

诺安双利债券型发起式证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 06 月 30 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 07 月 21 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 07 月 20 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 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 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 | 1,129,909,884.19 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 04 月 01 日-2023 年 06 月 30 日) |
|-----------------|---|
| 1. 本期已实现收益 | -4, 232, 023. 67 |
| 2. 本期利润 | -29, 631, 426. 16 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0. 0278 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2, 971, 233, 228. 80 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2. 630 |

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 | -0.90% | 0.16% | 0.94% | 0.04% | -1.84% | 0.12% |
| 过去六个月 | 0.57% | 0.19% | 1.22% | 0.04% | -0.65% | 0.15% |
| 过去一年 | -1.42% | 0.17% | 1.35% | 0.05% | -2.77% | 0.12% |
| 过去三年 | 18.68% | 0.45% | 2.99% | 0.05% | 15.69% | 0.40% |
| 过去五年 | 58.53% | 0.47% | 7.87% | 0.06% | 50.66% | 0.41% |
| 自基金合同生效起 至今 | 163.00% | 0.48% | 11.80% | 0.08% | 151.20% | 0.40% |

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， |

| | | | | | |
|-----|---------|------------------|---|------|--|
| | | | | | <p>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。</p> |
| 孔宪政 | 本基金基金经理 | 2023 年 02 月 21 日 | - | 11 年 | <p>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，2023 年 6 月起任诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金及诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。</p> |

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场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

报告期内美联储于 5 月加息，幅度为 25bp，6 月暂停加息，目前联邦基金目标利率区间提高至 5%-5.25%，虽点阵图显示年内仍有加息空间，但预计美联储加息周期或接近尾声。期间，受联储加息预期变化影响，10 年美债利率从 3.3% 附近震荡上行，高点接近 3.8% 左右，美债期限利差进一步倒挂，美元指数震荡偏强。

国内经济内生动能趋弱，有效需求不足，固定资产投资、物价水平整体震荡下行，信贷、社融增速处于低位。央行货币政策保持平稳，在 6 月降息 10BP。银行间市场资金面维持宽松，3 个月 SHIBOR 利率震荡下行。债市在经历 1 季度修复行情后，收益率进一步下行，信用利差先下后上，期限利差、等级利差有所走阔。转债市场整体震荡，流动性宽松背景下，转债估值依然处于相对较高水平。

权益方面，上半年的市场很像 2013 年，以 ChatGPT 等人工智能为代表的 TMT 行业风光无限。在一个资金不足的市场中，资金向 TMT 板块的转移难免会影响其他机构重仓的行业。在市场风格上，今年也与过去的常规市场有很大的不同。上半年出现了有业绩的公司常常表现不如没业绩的公司、增速快的公司常常表现不如增速慢的公司、高 ROE 的公司常常表现不如低 ROE 的公司的现象。题材股风光无限，传统的绩优白马股黯然失色。即便如此，我们依然相信巴菲特所说，“价值投资之所以长期有效就是因为它有时会无效”。我们相对看好以医药、食品饮料、新能源为代表的核心资产，也是当前增速与业绩匹配度较高的资产。

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。

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 2.630 元，本报告期内基金份额净值增长率为-0.90%，同期业绩比较基准收益率为 0.94%。

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 | 477,108,615.64 | 13.67 |
| | 其中：股票 | 477,108,615.64 | 13.67 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,990,770,178.15 | 85.72 |
| | 其中：债券 | 2,981,658,072.53 | 85.46 |
| | 资产支持证券 | 9,112,105.62 | 0.26 |
| 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 | 15,815,571.21 | 0.45 |
| 8 | 其他资产 | 5,250,314.80 | 0.15 |
| 9 | 合计 | 3,488,944,679.80 | 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 | 376,875,683.06 | 12.68 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 24,641,197.20 | 0.83 |
| F | 批发和零售业 | 34,731,007.00 | 1.17 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,205,850.00 | 0.24 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,081,512.00 | 0.04 |
| J | 金融业 | 2,055,826.00 | 0.07 |
| K | 房地产业 | 1,602,594.00 | 0.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | 12,732,502.50 | 0.43 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | 16,182,443.88 | 0.54 |
| 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 | 477,108,615.64 | 16.06 |

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 | 962,504 | 46,103,941.60 | 1.55 |
| 2 | 000661 | 长春高新 | 237,000 | 32,303,100.00 | 1.09 |
| 3 | 603392 | 万泰生物 | 475,157 | 31,726,232.89 | 1.07 |
| 4 | 002304 | 洋河股份 | 203,178 | 26,687,430.30 | 0.90 |
| 5 | 300601 | 康泰生物 | 1,013,813 | 25,740,712.07 | 0.87 |
| 6 | 601117 | 中国化学 | 2,975,990 | 24,641,197.20 | 0.83 |
| 7 | 600809 | 山西汾酒 | 119,400 | 22,097,358.00 | 0.74 |
| 8 | 000568 | 泸州老窖 | 86,100 | 18,043,977.00 | 0.61 |
| 9 | 300573 | 兴齐眼药 | 77,418 | 16,551,968.40 | 0.56 |
| 10 | 002422 | 科伦药业 | 506,600 | 15,035,888.00 | 0.51 |

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 | 204,412,871.95 | 6.88 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 711,475,504.50 | 23.95 |
| | 其中：政策性金融债 | 325,914,996.41 | 10.97 |
| 4 | 企业债券 | 204,116,943.57 | 6.87 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,102,920.55 | 0.34 |
| 6 | 中期票据 | 1,581,698,266.51 | 53.23 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 220,939,708.07 | 7.44 |
| 8 | 同业存单 | 48,911,857.38 | 1.65 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,981,658,072.53 | 100.35 |

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 | 230004 | 23 付息国债 04 | 1,500,000 | 154,128,646.41 | 5.19 |
| 2 | 230310 | 23 进出 10 | 1,000,000 | 102,942,054.79 | 3.46 |
| 3 | 230301 | 23 进出 01 | 1,000,000 | 100,951,311.48 | 3.40 |
| 4 | 232380015 | 23 工行二级资本债 01A | 900,000 | 91,899,245.90 | 3.09 |
| 5 | 2128039 | 21 中国银行二级 03 | 600,000 | 62,418,673.97 | 2.10 |

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 | 9,112,105.62 | 0.31 |

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 | 166,435.85 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,959,458.02 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 124,420.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,250,314.80 |

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 | 110089 | 兴发转债 | 14,154,870.14 | 0.48 |
| 2 | 113050 | 南银转债 | 10,588,576.73 | 0.36 |
| 3 | 110079 | 杭银转债 | 10,351,333.97 | 0.35 |
| 4 | 113054 | 绿动转债 | 10,270,224.06 | 0.35 |
| 5 | 127045 | 牧原转债 | 7,085,980.27 | 0.24 |
| 6 | 127062 | 垒知转债 | 7,050,802.19 | 0.24 |
| 7 | 113641 | 华友转债 | 6,395,943.52 | 0.22 |
| 8 | 113044 | 大秦转债 | 5,775,808.22 | 0.19 |
| 9 | 128048 | 张行转债 | 5,720,067.12 | 0.19 |
| 10 | 113049 | 长汽转债 | 5,535,923.29 | 0.19 |
| 11 | 113661 | 福 22 转债 | 5,447,109.45 | 0.18 |
| 12 | 110073 | 国投转债 | 5,408,987.67 | 0.18 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 13 | 128144 | 利民转债 | 5,103,434.34 | 0.17 |
| 14 | 113623 | 凤 21 转债 | 5,091,934.93 | 0.17 |
| 15 | 113656 | 嘉诚转债 | 5,079,776.70 | 0.17 |
| 16 | 113056 | 重银转债 | 5,058,883.56 | 0.17 |
| 17 | 113048 | 晶科转债 | 4,852,049.32 | 0.16 |
| 18 | 127027 | 能化转债 | 4,823,994.19 | 0.16 |
| 19 | 110086 | 精工转债 | 4,557,868.49 | 0.15 |
| 20 | 127024 | 盈峰转债 | 4,265,242.82 | 0.14 |
| 21 | 113636 | 甬金转债 | 4,231,659.59 | 0.14 |
| 22 | 111000 | 起帆转债 | 3,930,832.88 | 0.13 |
| 23 | 118019 | 金盘转债 | 3,831,881.10 | 0.13 |
| 24 | 118013 | 道通转债 | 3,762,461.92 | 0.13 |
| 25 | 118023 | 广大转债 | 3,750,648.49 | 0.13 |
| 26 | 128123 | 国光转债 | 3,542,382.81 | 0.12 |
| 27 | 123063 | 大禹转债 | 3,152,833.45 | 0.11 |
| 28 | 127070 | 大中转债 | 3,146,004.82 | 0.11 |
| 29 | 127061 | 美锦转债 | 2,904,200.07 | 0.10 |
| 30 | 127067 | 恒逸转 2 | 2,663,280.82 | 0.09 |
| 31 | 111004 | 明新转债 | 2,608,627.27 | 0.09 |
| 32 | 127078 | 优彩转债 | 2,366,452.65 | 0.08 |
| 33 | 128109 | 楚江转债 | 2,356,175.34 | 0.08 |
| 34 | 123165 | 回天转债 | 2,272,793.57 | 0.08 |
| 35 | 113640 | 苏利转债 | 2,219,950.69 | 0.07 |
| 36 | 127052 | 西子转债 | 1,989,082.47 | 0.07 |
| 37 | 127020 | 中金转债 | 1,267,250.14 | 0.04 |
| 38 | 113659 | 莱克转债 | 1,178,809.59 | 0.04 |
| 39 | 127055 | 精装转债 | 1,162,513.70 | 0.04 |
| 40 | 128119 | 龙大转债 | 1,140,036.99 | 0.04 |
| 41 | 123101 | 拓斯转债 | 170,595.67 | 0.01 |
| 42 | 113060 | 浙 22 转债 | 55,639.26 | 0.00 |

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 | 785,575,203.92 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 500,506,366.84 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 156,171,686.57 |
| 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 | 1,129,909,884.19 |

§ 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 | 10,003,200.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|-----------------|---------------|----------------|------|
| 1 | 赎回 | 2023年05月 08日 | 10,003,200.00 | -26,548,492.80 | - |
| 合计 | | | 10,003,200.00 | -26,548,492.80 | |

注：根据基金合同、招募说明书等相关法律文件的规定，该笔赎回费用为 0.00 元。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金本报告期末无发起资金持有份额。

§ 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|----|----------------|------------|
|----|----------------|------------|

| 者类别 | 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电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2023 年 07 月 21 日