

诺安双利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：招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。

基金托管人招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	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	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	15
6.3	净资产变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	36
7.1	期末基金资产组合情况	36
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	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	42
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	42
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	42
7.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.11	投资组合报告附注	42

§ 8	基金份额持有人信息	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	44
§ 9	开放式基金份额变动	44
§ 10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	46
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12	备查文件目录	48
12.1	备查文件目录	48
12.2	存放地点	48
12.3	查阅方式	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安双利债券型发起式证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	472,733,097.17 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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金保值、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</p>

	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。 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。
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。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	张姗
	联系电话	0755-83026688	400-61-95555
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-8998	400-61-95555
传真		0755-83026677	0755-83195201
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		李强	缪建民

### 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.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	-99,308,382.80
本期利润	-58,142,136.03

加权平均基金份额本期利润	-0.0934
本期加权平均净值利润率	-3.60%
本期基金份额净值增长率	-1.82%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末（2024年06月30日）</b>
期末可供分配利润	466,442,916.55
期末可供分配基金份额利润	0.9867
期末基金资产净值	1,222,203,906.73
期末基金份额净值	2.585
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末（2024年06月30日）</b>
基金份额累计净值增长率	158.50%

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	-1.11%	0.17%	0.65%	0.03%	-1.76%	0.14%
过去三个月	-0.12%	0.18%	1.06%	0.07%	-1.18%	0.11%
过去六个月	-1.82%	0.26%	2.42%	0.07%	-4.24%	0.19%
过去一年	-1.71%	0.23%	3.27%	0.06%	-4.98%	0.17%
过去三年	1.81%	0.22%	6.58%	0.05%	-4.77%	0.17%
自基金合同生效起至今	158.50%	0.47%	15.46%	0.08%	143.04%	0.39%

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		
潘飞	本基金基金经理	2022年06月17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。
王海畅	本基金基金经理	2022 年 11 月 17 日	-	7 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 11 月至 2024 年 1 月任诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理。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，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	-	12 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，现任多资产投资部总经理。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。
--	--	--	--	--	---

注：①此处基金经理的任职日期指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；

③自 2024 年 8 月 26 日起，增聘吕磊先生担任本基金基金经理，孔宪政先生、王海畅先生不再担任本基金基金经理。

## 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

报告期内美国通胀走势有所回落，失业率小幅回升，美联储按兵不动，维持联邦基金目标利率区间 5.25%-5.5%，市场预期年内美联储开启降息操作。期间，10 年美债利率在 3.8%-4.7% 区间震荡，美元指数在 101-107 区间震荡，中枢小幅提升。

国内经济内生动能略趋弱，终端有效需求仍显不足。央行货币政策保持平稳，降准 50BP，并在月末、季末等时点，加大公开市场投放，以平稳资金面波动。银行间市场资金面整体宽松。债市收益率整体震荡下行，信用债表现好于利率债，信用利差、期限利差、等级利差整体有所压缩。转债市场小幅下跌，估值压缩，结构分化。权益方面，沪深 300 上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%，风格上大盘价值优势明显，资源类、国企类、公用事业类等稳健行业会受到投资者青睐。

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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 2.585 元，本报告期内基金份额净值增长率为 -1.82%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。

#### 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，物价水平总温和，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。债市整体收益率处于相对低位，需关注波动风险。转债品种经过前期估值调整后性价比。权益方面，当前市场的整体估值处于历史中具有吸引力的位置。同时，随着成长股估值压缩，部分成长股已具有价值股和高股息属性。因此在传统价值和成长价值中均具有较多投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责

中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# § 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：诺安双利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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	12,774,676.12	14,636,767.36
结算备付金		1,678,940.56	1,373,565.69
存出保证金		165,543.68	170,901.85
交易性金融资产	6.4.7.2	1,481,427,177.43	3,200,955,915.95
其中：股票投资		194,654,195.10	396,378,601.33
基金投资		-	-
债券投资		1,286,772,982.33	2,804,577,314.62
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	50,012,328.77	-
应收清算款		262,643.26	-
应收股利		-	-
应收申购款		98,142.58	161,235.94
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,546,419,452.40	3,217,298,386.79
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年06月30日</b>	<b>2023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		315,517,085.29	670,867,889.13
应付清算款		2,508,718.85	7,601,810.18
应付赎回款		4,089,301.98	1,989,209.06
应付管理人报酬		712,678.91	1,583,454.01
应付托管费		203,622.55	452,415.42
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		173,861.59	245,865.37
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,010,276.50	824,513.75
负债合计		324,215,545.67	683,565,156.92
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	472,733,097.17	962,451,178.50
未分配利润	6.4.7.8	749,470,809.56	1,571,282,051.37
净资产合计		1,222,203,906.73	2,533,733,229.87
负债和净资产总计		1,546,419,452.40	3,217,298,386.79

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.585 元，基金份额总额 472,733,097.17 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安双利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
<b>一、营业总收入</b>		-46,511,561.23	25,483,867.80
1. 利息收入		97,705.54	111,589.08
其中：存款利息收入	6.4.7.9	48,944.76	85,681.44
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		48,760.78	25,907.64
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-88,653,020.98	37,524,766.75

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-103,224,501.96	-16,716,232.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	11,130,012.51	49,287,477.30
资产支持证券投资收益		-	153,256.23
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	3,441,468.47	4,800,266.04
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	41,166,246.77	-12,581,845.32
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	877,507.44	429,357.29
<b>减：二、营业总支出</b>		11,630,574.80	16,790,583.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,584,140.38	8,809,175.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,595,468.66	2,516,907.32
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,221,636.06	5,194,919.53
其中：卖出回购金融资产支出		4,221,636.06	5,194,919.53
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		80,916.96	114,316.69
8. 其他费用	6.4.7.17	148,412.74	155,264.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-58,142,136.03	8,693,283.92
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-58,142,136.03	8,693,283.92
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-58,142,136.03	8,693,283.92

### 6.3 净资产变动表

会计主体：诺安双利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	962,451,178.50	1,571,282,051.37	2,533,733,229.87
二、本期期初净资产	962,451,178.50	1,571,282,051.37	2,533,733,229.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-489,718,081.33	-821,811,241.81	-1,311,529,323.14
（一）、综合收益总额	-	-58,142,136.03	-58,142,136.03
（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）	-489,718,081.33	-763,669,105.78	-1,253,387,187.11

其中：1. 基金申购款	76,684,378.89	124,150,322.74	200,834,701.63
2. 基金赎回款	-566,402,460.22	-887,819,428.52	-1,454,221,888.74
(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	472,733,097.17	749,470,809.56	1,222,203,906.73
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	946,258,216.03	1,528,361,919.42	2,474,620,135.45
二、本期期初净资产	946,258,216.03	1,528,361,919.42	2,474,620,135.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	183,651,668.16	312,961,425.19	496,613,093.35
(一)、综合收益总额	-	8,693,283.92	8,693,283.92
(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）	183,651,668.16	304,268,141.27	487,919,809.43
其中：1. 基金申购款	529,717,565.47	877,099,357.53	1,406,816,923.00
2. 基金赎回款	-346,065,897.31	-572,831,216.26	-918,897,113.57
(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	1,129,909,884.19	1,841,323,344.61	2,971,233,228.80

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

诺安双利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”)证监许可(2012)1346号《关于核准诺安双利债券型发起式证券投资基金募集的批复》核准,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》和《诺安双利债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,395,253,241.91元。经向中国证监会备案,《诺安双利债券型发起式证券投资基金基金合同》于2012年11月29日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为1,395,901,371.31份基金份额,其中认购资金利息折合648,129.40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,基金托管人为招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》和《诺安双利债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是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上市的股票)、存托凭证、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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)。基金的投资组合比例为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或者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。本基金的业绩比较基准为中债综合指数(全价)。

#### 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺安双利债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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〔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。

(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。根据

财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 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	12,774,676.12
等于：本金	12,773,974.47
加：应计利息	701.65
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	12,774,676.12

##### 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	201,167,239.86	-	194,654,195.10	-6,513,044.76	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	96,659,882.91	1,076,195.04	94,747,949.82	-2,988,128.13
	银行间市场	1,159,747,013.53	16,522,132.51	1,192,025,032.51	15,755,886.47
	合计	1,256,406,896.44	17,598,327.55	1,286,772,982.33	12,767,758.34
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	1,457,574,136.30	17,598,327.55	1,481,427,177.43	6,254,713.58
----	------------------	---------------	------------------	--------------

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	50,012,328.77	-
合计	50,012,328.77	-

#### 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	20.67
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	896,529.69
其中：交易所市场	867,066.95
银行间市场	29,462.74
应付利息	-
预提费用	113,726.14
合计	1,010,276.50

### 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	962,451,178.50	962,451,178.50
本期申购	76,684,378.89	76,684,378.89
本期赎回（以“-”号填列）	-566,402,460.22	-566,402,460.22
本期末	472,733,097.17	472,733,097.17

## 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	1,058,315,473.95	512,966,577.42	1,571,282,051.37
本期期初	1,058,315,473.95	512,966,577.42	1,571,282,051.37
本期利润	-99,308,382.80	41,166,246.77	-58,142,136.03
本期基金份额交易产生的变动数	-492,564,174.60	-271,104,931.18	-763,669,105.78
其中：基金申购款	83,203,538.22	40,946,784.52	124,150,322.74
基金赎回款	-575,767,712.82	-312,051,715.70	-887,819,428.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	466,442,916.55	283,027,893.01	749,470,809.56

## 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	31,763.47
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	15,834.87	
其他	1,346.42	
合计	48,944.76	

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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	卖出股票成交总额	1,733,736,034.69
减：卖出股票成本总额	1,833,419,438.21	
减：交易费用	3,541,098.44	

买卖股票差价收入	-103,224,501.96
----------	-----------------

#### 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	26,618,462.03
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-15,488,449.52
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	11,130,012.51

##### 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	3,334,119,536.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,312,697,661.10
减：应计利息总额	36,870,069.52
减：交易费用	40,254.90
买卖债券差价收入	-15,488,449.52

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,441,468.47
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	3,441,468.47

#### 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	41,166,246.77
-- 股票投资	22,790,403.58
-- 债券投资	18,375,843.19
-- 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	41,166,246.77

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	800,346.97
其他	77,160.47
合计	877,507.44

注：此处“其他”列示的是基金转换费收入等。

#### 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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	25,386.60
账户维护费	18,600.00
合计	148,412.74

### 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
招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	5,584,140.38	8,809,175.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,172,309.85	1,882,405.73
应支付基金管理人的净管理费	4,411,830.53	6,926,769.74

注：本基金的管理费率为年费率 0.70%。

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：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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	1,595,468.66	2,516,907.32

注：本基金的托管费率为年费率 0.20%。

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：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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

基金合同生效日(2012年11月29日)持有的基金份额	10,003,200.00	10,003,200.00
报告期初持有的基金份额	-	10,003,200.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	10,003,200.00
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司-活期存款	12,774,676.12	31,763.47	15,011,674.73	38,596.83

注: 本基金的上述银行存款由基金托管人招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 315,517,085.29 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
102280294	22 中粮 MTN002	2024 年 07 月 01 日	101.52	50,000	5,076,087.43
102281280	22 新建元 MTN001	2024 年 07 月 01 日	101.16	64,000	6,474,038.36
102281520	22 电建地产 MTN002	2024 年 07 月 01 日	104.60	500,000	52,300,163.93
102281594	22 浙国贸 MTN003	2024 年 07 月 01 日	103.79	500,000	51,893,333.33
102281630	22 安徽港航 MTN002	2024 年 07 月 04 日	103.38	300,000	31,013,390.16
102281939	22 广州工投 MTN002	2024 年 07 月 03 日	103.12	73,000	7,527,560.55
102281939	22 广州工投 MTN002	2024 年 07 月 04 日	103.12	227,000	23,407,619.78
102282527	22 蜀道投资 MTN013	2024 年 07 月 03 日	103.95	210,000	21,830,395.08
102381081	23 越秀租赁 MTN002	2024 年 07 月 03 日	101.46	300,000	30,438,041.10
102381130	23 天马电子 MTN003	2024 年 07 月 01 日	102.48	85,000	8,710,541.97
102381130	23 天马电子 MTN003	2024 年 07 月 03 日	102.48	215,000	22,032,547.35
102381145	23 九龙江 MTN002	2024 年 07 月 01 日	102.33	100,000	10,232,820.82
102381145	23 九龙江 MTN002	2024 年 07 月 04 日	102.33	45,000	4,604,769.37
220403	22 农发 03	2024 年 07 月 03 日	101.45	500,000	50,722,589.04
240401	24 农发 01	2024 年 07 月 03 日	100.68	200,000	20,135,180.33
252480007	24 东方债 01BC	2024 年 07 月 01 日	100.84	28,000	2,823,549.76

合计				3,397,000	349,222,628.36
----	--	--	--	-----------	----------------

#### 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。本基金在日常投资管理中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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以合规审查与风险控制委员会、督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部、风险控制部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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本基金的托管人招商银行股份有限公司，因而与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。

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	20,135,180.33	202,975,233.23
合计	20,135,180.33	202,975,233.23

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

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	19,806,168.31	-
合计	19,806,168.31	-

#### 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	254,686,308.11	888,936,879.71
AAA 以下	418,310,240.74	846,717,237.41

未评级	573,835,084.84	865,947,964.27
合计	1,246,831,633.69	2,601,602,081.39

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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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个月以内到期且计息（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》及《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、流通受限制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%。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符合法律法规的相关要求。

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。于 2024 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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 2024 年 06 月	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
--------------------	--------	----------	-------	-------	-----	----

30 日						
资产						
货币资金	12,774,676.12	-	-	-	-	12,774,676.12
结算备付金	1,678,940.56	-	-	-	-	1,678,940.56
存出保证金	165,543.68	-	-	-	-	165,543.68
交易性金融资产	339,257,490.11	381,311,520.93	485,266,341.30	80,937,629.99	194,654,195.10	1,481,427,177.43
买入返售金融资产	50,012,328.77	-	-	-	-	50,012,328.77
应收清算款	-	-	-	-	262,643.26	262,643.26
应收申购款	-	-	-	-	98,142.58	98,142.58
资产总计	403,888,979.24	381,311,520.93	485,266,341.30	80,937,629.99	195,014,980.94	1,546,419,452.40
负债						
卖出回购金融资产款	315,517,085.29	-	-	-	-	315,517,085.29
应付清算款	-	-	-	-	2,508,718.85	2,508,718.85
应付赎回款	-	-	-	-	4,089,301.98	4,089,301.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	712,678.91	712,678.91
应付托管费	-	-	-	-	203,622.55	203,622.55
应交税费	-	-	-	-	173,861.59	173,861.59
其他负债	-	-	-	-	1,010,276.50	1,010,276.50
负债总计	315,517,085.29	-	-	-	8,698,460.38	324,215,545.67
利率敏感度缺口	88,371,893.95	381,311,520.93	485,266,341.30	80,937,629.99	186,316,520.56	1,222,203,906.73
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	14,636,767.36	-	-	-	-	14,636,767.36
结算备付金	1,373,565.69	-	-	-	-	1,373,565.69
存出保证金	170,901.85	-	-	-	-	170,901.85
交易性金融资产	473,350,374.09	527,428,698.08	1,264,837,432.32	538,960,810.13	396,378,601.33	3,200,955,915.95
应收申购款	-	-	-	-	161,235.94	161,235.94
资产总计	489,531,608.	527,428,698	1,264,837,432	538,960,810	396,539,837	3,217,298,386

	99	.08	.32	.13	.27	.79
负债						
卖出回购金	670,867,889.					670,867,889.1
融资产款	13					3
应付清算款					7,601,810.1	7,601,810.18
					8	
应付赎回款					1,989,209.0	1,989,209.06
					6	
应付管理人报酬					1,583,454.0	1,583,454.01
					1	
应付托管费					452,415.42	452,415.42
应交税费					245,865.37	245,865.37
其他负债					824,513.75	824,513.75
负债总计	670,867,889.				12,697,267.	683,565,156.9
	13				79	2
利率敏感度缺口	-181,336,280	527,428,698	1,264,837,432	538,960,810	383,842,569	2,533,733,229
	.14	.08	.32	.13	.48	.87

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	3,733,465.70	13,459,163.41
	市场利率上升27个基点	-3,733,465.70	-13,459,163.41

#### 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币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股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，

选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有的现金或者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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	194,654,195.10	15.93	396,378,601.33	15.64
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	194,654,195.10	15.93	396,378,601.33	15.64

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 15.93%（2023 年 12 月 31 日：15.64%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

### 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	228,133,324.65	613,638,507.25
第二层次	1,253,293,852.78	2,587,317,408.70
第三层次	-	-
合计	1,481,427,177.43	3,200,955,915.95

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；本基金根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其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

截至资产负债表日本基金无需要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	194,654,195.10	12.59
	其中：股票	194,654,195.10	12.59
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,286,772,982.33	83.21
	其中：债券	1,286,772,982.33	83.21
	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	50,012,328.77	3.23
	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	14,453,616.68	0.93
8	其他各项资产	526,329.52	0.03
9	合计	1,546,419,452.40	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	963,560.00	0.08
B	采矿业	31,167,379.00	2.55
C	制造业	80,472,584.10	6.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,076,948.00	2.79
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,060,972.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	15,687,143.00	1.28
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	24,740,021.00	2.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,933,646.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,551,942.00	0.13
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	194,654,195.10	15.93

## 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	600900	长江电力	312,300	9,031,716.00	0.74
2	600276	恒瑞医药	125,800	4,838,268.00	0.40
3	000858	五粮液	31,300	4,007,652.00	0.33
4	601699	潞安环能	205,000	3,716,650.00	0.30
5	000568	泸州老窖	25,200	3,615,948.00	0.30
6	601225	陕西煤业	137,700	3,548,529.00	0.29
7	603198	迎驾贡酒	60,400	3,473,000.00	0.28
8	601128	常熟银行	450,900	3,413,313.00	0.28
9	601665	齐鲁银行	682,100	3,349,111.00	0.27
10	600919	江苏银行	445,900	3,313,037.00	0.27
11	600548	深高速	306,600	3,259,158.00	0.27
12	600377	宁沪高速	257,900	3,249,540.00	0.27
13	002267	陕天然气	427,800	3,234,168.00	0.26
14	601339	百隆东方	612,000	3,188,520.00	0.26
15	600938	中国海油	96,200	3,174,600.00	0.26
16	001965	招商公路	265,200	3,145,272.00	0.26
17	601216	君正集团	850,900	3,139,821.00	0.26
18	600519	贵州茅台	2,100	3,081,519.00	0.25
19	605368	蓝天燃气	222,300	3,032,172.00	0.25
20	601328	交通银行	401,800	3,001,446.00	0.25
21	601939	建设银行	405,500	3,000,700.00	0.25
22	002027	分众传媒	484,100	2,933,646.00	0.24
23	601918	新集能源	297,500	2,900,625.00	0.24
24	600489	中金黄金	195,100	2,887,480.00	0.24
25	601006	大秦铁路	401,300	2,873,308.00	0.24
26	600023	浙能电力	400,200	2,845,422.00	0.23
27	601899	紫金矿业	160,900	2,827,013.00	0.23
28	601139	深圳燃气	421,500	2,815,620.00	0.23
29	601077	渝农商行	532,500	2,673,150.00	0.22
30	002032	苏泊尔	51,700	2,590,170.00	0.21
31	600027	华电国际	369,000	2,560,860.00	0.21
32	603689	皖天然气	304,300	2,501,346.00	0.20
33	002677	浙江美大	300,600	2,437,866.00	0.20
34	600348	华阳股份	241,600	2,406,336.00	0.20
35	601088	中国神华	52,900	2,347,173.00	0.19
36	600809	山西汾酒	10,800	2,277,504.00	0.19
37	002416	爱施德	240,600	2,129,310.00	0.17
38	600926	杭州银行	154,200	2,012,310.00	0.16

39	000429	粤高速 A	193,200	2,011,212.00	0.16
40	603053	成都燃气	207,900	2,008,314.00	0.16
41	002563	森马服饰	344,400	2,000,964.00	0.16
42	601838	成都银行	131,400	1,995,966.00	0.16
43	002142	宁波银行	89,800	1,980,988.00	0.16
44	600066	宇通客车	76,600	1,976,280.00	0.16
45	603706	东方环宇	134,100	1,964,565.00	0.16
46	603369	今世缘	42,300	1,954,260.00	0.16
47	600985	淮北矿业	115,200	1,928,448.00	0.16
48	600987	航民股份	269,935	1,905,741.10	0.16
49	000157	中联重科	236,300	1,814,784.00	0.15
50	600461	洪城环境	151,200	1,750,896.00	0.14
51	600282	南钢股份	339,400	1,690,212.00	0.14
52	002469	三维化学	295,000	1,681,500.00	0.14
53	600177	雅戈尔	234,700	1,671,064.00	0.14
54	601101	昊华能源	174,300	1,601,817.00	0.13
55	688057	金达莱	158,200	1,551,942.00	0.13
56	002884	凌霄泵业	79,600	1,528,320.00	0.13
57	600582	天地科技	220,200	1,517,178.00	0.12
58	600261	阳光照明	554,600	1,497,420.00	0.12
59	002327	富安娜	148,600	1,493,430.00	0.12
60	600210	紫江企业	275,500	1,465,660.00	0.12
61	000030	富奥股份	273,100	1,340,921.00	0.11
62	002479	富春环保	374,700	1,318,944.00	0.11
63	600585	海螺水泥	55,700	1,313,963.00	0.11
64	600817	宇通重工	159,300	1,306,260.00	0.11
65	603697	有友食品	223,600	1,296,880.00	0.11
66	000708	中信特钢	94,600	1,283,722.00	0.11
67	603355	莱克电气	55,900	1,207,440.00	0.10
68	601989	中国重工	211,900	1,044,667.00	0.09
69	601975	招商南油	290,700	1,043,613.00	0.09
70	600968	海油发展	251,300	1,035,356.00	0.08
71	002543	万和电气	103,500	1,030,860.00	0.08
72	601808	中海油服	59,400	1,021,680.00	0.08
73	002608	江苏国信	130,700	1,012,925.00	0.08
74	600801	华新水泥	73,300	1,007,875.00	0.08
75	600547	山东黄金	36,400	996,632.00	0.08
76	600362	江西铜业	42,000	994,560.00	0.08
77	603150	万朗磁塑	39,300	984,072.00	0.08
78	603408	建霖家居	73,200	965,508.00	0.08
79	002714	牧原股份	22,100	963,560.00	0.08

80	000777	中核科技	62,600	956,528.00	0.08
81	603008	喜临门	54,700	947,951.00	0.08
82	688087	英科再生	36,600	947,208.00	0.08
83	603367	辰欣药业	67,400	939,556.00	0.08
84	002100	天康生物	135,000	935,550.00	0.08
85	603878	武进不锈	142,700	933,258.00	0.08
86	002833	弘亚数控	51,100	932,064.00	0.08
87	300783	三只松鼠	42,600	931,662.00	0.08
88	605198	安德利	35,100	926,640.00	0.08
89	600566	济川药业	28,800	913,248.00	0.07
90	002790	瑞尔特	99,600	899,388.00	0.07
91	300791	仙乐健康	35,100	884,520.00	0.07
92	002035	华帝股份	138,100	860,363.00	0.07
93	601666	平煤股份	69,200	775,040.00	0.06
94	300154	瑞凌股份	91,900	489,827.00	0.04
95	603886	元祖股份	13,700	206,322.00	0.02
96	001205	盛航股份	6,500	105,040.00	0.01
97	002760	凤形股份	5,300	69,960.00	0.01
98	003036	泰坦股份	800	6,392.00	0.00

## 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	600900	长江电力	24,699,363.00	0.97
2	000001	平安银行	15,598,027.00	0.62
3	000858	五粮液	14,892,077.00	0.59
4	000568	泸州老窖	13,827,703.00	0.55
5	601225	陕西煤业	13,159,260.00	0.52
6	002142	宁波银行	13,112,539.00	0.52
7	600276	恒瑞医药	12,994,256.36	0.51
8	600519	贵州茅台	11,944,853.00	0.47
9	603198	迎驾贡酒	11,602,454.00	0.46
10	600348	华阳股份	11,033,438.57	0.44
11	002027	分众传媒	10,622,284.00	0.42
12	600985	淮北矿业	9,991,375.00	0.39
13	600546	山煤国际	9,990,543.99	0.39
14	000708	中信特钢	9,426,837.00	0.37
15	601666	平煤股份	9,412,882.00	0.37
16	601216	君正集团	7,465,424.00	0.29

17	001965	招商公路	7,331,399.52	0.29
18	603369	今世缘	7,301,552.86	0.29
19	601398	工商银行	7,288,422.00	0.29
20	002677	浙江美大	7,282,568.00	0.29

注：买入金额按成交金额(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	600276	恒瑞医药	29,397,983.93	1.16
2	600809	山西汾酒	21,001,858.00	0.83
3	002027	分众传媒	18,126,176.00	0.72
4	000568	泸州老窖	18,011,062.00	0.71
5	300601	康泰生物	17,591,655.41	0.69
6	600900	长江电力	17,535,112.00	0.69
7	600519	贵州茅台	16,799,558.00	0.66
8	000001	平安银行	16,196,213.00	0.64
9	688235	百济神州	14,464,464.37	0.57
10	000661	长春高新	14,421,126.00	0.57
11	000858	五粮液	14,391,321.00	0.57
12	300573	兴齐眼药	13,409,395.00	0.53
13	002304	洋河股份	13,007,524.47	0.51
14	002142	宁波银行	10,987,017.00	0.43
15	600546	山煤国际	10,229,832.99	0.40
16	603198	迎驾贡酒	10,151,320.38	0.40
17	688331	荣昌生物	10,114,817.10	0.40
18	601225	陕西煤业	10,081,576.44	0.40
19	688179	阿拉丁	10,061,404.10	0.40
20	603259	药明康德	9,437,788.00	0.37

注：卖出金额按成交金额(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	1,608,904,628.40
卖出股票收入(成交)总额	1,733,736,034.69

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(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	央行票据	-	-
3	金融债券	177,051,598.26	14.49
	其中：政策性金融债	70,857,769.37	5.80
4	企业债券	51,103,253.15	4.18
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,005,332,833.06	82.26
7	可转债（可交换债）	33,479,129.55	2.74
8	同业存单	19,806,168.31	1.62
9	其他	-	-
10	合计	1,286,772,982.33	105.28

### 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	102281520	22 电建地产 MTN002	500,000	52,300,163.93	4.28
2	102281594	22 浙国贸 MTN003	500,000	51,893,333.33	4.25
3	102101577	21 恒运 MTN002	500,000	51,606,393.44	4.22
4	102381082	23 番禺信息 MTN001	500,000	51,575,446.58	4.22
5	102381145	23 九龙江 MTN002	500,000	51,164,104.11	4.19

### 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。

### 7.11.3 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	165,543.68
2	应收清算款	262,643.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	98,142.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	526,329.52

### 7.11.4 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	113654	永 02 转债	5,004,168.01	0.41
2	123169	正海转债	4,288,441.12	0.35
3	118034	晶能转债	3,565,196.46	0.29
4	113636	甬金转债	3,075,318.49	0.25
5	123190	道氏转 02	2,889,088.62	0.24
6	123179	立高转债	2,774,571.71	0.23
7	127089	晶澳转债	2,764,365.39	0.23
8	127085	韵达转债	2,752,525.34	0.23
9	128121	宏川转债	2,506,141.11	0.21
10	127091	科数转债	2,313,215.43	0.19
11	123165	回天转债	1,546,097.87	0.13

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
60,074	7,869.18	217,292,070.77	45.97%	255,441,026.40	54.03%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	319,555.04	0.0676%

### 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

### 8.4 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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年11月29日）基金份额总额	1,395,901,371.31
本报告期期初基金份额总额	962,451,178.50
本报告期基金总申购份额	76,684,378.89
减：本报告期基金总赎回份额	566,402,460.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	472,733,097.17

## § 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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	1,599,062,934.84	47.84%	1,176,736.29	47.84%	-
国信证券	1	1,743,577,728.25	52.16%	1,283,112.25	52.16%	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-

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
长城证券	110,763,913.69	25.70%	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	116,466,724.68	27.02%	5,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
国信证券	153,532,458.49	35.62%	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	50,284,773.71	11.67%	-	-	-	-	-	-

#### 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关于旗下基金参加广发银行费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年01月08日

2	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
3	诺安双利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
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年02月02日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加排排网基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年02月29日
6	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》、《证券日报》	2024年03月29日
7	诺安双利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
8	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
9	诺安双利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
10	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在直销渠道的申购起点金额、最小追加申购金额及最低赎回份额的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年05月24日
11	诺安基金管理有限公司关于终止北京懒猫基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2024年06月07日
12	诺安双利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
13	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

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

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。							

## 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。

### 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](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2024 年 08 月 30 日