

# 同泰同欣混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

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  
送出日期：2022 年 8 月 30 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
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 .....	12
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 .....	12
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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	15
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 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	44

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
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 .....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
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 .....	48
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 ..	48
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 ..	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	同泰同欣混合型证券投资基金	
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	
基金管理人	同泰基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	23,180,187.27 份	
基金合同存续期	不定期	
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

### 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×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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		同泰基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	滕大江	李帅帅
	联系电话	0755-23537896	0755-25878287
	电子邮箱	tengdj@tongtaiamc.com	LISHUAI SHUAI130@pingan.com.cn

客户服务电话	400-830-1666	95511-3
传真	0755-23537801	0755-82080387
注册地址	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 41 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 41 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	518033	518001
法定代表人	马俊生	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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

基金类别	同泰同欣混合 A	同泰同欣混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）	报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-202,789.90	-623,823.40
本期利润	-168,020.57	-500,485.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0130	-0.0096
本期加权平均净值利润率	-1.32%	-0.97%
本期基金份额净值增长率	-0.69%	-0.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2022 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	-89,674.95	-188,329.97
期末可供分配基金份额利润	-0.0107	-0.0127
期末基金资产净值	8,290,132.86	14,704,369.45
期末基金份额净值	0.9932	0.9913

3.1.3 累计期末指标	报告期末（2022 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-0.68%	-0.87%

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

同泰同欣混合 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	2.12%	0.51%	1.97%	0.35%	0.15%	0.16%
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%

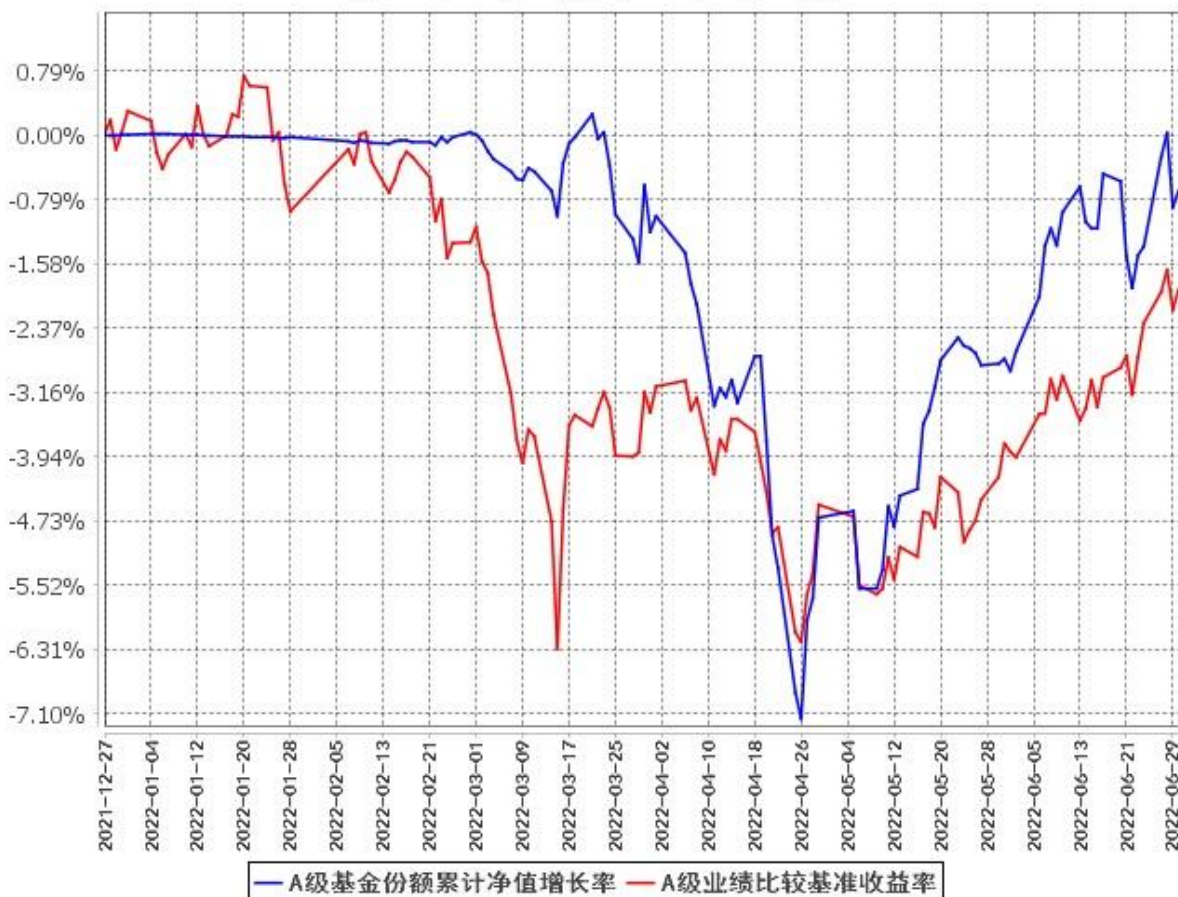
同泰同欣混合 C

阶段	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	2.09%	0.51%	1.97%	0.35%	0.12%	0.16%
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%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 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%，每日进行再平衡过程。

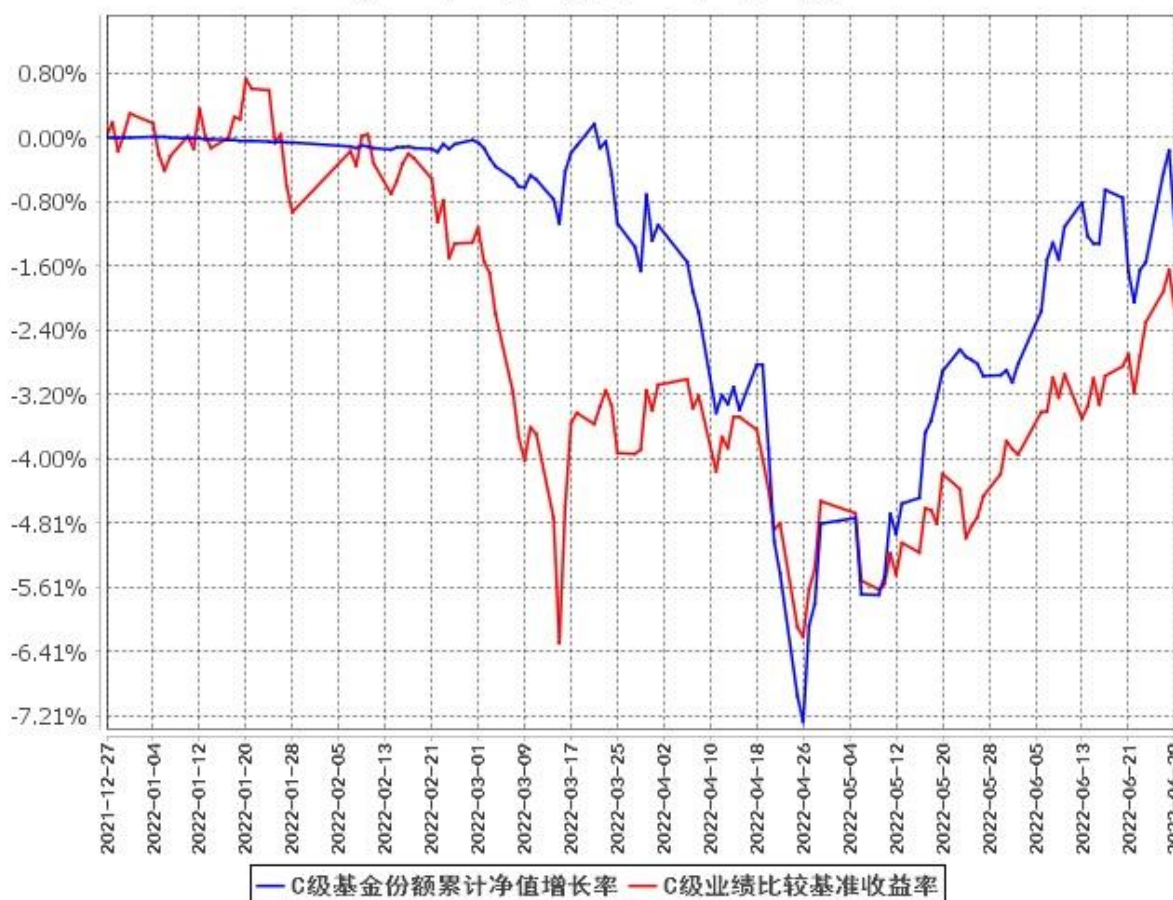
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**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，本基金运作时间未满 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 19 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		
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。
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。

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。

#### 4.1.3 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。

## 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

2022 年上半年债券市场整体以区间震荡为主。年初，因央行先后调降 MLF 利率和 LPR，债市短期做多热情高涨，债券收益率快速下行。随后，公布的 1 月份社融数据大超市场预期，因城施策下广州、杭州等地下调房贷利率，外资机构减持中国债券，2 月份官方制造业 PMI 新订单指数回到荣枯线以上，债券收益率出现较大幅度上行。3 月中下旬至 5 月底，因新冠疫情冲击下经济基本面走弱，叠加流动性宽松、融资需求不足情况下“资产荒”导致机构配置需求较为旺盛，债券收益率震荡下行，信用债表现好于利率债。6 月，因 5 月份 PMI 环比边际回升、上海全面复工复产复市、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。整体来看，上半年除 1 年期以外的其他期限债券收益率呈现一定幅度内的区间震荡为主，10 年期国债收益率较去年底上行约 4bp，而 1 年期国债收益率较去年下行约 20bp。

股票市场方面，受国外地缘政治冲突升级、通胀高企、美联储加息，以及国内新冠疫情冲击、稳住经济一揽子政策措施发力等因素影响，上半年股市大幅下跌后有所反弹。1 月-4 月，欧美主要发达国家通胀走高，俄乌冲突进一步推高通胀，美联储开启加息进程，全球无风险利率美债利率上行；中国坚持高质量发展，新冠疫情防控坚持“动态清零”制约中国稳增长实施的力度和空间，企业盈利预期下降，股市经历了持续的大幅下跌，成长板块估值压缩跌幅靠前，尤其是受上海疫情防

控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。

转债市场方面，上半年类似股市先跌后涨。一季度中证转债指数下跌了 8.36%，在 2 月和 3 月先后经历了 2 次幅度较大的下跌和估值压缩，高价转债估值压缩相对低价转债更为明显。4 月，上海因疫情全面封控，经济受挫，股市下跌，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，转债上涨，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，以获取一定的票息收益为主。转债方面，鉴于转债估值普遍处于较高水平，主要选择绝对价格或转股溢价率相对较低的品种重点配置，例如银行转债。股票方面，本基金在 1 月-2 月以很低仓位参与股票的投资；3 月金融委会议有力消除了股市资金（尤其是北上资金）对市场政治风险的担忧，本基金开始加仓累计调整幅度较大且估值已较为合理的成长板块个股；进入二季度，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。

#### 4.4.2 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 -0.69%；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 -0.87%；同期业绩比较基准收益率为 -2.18%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，国内经济稳增长的政策力度、经济增速预期大概率出现回落。我国经济的外部环境预计依旧复杂严峻，通胀高位运行，欧美等发达国家继续加息，全球经济增长放缓，地缘政治冲突持续。国内经济发展面临三重压力，着力稳就业稳物价，不再强调 5.5%左右经济增速目标。国内疫情防控坚持动态清零，防控形势总体向好但任务仍然艰巨，经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，7 月中央政治局会议未提全年 5.5%左右经济增速目标，而是着力稳就业稳物价，经济运行“力争实现最好结果”。因此，国内稳增长的政策力度、下半年的经济增速预期较 7 月份之前大概率出现回落。

展望后市，一方面，7 月政治局会议继续强调“货币政策要保持流动性合理充裕”，流动性宽松可期，资金价格或较 7 月低点有所抬升、但预计仍处较低水平，债券的息差空间有望仍处于较好水

平。另一方面，全年经济增速目标淡化之后，下半年经济基本面改善力度或有减弱，中长端债券收益率存在下行机会，关注基数效应下经济增速对债市的扰动。权益市场，中央强调提升能源资源供应保障能力，加大力度规划建设新能源供给消化体系，财政货币政策要在夸大需求上积极作为有效弥补社会需求不足，因此下半年新能源车、光伏、风电等新能源产业链有望继续面临较好的政策环境和发展机遇，同时可关注财政货币政策在扩大需求上带来的投资机会。

下半年，本基金在债券方面将继续配置和交易相结合，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，双碳目标下能源变革带来中国制造重大机遇，拟在相关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，同时关注其他板块中盈利能力明显改善个股的投资机会。

#### 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。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本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，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：同泰同欣混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	796.44	125,735.92
结算备付金		171,589.90	160,025,833.33
存出保证金		88,839.16	46,937,386.33
交易性金融资产	6.4.7.2	19,807,395.12	-
其中：股票投资		5,006,050.40	-
基金投资		-	-
债券投资		14,801,344.72	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,060,003.06	-18,691.92
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		14,407.37	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,155.22	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		23,144,186.27	207,070,263.66
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		41,166.09	-
应付管理人报酬		23,042.13	22,687.45
应付托管费		4,608.44	4,537.49
应付销售服务费		6,411.38	8,290.65
应付投资顾问费		-	-
应交税费		72.16	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	74,383.76	-
负债合计		149,683.96	35,515.59
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	23,180,187.27	207,023,719.59
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-185,684.96	11,028.48
净资产合计		22,994,502.31	207,034,748.07
负债和净资产总计		23,144,186.27	207,070,263.66



注：(1)报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 23,180,187.27 份，其中同泰同欣混合 A 基金份额净值 0.9932 元，基金份额总额 8,346,516.30 份；同泰同欣混合 C 基金份额净值 0.9913 元，基金份额总额 14,833,670.97 份。

(2)本基金合同于 2021 年 12 月 27 日生效，无上年度可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体：同泰同欣混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-96,833.16
1. 利息收入		195,906.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	124,502.98
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		71,403.58
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-593,879.82
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-660,148.95
基金投资收益	6.4.7.15	-
债券投资收益	6.4.7.16	49,410.72
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-1,406.24
股利收益	6.4.7.20	18,264.65
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	158,106.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	143,033.12
<b>减：二、营业总支出</b>		571,673.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	324,842.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,968.39

3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	104, 374. 71
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 23	-
7. 税金及附加		103. 16
8. 其他费用	6. 4. 7. 24	77, 384. 67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-668, 506. 32
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-668, 506. 32
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-668, 506. 32

注：本基金合同于 2021 年 12 月 27 日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：同泰同欣混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	207, 023, 719. 59	-	11, 028. 48	207, 034, 748. 07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	207, 023, 719. 59	-	11, 028. 48	207, 034, 748. 07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-183, 843, 532. 32	-	-196, 713. 44	-184, 040, 245. 76
（一）、综合收益总额	-	-	-668, 506. 32	-668, 506. 32

(二)、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)	-183,843,532.32	-	471,792.88	-183,371,739.44
其中：1. 基金申购款	20,905,948.05	-	-549,941.33	20,356,006.72
2. 基金赎回款	-204,749,480.37	-	1,021,734.21	-203,727,746.16
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	23,180,187.27	-	-185,684.96	22,994,502.31

注：本基金合同于 2021 年 12 月 27 日生效，无上年度可比期间。

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：

马俊生	杨伍	刘韞芬
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

同泰同欣混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]985号《关于准予同泰同欣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 2021 年 12 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 207,023,719.59 份基金份额。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为同泰基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（包括

国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 0%-40%，港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%，本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×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%。

#### 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于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，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基

金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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。

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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方法进行估值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，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金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。

#### 6.4.4.8 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）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。



以摊余成本计量的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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

##### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。

(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。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	796.44
等于：本金	794.55
加：应计利息	1.89
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	796.44

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,911,343.18	-	5,006,050.40	94,707.22
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	278,054.02	14,801,344.72	63,399.76
	银行间市场	-	-	-
	合计	278,054.02	14,801,344.72	63,399.76
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	19,371,234.12	278,054.02	19,807,395.12	158,106.98

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,060,003.06	-
银行间市场	-	-
合计	3,060,003.06	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,383.76
合计	74,383.76

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

同泰同欣混合 A	
项目	本期 2022年1月1日至 2022年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,892,451.23	17,892,451.23
本期申购	175,246.18	175,246.18
本期赎回(以“-”号填列)	-9,721,181.11	-9,721,181.11
本期末	8,346,516.30	8,346,516.30

金额单位：人民币元

同泰同欣混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	189,131,268.36	189,131,268.36
本期申购	20,730,701.87	20,730,701.87
本期赎回(以“-”号填列)	-195,028,299.26	-195,028,299.26
本期末	14,833,670.97	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。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

同泰同欣混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,669.75	-	1,669.75
本期利润	-202,789.90	34,769.33	-168,020.57
本期基金份额交易产生的变动数	111,445.20	-1,477.82	109,967.38
其中：基金申购款	-1,292.74	-529.84	-1,822.58
基金赎回款	112,737.94	-947.98	111,789.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-89,674.95	33,291.51	-56,383.44

单位：人民币元

同泰同欣混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	9,358.73	-	9,358.73
本期利润	-623,823.40	123,337.65	-500,485.75
本期基金份额交易产生的变动数	426,134.70	-64,309.20	361,825.50
其中：基金申购款	-843,097.05	294,978.30	-548,118.75
基金赎回款	1,269,231.75	-359,287.50	909,944.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-188,329.97	59,028.45	-129,301.52

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	642.12
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	122,930.16
其他	930.70
合计	124,502.98

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

项目	本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-660,148.95
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	-660,148.95

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	65,655,710.03
减：卖出股票成本总额	66,139,746.26
减：交易费用	176,112.72
买卖股票差价收入	-660,148.95

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 基金投资收益

无。

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日 至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	148,819.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-99,408.59
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	49,410.72

## 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日 至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	31,900,831.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,568,214.45
减：应计利息总额	429,971.88
减：交易费用	2,053.62
买卖债券差价收入	-99,408.59

## 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。



## 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.18 贵金属投资收益

## 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 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 2022年1月1日 至2022年6月30日
国债期货投资收益	-1,406.24

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日 至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,264.65
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	18,264.65

#### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日 至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	158,106.98
——股票投资	94,707.22
——债券投资	63,399.76
——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	158,106.98

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日 至2022年6月30日
基金赎回费收入	143,033.12
合计	143,033.12

#### 6.4.7.23 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日 至2022年6月30日
----	--------------------------------

审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
交易费用_深港通_证券组合费	0.91
账户维护费	3,000.00
合计	77,384.67

#### 6.4.7.25 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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

#### 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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

##### 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 基金交易**

无。

**6.4.10.1.5 权证交易**

无。

**6.4.10.1.6 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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	324,842.23
其中：支付销售机构的客户维护费	120,675.50

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	64,968.39

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	同泰同欣混合 A	同泰同欣混合 C	合计
同泰基金管理有 限公司	-	30,140.76	30,140.76
平安银行股份有 限公司	-	35,850.65	35,850.65
合计	-	65,991.41	65,991.41

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	796.44	642.12

## 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2022 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

无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 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 15.19%。

#### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
AAA	3,170,227.53	-
AAA 以下	322,939.46	-
未评级	-	-
合计	3,493,166.99	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本统计数据不包含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

#### 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

本基金本报告期不适用。

##### 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(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。

#### 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 2022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	796.44	-	-	-	796.44
结算备付金	171,589.90	-	-	-	171,589.90
存出保证金	88,839.16	-	-	-	88,839.16
交易性金融资产	5,512,050.28	9,289,294.44	-	5,006,050.40	19,807,395.12
买入返售金融资产	3,060,003.06	-	-	-	3,060,003.06
应收证券清算款	-	-	-	14,407.37	14,407.37
应收申购款	-	-	-	1,155.22	1,155.22
资产总计	8,833,278.84	9,289,294.44	-	5,021,612.99	23,144,186.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	41,166.09	41,166.09
应付管理人报酬	-	-	-	23,042.13	23,042.13
应付托管费	-	-	-	4,608.44	4,608.44
应付销售服务费	-	-	-	6,411.38	6,411.38
应交税费	-	-	-	72.16	72.16
其他负债	-	-	-	74,383.76	74,383.76
负债总计	-	-	-	149,683.96	149,683.96
利率敏感度缺口	8,833,278.84	9,289,294.44	-	4,871,929.03	22,994,502.31

上年度末 2021 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	125,735.92	-	-	-	125,735.92
结算备付金	160,025,833.33	-	-	-	160,025,833.33
存出保证金	46,937,386.33	-	-	-	46,937,386.33
买入返售金融资产	-18,691.92	-	-	-	-18,691.92
资产总计	207,070,263.66	-	-	-	207,070,263.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,687.45	22,687.45
应付托管费	-	-	-	4,537.49	4,537.49
应付销售服务费	-	-	-	8,290.65	8,290.65
负债总计	-	-	-	35,515.59	35,515.59
利率敏感度缺口	207,070,263.66	-	-	-35,515.59	207,034,748.07

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-60,229.95	-
市场利率下降 25 个基点	60,753.10	-	

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

本基金本报告期不适用。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期不适用。

#### 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	5,006,050.40	21.77	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	14,801,344.72	64.37	-	-
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	19,807,395.12	86.14	-	-

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数收益率上升 5%	333,420.28	-
沪深 300 指数收益率下降 5%	-333,420.28	-	-

#### 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 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	7,980,559.50
第二层次	11,826,835.62
第三层次	-
合计	19,807,395.12

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 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	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	其他各项资产	104,401.75	0.45
9	合计	23,144,186.27	100.00

## 7.2 报告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

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

## 7.2.2 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港股通标的股票。

## 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（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
11	688598	金博股份	756	222,793.20	0.97
12	601899	紫金矿业	23,000	214,590.00	0.93
13	002241	歌尔股份	6,200	208,320.00	0.91
14	601012	隆基绿能	60	3,997.80	0.02

## 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	300772	运达股份	3,194,707.80	1.54
2	601012	隆基绿能	2,805,876.60	1.36
3	002460	赣锋锂业	2,530,256.50	1.22
4	601238	广汽集团	2,485,600.00	1.20
5	688599	天合光能	2,325,845.36	1.12
6	688598	金博股份	2,142,623.90	1.03
7	601899	紫金矿业	1,968,667.00	0.95
8	601633	长城汽车	1,929,329.00	0.93
9	002738	中矿资源	1,875,413.00	0.91
10	002475	立讯精密	1,851,991.00	0.89
11	002756	永兴材料	1,798,794.00	0.87
12	603799	华友钴业	1,677,772.80	0.81

13	002594	比亚迪	1,586,182.00	0.77
14	300919	中伟股份	1,545,469.00	0.75
15	603986	兆易创新	1,542,685.00	0.75
16	000932	华菱钢铁	1,382,091.00	0.67
17	688005	容百科技	1,343,261.25	0.65
18	600497	驰宏锌锗	1,199,661.00	0.58
19	603185	上机数控	1,188,134.00	0.57
20	600111	北方稀土	1,159,365.00	0.56

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	300772	运达股份	3,077,701.60	1.49
2	601012	隆基绿能	2,891,301.00	1.40
3	688599	天合光能	2,421,766.45	1.17
4	002756	永兴材料	2,006,184.00	0.97
5	601633	长城汽车	1,952,961.00	0.94
6	688598	金博股份	1,918,837.01	0.93
7	002738	中矿资源	1,878,123.00	0.91
8	601238	广汽集团	1,777,583.00	0.86
9	002475	立讯精密	1,767,392.00	0.85
10	601899	紫金矿业	1,691,360.00	0.82
11	002594	比亚迪	1,647,884.00	0.80
12	603799	华友钴业	1,596,575.00	0.77
13	002460	赣锋锂业	1,533,063.50	0.74
14	603986	兆易创新	1,528,616.00	0.74
15	300919	中伟股份	1,469,122.05	0.71
16	688005	容百科技	1,353,639.12	0.65
17	000932	华菱钢铁	1,331,490.00	0.64
18	600497	驰宏锌锗	1,114,730.00	0.54
19	600111	北方稀土	1,096,308.00	0.53
20	000807	云铝股份	1,079,978.00	0.52

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	71,051,089.44
卖出股票收入(成交)总额	65,655,710.03

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	2,018,883.29	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

### 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	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

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

本基金本报告期末未持有权证。



## 7.10 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 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。

## 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

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。

### 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未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	88,839.16
2	应收清算款	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。

### 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	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

### 7.12.5 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情况。

### 7.12.6 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。

## § 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

份额类别	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
同泰同欣混合 A	180	46,369.54	-	0.00%	8,346,516.30	100.00%
同泰同欣混合 C	874	16,972.16	-	0.00%	14,833,670.97	100.00%
合计	1,054	21,992.59	-	0.00%	23,180,187.27	100.00%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	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	同泰同欣混合 A	50,576.65	0.6060%
	同泰同欣混合 C	20.06	0.0001%
	合计	50,596.71	0.2183%

## 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	份额类别	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	同泰同欣混合 A	0
	同泰同欣混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	同泰同欣混合 A	0~10
	同泰同欣混合 C	0
	合计	0~10

## § 9 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
基金合同生效日 (2021 年 12 月 27 日) 基金份额总额	17,892,451.23	189,131,268.36
本报告期期初基金份额总额	17,892,451.23	189,131,268.36
本报告期基金总申购份额	175,246.18	20,730,701.87
减：本报告期基金总赎回份额	9,721,181.11	195,028,299.26
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-

本报告期末基金份额总额	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。

## § 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

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	
东兴证券	2	129,905,474.93	95.02%	95,427.70	94.79%	-
国海证券	3	6,801,324.54	4.98%	5,240.03	5.21%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-

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
东兴证券	38,994,124.49	73.02%	369,250,000.00	89.69%	-	-
国海证券	14,407,569.95	26.98%	42,438,000.00	10.31%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

### 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	同泰基金管理有限公司关于同泰同欣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	2022年1月6日
2	同泰同欣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	2022年1月8日
3	同泰同欣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	2022年1月8日
4	同泰同欣混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定的媒介	2022年1月25日
5	同泰基金管理有限公司关于旗下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	2022年3月23日
6	同泰同欣混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定的媒介	2022年4月22日
7	关于同泰同欣混合型证券投资基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会指定的媒介	2022年4月23日
8	同泰基金管理有限公司关于旗下基金估值调整的公告	中国证监会指定的媒介	2022年4月28日
9	关于同泰同欣混合型证券投资基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会指定的媒介	2022年5月12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

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 1 月 1 日 -2022 年 1 月 25 日	50,000,000.00	-	50,000,000.00	0.00	0.00%
	2	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 3 月 18 日 -2022 年 5 月 23 日	7,803,683.33	-	7,803,683.33	0.00	0.00%
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>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

## 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](http://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 8 月 30 日