

# 诺安双利债券型发起式证券投资基金

## 2023 年第 1 季度报告

2023 年 03 月 31 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 04 月 22 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的法律责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 04 月 21 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	诺安双利债券发起
基金主代码	320021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 11 月 29 日
报告期末基金份额总额	785,575,203.92 份
投资目标	本基金力图在获得稳定收益的同时增加长期资本增值的能力，使基金资产在风险可控的基础上得到最大化增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金 80%以上的基金资产投资于债券等固定收益类金融工具，本基金股票投资比例上限不超过 20%，以便控制市场波动风险。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金将在保持组合低波动性的前提下，运用多种积极管理增值策略，追求绝对回报。绝对回报投资组合的目标在于资本保值、持续性地以绝对正回报的方式实现增值。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>(1) 个股精选策略</p> <p>本基金将主要采取自下而上的个股精选策略，投资于具备稳定</p>

	<p>内生增长、能给股东创造经济价值 (EVA) 的股票。</p> <p>(2) 组合动态调整策略</p> <p>本基金将根据市场波动性及其走向趋势, 采用时间平均法调整建仓节奏, 控制建仓成本, 同时设置止赢止损点, 在组合获利达到既定目标时及时兑现, 以实现基金每年的绝对收益目标。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略, 基于对基础证券投资价值的研究判断, 进行存托凭证的投资。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险的前提下, 主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础, 在采用数量化模型分析其合理定价的基础上, 把握市场的短期波动, 进行积极操作, 追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>股指期货投资用于对冲股市系统性风险, 根据诺安大盘的定量分析模型和投资决策委员会的定性结论, 选取适当期限的股指期货合约对冲大盘中短期下跌的风险; 具体对冲比例应由历史回归方法所确定的 Beta 值和短线择时模型共同决定。</p> <p>未来, 随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等, 基金还将积极寻求其他投资机会, 履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	中债综合指数(全价)
风险收益特征	本基金为债券型基金, 其预期收益和风险水平高于货币市场基金, 低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

### § 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 (2023 年 01 月 01 日-2023 年 03 月 31 日)
1. 本期已实现收益	25,507,152.91
2. 本期利润	38,324,710.08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0454
4. 期末基金资产净值	2,085,037,777.05
5. 期末基金份额净值	2.654

注: 1、上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, 计入费用后实际收益水平要低于所

列数字。

2、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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

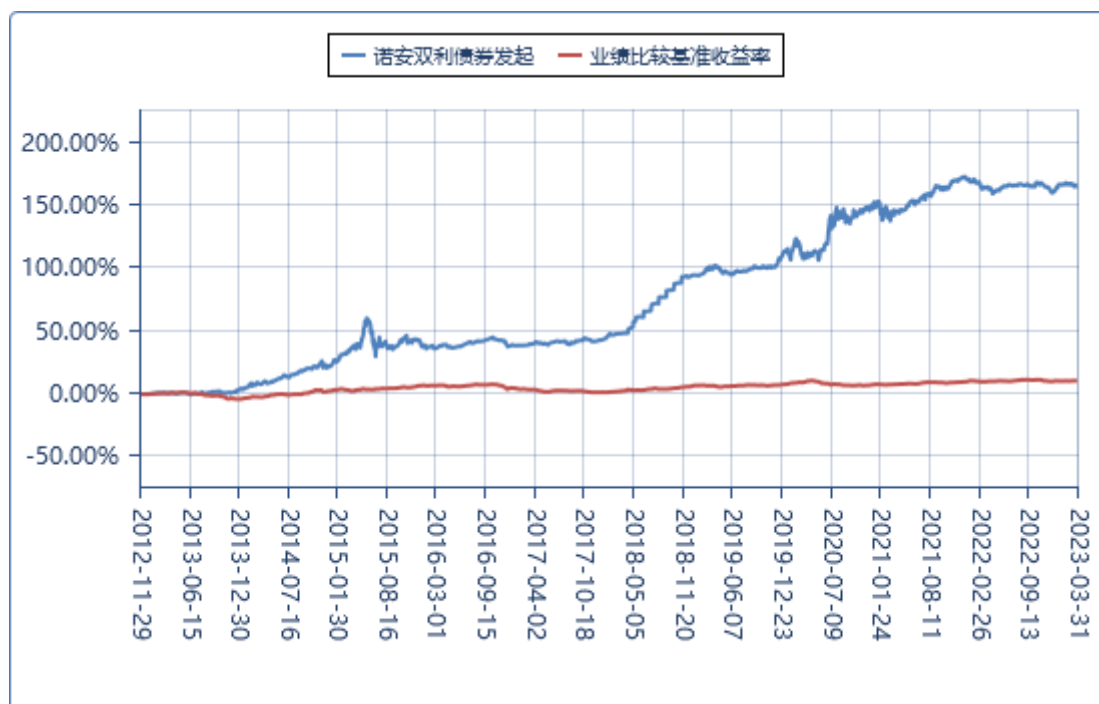
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	1.49%	0.21%	0.28%	0.03%	1.21%	0.18%
过去六个月	0.00%	0.20%	-0.32%	0.06%	0.32%	0.14%
过去一年	0.45%	0.18%	0.70%	0.05%	-0.25%	0.13%
过去三年	27.60%	0.47%	0.98%	0.06%	26.62%	0.41%
过去五年	78.72%	0.49%	7.95%	0.06%	70.77%	0.43%
自基金合同生效起 至今	165.40%	0.49%	10.76%	0.08%	154.64%	0.41%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合指数(全价)。

#### 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



## § 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		
潘飞	本基金基金经理	2022 年 06 月 17 日	-	13 年	硕士，CFA，具有基金从业资格。曾就职于广发银行股份有限公司，任投资经理。2015 年 4 月加入诺安基金管理有限公司，任基金经理助理，从事资金、债券交易工作，现任固定收益事业部总经理助理。2019 年 5 月至 2022 年 2 月任诺安恒惠债券型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月至 2022 年 6 月任诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月起任诺安理财宝货币市场基金基金经理，2017 年 12 月起任诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 11 月起任诺安天天宝货币市场基金基金经理，2022 年 4 月起任诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 6 月起任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理。
王海畅	本基金基金经理	2022 年 11 月 17 日	-	6 年	硕士，具有基金从业资格。2017 年 1 月加入诺安基金管理有限公司，

					历任研究员。2022 年 7 月起任诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月起任诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。
孔宪政	本基金基金经理	2023 年 02 月 21 日	-	11 年	博士，具有基金从业资格。历任野村证券交易员、白湾基金投资经理、前海开源基金投资部副总监、兴证证券资产管理有限公司投资部投资经理、蜂巢基金管理有限公司基金经理。2021 年 10 月加入诺安基金管理有限公司，现任量化与创新投资部总经理。2023 年 2 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期均为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了基金合同的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所

公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内美国通胀走势有所回落。美联储两次加息，其中 2 月加息幅度为 25bp，3 月为 25bp，目前联邦基金目标利率区间提高至 4.75%-5.0%。持续的加息导致美国金融市场不稳定因素增加，“硅谷银行”事件导致市场乐观预期美联储货币政策的转向。整体看，美联储加息周期或接近尾声，降息操作需进一步跟踪美国经济、金融环境变化。期间，10 年美债利率先上后下，高点接近 4.0%左右，后受银行业危机事件影响，快速回落；美债收益率曲线倒挂现象有所缓和，美元指数先走强后回落。

国内受疫情放开、地产政策优化等因素影响，经济内生动能增强，投资、消费等数据有所回升，信贷、社融扩张。央行货币政策保持平稳，在 3 月降准 25BP。银行间市场资金利率中枢抬升，波动加大。债市在经历去年底调整后，1 季度呈现修复行情，信用债收益率明显下行，信用利差、期限利差、等级利差整体有所压缩。转债市场在经历 1 月普涨后进入震荡行情，行业走势分化。流动性宽松背景下，转债估值依然处于相对较高水平。本组合在报告期内根据市场变化，灵活调整持仓品种结构、杠杆和久期分布，以增厚组合收益，力求为持有人提供可持续的中长期回报。

权益方面，我们认为，选股的核心逻辑应当建立在公司在产业链中的竞争优势、估值和确定性的基础上而不是善变的市场风格基础上，我们对市场的中短期分析应当以此为前提。我们坚持以中长期视角看待企业和股票，不追高，坚持价值导向，勤奋翻石头，寻找预期差，筛选估值与业绩增速相比低估较为明显的细分行业，测算其市值空间，分散买入潜在增幅大的子行业，同时，作为对波动和回撤有要求的二级债基，我们更多会考虑股票可能的回撤区间。这是我们选股的整体原则。

站在 2023 年初，我们有理由对权益资产保持乐观，原因有二：

2022 年市场的大幅回调，使得一批成长性突出的优秀企业的市盈率从高高在上下降到有了充足的安全边际。从而使得下行风险的控制难度略有降低。

对标海外，还有很多细分行业正在成长之中，相对分散的市场格局和优秀的管理能力结合在一起的企业，将会完成企业市占率、盈利和市值的大幅度提升。

回到整体权益市场的角度上来看，今年以来市场的复苏慢于早前预期，主要原因一是在于经济复苏较以往几轮经济周期略慢。二是因为增量资金仍大量囤积在存款中，尚未大规模流入基金。

目前两方面均有改善的预期。一方面是对民营资本的政策更加友好，另一方面增量资金的流入需要收



入效应或财富效应的带动。以往财富效应往往由地产市场拉动，而本轮财富效应可能需要股市自身启动。目前火热的科技起到了一个点火的作用。后续进入业绩披露期后，业绩兑现度高的板块有望接力。我们希望布局的高性价比行业能够在这一轮的业绩披露期获得认可，如果没有也不必着急，我们在有足够的安全边际来抵御下行风险的同时也相信高质量的管理层和具有高竞争优势的企业会在时间中展露其价值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 2.654 元，本报告期内基金份额净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 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	356,482,701.35	13.63
	其中：股票	356,482,701.35	13.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,249,423,298.19	86.00
	其中：债券	2,236,445,426.28	85.50
	资产支持证券	12,977,871.91	0.50
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	9,258,115.94	0.35
8	其他资产	495,669.41	0.02
9	合计	2,615,659,784.89	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	-	-
C	制造业	232,238,346.65	11.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	27,041,827.20	1.30
F	批发和零售业	36,715,658.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	4,689,000.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,603,592.00	1.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,194,277.50	1.45
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	356,482,701.35	17.10

### 5.3 报告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	600276	恒瑞医药	985,904	42,216,409.28	2.02
2	000661	长春高新	209,000	34,129,700.00	1.64
3	300601	康泰生物	1,075,013	34,013,411.32	1.63
4	603392	万泰生物	276,669	32,135,104.35	1.54
5	600057	厦门象屿	2,808,770	30,194,277.50	1.45
6	601117	中国化学	2,913,990	27,041,827.20	1.30
7	600755	厦门国贸	2,223,100	19,163,122.00	0.92
8	301208	中亦科技	293,300	18,331,250.00	0.88
9	000739	普洛药业	776,300	16,535,190.00	0.79
10	002049	紫光国微	137,000	15,224,810.00	0.73

### 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	央行票据	-	-
3	金融债券	350,425,799.86	16.81
	其中：政策性金融债	121,270,679.45	5.82
4	企业债券	203,488,906.31	9.76
5	企业短期融资券	10,029,063.01	0.48
6	中期票据	1,440,082,411.84	69.07
7	可转债（可交换债）	162,581,789.36	7.80
8	同业存单	69,837,455.90	3.35
9	其他	-	-
10	合计	2,236,445,426.28	107.26

### 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	220211	22 国开 11	1,100,000	111,130,227.40	5.33
2	2128039	21 中国银行二级 03	600,000	61,207,857.53	2.94
3	102101577	21 恒运 MTN002	500,000	51,391,849.32	2.46
4	102281280	22 新建元 MTN001	500,000	51,344,315.07	2.46
5	1880163	18 首旅债 01	500,000	51,204,539.73	2.46

### 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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	2289168	22 兴渝 1A	200,000	12,977,871.91	0.62

### 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国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体，除中国银行外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚。

截至本报告期末，21 中国银行二级 03（2128039）为本基金前十大重仓证券。从投资的角度看，我们认为处罚对公司净利润影响很小，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。本基金对该债券的投资符合法律法规和公司制度。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	148,558.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	347,110.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	495,669.41

### 5.10.4 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	110053	苏银转债	14,413,736.40	0.69

2	113052	兴业转债	13,175,927.40	0.63
3	113054	绿动转债	10,150,648.80	0.49
4	113641	华友转债	6,715,544.37	0.32
5	113050	南银转债	6,164,632.03	0.30
6	128048	张行转债	5,743,116.44	0.28
7	113049	长汽转债	5,708,122.78	0.27
8	128144	利民转债	5,374,458.85	0.26
9	113656	嘉诚转债	5,247,971.89	0.25
10	110086	精工转债	4,611,847.67	0.22
11	110079	杭银转债	4,558,210.41	0.22
12	113636	甬金转债	4,438,869.73	0.21
13	127024	盈峰转债	4,352,053.85	0.21
14	118013	道通转债	3,815,866.85	0.18
15	127062	垒知转债	3,628,273.97	0.17
16	127049	希望转 2	3,478,545.21	0.17
17	128075	远东转债	2,920,987.50	0.14
18	113623	凤 21 转债	2,852,058.22	0.14
19	127067	恒逸转 2	2,847,783.56	0.14
20	128109	楚江转债	2,406,394.52	0.12
21	110089	兴发转债	2,334,074.52	0.11
22	127061	美锦转债	2,228,727.24	0.11
23	123101	拓斯转债	1,840,131.51	0.09
24	113579	健友转债	1,630,791.90	0.08
25	113530	大丰转债	1,562,469.74	0.07
26	123063	大禹转债	1,244,896.44	0.06
27	123127	耐普转债	1,223,225.21	0.06
28	127055	精装转债	1,178,516.44	0.06
29	128119	龙大转债	1,178,042.47	0.06
30	113640	苏利转债	1,171,278.63	0.06
31	123010	博世转债	1,110,752.05	0.05

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	946,258,216.03
报告期期间基金总申购份额	29,211,198.63
减：报告期期间基金总赎回份额	189,894,210.74
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	785,575,203.92

## § 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,003,200.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,003,200.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.27

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,200.00	1.27%	10,003,200.00	1.27%	自基金合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,003,200.00	1.27%	10,003,200.00	1.27%	-

注：该固有资金为本发起式基金认购期内认购金额。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%的情形，敬请投资者留意。							

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安双利债券型发起式证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安双利债券型发起式证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安双利债券型发起式证券投资基金托管协议》。
- ④基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑤报告期内诺安双利债券型发起式证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

### 10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务热线：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2023 年 04 月 22 日