国卫通	4,300	78,002.00	0.03
291	688617	惠泰医疗	903	67,237.38	0.03
292	688308	欧科亿	2,457	57,518.37	0.03
293	688286	敏芯股份	486	57,022.38	0.03
294	688155	先惠技术	841	56,565.66	0.02
295	688336	三生国健	2,198	53,389.42	0.02
296	688618	三旺通信	1,117	51,560.72	0.02
297	002945	华林证券	2,800	42,196.00	0.02

298	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.02
299	600299	安迪苏	3,200	36,832.00	0.02
300	003022	联泓新科	2,304	35,665.92	0.02
301	688550	瑞联新材	356	29,932.48	0.01
302	300927	江天化学	2,164	28,975.96	0.01
303	300900	广联航空	808	26,793.28	0.01
304	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
305	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
306	300910	瑞丰新材	360	18,233.52	0.01
307	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
308	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
309	300909	汇创达	381	15,495.27	0.01
310	300902	国安达	551	13,367.26	0.01
311	300908	仲景食品	217	13,115.48	0.01
312	300911	亿田智能	375	12,397.50	0.01
313	300917	特发服务	316	10,093.04	0.00
314	300918	南山智尚	1,087	9,717.78	0.00
315	003020	立方制药	274	9,420.12	0.00
316	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
317	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
318	601236	红塔证券	400	7,436.00	0.00
319	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
320	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600216	浙江医药	15,105,659.75	7.09
2	601318	中国平安	13,911,258.16	6.53
3	600801	华新水泥	12,501,480.00	5.87
4	000050	深天马 A	12,422,292.32	5.83
5	002384	东山精密	11,837,446.00	5.56
6	600519	贵州茅台	9,203,506.00	4.32
7	002745	木林森	8,986,891.72	4.22
8	002456	欧菲光	8,344,108.00	3.92

9	000636	风华高科	8,064,889.00	3.79
10	601231	环旭电子	7,958,760.00	3.74
11	600183	生益科技	7,675,909.00	3.60
12	600160	巨化股份	7,630,155.60	3.58
13	601012	隆基股份	7,483,726.60	3.51
14	600109	国金证券	7,387,232.02	3.47
15	600900	长江电力	7,233,492.00	3.40
16	300136	信维通信	6,968,250.00	3.27
17	600438	通威股份	6,952,561.00	3.26
18	000100	TCL 科技	6,864,735.00	3.22
19	603636	南威软件	6,722,395.13	3.16
20	600346	恒力石化	6,648,707.47	3.12
21	000021	深科技	6,188,252.00	2.91
22	300433	蓝思科技	6,169,931.00	2.90
23	600378	昊华科技	6,163,329.00	2.89
24	300003	乐普医疗	6,045,844.00	2.84
25	600640	号百控股	6,040,907.00	2.84
26	603079	圣达生物	5,942,080.00	2.79
27	603659	璞泰来	5,833,764.00	2.74
28	002074	国轩高科	5,775,483.00	2.71
29	000858	五粮液	5,692,662.82	2.67
30	600426	华鲁恒升	5,647,651.50	2.65
31	600030	中信证券	5,565,056.48	2.61
32	002117	东港股份	5,564,466.40	2.61
33	601138	工业富联	5,486,775.34	2.58
34	002241	歌尔股份	5,396,187.00	2.53
35	601555	东吴证券	5,392,235.00	2.53
36	601872	招商轮船	5,203,683.00	2.44
37	600926	杭州银行	5,157,509.80	2.42
38	600131	国网信通	5,121,606.00	2.40
39	600143	金发科技	5,056,421.00	2.37
40	600068	葛洲坝	4,927,586.00	2.31
41	300037	新宙邦	4,866,146.00	2.28
42	002146	荣盛发展	4,863,563.00	2.28
43	603650	彤程新材	4,853,886.00	2.28
44	000553	安道麦 A	4,688,140.98	2.20

45	600585	海螺水泥	4,585,053.00	2.15
46	601336	新华保险	4,549,604.51	2.14
47	600195	中牧股份	4,455,568.90	2.09
48	600016	民生银行	4,438,555.00	2.08
49	300408	三环集团	4,436,813.00	2.08
50	000333	美的集团	4,418,683.00	2.07
51	600031	三一重工	4,338,849.88	2.04
52	300014	亿纬锂能	4,321,982.25	2.03
53	002402	和而泰	4,304,055.71	2.02

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	600216	浙江医药	15,341,879.39	7.20
2	600801	华新水泥	12,097,935.48	5.68
3	000050	深天马 A	11,859,275.00	5.57
4	002384	东山精密	10,674,198.00	5.01
5	002745	木林森	9,731,731.76	4.57
6	601318	中国平安	9,233,407.00	4.34
7	601231	环旭电子	9,084,508.00	4.27
8	600183	生益科技	9,032,937.00	4.24
9	600346	恒力石化	8,120,172.00	3.81
10	000636	风华高科	8,038,827.91	3.77
11	002074	国轩高科	7,825,225.72	3.67
12	002456	欧菲光	7,717,176.00	3.62
13	600438	通威股份	7,671,766.00	3.60
14	600109	国金证券	7,407,383.00	3.48
15	002146	荣盛发展	7,368,161.40	3.46
16	603659	璞泰来	7,204,342.76	3.38
17	002241	歌尔股份	7,169,542.37	3.37
18	000021	深科技	6,820,018.00	3.20
19	000100	TCL 科技	6,671,452.00	3.13
20	300136	信维通信	6,562,671.22	3.08
21	300003	乐普医疗	6,557,250.00	3.08
22	600340	华夏幸福	6,530,324.05	3.07

23	601012	隆基股份	6,455,929.27	3.03
24	600160	巨化股份	6,378,422.00	2.99
25	603636	南威软件	6,147,064.00	2.89
26	600143	金发科技	6,082,816.80	2.86
27	300433	蓝思科技	6,028,907.00	2.83
28	600378	昊华科技	5,916,122.11	2.78
29	600640	号百控股	5,888,150.00	2.76
30	603650	彤程新材	5,840,739.72	2.74
31	600900	长江电力	5,461,189.00	2.56
32	600426	华鲁恒升	5,385,580.65	2.53
33	600926	杭州银行	5,259,831.47	2.47
34	300014	亿纬锂能	5,088,530.40	2.39
35	300037	新宙邦	5,053,233.00	2.37
36	600131	国网信通	5,033,772.00	2.36
37	601555	东吴证券	5,019,513.00	2.36
38	603079	圣达生物	4,944,736.60	2.32
39	600195	中牧股份	4,870,649.10	2.29
40	601138	工业富联	4,838,269.00	2.27
41	600068	葛洲坝	4,795,059.00	2.25
42	600703	三安光电	4,693,990.00	2.20
43	002117	东港股份	4,656,773.10	2.19
44	603639	海利尔	4,423,870.60	2.08
45	000553	安道麦 A	4,276,658.98	2.01

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	735,222,486.05
卖出股票收入（成交）总额	616,583,521.98

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	13,820,616.60	6.09
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）	11,999.89	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,832,616.49	6.09

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	019640	20 国债 10	100,000	9,987,000.00	4.40
2	019627	20 国债 01	38,340	3,833,616.60	1.69
3	113616	韦尔转债	120	11,999.89	0.01

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）					1,989,382.84
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）					17,961.16
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

兴业银行于 2020 年 9 月 4 日收到中国人民银行福州中心支行的行政处罚显示，兴业银行存在的违法违规行为主要有：为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定；未按规定履行客户身份识别义务。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，兴业银行改正态度积极，公司经营状况正常。该公司作为银行业龙头之一，目前处于估值底部，后续有望底部回升。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，基于以上理由和研判过程，对兴业银行进行了投资。

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	214,336.73
5	应收申购款	3,017.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	217,354.70

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
同泰慧盈混合 A	332	137,137.80	40,876,230.66	89.78%	4,653,518.96	10.22%
同泰慧盈混合 C	648	175,283.70	90,859,788.87	79.99%	22,724,046.94	20.01%
合计	980	162,360.80	131,736,019.53	82.79%	27,377,565.90	17.21%

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	同泰慧盈混合 A	13,175.25	0.03%
	同泰慧盈混合 C	1,386.68	0.00%
	合计	14,561.93	0.01%

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	同泰慧盈混合 A	0
	同泰慧盈混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	同泰慧盈混合 A	0
	同泰慧盈混合 C	0
	合计	0

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	同泰慧盈混合 A	同泰慧盈混合 C
基金合同生效日（2019 年 11 月 26 日）基金份额总额	33,909,828.11	177,809,819.13
本报告期期初基金份额总额	33,909,828.11	177,809,819.13
本报告期基金总申购份额	46,408,469.71	140,688,223.48
减:本报告期基金总赎回份额	34,788,548.20	204,914,206.80
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	45,529,749.62	113,583,835.81

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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：

2020 年 7 月，中国光大银行股份有限公司聘任李守靖先生担任资产托管部总经理职务。

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 1 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	1,066,516,199.11	79.41%	770,890.96	79.04%	-
银河证券	2	276,481,671.38	20.59%	204,431.95	20.96%	-

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	46,844,006.93	82.08%	1,408,800,000.00	81.44%	-	-
银河证券	10,227,461.22	17.92%	321,000,000.00	18.56%	-	-

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
2	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
3	中国光大银行“投资与托管业务部”名称变更为“资产托管部”	中国证监会指定的媒介	2020 年 4 月 15 日
4	同泰慧盈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
5	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
6	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
7	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
8	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

9	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——兴业证券	中国证监会指定的媒介	2020年6月8日
10	同泰慧盈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——华宝证券	中国证监会指定的媒介	2020年8月26日
12	同泰慧盈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
13	同泰慧盈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
14	关于同泰慧盈混合型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会指定的媒介	2020年9月11日
15	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
16	同泰慧盈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
17	同泰慧盈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
18	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
19	同泰慧盈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
20	同泰慧盈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
21	关于同泰慧盈混合型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会指定的媒介	2020年10月24日
22	同泰慧盈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
23	关于同泰慧盈混合型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会指定的媒介	2020年11月11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	20200821-20200831	-	16,326,132.14	16,326,132.14	-	-
	2	20200901-20201231	-	93,298,740.15	6,020,000.00	87,278,740.15	54.85%
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。							

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、《同泰慧盈混合型证券投资基金基金合同》；

2、《同泰慧盈混合型证券投资基金托管协议》；

3、报告期内同泰慧盈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