

同泰慧择混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：同泰基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	53
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	同泰慧择混合型证券投资基金	
基金简称	同泰慧择混合	
场内简称	-	
基金主代码	008050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 11 月 20 日	
基金管理人	同泰基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	74,829,551.12 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:	同泰慧择混合 A	同泰慧择混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	008050	008051
报告期末下属分级基金的份额总额	67,132,749.48 份	7,696,801.64 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。	
	同泰慧择混合 A	同泰慧择混合 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	滕大江	胡波

	联系电话	0755-23537892	021-61618888
	电子邮箱	tengdj@tongtaiamc.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-830-1666	95528
传真		0755-23537801	021-63602540
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		上海市中山东一路 12 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		上海市北京东路 689 号
邮政编码	518033		200001
法定代表人	马俊生		郑杨

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tongtaiamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	同泰基金管理有限公司	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 41 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	同泰慧择混合 A	同泰慧择混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 – 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 – 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,092,158.44	188,409.52
本期利润	3,362,124.76	544,658.00
加权平均基金份额本期利润	0.0564	0.0711
本期加权平均净值利润率	4.41%	5.59%
本期基金份额净值增长率	6.30%	6.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	21,494,131.19	2,399,596.30
期末可供分配基金份额利润	0.3202	0.3118
期末基金资产净值	88,626,880.67	10,096,397.94
期末基金份额净值	1.3202	1.3118
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	32.02%	31.18%

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

同泰慧择混合 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
过去一个月	-0.27%	1.31%	-1.22%	0.48%	0.95%	0.83%
过去三个月	7.41%	1.49%	2.33%	0.59%	5.08%	0.90%
过去六个月	6.30%	1.75%	0.65%	0.79%	5.65%	0.96%
过去一年	31.74%	1.58%	15.09%	0.80%	16.65%	0.78%

自基金合同 生效起至今	32.02%	1.48%	19.92%	0.81%	12.10%	0.67%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

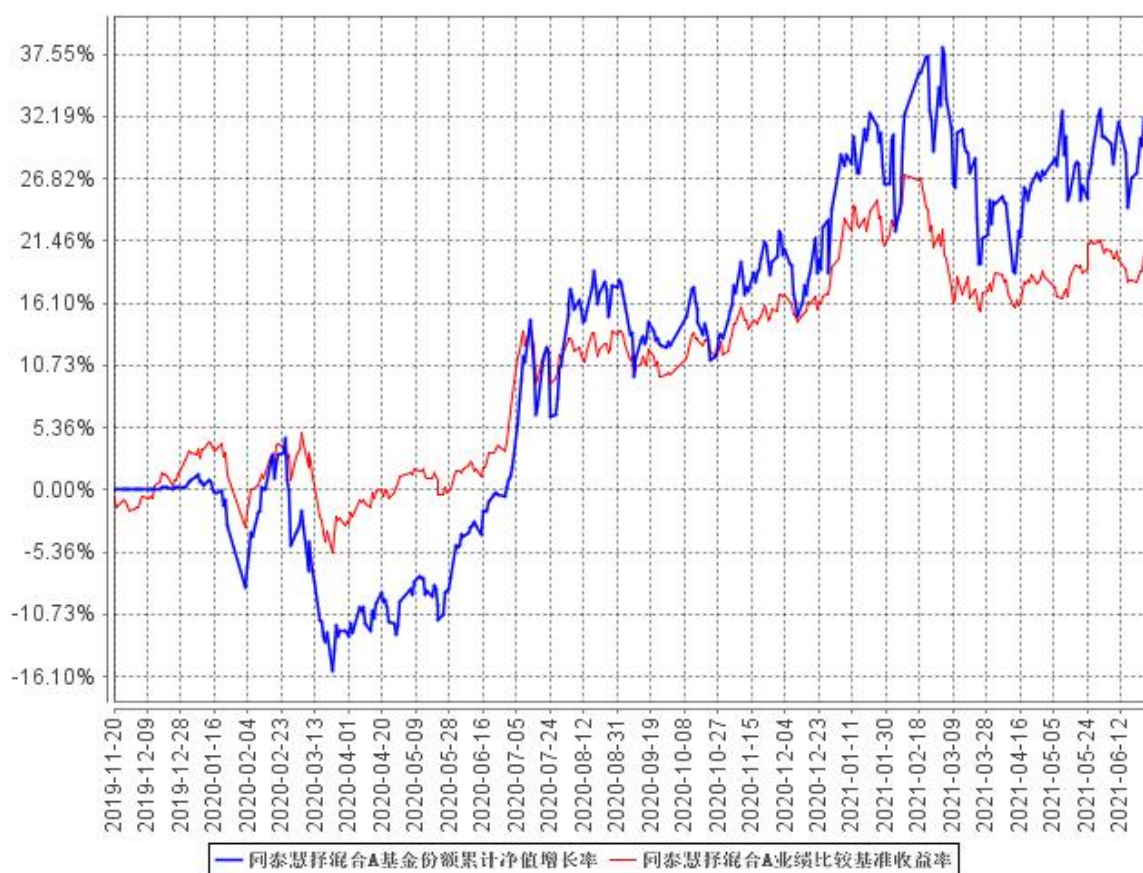
同泰慧择混合 C

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
过去一个月	-0.30%	1.31%	-1.22%	0.48%	0.92%	0.83%
过去三个月	7.30%	1.49%	2.33%	0.59%	4.97%	0.90%
过去六个月	6.09%	1.75%	0.65%	0.79%	5.44%	0.96%
过去一年	31.22%	1.58%	15.09%	0.80%	16.13%	0.78%
自基金合同 生效起至今	31.18%	1.48%	19.92%	0.81%	11.26%	0.67%

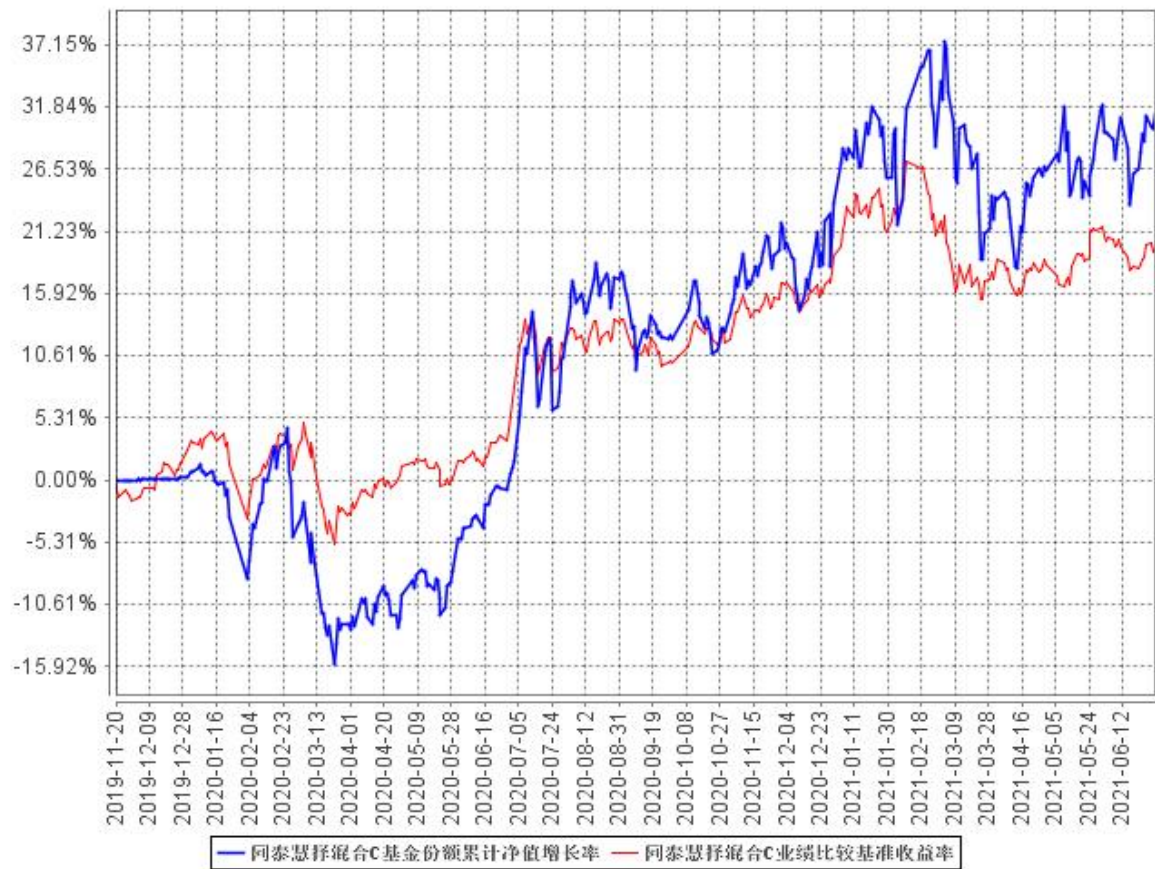
注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%，每日进行再平衡过程。

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

同泰慧择混合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



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



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 10 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		
沈莉	本基金的基金经理、投资研究部行业研究总监	2019 年 11 月 20 日	—	13	沈莉女士，中国国籍，硕士。曾任上海证券有限责任公司研究员、诺德基金管理有限公司研究员、国泰君安证券股份有限公司研究员、中泰证券股份有限公司投资经理、银华基金管理有限公司策略研究组组长、投资经理助理、基金经理助理等职。2019 年 4 月加入同泰基金管理有限公司，现任投资研究部行业研究总监兼基金经理。2019 年 11 月 20 日起担任同泰慧择混合型证券投资基金基金经理，2019 年 12 月 17 日起担任同泰慧选混合型发起式证券投资基金基金经理，2020 年 7 月 3 日起担任同泰慧利混合型证券投资基金基金经理。
黄伟轩	本基金的基金经理	2021 年 6 月 29 日	—	10	黄伟轩先生，中国国籍，硕士。曾任长江证券股份有限公司研究部分析师、上投摩根基金管理有限公司

					司研究员。2021 年 4 月加入同泰基金管理有限公司，现任投资研究部基金经理。2021 年 6 月 29 日起担任同泰慧择混合型证券投资基金基金经理。
王伟	本基金的基金经理	2021 年 4 月 23 日	-	5	王伟先生，中国国籍，硕士。曾任平安证券分析师。2019 年 4 月加入同泰基金管理有限公司，现任投资研究部基金经理。2021 年 4 月 23 日起担任同泰慧择混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月 29 日起担任同泰慧利混合型证券投资基金基金经理。
王伟	本基金的基金经理助理	2020 年 8 月 18 日	2021 年 4 月 22 日	5	王伟先生，中国国籍，硕士。曾任平安证券分析师。2019 年 4 月加入同泰基金管理有限公司，现任投资研究部基金经理。2021 年 4 月 23 日起担任同泰慧择混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月 29 日起担任同泰慧利混合型证券投资基金基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本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

本基金上半年，主要重仓顺周期如有色、化工等行业，新增少量新能源汽车、科技、机械等产业中具有核心竞争力的优质成长股。展望后市，受新冠疫情反复影响，国内整体经济确实面临的一些不确定性：例如进出口的拉动力受外围经济复苏可能逐步减弱、疫情之后一直低于预期的消费未出现大幅的转好。但同时，中国的经济在局部领域也出现明显的高增长，例如创新药的投资，电动车的消费等等。同时在经济复苏基础仍未牢固的情况下，国内的流动性也仍将维持合理宽裕，以服务于国内经济运行情况。

下半年，本基金将致力于选择高景气、快成长的投资标的。未来宏观保持平稳的情况下，不同行业景气度将呈现显著的差异，同时这种细分领域的景气度也会不断的出现变化。对应于投资，持续挖掘景气度向上的结构性投资机会将是慧择未来的核心投资思路。操作逻辑上主要以自下而上的视角为主，在景气度持续结构化的宏观环境下，优先倾斜成长确定性高，业绩持续性较强的医疗、能源、新消费领域。致力于挖掘其中质地优异，且处于快速成长阶段中的标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰慧择混合 A 基金份额净值为 1.3202 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.30%；截至本报告期末同泰慧择混合 C 基金份额净值为 1.3118 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.09%；同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、经济波动将逐渐减弱，增长主要在局部。受新冠疫情影响，国内外经济偏离增长正常均值。中美欧等主要经济体处于不同复苏阶段。中国已过复苏增速高点，其次将是美国，最后欧洲经济体，最终主要经济体经济增速回归均值。展望下半年甚至更远的视角，整体经济确实面临着一些

不确定性：例如进出口的拉动力受外围经济复苏可能逐步减弱、疫情之后一直低于预期的消费未出现大幅的转好。但同时，中国的经济在局部领域也出现明显的高增长，例如创新药的投资，电动车的消费等等。

2、流动性预计较上半年有所改善。在经济复苏基础仍未牢固的情况下，即使美联储存在比较大的加息可能，国内的流动性预计持续维持合理宽裕，以服务于国内经济运行情况。结合对未来宏观环境的判断，未来的经济将很难出现“过热”、“过冷”的明显周期，货币政策的强力逆周期调节作用力也将会明显减弱，历史上的“钱荒”或者“大水漫灌”情况将难再现。考虑到疫情的反复，流动性对经济的支持预计会进一步凸显。

3、持续看好新能源、高端制造及医疗科技。新能源方面，国内新能源车尚处于渗透率快速提升阶段，储能领域也将迎来快速的增长，其中蕴藏着巨大的投资机会。医疗科技也是极具潜力的中长期赛道，部分公司已经极具性价比。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期末实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对同泰慧择混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对同泰慧择混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由同泰基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：同泰慧择混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	7,740,285.40	4,569,651.88
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	91,698,895.72	45,324,661.42
其中：股票投资		91,644,268.75	45,317,567.52
基金投资		-	-
债券投资		54,626.97	7,093.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,677.85	10,478.39
应收股利		-	-
应收申购款		111,428.95	49,636.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		99,553,287.92	49,954,428.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		659,731.80	540,473.64
应付管理人报酬		96,176.51	47,665.39
应付托管费		16,029.42	7,944.24
应付销售服务费		3,419.06	3,627.28
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		0.07	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	54,652.45	180,734.89
负债合计		830,009.31	780,445.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	74,829,551.12	39,628,327.21
未分配利润	6.4.7.10	23,893,727.49	9,545,655.87
所有者权益合计		98,723,278.61	49,173,983.08
负债和所有者权益总计		99,553,287.92	49,954,428.52

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 74,829,551.12 份，其中同泰慧择混合 A 基金份额净值 1.3202 元，份额总额 67,132,749.48 份；同泰慧择混合 C 基金份额净值 1.3118 元，份额总额 7,696,801.64 份；

6.2 利润表

会计主体：同泰慧择混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		5,446,863.00	-3,399,607.41
1.利息收入		27,908.37	294,432.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,430.29	29,654.85
债券利息收入		4.27	128,145.08
资产支持证券利息收入		-	16,385.11
买入返售金融资产收入		473.81	120,247.89
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,653,257.37	-4,341,632.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,237,318.52	-5,825,491.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,061.84	71,831.32
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-876.71
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	1,214,671.84
股利收益	6.4.7.16	406,877.01	198,233.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,626,214.80	581,434.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	139,482.46	66,157.46
减：二、费用		1,540,080.24	1,419,168.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	509,135.14	524,599.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	84,855.88	87,433.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	19,281.35	139,158.40
4. 交易费用	6.4.7.19	867,528.68	575,210.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	5,384.90
7. 其他费用	6.4.7.20	59,279.19	87,381.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,906,782.76	-4,818,776.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,906,782.76	-4,818,776.14

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：同泰慧择混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	39,628,327.21	9,545,655.87	49,173,983.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,906,782.76	3,906,782.76
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）	35,201,223.91	10,441,288.86	45,642,512.77
其中：1.基金申购款	71,082,970.38	20,640,145.48	91,723,115.86
2. 基金赎回款	-35,881,746.47	-10,198,856.62	-46,080,603.09
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）	74,829,551.12	23,893,727.49	98,723,278.61
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	155,742,436.03	375,125.57	156,117,561.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,818,776.14	-4,818,776.14
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）	-104,661,040.84	4,458,816.49	-100,202,224.35
其中：1.基金申购款	25,815,981.80	-288,434.26	25,527,547.54
2.基金赎回款	-130,477,022.64	4,747,250.75	-125,729,771.89
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）	51,081,395.19	15,165.92	51,096,561.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>马俊生</u>	<u>杨伍</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

同泰慧择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]1745号《关于准予同泰慧择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20日正式生效，首次设立募集规模为208,233,986.44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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围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 50%-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×60%+中债综合全价（总值）指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,180,542.94
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	6,559,742.46
合计：	7,740,285.40

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		87,313,508.01	91,644,268.75	4,330,760.74
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	53,126.11	54,626.97	1,500.86
	银行间市场	—	—	—
	合计	53,126.11	54,626.97	1,500.86
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—

其他	-	-	-
合计	87,366,634.12	91,698,895.72	4,332,261.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	38.23
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	35.13
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	941.12
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1,663.37
合计	2,677.85

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	859.18
应付证券出借违约金	—
其他应付款-股利派息日前一日到账	1,725.00
预提费用	52,068.27
合计	54,652.45

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

同泰慧择混合 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,434,893.68	31,434,893.68
本期申购	61,242,768.58	61,242,768.58
本期赎回(以“-”号填列)	-25,544,912.78	-25,544,912.78
— 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	67,132,749.48	67,132,749.48

金额单位：人民币元

同泰慧择混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,193,433.53	8,193,433.53
本期申购	9,840,201.80	9,840,201.80
本期赎回(以“-”号填列)	-10,336,833.69	-10,336,833.69
— 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	7,696,801.64	7,696,801.64

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

同泰慧择混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,920,677.84	-2,312,920.03	7,607,757.81
本期利润	1,092,158.44	2,269,966.32	3,362,124.76
本期基金份额交易产生的变动数	13,795,387.23	-3,271,138.61	10,524,248.62
其中：基金申购款	23,044,823.36	-5,182,711.21	17,862,112.15
基金赎回款	-9,249,436.13	1,911,572.60	-7,337,863.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,808,223.51	-3,314,092.32	21,494,131.19

单位：人民币元

同泰慧择混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,539,332.24	-601,434.18	1,937,898.06
本期利润	188,409.52	356,248.48	544,658.00
本期基金份额交易产生的变动数	51,805.62	-134,765.38	-82,959.76
其中：基金申购款	3,604,523.08	-826,489.75	2,778,033.33
基金赎回款	-3,552,717.46	691,724.37	-2,860,993.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,779,547.38	-379,951.08	2,399,596.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,440.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	24,989.99
合计	27,430.29

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,237,318.52
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	2,237,318.52

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	318,174,528.31
减：卖出股票成本总额	315,937,209.79
买卖股票差价收入	2,237,318.52

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	9,061.84
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	9,061.84

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	105,156.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	96,023.63
减：应收利息总额	70.71
买卖债券差价收入	9,061.84

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	406,877.01
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	406,877.01

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,626,214.80
——股票投资	2,626,307.86
——债券投资	-93.06
——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	2,626,214.80

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	138,514.53
转换费收入 008050	966.38
转换费收入 008051	1.55
其他收入	-
合计	139,482.46

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	867,528.68
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	867,528.68

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,110.92
其他费用	100.00
中债登账户维护费	6,000.00
合计	59,279.19

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
同泰基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	509,135.14	524,599.66

其中：支付销售机构的客户维护费	77,689.31	222,939.64
-----------------	-----------	------------

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：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	84,855.88	87,433.26

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	同泰慧择混合 A	同泰慧择混合 C	合计
同泰基金管理有限公司	-	6,303.98	6,303.98
合计	-	6,303.98	6,303.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	同泰慧择混合 A	同泰慧择混合 C	合计
同泰基金管理有限公司	-	23,307.36	23,307.36
合计	-	23,307.36	23,307.36

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	1,180,542.94	2,440.30	39,472.71	17,389.49

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021 年 6 月 30 日	重大事项	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	15,400	476,778.00	867,790.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、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 0.06%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期不适用。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期不适用。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12

中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，本基金所持的证券均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理。

本报告期内，未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,740,285.40	-	-	-	7,740,285.40
交易性金融资产	54,626.97	-	-	-91,644,268.75	91,698,895.72
应收利息	-	-	-	2,677.85	2,677.85
应收申购款	61,738.16	-	-	49,690.79	111,428.95
资产总计	7,856,650.53	-	-	-91,696,637.39	99,553,287.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	659,731.80	659,731.80
应付管理人报酬	-	-	-	96,176.51	96,176.51
应付托管费	-	-	-	16,029.42	16,029.42
应付销售服务费	-	-	-	3,419.06	3,419.06
应交税费	-	-	-	0.07	0.07

其他负债	-	-	-	54,652.45	54,652.45
负债总计	-	-	-	830,009.31	830,009.31
利率敏感度缺口	7,856,650.53	-	-	-90,866,628.08	98,723,278.61
上年度末 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	4,569,651.88	-	-	-	4,569,651.88
交易性金融资产	7,093.90	-	-	-45,317,567.52	45,324,661.42
应收利息	-	-	-	10,478.39	10,478.39
应收申购款	31,031.53	-	-	18,605.30	49,636.83
资产总计	4,607,777.31	-	-	-45,346,651.21	49,954,428.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	540,473.64	540,473.64
应付管理人报酬	-	-	-	47,665.39	47,665.39
应付托管费	-	-	-	7,944.24	7,944.24
应付销售服务费	-	-	-	3,627.28	3,627.28
其他负债	-	-	-	180,734.89	180,734.89
负债总计	-	-	-	780,445.44	780,445.44
利率敏感度缺口	4,607,777.31	-	-	-44,566,205.77	49,173,983.08

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基

金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	91,644,268.75	92.83	45,317,567.52	92.16
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	54,626.97	0.06	7,093.90	0.01
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	91,698,895.72	92.88	45,324,661.42	92.17

6.4.13.4.3.2 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数收益率上升 5%	4,933,945.71	2,778,330.04
	沪深 300 指数收益率下降 5%	-4,933,945.71	-2,778,330.04

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金本报告期不适用。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	91,644,268.75	92.06
	其中：股票	91,644,268.75	92.06
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	54,626.97	0.05
	其中：债券	54,626.97	0.05
	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	7,740,285.40	7.78
8	其他各项资产	114,106.80	0.11
9	合计	99,553,287.92	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	10,587,583.00	10.72
C	制造业	70,321,449.25	71.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	1,292,881.00	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	215,960.00	0.22
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,185,237.96	6.27
J	金融业	1,970,352.30	2.00
K	房地产业	178,192.00	0.18
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	676,468.80	0.69

N	水利、环境和公共设施管理业	200,468.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	91,644,268.75	92.83

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600111	北方稀土	271,100	5,611,770.00	5.68
2	603501	韦尔股份	12,900	4,153,800.00	4.21
3	000933	神火股份	432,100	4,083,345.00	4.14
4	688390	固德威	11,531	3,851,354.00	3.90
5	601633	长城汽车	86,600	3,774,894.00	3.82
6	000807	云铝股份	310,400	3,693,760.00	3.74
7	300496	中科创达	18,600	2,921,316.00	2.96
8	000831	五矿稀土	122,800	2,370,040.00	2.40
9	600392	盛和资源	133,300	2,314,088.00	2.34
10	300763	锦浪科技	12,710	2,295,426.00	2.33
11	601899	紫金矿业	221,200	2,143,428.00	2.17
12	601388	怡球资源	629,300	2,007,467.00	2.03
13	600985	淮北矿业	160,000	1,953,600.00	1.98
14	600010	包钢股份	1,138,500	1,764,675.00	1.79
15	600549	厦门钨业	81,800	1,703,894.00	1.73
16	688536	思瑞浦	2,854	1,572,554.00	1.59
17	300316	晶盛机电	30,600	1,545,300.00	1.57
18	600259	广晟有色	43,700	1,477,497.00	1.50
19	300035	中科电气	54,400	1,330,080.00	1.35
20	600104	上汽集团	59,300	1,302,821.00	1.32
21	603993	洛阳钼业	250,900	1,294,644.00	1.31
22	000963	华东医药	28,100	1,292,881.00	1.31
23	002036	联创电子	96,700	1,271,605.00	1.29

24	601225	陕西煤业	102,500	1,214,625.00	1.23
25	601088	中国神华	61,700	1,204,384.00	1.22
26	300613	富瀚微	7,647	1,192,014.36	1.21
27	600893	航发动力	21,400	1,138,266.00	1.15
28	603612	索通发展	62,300	1,119,531.00	1.13
29	601689	拓普集团	29,300	1,096,699.00	1.11
30	002258	利尔化学	38,300	988,140.00	1.00
31	600219	南山铝业	266,500	959,400.00	0.97
32	600711	盛屯矿业	128,200	914,066.00	0.93
33	600460	士兰微	15,400	867,790.00	0.88
34	002460	赣锋锂业	7,100	859,739.00	0.87
35	002585	双星新材	42,700	859,551.00	0.87
36	601128	常熟银行	132,500	821,500.00	0.83
37	000550	江铃汽车	35,000	820,050.00	0.83
38	300073	当升科技	12,500	702,375.00	0.71
39	603259	药明康德	4,320	676,468.80	0.69
40	002240	盛新锂能	23,300	665,215.00	0.67
41	300567	精测电子	10,600	650,840.00	0.66
42	300724	捷佳伟创	5,600	649,656.00	0.66
43	603330	上海天洋	21,300	645,390.00	0.65
44	601238	广汽集团	44,300	573,685.00	0.58
45	000932	华菱钢铁	82,800	546,480.00	0.55
46	605338	巴比食品	16,800	543,144.00	0.55
47	300450	先导智能	8,960	538,854.40	0.55
48	300132	青松股份	23,500	495,850.00	0.50
49	002651	利君股份	40,400	488,436.00	0.49
50	300896	爱美客	600	473,328.00	0.48
51	300373	扬杰科技	7,700	466,158.00	0.47
52	300476	胜宏科技	18,900	412,965.00	0.42
53	688266	泽璟制药	5,708	403,612.68	0.41
54	002759	天际股份	10,600	393,790.00	0.40
55	601168	西部矿业	32,300	385,339.00	0.39
56	002906	华阳集团	12,000	378,960.00	0.38
57	300568	星源材质	8,477	350,693.49	0.36
58	600036	招商银行	6,200	335,978.00	0.34
59	002522	浙江众成	49,900	312,374.00	0.32
60	300274	阳光电源	2,600	299,156.00	0.30
61	603659	璞泰来	2,100	286,860.00	0.29
62	603040	新坐标	14,170	285,950.60	0.29

63	600908	无锡银行	47,400	274,920.00	0.28
64	601658	邮储银行	54,000	271,080.00	0.27
65	300014	亿纬锂能	2,500	259,825.00	0.26
66	002669	康达新材	20,300	258,419.00	0.26
67	688598	金博股份	952	256,088.00	0.26
68	002709	天赐材料	2,400	255,792.00	0.26
69	002028	思源电气	7,800	240,162.00	0.24
70	000858	五粮液	800	238,312.00	0.24
71	688198	佰仁医疗	1,028	234,384.00	0.24
72	300059	东方财富	7,080	232,153.20	0.24
73	600328	中盐化工	15,900	222,123.00	0.22
74	300224	正海磁材	20,400	221,748.00	0.22
75	603713	密尔克卫	2,000	215,960.00	0.22
76	300750	宁德时代	400	213,920.00	0.22
77	300034	钢研高纳	6,600	212,586.00	0.22
78	601012	隆基股份	2,380	211,439.20	0.21
79	002812	恩捷股份	900	210,690.00	0.21
80	300124	汇川技术	2,800	207,928.00	0.21
81	600519	贵州茅台	100	205,670.00	0.21
82	600323	瀚蓝环境	9,200	200,468.00	0.20
83	000547	航天发展	10,300	194,361.00	0.20
84	603308	应流股份	9,380	193,697.00	0.20
85	600884	杉杉股份	8,100	188,892.00	0.19
86	603799	华友钴业	1,600	182,720.00	0.19
87	600516	方大炭素	24,400	181,536.00	0.18
88	688007	光峰科技	4,333	181,466.04	0.18
89	600406	国电南瑞	7,680	178,483.20	0.18
90	000961	中南建设	30,100	178,192.00	0.18
91	603712	七一二	4,900	176,890.00	0.18
92	300448	浩云科技	21,300	174,660.00	0.18
93	600217	中再资环	33,900	172,212.00	0.17
94	300118	东方日升	8,600	166,840.00	0.17
95	002271	东方雨虹	3,000	165,960.00	0.17
96	600887	伊利股份	4,500	165,735.00	0.17
97	603686	龙马环卫	10,600	161,226.00	0.16
98	002013	中航机电	15,900	160,113.00	0.16
99	600110	诺德股份	13,100	159,558.00	0.16
100	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.16
101	002381	双箭股份	19,100	157,002.00	0.16

102	300829	金丹科技	2,240	146,720.00	0.15
103	300760	迈瑞医疗	300	144,015.00	0.15
104	002068	黑猫股份	18,800	142,692.00	0.14
105	603486	科沃斯	600	136,848.00	0.14
106	300369	绿盟科技	8,400	133,980.00	0.14
107	300037	新宙邦	1,300	130,130.00	0.13
108	002367	康力电梯	14,500	129,630.00	0.13
109	600660	福耀玻璃	2,300	128,455.00	0.13
110	603916	苏博特	6,120	126,316.80	0.13
111	300823	建科机械	5,300	124,815.00	0.13
112	002139	拓邦股份	6,600	118,734.00	0.12
113	000661	长春高新	300	116,100.00	0.12
114	601799	星宇股份	500	112,860.00	0.11
115	600438	通威股份	2,300	99,521.00	0.10
116	601865	福莱特	1,500	59,295.00	0.06
117	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.04
118	001207	联科科技	682	22,581.02	0.02
119	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
120	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
121	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
122	688425	铁建重工	1,000	6,120.00	0.01
123	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600111	北方稀土	17,392,579.00	35.37
2	600392	盛和资源	9,224,020.00	18.76
3	601633	长城汽车	8,382,518.20	17.05
4	600219	南山铝业	8,190,821.00	16.66
5	000807	云铝股份	6,512,113.00	13.24
6	603799	华友钴业	6,365,094.00	12.94
7	601600	中国铝业	6,035,802.00	12.27
8	000625	长安汽车	5,892,358.00	11.98
9	600362	江西铜业	5,761,303.00	11.72

10	000878	云南铜业	5,409,446.45	11.00
11	600549	厦门钨业	5,408,497.00	11.00
12	000831	五矿稀土	5,299,527.48	10.78
13	300751	迈为股份	5,153,334.00	10.48
14	000933	神火股份	5,120,298.00	10.41
15	300724	捷佳伟创	5,045,663.00	10.26
16	002460	赣锋锂业	5,030,235.00	10.23
17	601899	紫金矿业	4,992,971.00	10.15
18	601238	广汽集团	4,992,320.00	10.15
19	600259	广晟有色	4,938,824.00	10.04
20	601088	中国神华	4,712,693.00	9.58
21	600010	宝钢股份	4,483,019.00	9.12
22	688390	固德威	4,408,306.20	8.96
23	603501	韦尔股份	4,399,981.00	8.95
24	300763	锦浪科技	4,321,396.90	8.79
25	600438	通威股份	4,272,990.00	8.69
26	300014	亿纬锂能	4,271,717.00	8.69
27	600585	海螺水泥	4,200,148.00	8.54
28	601012	隆基股份	4,084,774.00	8.31
29	600104	上汽集团	4,022,078.96	8.18
30	601168	西部矿业	3,906,204.00	7.94
31	688005	容百科技	3,897,938.37	7.93
32	002466	天齐锂业	3,866,047.00	7.86
33	000612	焦作万方	3,726,211.00	7.58
34	000661	长春高新	3,700,886.00	7.53
35	601388	怡球资源	3,583,576.00	7.29
36	002756	永兴材料	3,440,045.56	7.00
37	002240	盛新锂能	3,395,979.00	6.91
38	002812	恩捷股份	3,305,099.00	6.72
39	603612	索通发展	3,234,351.00	6.58
40	300363	博腾股份	3,221,394.00	6.55
41	300496	中科创达	3,041,930.00	6.19
42	002258	利尔化学	2,948,107.71	6.00
43	300750	宁德时代	2,845,346.00	5.79
44	300253	卫宁健康	2,843,809.96	5.78
45	300567	精测电子	2,717,051.00	5.53

46	002532	天山铝业	2,637,908.20	5.36
47	300748	金力永磁	2,593,219.00	5.27
48	300274	阳光电源	2,563,438.00	5.21
49	000963	华东医药	2,352,110.00	4.78
50	002340	格林美	2,336,453.00	4.75
51	600893	航发动力	2,242,617.00	4.56
52	603993	洛阳钼业	2,233,735.00	4.54
53	000155	川能动力	2,219,072.00	4.51
54	000932	华菱钢铁	2,077,821.00	4.23
55	601939	建设银行	2,060,121.00	4.19
56	601689	拓普集团	2,051,040.00	4.17
57	300316	晶盛机电	2,017,352.00	4.10
58	600985	淮北矿业	2,017,343.00	4.10
59	300224	正海磁材	1,997,087.00	4.06
60	600908	无锡银行	1,930,735.00	3.93
61	600967	内蒙一机	1,914,357.00	3.89
62	601009	南京银行	1,907,089.00	3.88
63	300823	建科机械	1,874,600.00	3.81
64	601128	常熟银行	1,846,896.00	3.76
65	600160	巨化股份	1,823,074.00	3.71
66	002123	梦网科技	1,801,953.00	3.66
67	002056	横店东磁	1,755,785.00	3.57
68	000550	江铃汽车	1,747,104.00	3.55
69	300357	我武生物	1,731,692.00	3.52
70	300373	扬杰科技	1,704,307.76	3.47
71	600690	海尔智家	1,649,815.00	3.36
72	000002	万科 A	1,641,280.00	3.34
73	300059	东方财富	1,593,626.00	3.24
74	600346	恒力石化	1,548,556.00	3.15
75	600188	兖州煤业	1,546,133.00	3.14
76	300073	当升科技	1,528,386.00	3.11
77	002906	华阳集团	1,521,232.22	3.09
78	600711	盛屯矿业	1,515,065.00	3.08
79	002230	科大讯飞	1,438,871.00	2.93
80	600660	福耀玻璃	1,437,550.00	2.92
81	002594	比亚迪	1,430,977.00	2.91

82	600352	浙江龙盛	1,409,385.74	2.87
83	300127	银河磁体	1,379,128.00	2.80
84	600919	江苏银行	1,375,667.00	2.80
85	601225	陕西煤业	1,236,986.00	2.52
86	600323	瀚蓝环境	1,222,010.00	2.49
87	600519	贵州茅台	1,209,500.00	2.46
88	300613	富瀚微	1,200,167.00	2.44
89	688536	思瑞浦	1,196,797.97	2.43
90	601166	兴业银行	1,182,363.00	2.40
91	601618	中国中冶	1,165,130.00	2.37
92	300618	寒锐钴业	1,160,244.00	2.36
93	603583	捷昌驱动	1,073,536.00	2.18
94	002367	康力电梯	1,068,216.00	2.17
95	000961	中南建设	1,067,758.00	2.17
96	688567	孚能科技	1,013,530.73	2.06
97	002036	联创电子	1,011,482.00	2.06
98	601233	桐昆股份	998,988.00	2.03

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。

7.4.2 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	600111	北方稀土	11,614,852.04	23.62
2	600219	南山铝业	7,351,483.00	14.95
3	600392	盛和资源	7,161,036.00	14.56
4	000625	长安汽车	6,464,270.00	13.15
5	603799	华友钴业	6,435,028.00	13.09
6	601600	中国铝业	5,830,581.00	11.86
7	300751	迈为股份	5,699,829.20	11.59
8	600362	江西铜业	5,275,830.00	10.73
9	000878	云南铜业	5,016,042.00	10.20
10	601633	长城汽车	4,524,197.00	9.20
11	300724	捷佳伟创	4,464,297.00	9.08
12	600438	通威股份	4,454,994.69	9.06
13	601238	广汽集团	4,375,477.48	8.90

14	002340	格林美	4,335,378.00	8.82
15	002466	天齐锂业	4,277,595.00	8.70
16	600585	海螺水泥	4,230,185.00	8.60
17	688005	容百科技	4,161,931.64	8.46
18	600104	上汽集团	4,146,922.00	8.43
19	002460	赣锋锂业	4,108,758.00	8.36
20	000612	焦作万方	4,045,523.00	8.23
21	300014	亿纬锂能	3,824,257.00	7.78
22	601012	隆基股份	3,744,779.00	7.62
23	600549	厦门钨业	3,707,265.11	7.54
24	002756	永兴材料	3,348,202.00	6.81
25	000807	云铝股份	3,344,755.90	6.80
26	000661	长春高新	3,337,706.00	6.79
27	600010	宝钢股份	3,292,104.00	6.69
28	300363	博腾股份	3,291,507.50	6.69
29	601088	中国神华	3,280,751.00	6.67
30	600259	广晟有色	3,269,979.00	6.65
31	002812	恩捷股份	3,121,356.00	6.35
32	002123	梦网科技	3,020,929.00	6.14
33	601168	西部矿业	2,988,822.00	6.08
34	300253	卫宁健康	2,863,423.00	5.82
35	000831	五矿稀土	2,815,374.00	5.73
36	300750	宁德时代	2,767,815.00	5.63
37	002240	盛新锂能	2,756,776.00	5.61
38	300763	锦浪科技	2,747,941.00	5.59
39	600967	内蒙一机	2,571,396.00	5.23
40	300748	金力永磁	2,456,255.00	5.00
41	600893	航发动力	2,366,575.00	4.81
42	000002	万科 A	2,351,608.00	4.78
43	300274	阳光电源	2,345,704.00	4.77
44	002532	天山铝业	2,344,985.98	4.77
45	603993	洛阳钼业	2,328,296.00	4.73
46	601009	南京银行	2,284,649.00	4.65
47	000155	川能动力	2,273,698.00	4.62
48	601899	紫金矿业	2,247,405.52	4.57
49	688390	固德威	2,069,615.35	4.21
50	601939	建设银行	2,050,683.00	4.17
51	002258	利尔化学	1,935,121.00	3.94

52	300823	建科机械	1,912,264.00	3.89
53	601233	桐昆股份	1,911,202.00	3.89
54	300059	东方财富	1,898,043.80	3.86
55	603612	索通发展	1,883,722.00	3.83
56	300567	精测电子	1,857,894.00	3.78
57	000963	华东医药	1,776,547.00	3.61
58	600690	海尔智家	1,701,069.00	3.46
59	300450	先导智能	1,700,255.05	3.46
60	600160	巨化股份	1,696,783.18	3.45
61	000768	中航西飞	1,637,070.00	3.33
62	600346	恒力石化	1,635,353.00	3.33
63	300357	我武生物	1,632,787.32	3.32
64	300224	正海磁材	1,604,759.00	3.26
65	000066	中国长城	1,598,256.00	3.25
66	002056	横店东磁	1,591,621.64	3.24
67	600908	无锡银行	1,585,376.00	3.22
68	600188	兖州煤业	1,567,566.00	3.19
69	000001	平安银行	1,550,610.00	3.15
70	300308	中际旭创	1,539,541.50	3.13
71	600919	江苏银行	1,523,929.00	3.10
72	600316	洪都航空	1,520,794.00	3.09
73	300373	扬杰科技	1,480,682.00	3.01
74	600536	中国软件	1,465,834.00	2.98
75	002594	比亚迪	1,448,605.00	2.95
76	600038	中直股份	1,358,980.00	2.76
77	002230	科大讯飞	1,357,341.67	2.76
78	600352	浙江龙盛	1,346,691.00	2.74
79	002624	完美世界	1,334,457.00	2.71
80	601166	兴业银行	1,315,575.00	2.68
81	300394	天孚通信	1,284,197.00	2.61
82	300496	中科创达	1,243,558.00	2.53
83	300127	银河磁体	1,221,375.00	2.48
84	600660	福耀玻璃	1,219,841.00	2.48
85	000932	华菱钢铁	1,213,088.00	2.47
86	600760	中航沈飞	1,174,515.00	2.39
87	300316	晶盛机电	1,127,584.00	2.29
88	002920	德赛西威	1,093,646.61	2.22
89	601618	中国中冶	1,067,746.00	2.17

90	601128	常熟银行	1,030,868.00	2.10
91	300618	寒锐钴业	1,028,426.00	2.09
92	002906	华阳集团	1,005,721.00	2.05
93	688567	孚能科技	994,509.69	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。

7.4.3 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	359,637,603.16
卖出股票收入（成交）总额	318,174,528.31

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
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）	54,626.97	0.06
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	54,626.97	0.06

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113611	福 20 转债	300	51,627.00	0.05
2	113049	长汽转债	30	2,999.97	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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**

上海韦尔半导体股份有限公司（以下简称“公司”）于 2021 年 4 月 28 收到中国证券监督管理委员会上海监管局出具的《关于对上海韦尔半导体股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。

主要内容如下：

2019 年 1 月 17 日完成深圳市芯能投资有限公司（以下简称“芯能投资”）、深圳市芯力投资有限公司（以下简称“芯力投资”）100%股权的收购，收购价款合计 16.87 亿元。其中，芯能投资、芯力投资主要资产分别为其持有的北京豪威科技有限公司 6.31%股权、4.24%股权。2019 年 7 月，公司与兴业银行签订借款合同，借款金额为 10 亿元，借款期限为 2019 年 7 月 5 日至 2024

年 7 月 4 日，借款用途为用于支付（或置换）芯能投资和芯力投资 100% 股权的股权并购款。公司以持有的芯能投资、芯力投资 100% 股权及芯能投资、芯力投资持有的北京豪威科技有限公司 10.55% 股权提供质押担保。上述质押资产的账面值约占最近一期经审计总资产 37%。公司对于上述资产质押情况未及时在临时公告中披露，直至 2020 年 4 月 10 日才在 2019 年年度报告中披露。

本基金投研人员分析认为，该事件发生后该公司经营状况正常，且不影响中长期逻辑。本基金依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对韦尔股份进行了投资。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,677.85
5	应收申购款	111,428.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,106.80

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113611	福 20 转债	51,627.00	0.05

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
同泰慧择混合 A	1,845	36,386.31	2,599,480.44	3.87%	64,533,269.04	96.13%
同泰慧择混合 C	1,251	6,152.52	0.00	0.00%	7,696,801.64	100.00%
合计	3,096	24,169.75	2,599,480.44	3.47%	72,230,070.68	96.53%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	同泰慧择混合 A	388.93	0.00%
	同泰慧择混合 C	130.43	0.00%
	合计	519.36	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	同泰慧择混合 A	0~10
	同泰慧择混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	同泰慧择混合 A	0
	同泰慧择混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	同泰慧择混合 A	同泰慧择混合 C
基金合同生效日（2019 年 11 月 20 日）基金份额总额	31,611,594.28	176,622,392.16
本报告期期初基金份额总额	31,434,893.68	8,193,433.53
本报告期基金总申购份额	61,242,768.58	9,840,201.80
减：本报告期基金总赎回份额	25,544,912.78	10,336,833.69
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	67,132,749.48	7,696,801.64

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
华福证券	2	677,088,872.93	100.00%	489,295.35	100.00%	-

注：1、本基金使用券商结算模式。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华福证券	245,905.58	100.00%	2,900,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	同泰慧择混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定的媒介	2021 年 1 月 21 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	中国证监会指定的媒介	2021 年 3 月 31 日
3	同泰慧择混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定的媒介	2021 年 3 月 31 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	中国证监会指定的媒介	2021 年 4 月 21 日
5	同泰慧择混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定的媒介	2021 年 4 月 22 日
6	同泰慧择混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定的媒介	2021 年 4 月 23 日
7	同泰慧择混合型证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定的媒介	2021 年 4 月 28 日
8	同泰慧择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	2021 年 4 月 28 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	中国证监会指定的媒介	2021 年 5 月 21 日
10	同泰慧择混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2021 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2021 年 7 月 7 日，沈莉离任同泰慧择混合型证券投资基金基金经理。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人网站 (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 8 月 27 日