

诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 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 | 5 |
| 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 | 7 |
| 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 | 7 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 | 基金净值表现 | 8 |
| § 4 | 管理人报告 | 9 |
| 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 | 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 | 13 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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 | 14 |
| § 5 | 托管人报告 | 14 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 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 | 14 |
| § 6 | 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 | 资产负债表 | 14 |
| 6.2 | 利润表 | 16 |
| 6.3 | 净资产变动表 | 17 |
| 6.4 | 报表附注 | 18 |
| § 7 | 投资组合报告 | 34 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况 | 34 |
| 7.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 35 |
| 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 | 35 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动 | 35 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 35 |
| 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 | 35 |
| 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 | 36 |
| 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 | 36 |
| 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 | 36 |
| 7.10 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 36 |
| 7.11 | 投资组合报告附注 | 36 |

| | | |
|------|------------------------------------|----|
| § 8 | 基金份额持有人信息..... | 37 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 37 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 37 |
| 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情况..... | 37 |
| 8.4 | 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 37 |
| § 9 | 开放式基金份额变动..... | 37 |
| § 10 | 重大事件揭示..... | 38 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 38 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变..... | 38 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 38 |
| 10.8 | 其他重大事件..... | 39 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 40 |
| § 12 | 备查文件目录..... | 41 |
| 12.1 | 备查文件目录..... | 41 |
| 12.2 | 存放地点..... | 41 |
| 12.3 | 查阅方式..... | 41 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------------|
| 基金名称 | 诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 诺安浙享定开发起式债券 |
| 基金主代码 | 005655 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 09 月 27 日 |
| 基金管理人 | 诺安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 浙商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 733,419,507.33 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 在谨慎投资的前提下,本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | <p>1、封闭期投资策略</p> <p>在封闭期内,为合理控制本基金开放期的流动性风险,并满足每次开放期的流动性需求,原则上本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。同时,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。</p> <p>(1) 固定收益资产配置策略</p> <p>1) 组合久期配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济形势、财政及货币政策、利率环境、债券市场资金供求等因素的分析,主动判断利率和收益率曲线可能移动的方向和方式,并据此确定收益资产组合的平均久期。原则上,利率处于上行通道时,缩短目标久期;利率处于下降通道时,则延长目标久期。</p> <p>2) 期限结构配置策略</p> <p>本基金在确定固定收益组合平均久期的基础上,将对债券市场收益率期限结构进行分析,预测收益率期限结构的变化方式,根据收益率曲线形态变化确定合理的组合期限结构,包括采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,以从收益率曲线的形变和不同期限债券价格的相对变化中获利。</p> <p>3) 类属资产配置策略</p> <p>受信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等不同因素的影响,国债、央票、金融债、企业债、公司债、短期融资券等不同类属的券种收益率变化特征存在明显的差异,并表现出不同的利差变化趋势。基金管理人将分析各类属券种的利差变化趋势,合理配置并灵活调整不同类属券种在组合中的构成比例,通过对类属的合理配置力争获取超越基准的收益率水平。</p> |

| | |
|---------------|--|
| | <p>(2) 固定收益类个券投资策略</p> <p>1) 利率品种投资策略</p> <p>利率品种的主要影响因素为基准利率。本基金对国债、央行票据等利率品种的投资,首先根据对宏观经济变量、宏观经济政策、利率环境、债券市场资金供求状况的分析,预测收益率曲线变化的两个方面:变化方向及变化形态,从而确定利率品种组合的久期和期限配置结构。其次根据不同利率品种的收益风险特征、流动性因素等,决定投资品种及相应的权重,在控制风险并保证流动性的前提下获得最大的收益。</p> <p>2) 信用品种投资策略</p> <p>信用品种收益率的主要影响因素为利率品种基准收益与信用利差。信用利差是信用产品相对国债、央行票据等利率产品获取较高收益的来源。信用利差主要受两方面的影响,一方面为债券所对应信用等级的市场平均信用利差水平,另一方面为发行人本身的信用状况。</p> <p>(3) 杠杆投资策略</p> <p>本基金通过正回购,融资买入债券,通过杠杆作用,力争为投资者实现更高的投资收益和现金流收入。本基金将在谨慎投资的前提下运用融资杠杆,严格控制融资杠杆的风险。</p> <p>(4) 资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。</p> <p>(5) 中小企业私募债投资策略</p> <p>与传统的信用债相比,中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易,整体流动性相对较差,而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响,整体的信用风险相对较高。本基金对中小企业私募债的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面,基金管理人将根据宏观经济运行状况的分析和预判,灵活调整组合的久期。流动性控制方面,基金管理人将密切跟踪个券的流动性状况,并据此控制个券的仓位。在信用风险控制方面,基金管理人将综合考虑发行人的所处行业、企业性质、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等因素。</p> <p>2、开放期投资安排</p> <p>在开放期,基金管理人将采取各种有效管理措施,保障基金运作安排,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。在开放期前根据市场情况,进行相应压力测试,制定开放期操作规范流程和应急预案,做好应付极端情况下巨额赎回的准备。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>中债综合财富(总值)指数收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%</p> |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金为债券型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金,属于较低预期收益和预期风险</p> |

| | |
|--|----------|
| | 水平的投资品种。 |
|--|----------|

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 | | 诺安基金管理有限公司 | 浙商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李学君 | 朱巍 |
| | 联系电话 | 0755-83026688 | 0571-87659806 |
| | 电子邮箱 | info@lionfund.com.cn | zsyhzctgb@czbank.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-8998 | 95527 |
| 传真 | | 0755-83026677 | 0571-88268688 |
| 注册地址 | | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层 | 杭州市萧山区鸿宁路 1788 号 |
| 办公地址 | | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层 | 杭州市拱墅区环城西路 76 号 |
| 邮政编码 | | 518048 | 310006 |
| 法定代表人 | | 李强 | 陆建强 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.lionfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 诺安基金管理有限公司 | 深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日） |
|---------------|---|
| 本期已实现收益 | 14,476,089.94 |
| 本期利润 | 18,060,757.97 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0246 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.27% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.30% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2024 年 06 月 30 日） |
| 期末可供分配利润 | 61,787,864.83 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0842 |
| 期末基金资产净值 | 804,119,611.54 |

| | |
|--------------|------------------------|
| 期末基金份额净值 | 1.0964 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2024 年 06 月 30 日） |
| 基金份额累计净值增长率 | 24.27% |

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、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。

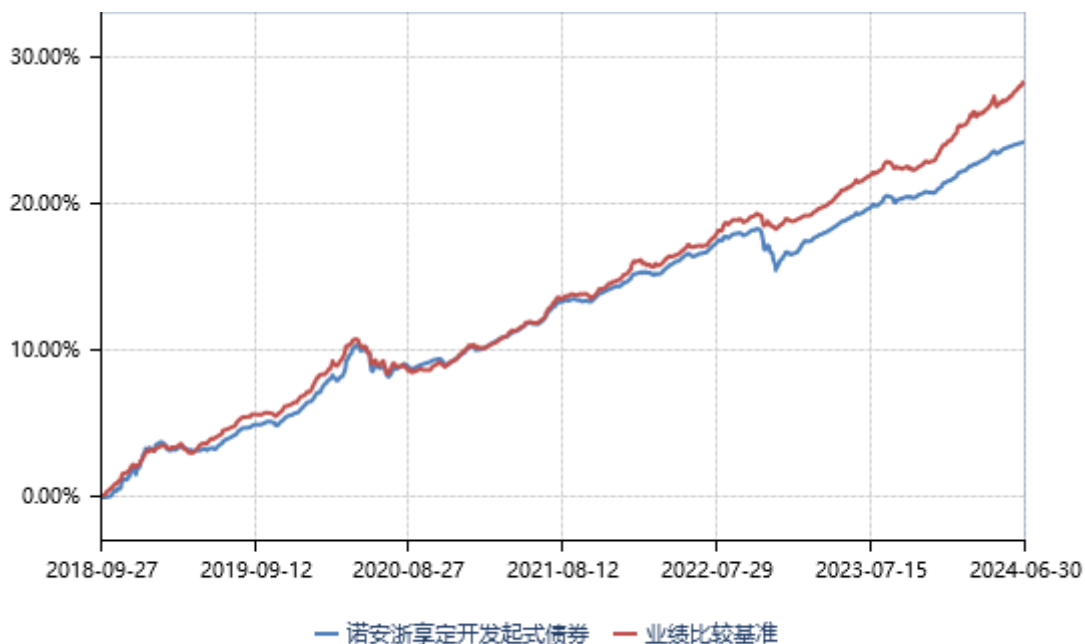
3.2 基金净值表现

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 | 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 | 0.23% | 0.01% | 0.79% | 0.03% | -0.56% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.99% | 0.02% | 1.60% | 0.06% | -0.61% | -0.04% |
| 过去六个月 | 2.30% | 0.02% | 3.46% | 0.06% | -1.16% | -0.04% |
| 过去一年 | 3.98% | 0.03% | 5.48% | 0.05% | -1.50% | -0.02% |
| 过去三年 | 10.88% | 0.04% | 14.43% | 0.05% | -3.55% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.27% | 0.05% | 28.37% | 0.05% | -4.10% | 0.00% |

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%。

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



§ 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

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增

强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金等。

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 | | |
| 岳帅 | 本基金基金经理 | 2018年09月27日 | - | 14年 | 硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于红塔证券股份有限公司，任分析师助理；银河期货有限公司，任客户经理；平安利顺货币经纪有限公司，任债券交易员。2013年4月加入诺安基金管理有限公司，历任债券交易员。2017年8月至2018年8月任诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年9月起任诺安货币市场基金基金经理，2017年8月起任诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2018年9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，2019年10月起任诺安天天宝货币市场基金基金经理。 |
| 潘飞 | 本基金基金经理 | 2022年04月01日 | - | 14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，历任基金经理助理、固定收益事业部总经理助理，现任固定收益事业部副总经理。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。 |

注：①此处岳帅先生的任职日期为基金合同生效之日，潘飞先生的任职日期为根据公司决定确定的聘任日期；

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 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

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 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

报告期内，经济动能边际放缓，终端需求不足，地产投资增速偏弱，物价水平处于低位。央行货币政策稳健，降准 50BP，在月末、季末等关键时点，加大公开市场投放，以平滑资金面波动。银行间市场资金利率中枢平稳，非银机构资金状况明显改善。债市收益率下行，信用利差、期限利差、等级利差整体有所压缩。

报告期内组合根据市场情况，灵活调整组合杠杆、久期与品种结构，部分仓位积极参与利率债交易性机会，以增厚组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.0964 元，本报告期内基金份额净值增长率为 2.30%，同期业绩比较基准收益率为 3.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计随着宏观政策累积效应的逐步显现，经济内生动能或有望边际改善，物价水平总体温和不，央行货币政策保持平稳，银行间市场资金面大概率维持宽松态势。

管理人将密切关注经济金融形势以及市场的变化，灵活调整组合的杠杆、久期，切实防范信用风险，重点配置中高等级信用品种。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值政策和程序。估值委员会由督察长、投资、研究、风险管理、法律合规和基金运营等部门负责人及指定人员组成，估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

开放期内，本基金不进行收益分配。封闭期内，本基金默认的收益分配方式为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金。

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

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

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 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，本基金的管理人——诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------------------|------------------|
| | | 2024 年 06 月 30 日 | 2023 年 12 月 31 日 |
| | | | |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 5,070,034.78 | 2,477,057.90 |
| 结算备付金 | | - | 918,682.19 |
| 存出保证金 | | - | 23,341.44 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 849,418,076.75 | 898,186,784.66 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 849,418,076.75 | 898,186,784.66 |
| 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 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 854,488,111.53 | 901,605,866.19 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年06月30日 | 上年度末 2023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 | | 49,927,044.57 | 115,022,895.59 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 197,512.28 | 199,521.03 |
| 应付托管费 | | 65,837.42 | 66,507.00 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 65,782.06 | 62,976.61 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 112,323.66 | 195,162.34 |
| 负债合计 | | 50,368,499.99 | 115,547,062.57 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 733,419,507.33 | 733,419,460.83 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 70,700,104.21 | 52,639,342.79 |
| 净资产合计 | | 804,119,611.54 | 786,058,803.62 |
| 负债和净资产总计 | | 854,488,111.53 | 901,605,866.19 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0964 元，基金份额总额 733,419,507.33 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日 |
|----------------------------|------------|--|--|
| 一、营业总收入 | | 21,390,328.04 | 28,405,641.28 |
| 1. 利息收入 | | 107,463.05 | 196,283.53 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 13,048.28 | 28,763.41 |
| 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 | | 94,414.77 | 167,520.12 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 17,698,196.96 | 15,454,798.54 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 17,698,196.96 | 15,454,798.54 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.14 | 3,584,668.03 | 12,754,559.21 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 3,329,570.07 | 4,122,611.02 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,187,512.20 | 1,411,667.13 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 395,837.44 | 470,555.69 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 1,599,937.72 | 2,081,622.31 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,599,937.72 | 2,081,622.31 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.16 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 48,119.59 | 55,863.33 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.17 | 98,163.12 | 102,902.56 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 18,060,757.97 | 24,283,030.26 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 18,060,757.97 | 24,283,030.26 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 18,060,757.97 | 24,283,030.26 |

6.3 净资产变动表

会计主体：诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | | |
|--|---|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配 利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 733,419,460.83 | 52,639,342.79 | 786,058,803.62 |
| 二、本期期初净资产 | 733,419,460.83 | 52,639,342.79 | 786,058,803.62 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 46.50 | 18,060,761.42 | 18,060,807.92 |
| （一）、综合收益总额 | - | 18,060,757.97 | 18,060,757.97 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | 46.50 | 3.45 | 49.95 |
| 其中：1. 基金申购款 | 46.50 | 3.45 | 49.95 |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 733,419,507.33 | 70,700,104.21 | 804,119,611.54 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配 利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 1,443,419,312.98 | 106,667,071.11 | 1,550,086,384.09 |
| 二、本期期初净资产 | 1,443,419,312.98 | 106,667,071.11 | 1,550,086,384.09 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -699,999,952.15 | -66,204,649.51 | -766,204,601.66 |
| （一）、综合收益总额 | - | 24,283,030.26 | 24,283,030.26 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -699,999,952.15 | -46,429,997.90 | -746,429,950.05 |
| 其中：1. 基金申购款 | 47.85 | 2.10 | 49.95 |
| 2. 基金赎回款 | -700,000,000.00 | -46,430,000.00 | -746,430,000.00 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | -44,057,681.87 | -44,057,681.87 |
| 四、本期期末净资产 | 743,419,360.83 | 40,462,421.60 | 783,881,782.43 |

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：

齐斌

田冲

何柳姿

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

诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》证监许可(2018)190号)及《关于诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金延期募集备案的回函》(机构部函(2018)2011号)批准,由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2018年9月27日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为209,999,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和《诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、同业存单、中小企业私募债、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)、可分离交易可转债的纯债部分、货币市场工具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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金不投资于股票、权证,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产净值80%,在开放期内,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。应开放期流动性需要,为保护持有人利益,本基金在开放期前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日内,本基金的债券资产比例可不受上述限制。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(以下合称“企

业会计准则”)编制。同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会制定的《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内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会和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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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相一致。

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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

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〔2008〕132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、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《中华人

民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定等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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、质押式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以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，包括买卖债券的差价收入，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。自 2008 年 10 月 9 日起，暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(4) 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 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款 | 5,070,034.78 |
| 等于：本金 | 5,069,824.84 |
| 加：应计利息 | 209.94 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 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 | - |

| | |
|----|--------------|
| 合计 | 5,070,034.78 |
|----|--------------|

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年06月30日 | | | | |
|---------------|--------------------|----------------|----------------|----------------|--------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | - | - | - | - | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 50,499,569.32 | 1,151,960.55 | 51,221,960.55 | -429,569.32 |
| | 银行间市场 | 780,632,206.76 | 10,107,116.20 | 798,196,116.20 | 7,456,793.24 |
| | 合计 | 831,131,776.08 | 11,259,076.75 | 849,418,076.75 | 7,027,223.92 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 831,131,776.08 | 11,259,076.75 | 849,418,076.75 | 7,027,223.92 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年06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 | 23,460.54 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 23,460.54 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 88,863.12 |
| 合计 | 112,323.66 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年01月01日至2024年06月30日 | |
|---------------|-------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 733,419,460.83 | 733,419,460.83 |
| 本期申购 | 46.50 | 46.50 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 733,419,507.33 | 733,419,507.33 |

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末 | 47,311,771.84 | 5,327,570.95 | 52,639,342.79 |
| 本期期初 | 47,311,771.84 | 5,327,570.95 | 52,639,342.79 |
| 本期利润 | 14,476,089.94 | 3,584,668.03 | 18,060,757.97 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3.05 | 0.40 | 3.45 |
| 其中：基金申购款 | 3.05 | 0.40 | 3.45 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 61,787,864.83 | 8,912,239.38 | 70,700,104.21 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年01月01日至2024年06月30日 | |
|-----------|-------------------------------|----------|
| | 活期存款利息收入 | 3,584.57 |
| 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 | 9,443.71 | - |
| 其他 | 20.00 | - |
| 合计 | 13,048.28 | - |

注：此处“其他”列示的是存出保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益--买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------------------------|-------------------------|
| | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 债券投资收益--利息收入 | 14,094,518.47 |
| 债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入 | 3,603,678.49 |
| 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 | 17,698,196.96 |

6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|-------------------------|
| | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,968,369,989.28 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,943,265,854.02 |
| 减：应计利息总额 | 21,477,701.77 |
| 减：交易费用 | 22,755.00 |
| 买卖债券差价收入 | 3,603,678.49 |

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|-------------------------|
| | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 3,584,668.03 |
| --股票投资 | - |

| | |
|------------------------|--------------|
| —债券投资 | 3,584,668.03 |
| —资产支持证券投资 | — |
| —基金投资 | — |
| —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 | 3,584,668.03 |

6.4.7.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 审计费用 | 19,890.78 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | — |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 合计 | 98,163.12 |

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的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

本基金本报告期不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。

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 |
|------------|-------------------|
| 诺安基金管理有限公司 | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 浙商银行股份有限公司 | 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2024年01月01日至2024 年06月30日 | 上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,187,512.20 | 1,411,667.13 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | - | - |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,187,512.20 | 1,411,667.13 |

注：本基金的管理费率为年费率 0.30%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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 2024年01月01日至2024年06 月30日 | 上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日 |
|----|-----------------------------------|--|
|----|-----------------------------------|--|

| | | |
|----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 395,837.44 | 470,555.69 |
|----------------|------------|------------|

注：本基金的托管费率为年费率 0.10%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

| 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | | | | | | |
|---|----------|----------|----------|----------|----------------|-----------|
| 银行间市场交易的各关联方 名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买 入 | 基金卖 出 | 交易金 额 | 利息收 入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 浙商银行股份有限公司 | - | - | - | - | 178,600,000.00 | 23,487.12 |
| 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方 名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买 入 | 基金卖 出 | 交易金 额 | 利息收 入 | 交易金额 | 利息支出 |
| - | - | - | - | - | - | - |

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| | 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
| 基金合同生效日(2018 年 09 月 27 日)持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 100.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期内申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 100.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | 1.35% |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照本基金合同及招募说明书的规定执行。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 | | 上年度可比期间 | |
|-----------------|------------------------------------|----------|------------------------------------|-----------|
| | 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | | 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 浙商银行股份有限公司-活期存款 | 5,070,034.78 | 3,584.57 | 2,495,944.90 | 20,996.58 |

注：本基金的上述银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

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 2024 年 06 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,927,044.57 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|----------------|------------------|--------|---------|---------------|
| 102281390 | 22 山东港口 MTN001 | 2024 年 07 月 04 日 | 100.63 | 531,000 | 53,435,449.43 |
| 合计 | | | | 531,000 | 53,435,449.43 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关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。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行浙商银行股份有限公司，因而与该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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券市值的 10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 110,994,936.09 | 20,082,544.26 |
| 合计 | 110,994,936.09 | 20,082,544.26 |

注：未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
|--------|-------------------------|--------------------------|

| | | |
|--------|----------------|----------------|
| AAA | 297,849,884.33 | 440,424,082.48 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 440,573,256.33 | 437,680,157.92 |
| 合计 | 738,423,140.66 | 878,104,240.40 |

注：未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2024 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款将在一年以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超

过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例低于 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| | | | | | | |
|-----|--------|----------|-------|-------|-----|----|
| 本期末 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|--------|----------|-------|-------|-----|----|

| | | | | | | |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|------|-------------|----------------|
| 2024年06月30日 | | | | | | |
| 资产 | | | | | | |
| 货币资金 | 5,070,034.78 | - | - | - | - | 5,070,034.78 |
| 交易性金融资产 | 193,029,808.12 | 294,388,292.13 | 361,999,976.50 | - | - | 849,418,076.75 |
| 资产总计 | 198,099,842.90 | 294,388,292.13 | 361,999,976.50 | - | - | 854,488,111.53 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 49,927,044.57 | - | - | - | - | 49,927,044.57 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 197,512.28 | 197,512.28 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 65,837.42 | 65,837.42 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 65,782.06 | 65,782.06 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 112,323.66 | 112,323.66 |
| 负债总计 | 49,927,044.57 | - | - | - | 441,455.42 | 50,368,499.99 |
| 利率敏感度缺口 | 148,172,798.33 | 294,388,292.13 | 361,999,976.50 | - | -441,455.42 | 804,119,611.54 |
| 上年度末 2023年12月31日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | |
| 货币资金 | 2,477,057.90 | - | - | - | - | 2,477,057.90 |
| 结算备付金 | 918,682.19 | - | - | - | - | 918,682.19 |
| 存出保证金 | 23,341.44 | - | - | - | - | 23,341.44 |
| 交易性金融资产 | 175,362,203.44 | 101,101,040.79 | 621,723,540.43 | - | - | 898,186,784.66 |
| 资产总计 | 178,781,284.97 | 101,101,040.79 | 621,723,540.43 | - | - | 901,605,866.19 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 115,022,895.59 | - | - | - | - | 115,022,895.59 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 199,521.03 | 199,521.03 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 66,507.00 | 66,507.00 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 62,976.61 | 62,976.61 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 195,162.34 | 195,162.34 |
| 负债总计 | 115,022,895.59 | - | - | - | 524,166.98 | 115,547,062.57 |
| 利率敏感度缺口 | 63,758,389.38 | 101,101,040.79 | 621,723,540.43 | - | -524,166.98 | 786,058,803.62 |

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率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(2024年06月30日) | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 市场利率下降 27 个基点 | 1,840,796.08 | 2,630,849.07 |
| 市场利率上升 27 个基点 | -1,840,796.08 | -2,630,849.07 | |

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，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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债券，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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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 2024年06月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 849,418,076.75 | 898,186,784.66 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 849,418,076.75 | 898,186,784.66 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券，若出现重大事项、新发未上市等原因导致不存在活跃市场未经调整的报价，本基金不会于此期间将相关证券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，其剩余期限较短，账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需说明的其他重要事项。

§ 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 849,418,076.75 | 99.41 |
| | 其中：债券 | 849,418,076.75 | 99.41 |
| | 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 | 5,070,034.78 | 0.59 |
| 8 | 其他各项资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 854,488,111.53 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未进行股票买入交易。

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

本基金本报告期末未进行股票卖出交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票买卖交易。

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 | 51,221,960.55 | 6.37 |
| 5 | 企业短期融资券 | 110,994,936.09 | 13.80 |
| 6 | 中期票据 | 687,201,180.11 | 85.46 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 849,418,076.75 | 105.63 |

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 | 102281390 | 22 山东港口 MTN001 | 700,000 | 70,442,212.05 | 8.76 |
| 2 | 102281863 | 22 中兵投资 MTN001 | 500,000 | 51,701,628.42 | 6.43 |
| 3 | 102281849 | 22 河南发电 MTN001(可持续挂钩) | 500,000 | 51,691,628.42 | 6.43 |

| | | | | | |
|---|-----------|----------------|---------|---------------|------|
| 4 | 102281630 | 22 安徽港航 MTN002 | 500,000 | 51,688,983.61 | 6.43 |
| 5 | 102281862 | 22 中盐 MTN002 | 500,000 | 51,585,448.09 | 6.42 |

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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，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。

7.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 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。

§ 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

| 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 |
| 211 | 3,475,921.84 | 733,419,507.33 | 100.00% | - | - |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本基金。

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情况

| 项目 | 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基 金 | 0 |

8.4 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 | 100.00 | 0.00% | 100.00 | 0.00% | 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 | 100.00 | 0.00% | 100.00 | 0.00% | - |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018 年 09 月 27 日）基金份额总 额 | 209,999,000.00 |
|-------------------------------------|----------------|

| | |
|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 733,419,460.83 |
| 本报告期基金总申购份额 | 46.50 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 733,419,507.33 |

§ 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，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

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，本基金管理人、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管理业务、本基金基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 | |
| | | | | | | |

| | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|
| 中金财富 | 2 | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 信誉良好，财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，能为本基金提供全面的信息服务；
- (3) 研究实力较强，有足够数量的专职的高素质研究人员，能为公司提供全面的研究支持和信息服务；
- (4) 能根据基金投资的特定要求，提供个性化的研究服务；
- (5) 公司要求的其他条件。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

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 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 中金财富 | - | - | 549,000,000.00 | 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 | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告 | 《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》 | 2024年01月22日 |
| 2 | 诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告 | 基金管理人网站 | 2024年01月22日 |
| 3 | 诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金第十九个开放期开放申购、赎回业务的公告 | 《中国证券报》 | 2024年01月23日 |
| 4 | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告 | 《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》 | 2024年03月29日 |

| | | | |
|----|---|-------------------------------|-------------|
| | | 报》、《证券日报》 | |
| 5 | 诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年年度报告 | 基金管理人网站 | 2024年03月29日 |
| 6 | 诺安基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告 | 《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》 | 2024年04月22日 |
| 7 | 诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 基金管理人网站 | 2024年04月22日 |
| 8 | 诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金第二十个开放期开放申购、赎回业务的公告 | 《中国证券报》 | 2024年04月23日 |
| 9 | 诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金基金产品资料概要（更新）的提示性公告 | 《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》 | 2024年06月26日 |
| 10 | 诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站 | 2024年06月26日 |

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站进行披露。

§ 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 | 20240101-20240630 | 733,416,474.43 | - | - | 733,416,474.43 | 100.00% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本报告期内，本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形，敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。 | | | | | | | |

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安浙享定期开放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报告期内诺安浙享定期开放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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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

2024 年 08 月 30 日