

同泰同欣混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 同泰同欣混合 |
| 基金主代码 | 013657 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 23,180,187.27 份 |
| 投资目标 | 在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过自上而下的分析，形成对不同大类资产市场的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定固定收益类资产、权益类资产和现金等的配置比例，并随着市场运行状况以及各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，力争有效控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×20%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合全价(总值)指数收益率×70% |
| 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。 本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

| | | |
|-----------------|----------------|-----------------|
| 基金管理人 | 同泰基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 | |
| 下属分类基金的基金简称 | 同泰同欣混合 A | 同泰同欣混合 C |
| 下属分类基金的交易代码 | 013657 | 013658 |
| 报告期末下属分类基金的份额总额 | 8,346,516.30 份 | 14,833,670.97 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2022 年 4 月 1 日 — 2022 年 6 月 30 日) | |
|-----------------|----------------------------------------|---------------|
| | 同泰同欣混合 A | 同泰同欣混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -157,745.81 | -376,699.29 |
| 2. 本期利润 | -10,929.58 | 5,337.95 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0011 | 0.0002 |
| 4. 期末基金资产净值 | 8,290,132.86 | 14,704,369.45 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9932 | 0.9913 |

注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等), 计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

同泰同欣混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.51% | 0.58% | 1.56% | 0.43% | -1.05% | 0.15% |
| 过去六个月 | -0.69% | 0.44% | -2.18% | 0.48% | 1.49% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.68% | 0.43% | -1.89% | 0.47% | 1.21% | -0.04% |

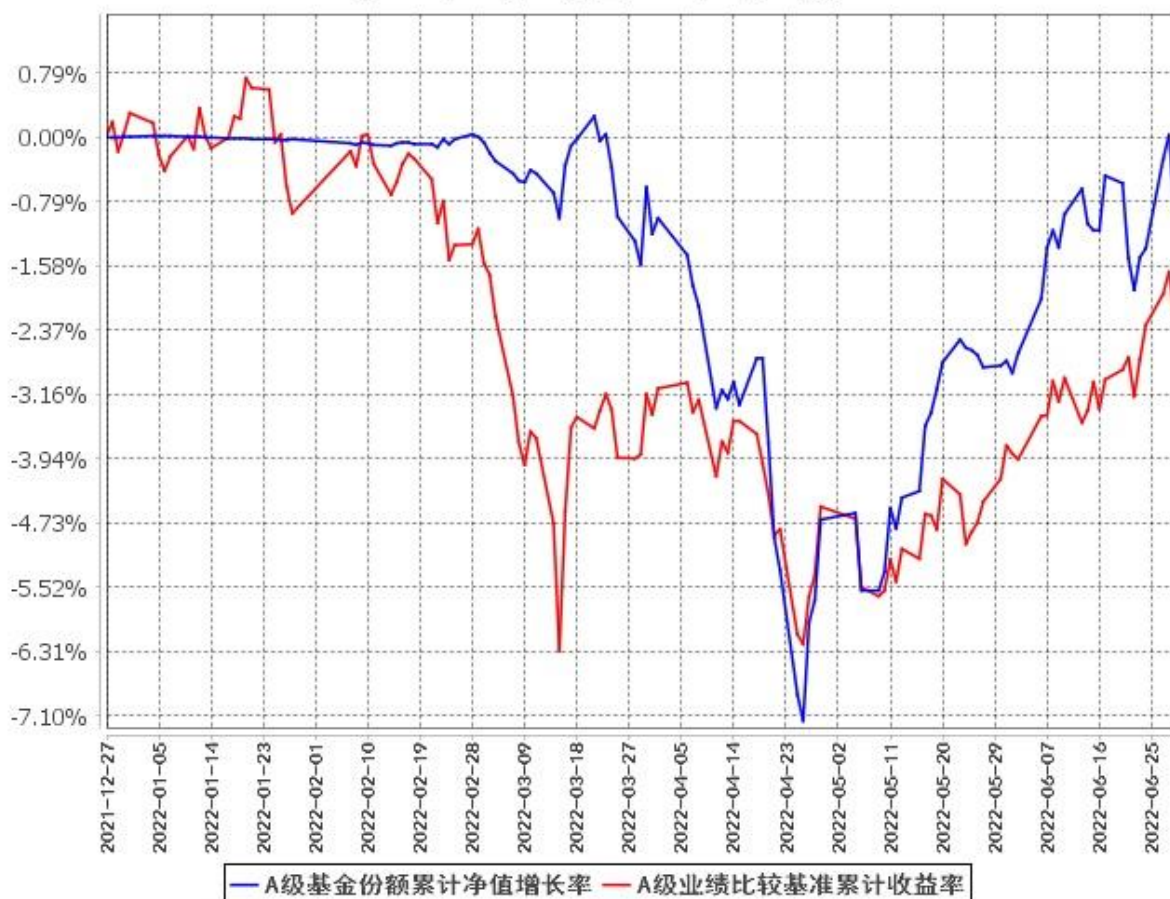
同泰同欣混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.42% | 0.58% | 1.56% | 0.43% | -1.14% | 0.15% |

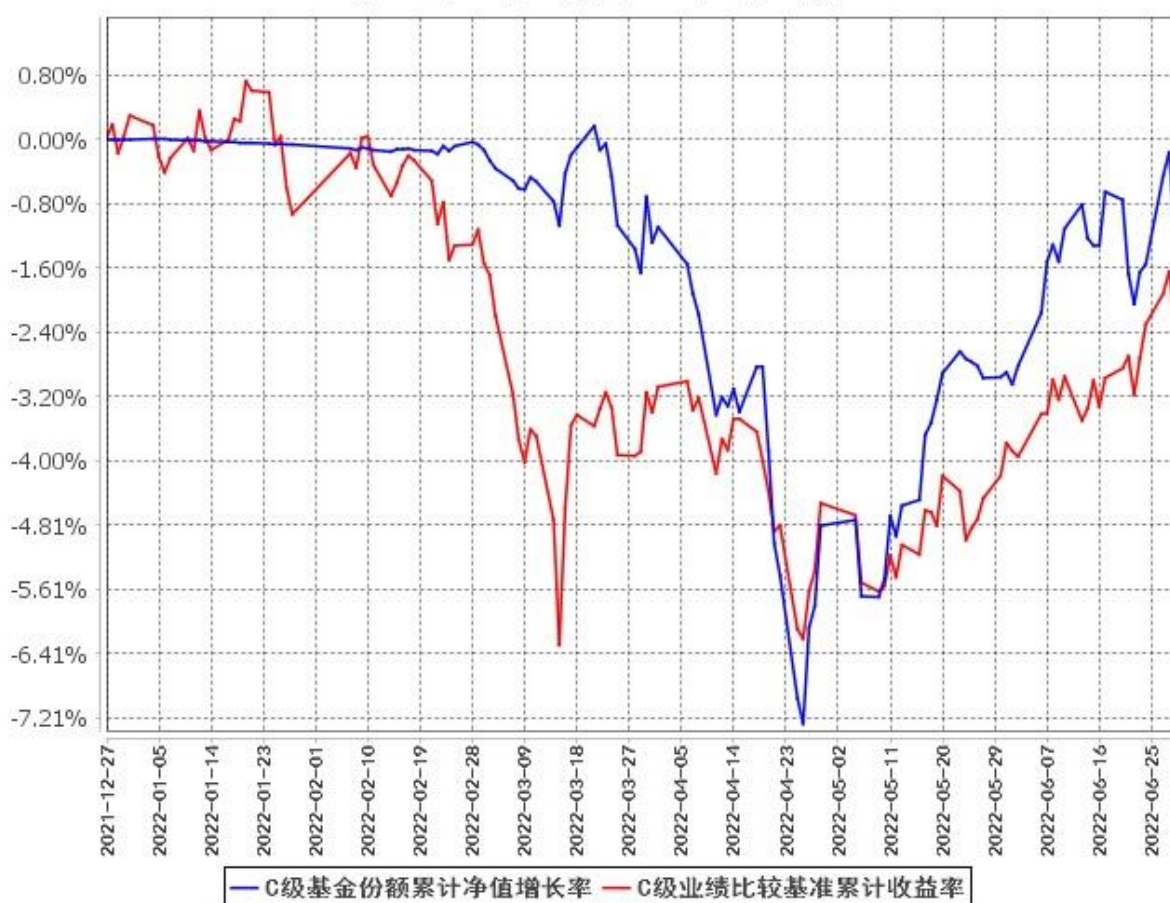
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去六个月 | -0.87% | 0.44% | -2.18% | 0.48% | 1.31% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.87% | 0.43% | -1.89% | 0.47% | 1.02% | -0.04% |

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

A级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
(2021年12月27日至2022年6月30日)



C级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
(2021年12月27日至2022年6月30日)



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 12 月 27 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未滿 1 年。

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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | |
|-----|-----------------------|------------------|---|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 鲁秦 | 本基金基金经理, 投资研究部信用研究负责人 | 2021 年 12 月 27 日 | - | 14 鲁秦女士, 中国国籍, 硕士。曾任神州数码(中国)有限公司 ERP 实施顾问、中诚信证券评估有限公司评级分析师、中债资信评估有限责任公司技术总监等职。2019 年 8 月加入同泰基金管理有限公司, 现任投资研究部信用研究负责人兼基金经理。2021 年 8 月 31 日起担任同泰恒利纯债债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 8 月 31 日起担任同泰恒兴纯债债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 10 月 29 日起担任同泰泰和三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 12 月 27 日起担任同泰同欣混合型证券投资基金基金经理。 |
| 卞亚军 | 本基金基金经理, 投资决策委员会联席主席 | 2021 年 12 月 27 日 | - | 18 卞亚军先生, 中国国籍, 硕士。曾任红塔证券股份有限公司研究员、投资经理助理, 华泰柏瑞基金管理有限公司研究员、基金经理, 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司基金经理、基金投资部总监, 上海濠河投资管理有限公司总经理等职。2020 年 8 月加入同泰基金管理有限公司, 现任投资决策委员会联席主席兼基金经理。2020 年 9 月 23 日起担任同泰竞争优势混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 12 月 31 日起担任同泰远见灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 4 月 8 日起担任同泰大健康主题混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 7 月 26 日起 |

| | | | | | |
|-----|---------|-----------|---|----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 担任同泰数字经济主题股票型证券投资基金基金经理,2021年8月30日起担任同泰行业优选股票型证券投资基金基金经理,2021年12月27日起担任同泰同欣混合型证券投资基金基金经理。 |
| 王小根 | 本基金基金经理 | 2022年1月5日 | - | 14 | 王小根先生,中国国籍,硕士。曾任长城国瑞证券投资经理,华泰证券信用研究员、投资经理,华泰联合证券研究员、交易员,联合证券债券业务员等职。2021年11月加入同泰基金管理有限公司,现任投资研究部基金经理。2022年1月5日起担任同泰同欣混合型证券投资基金基金经理,2022年1月27日起担任同泰恒兴纯债债券型证券投资基金基金经理,2022年3月30日起担任同泰产业升级混合型证券投资基金基金经理,2022年6月9日起担任同泰泰享中短债债券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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期,无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、

证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年第二季度，在新冠疫情冲击与消退的影响下，4 月经济增速降至上半年低点，5-6 月环比逐月改善。4 月，固定资产投资累计同比 6.8%，与上月相比回落 2.5 个百分点，基建投资支撑效果暂不显著；规模以上工业增加值同比-2.9%，与上月相比回落 7.9 个百分点；社会消费品零售总额同比-11.1%，降幅较上月扩大 7.6 个百分点。5 月，随着疫情缓解、企业复工复产、上海解除封控、政府稳住经济一揽子政策措施逐步落地，经济形势环比明显改善；5 月固定资产投资累计同比 6.2%，与上月相比回落 0.6 个百分点，降幅明显收窄；规模以上工业增加值同比增速转正；社会消费品零售总额同比-6.7%，降幅较上月缩小 4.4 个百分点。6 月，官方制造业 PMI 录得 50.2%，环比上月回升 0.6 个百分点，重回扩张区间，疫情影响基本消退，经济供需继续好转。

通胀压力总体可控，央行要求“稳物价”。上半年 CPI 低位逐步回升，继续在合理区间内运行；PPI 呈现高位回落态势。央行在第二季度货币政策委员会例会中强调：在国内粮食稳产增产、能源市场平稳运行的有利条件下，保持物价水平基本稳定。下半年通胀或成为央行进一步宽松的掣肘。

债券市场第二季度整体震荡。4 月上半月，疫情冲击下经济基本面走弱、3 月份 PMI 超预期下滑，债券收益率震荡下行；4 月下半月因降准幅度低于预期、政策或难以再宽松，债券收益率明显上行；5 月，由于 4 月份经济数据弱、融资需求差、银行间资产荒，债券收益率持续下行；6 月，因 5 月份 PMI 环比边际回升、房地产销售回暖、经济基本面预期继续改善，债券收益率走高。

受疫情冲击、政策发力等因素影响，股市 4 月份调整，5-6 月明显反弹。4 月，因新冠疫情多发、

上海封城经济几乎停摆、企业盈利预期下降等，股市继 3 月之后继续大幅下跌，月底最后三天出现较大幅度反弹，成长板块跌幅靠前，尤其是受上海疫情影响较大的汽车和半导体等产业链。5-6 月，因疫情得到有效控制、企业逐步复工复产、商业复市、政府稳住经济一揽子政策措施出台并实施，经济数据边际改善，企业盈利预期回升，股市迎来强劲反弹，新能源车产业链、光伏、风电等板块表现较好。

可转债市场第二季度类似股市先跌后涨。4 月股市下跌致转债继续调整，中证转债指数下跌 1.40% (振幅高达 5.46%)；5-6 月，股市强劲反弹下转债也同步上涨，中证转债指数分别上涨 2.26% 和 3.82%，收复 3-4 月的大部分跌幅。

投资操作上，本基金纯债部分的配置上以 3 年以内的品种为主，在市场波动较大的情况下，通过控制久期、有效控制风险的前提下获取一定的票息收益。转债方面，主要选择绝对价格和转股溢价率相对较低的标的进行重点配置，例如银行转债。股票方面，重点参与新能源车产业链、光伏、风电等成长板块标的，以分享经济增长、行业政策和企业成长等带来的增长红利。

展望后市，一方面，流动性宽松可期，资金价格或有抬升，但息差空间预计尚可。虽然 6 月底跨季资金价格脉冲式走高，但流动性持续宽松下，资金价格有望重新回落，关注稳物价下资金价格变化，持有债券的息差空间预计依旧尚可。另一方面，经济基本面环比边际改善，中长端收益率或继续承压。继新冠疫情 4-5 月严重影响我国经济之后，6 月疫后复苏经济环比明显好转，在稳经济一揽子政策措施快速落地之下下半年经济基本面有望继续边际改善，利空中长端债券，而企业盈利大概率提升利好股市。投资操作上，本基金在债券方面将配置和交易相结合，以配置短久期品种的票息策略为主，通过研判经济形势和市场走势，适度参与中长期品种的交易机会；转债方面，拟继续选择绝对价格和转股溢价率相对较低的标的进行重点配置；股票方面，拟在成长板块产业链的细分环节中挖掘盈利占优环节的优质标的进行重点投资，关注其他板块中盈利能力明显改善个股的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰同欣混合 A 的基金份额净值为 0.9932 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.51%；截至本报告期末同泰同欣混合 C 的基金份额净值为 0.9913 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.42%；同期业绩比较基准收益率为 1.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，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的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 5,006,050.40 | 21.63 |
| | 其中：股票 | 5,006,050.40 | 21.63 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 14,801,344.72 | 63.95 |
| | 其中：债券 | 14,801,344.72 | 63.95 |
| | 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 | 3,060,003.06 | 13.22 |
| | 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 | 172,386.34 | 0.74 |
| 8 | 其他资产 | 104,401.75 | 0.45 |
| 9 | 合计 | 23,144,186.27 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 445,140.00 | 1.94 |
| C | 制造业 | 4,560,910.40 | 19.83 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|--------------|-------|
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | 5,006,050.40 | 21.77 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 002460 | 赣锋锂业 | 6,600 | 981,420.00 | 4.27 |
| 2 | 002466 | 天齐锂业 | 5,300 | 661,440.00 | 2.88 |
| 3 | 601238 | 广汽集团 | 40,700 | 620,268.00 | 2.70 |
| 4 | 300443 | 金雷股份 | 9,900 | 451,242.00 | 1.96 |
| 5 | 300428 | 立中集团 | 13,300 | 439,565.00 | 1.91 |
| 6 | 002738 | 中矿资源 | 3,140 | 290,795.40 | 1.26 |
| 7 | 300850 | 新强联 | 2,600 | 231,478.00 | 1.01 |
| 8 | 002192 | 融捷股份 | 1,500 | 230,550.00 | 1.00 |
| 9 | 300681 | 英搏尔 | 3,900 | 225,303.00 | 0.98 |
| 10 | 000630 | 铜陵有色 | 68,800 | 224,288.00 | 0.98 |

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 2,018,883.29 | 8.78 |

| | | | |
|----|-----------|---------------|-------|
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 9,289,294.44 | 40.40 |
| | 其中：政策性金融债 | 9,289,294.44 | 40.40 |
| 4 | 企业债券 | 518,657.89 | 2.26 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,974,509.10 | 12.94 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 14,801,344.72 | 64.37 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 108615 | 国开 2105 | 49,500 | 5,067,641.84 | 22.04 |
| 2 | 018008 | 国开 1802 | 40,000 | 4,221,652.60 | 18.36 |
| 3 | 019629 | 20 国债 03 | 20,000 | 2,018,883.29 | 8.78 |
| 4 | 113052 | 兴业转债 | 7,500 | 837,536.51 | 3.64 |
| 5 | 128129 | 青农转债 | 7,000 | 735,012.47 | 3.20 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，届时将根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 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) | | | | | -1,406.24 |
| 国债期货投资本期公允价值变动 (元) | | | | | - |

5.10.3 本期国债期货投资评价

本期国债期货投资参与的是 1 手 2 年期国债期货，是小规模参与短久期品种，对基金总体风险影响不大，符合既定投资政策和投资目标。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

赣锋锂业(002460.SZ)为同泰同欣混合型证券投资基金的前十大持仓证券。江西赣锋锂业股份有限公司(以下简称“公司”)于 2022 年 6 月 8 日收到深圳证券交易所上市公司管理一部《关于对江西赣锋锂业股份有限公司的监管函》(编号:公司部监管函〔2022〕第 117 号):公司于 2022 年 5 月 17 日披露的《关于深圳证券交易所对公司 2021 年年度报告问询函回函的公告》显示,2022 年 2 月,公司与上海聚锦归企业管理合伙企业(有限合伙)共同投资设立新余赣锋矿业有限公司(以下简称“赣锋矿业”),公司出资 10.85 亿元,持有赣锋矿业 62%的股权,占 2020 年经审计净资产的 10.13%,公司未及时对上述投资事项履行信息披露义务。公司于 2021 年 3 月 9 日披露的《关于收购伊犁鸿大 100%财产份额涉及矿业权投资的公告》显示,公司拟以 14.70 亿元收购伊犁鸿大基业股权投资合伙企业(有限合伙)100%财产份额。公司于 2022 年 3 月 31 日披露的《2021 年年度报告》显示,上述收

购事项已于 2021 年 12 月 3 日完成，公司未及时披露有关交付或者过户事宜。

公司的上述行为违反了深圳证券交易所《股票上市规则(2022 年修订)》第 6.1.2 条，以及深圳证券交易所《股票上市规则(2020 年修订)》第 7.6 条的规定。公司未及时披露重大事件，对公司的经营影响小。本基金投资赣锋锂业的投资决策程序符合投资制度的规定。除赣锋锂业外，本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 88,839.16 |
| 2 | 应收证券清算款 | 14,407.37 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,155.22 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 104,401.75 |

注：本基金持有的存出保证金包含存放在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1 | 113052 | 兴业转债 | 837,536.51 | 3.64 |
| 2 | 128129 | 青农转债 | 735,012.47 | 3.20 |
| 3 | 110079 | 杭银转债 | 375,847.23 | 1.63 |
| 4 | 127032 | 苏行转债 | 362,384.44 | 1.58 |
| 5 | 113013 | 国君转债 | 340,788.99 | 1.48 |
| 6 | 127020 | 中金转债 | 234,826.68 | 1.02 |
| 7 | 110074 | 精达转债 | 88,112.78 | 0.38 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 同泰同欣混合 A | 同泰同欣混合 C |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 11,478,294.50 | 24,284,021.60 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 75,587.82 | 20,661,105.32 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 3,207,366.02 | 30,111,455.95 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 8,346,516.30 | 14,833,670.97 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|--------------------------------|--------------|---------------|---------------|------------|-------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2022 年 5 月 24 日-2022 年 6 月 6 日 | - | 20,545,173.50 | 20,545,173.50 | 0.00 | 0.00% |
| 个人 | 1 | 2022 年 4 月 1 | 7,803,683.33 | - | 7,803,683.33 | 0.00 | 0.00% |

| | | | | | | | |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|----------------------|--|--|--|--|--|
| | | 日-2022 年 5 月 23 日 | | | | | |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)或者基金管理人网站(www.tongtaiamc.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人住所免费查阅。

同泰基金管理有限公司

2022 年 7 月 20 日