

# 诺安双利债券型发起式证券投资基金

2021年第1季度报告

2021年03月31日

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2021年04月22日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2021年4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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至2021年3月31日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 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 | 540,256,737.08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、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>5、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 | 本基金的业绩比较基准为中债综合指数(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（2021年01月01日 - 2021年03月31日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 58,772,640.79                  |
| 2. 本期利润         | -33,754,063.85                 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0641                        |

|             |                  |
|-------------|------------------|
| 4. 期末基金资产净值 | 1,325,513,587.64 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.453            |

注：①上述基金业绩指标不包括持有人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

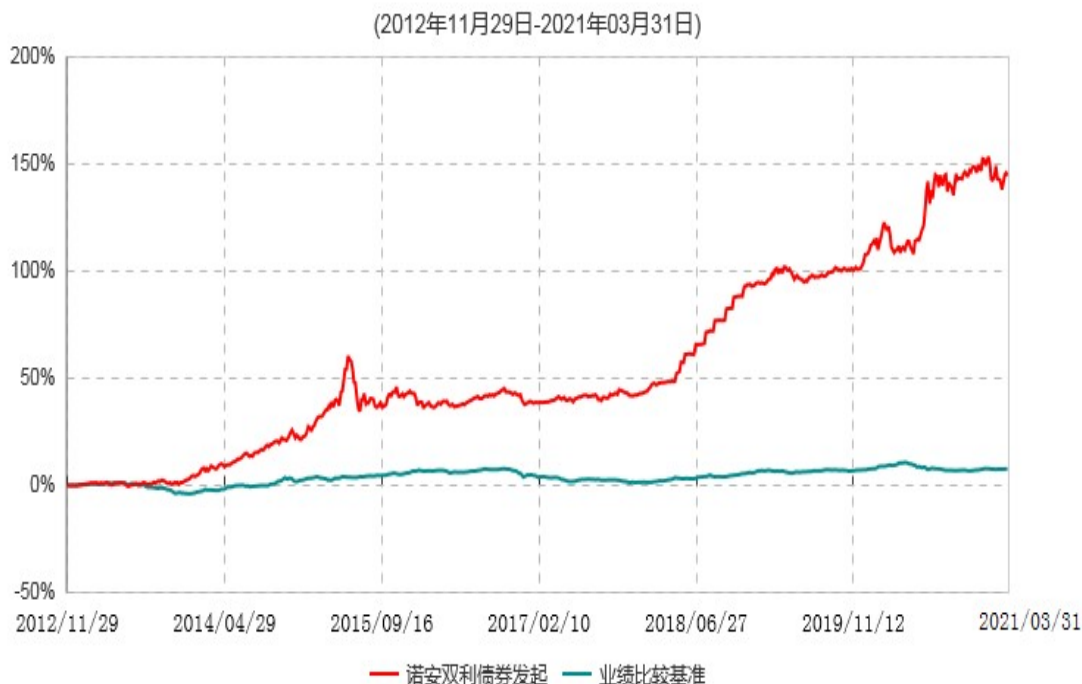
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | -2.54%  | 0.79%     | 0.20%      | 0.04%         | -2.74%  | 0.75% |
| 过去六个月      | 2.85%   | 0.68%     | 0.84%      | 0.04%         | 2.01%   | 0.64% |
| 过去一年       | 17.93%  | 0.75%     | -1.68%     | 0.08%         | 19.61%  | 0.67% |
| 过去三年       | 65.19%  | 0.60%     | 5.11%      | 0.07%         | 60.08%  | 0.53% |
| 过去五年       | 76.35%  | 0.48%     | 0.72%      | 0.07%         | 75.63%  | 0.41% |
| 自基金合同生效起至今 | 145.30% | 0.53%     | 7.85%      | 0.08%         | 137.45% | 0.45% |

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

诺安双利债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

#### § 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 |        |   |
| 裴禹翔 | 本基金基金经理 | 2017-08-30  | -    | 10年    | 硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于华融湘江银行股份有限公司、浙江浙商证券资产管理有限公司，任投资经理。2015年12月加入诺安基金管理有限公司，任基金经理助理，从事债券投资工作。2016年2月至2017年4月任诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016年2月至2018年5月任诺安天天宝货币市场基金 |

|    |         |            |   |     |  |
|----|---------|------------|---|-----|--|
|    |         |            |   |     | <p>基金经理，2017年8月至2019年9月任诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016年2月起任诺安增利债券型证券投资基金基金经理，2016年3月起任诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016年8月起任诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年9月起任诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年8月起任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年1月起任诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年2月起任诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年11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，2020年9月起任诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> |
| 杨琨 | 本基金基金经理 | 2020-03-24 | - | 13年 | <p>硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于</p>  |

|     |         |            |   |    |   |
|-----|---------|------------|---|----|---|
|     | 理       |            |   |    | 益民基金管理有限公司、天弘基金管理有限公司、诺安基金管理有限公司、安邦人寿保险股份有限公司，从事行业研究、投资工作。2014年6月至2015年7月任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年5月加入诺安基金管理有限公司，任基金经理助理。2019年1月至2020年4月任诺安优化配置混合型证券投资基金基金经理。2017年8月任诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年2月起任诺安新经济股票型证券投资基金基金经理，2020年3月起任诺安新兴产业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。 |
| 夏荣尧 | 本基金基金经理 | 2020-07-10 | - | 9年 | 硕士，具有基金从业资格，曾任中国农业银行股份有限公司客户经理、鹏元资信评估有限公司信用评级分析师、生命保险资产管理有限公司信用评级分析师，2016年2月加入诺安基金管理  |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 有限公司，历任研究员、投资经理。2020年7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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间，诺安双利债券型发起式证券投资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《诺安双利债券型发起式证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明



本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年1季度，各项经济数据显示国内经济仍持续向好，外围经济近期持续修复，领先指标继续回升，但仍需关注疫情再次反弹带来的负面影响。本季度长债收益率冲高回落，前期受通胀交易驱动收益率上行较快，而后尽管面临经济数据以及社融数据不利因素冲击，债市仍表现出较强的韧性，长债收益率持续下行。权益市场方面，本季度权益市场先扬后抑，受美国国债利率大幅上行的影响，交易拥挤板块出现了显著的回落，白酒、新能源汽车、新能源等板块回调幅度颇大，市场整体表现疲弱，可转债指数在本季度也小幅承压，结构上与权益市场相似，内部分化较大，大盘成长类标的显著回调，价值类以及中小盘成长类标的小幅的修复。

本季度组合规模基本维持，组合杠杆下降。由于组合持有的股票长期回报下降，本季度股票仓位显著下调，组合相应的增加了纯债仓位配置，而转债在本季度经历了正股下跌以及转债估值压缩后出现了较为理想的配置机会，故而组合在本季度也增加了转债的配置仓位，增加的转债仓位以中低价位为主，且对应正股的估值与业绩增速相对匹配。

展望未来，国内经济修复步伐放缓，全球范围内的政策仍未全面紧缩，权益市场仍有一定的机会，但料将继续分化，可转债整体上仍有安全边际，部分双低的转债对应正股仍有较强的吸引力，债市已初步具备一定的配置价值。下一阶段，我们仍将积极配置可转债，注重业绩与估值的匹配性，注重债底的保护，力求在回撤可控的基础上获得更高的回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，诺安双利债券发起基金份额净值为2.453元，本报告期内，基金份额净值增长率为-2.54%，同期业绩比较基准收益率为0.20%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 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   | 12,557,780.20    | 0.94          |
|    | 其中：股票  | 12,557,780.20    | 0.94          |
| 2  | 基金投资   | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 1,171,855,005.99 | 88.03         |
|    | 其中：债券  | 1,171,855,005.99 | 88.03         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 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      | 48,230,090.48    | 3.62   |
| 8 | 其他资产              | 98,594,493.65    | 7.41   |
| 9 | 合计                | 1,331,237,370.32 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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              | 12,557,780.20 | 0.95         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |

|   |           |               |      |
|---|-----------|---------------|------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | -             | -    |
| S | 综合        | -             | -    |
|   | 合计        | 12,557,780.20 | 0.95 |

### 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  | 601677 | 明泰铝业 | 630,714 | 12,172,780.20 | 0.92         |
| 2  | 300751 | 迈为股份 | 700     | 385,000.00    | 0.03         |

### 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      | 19,992,000.00    | 1.51         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 49,910,000.00    | 3.77         |
|    | 其中：政策性金融债 | 49,910,000.00    | 3.77         |
| 4  | 企业债券      | 19,658,000.00    | 1.48         |
| 5  | 企业短期融资券   | 20,044,000.00    | 1.51         |
| 6  | 中期票据      | 243,553,400.00   | 18.37        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 818,697,605.99   | 61.76        |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,171,855,005.99 | 88.41        |

### 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  | 113025    | 明泰转债         | 373,760 | 65,019,289.60 | 4.91         |
| 2  | 110067    | 华安转债         | 556,890 | 60,712,147.80 | 4.58         |
| 3  | 113605    | 大参转债         | 454,530 | 56,493,533.70 | 4.26         |
| 4  | 101801271 | 18中粮地产MTN003 | 500,000 | 50,570,000.00 | 3.82         |
| 5  | 110073    | 国投转债         | 475,820 | 49,965,858.20 | 3.77         |

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体,本期除华安证券、大参林外,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。

1. 2020年11月6日,华安证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会安徽证监局出具的《关于对华安证券股份有限公司采取责令改正并增加内部合规检查次数措施的决定》,主要是因为:(1)公司在负责湖南奥莎动力集团股份有限公司挂牌申请和持续督导工作中,尽职调查不够充分、内核把关不够严格、持续督导不够尽责。(2)公司廉洁从业风险管控机制建设不够完善,对员工执业行为规范性缺乏有效约束等。

截至本报告期末,华安转债(110067.SH)为本基金前十大重仓。从投资的角度看,我们认为公司估值较低,转债绝对价格也较低,上述监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有华安转债。本基金对该证券的投资符合法律法规和公司制度。

2. 2020年7月28日,安阳大参林千年健医药连锁有限公司受到安阳市市场监督管理局行政处罚,保定市盛世华兴医药连锁有限公司受到莲池区应急管理局行政处罚,潮州市大参林药店有限公司凤园路分店受到潮州市公安局湘桥分局行政处罚,大参林医药集团股份有限公司受到广州市市场监督管理局行政处罚,赣州大参林连锁药店有限公司大余新城峰山街店受到大余县市场和质量监督管理局行政处罚,主要原因是相应门店运营过程中存在部分行为不合规。公司配合监管部门,迅速实施整改,并对相关人员进行严肃教育和责任追究,并按制度予以集团通报批评。公司集团及地区主要负责人月度会议会针对当月各主体所受处罚作出汇总通报、认真总结,重申和强调相关制度规范并由各地区负责人牵头传达,避免类似事件再度出现。

截至本报告期末,大参转债(113605.SH)为本基金前十大重仓。从投资的角度看,我们认为该公司估值合理,未来成长持续性强,上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有大参转债。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

## 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 183,366.51    |
| 2  | 应收证券清算款 | 87,570,521.44 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 5,129,384.13  |
| 5  | 应收申购款   | 5,711,221.57  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 98,594,493.65 |

## 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  | 113025 | 明泰转债 | 65,019,289.60 | 4.91         |
| 2  | 110067 | 华安转债 | 60,712,147.80 | 4.58         |
| 3  | 110073 | 国投转债 | 49,965,858.20 | 3.77         |
| 4  | 128034 | 江银转债 | 33,901,841.43 | 2.56         |
| 5  | 110053 | 苏银转债 | 32,861,455.20 | 2.48         |
| 6  | 128106 | 华统转债 | 29,012,028.14 | 2.19         |
| 7  | 123053 | 宝通转债 | 25,696,463.10 | 1.94         |
| 8  | 113011 | 光大转债 | 24,466,549.00 | 1.85         |
| 9  | 113588 | 润达转债 | 24,152,314.80 | 1.82         |
| 10 | 110051 | 中天转债 | 23,573,513.40 | 1.78         |
| 11 | 128114 | 正邦转债 | 22,517,468.50 | 1.70         |
| 12 | 113034 | 滨化转债 | 20,625,105.30 | 1.56         |
| 13 | 113559 | 永创转债 | 19,531,458.50 | 1.47         |
| 14 | 123064 | 万孚转债 | 18,879,066.14 | 1.42         |
| 15 | 123050 | 聚飞转债 | 17,261,765.22 | 1.30         |
| 16 | 123060 | 苏试转债 | 16,316,197.44 | 1.23         |
| 17 | 128123 | 国光转债 | 15,980,629.14 | 1.21         |
| 18 | 113594 | 淳中转债 | 10,361,520.00 | 0.78         |
| 19 | 110059 | 浦发转债 | 10,270,000.00 | 0.77         |
| 20 | 127005 | 长证转债 | 9,178,400.00  | 0.69         |
| 21 | 123025 | 精测转债 | 6,698,964.04  | 0.51         |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 22 | 128113 | 比音转债 | 5,779,164.56 | 0.44 |
| 23 | 128133 | 奇正转债 | 3,549,952.77 | 0.27 |
| 24 | 128111 | 中矿转债 | 449,310.00   | 0.03 |
| 25 | 113516 | 苏农转债 | 208,012.30   | 0.02 |
| 26 | 128122 | 兴森转债 | 90,936.30    | 0.01 |

#### 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，分项之和与合计可能有尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 541,625,349.45 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 136,216,135.52 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 137,584,747.89 |
| 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               | 540,256,737.08 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,003,200.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,003,200.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 1.85          |

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

### § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目    | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人 | 10,003,200.00 | 1.85%        | 10,003,200.00 | 1.85%        | 三年         |

|                 |               |       |               |       |    |
|-----------------|---------------|-------|---------------|-------|----|
| 固有资金            |               |       |               |       |    |
| 基金管理人<br>高级管理人员 | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -  |
| 基金经理等<br>人员     | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -  |
| 基金管理人<br>股东     | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -  |
| 其他              | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -  |
| 合计              | 10,003,200.00 | 1.85% | 10,003,200.00 | 1.85% | 三年 |

注：该固有资金为本发起式基金认购期内认购金额。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                       |      |      |      | 报告期末持有基金情况 |      |
|--|----------------|-----------------------|------|------|------|------------|------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或超过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基金份额比例达到或者超过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诺安双利债券型发起式证券投资基金2021年第一季度报告正文。
- ⑥报告期内诺安双利债券型发起式证券投资基金在中国证监会基金电子披露网站上披露的各项公告。

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

诺安基金管理有限公司

2021年04月22日