

诺安鼎利混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月27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2021年01月01日起至2021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	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 中期财务会计报告(未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	21
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49

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	49
§9 开放式基金份额变动	50
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安鼎利混合型证券投资基金	
基金简称	诺安鼎利混合	
基金主代码	006005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年03月28日	
基金管理人	诺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,961,993.04份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	诺安鼎利混合A	诺安鼎利混合C
下属分级基金的交易代码	006005	006006
报告期末下属分级基金的份额总额	2,342,451.63份	11,619,541.41份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制组合下行风险的基础上，通过积极的大类资产配置和个股个券精选，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金通过对国内外经济形势、宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平及信用风险等因素的研判，预测各大类资产在不同市场周期内的风险收益特征，并以此来调整基金资产在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、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</p>

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。

3、普通债券投资策略

本基金将采取利率策略、期限结构策略、信用策略、息差策略和个券选择策略，判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值，并确定不同债券在组合资产中的配置比例，实现组合的稳健增值。

4、可转换债券投资策略

本基金将积极参与公司发行条款较好、基本面优秀、申购收益高的可转债的一级市场申购，待其上市后依据对其正股的判断以及可转债合理定价水平决定继续持有或卖出；同时，本基金将综合运用多种投资策略在可转债二级市场上进行投资操作，力争在风险可控的前提下获取较高的投资收益。

5、可交换债券投资策略

可交换债券在换股期间用于交换的股票是发行人持有的其他上市公司（以下简称“目标公司”）的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中，债券特性与可转换债券相同，指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特性则指目标公司的成长能力、盈利能力及目标公司股票价格的成长性等。本基金将通过对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析，综合开展投资决策。

6、股票投资策略

本基金可适当参与股票二级市场投资，增强基金资产收益。

股票投资主要采用自上而下与自下而上相结合，定性分析与定量分析相结合。充分借鉴内部和外部研究观点，动态跟踪行业景气度和估值水平，优先选择具备完善的法人治理结构和有效的激励机制、明显受益于行业景气提升、根据市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）

	<p>等指标衡量的估值水平相对偏低的上市公司</p> <p>7、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>8、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>9、权证投资策略</p> <p>在严格控制风险的前提下，本基金可适度进行权证投资。投资权证的目的为控制下跌风险和实现基金资产增值。</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	$\text{沪深300指数收益率} \times 20\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 80\%$
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。</p>

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐斌	郭明
	联系电话	0755-83026688	(010) 66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	(010) 66105798
注册地址		深圳市深南大道4013号兴业 银行大厦19-20层	北京市西城区复兴门内大街5 5号
办公地址		深圳市深南大道4013号兴业 银行大厦19-20层	北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		秦维舟	陈四清

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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	诺安鼎利混合A	诺安鼎利混合C

本期已实现收益	102,362.27	459,864.24
本期利润	16,749.55	68,933.80
加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0058
本期加权平均净值利润率	0.53%	0.50%
本期基金份额净值增长率	0.78%	0.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	420,662.02	1,878,576.45
期末可供分配基金份额利润	0.1796	0.1617
期末基金资产净值	2,763,113.65	13,498,117.86
期末基金份额净值	1.1796	1.1617
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	17.96%	16.17%

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期末可供分配利润是采用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

诺安鼎利混合A

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	-0.08%	0.21%	-0.25%	0.17%	0.17%	0.04%
过去三个月	3.23%	0.27%	1.72%	0.20%	1.51%	0.07%
过去六个月	0.78%	0.45%	1.96%	0.27%	-1.18%	0.18%
过去一年	4.05%	0.82%	7.38%	0.27%	-3.33%	0.55%
自基金合同	17.96%	0.84%	15.21%	0.25%	2.75%	0.59%

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	-0.14%	0.21%	-0.25%	0.17%	0.11%	0.04%
过去三个月	3.07%	0.27%	1.72%	0.20%	1.35%	0.07%
过去六个月	0.48%	0.45%	1.96%	0.27%	-1.48%	0.18%
过去一年	3.43%	0.82%	7.38%	0.27%	-3.95%	0.55%
自基金合同 生效起至今	16.17%	0.84%	15.21%	0.25%	0.96%	0.59%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×80%。

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

诺安鼎利混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年03月28日-2021年06月30日)



诺安鼎利混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年03月28日-2021年06月30日)



注：本基金建仓期为 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2021年6月30日，本基金管理人共管理62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、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、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、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、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、诺安进取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、诺安恒惠债券型证券投资基金、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		
谢志华	本基金基金经理	2019年03月28日	-	15年	理学硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于华泰证券有限责任公司、招商基金管理有限公司，从事固定收益类品种的研究、投资工作。曾于2010年8月至2012年8月任招商安心收益债券基金经理，2011年3月至2012年8月任招商安瑞进取债券基金经理。2012年8月加入诺安基金管理有限公司，任投资

				<p>经理，现任公司总经理助理、固定收益事业部总经理。2013年11月至2016年2月任诺安泰鑫一年定期开放债券基金经理，2015年3月至2016年2月任诺安裕鑫收益两年定期开放债券基金经理，2013年6月至2016年3月任诺安信用债券一年定期开放债券基金经理，2014年6月至2016年3月任诺安永鑫收益一年定期开放债券基金经理，2013年8月至2016年3月任诺安稳固收益一年定期开放债券基金经理，2014年11月至2017年6月任诺安保本混合基金经理，2015年12月至2017年12月任诺安利鑫保本混合及诺安景鑫保本混合基金经理，2016年1月至2018年1月任诺安益鑫保本混合基金经理，2016年2月至2018年3月任诺安安鑫保本混合基金经理，2017年12月至2018年1月任诺安利鑫混合基金经理，2016年4月至2018年5月任诺安和鑫保本混合基金经理，2014年11月至2018年6月任诺安汇鑫保本混合基金经理，2017年12月至2018年7月任诺安景鑫混合基金经理，2017年6月至2019年1月任</p>
--	--	--	--	--

				诺安行业轮动混合基金经理，2013年5月至2019年6月任诺安鸿鑫保本混合基金经理。2013年5月起任诺安纯债定期开放债券基金经理，2013年12月起任诺安优化收益债券基金经理，2014年11月起任诺安聚利债券基金经理，2016年2月起任诺安理财宝货币、诺安聚鑫宝货币及诺安货币基金经理，2018年5月起任诺安天天宝货币基金经理，2018年7月起任诺安汇利混合基金经理，2019年3月起任诺安鼎利混合基金经理。
曲泉儒	本基金基金经理	2021年04月22日	-	9年 硕士，具有基金从业资格，曾任远策投资管理有限公司研究员、长盛基金管理有限公司投资经理。2016年加入诺安基金管理有限公司，任投资经理。2019年4月至2020年7月任诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年4月起任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年3月起任诺安平衡证券投资基金基金经理，2021年4月起任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。

注：①此处谢志华先生的任职日期为基金合同生效之日，曲泉儒先生的任职日期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，诺安鼎利混合型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《诺安鼎利混合型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 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

上半年国内经济修复动能边际减弱，而随着海外疫苗接种推广，国外经济恢复较快，大宗商品价格推动国内PPI冲顶，但向下游传导不畅，受猪肉价格下行影响，CPI仍处于低位。货币政策稳中偏松，资金面相对宽松。财政政策有所收敛，呈现结构性紧信用态势。债券供给偏少，银行等机构配置压力较大，债券收益率震荡下行，信用利差收窄。股票市场上半年波动较大，先跌后涨，结构差异明显。转债市场上半年宽幅震荡上行，个券表现分化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，诺安鼎利混合A基金份额净值为1.1796元；本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.78%，同期业绩比较基准收益率为1.96%。

截至报告期末，诺安鼎利混合C基金份额净值为1.1617元；本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.48%，同期业绩比较基准收益率为1.96%。

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，预计在长期政策约束下，房地产链条将会继续调整，而出口链条随着海外疫情修复可能存在份额回归的可能，国内经济仍有继续下行的压力，基本面对债市仍有支撑。货币政策预计以稳为主，资金面较上半年波动可能有所加大，但整体预计保持平稳。但前期市场预期反映比较充分，利差等指标处于历史偏低位置，预计下半年收益率继续下行空间不会很大。转债市场方面，预计下半年仍以结构性行情为主。

投资运作上，二季度诺安鼎利混合做了策略定位调整，以绝对收益为目标，控制回撤。上半年诺安鼎利混合基本保持了股票比例，降低了可转债仓位，增加了国债和信用债配置比例。下一阶段，诺安鼎利混合将在控制产品回撤的基础上努力通过资产配置获取绝对收益。

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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关法律法规的规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、基金运营部、监察稽核部、风险控制部、权益投资事业部、固定收益事业部及基金经理等组成

了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

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12次，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期未有收益分配事项。

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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人将积极与基金托管人协商解决方案，包括但不限于持续营销、转换运作方式、与其他基金合并等，并适时根据法律法规及基金合同约定的程序进行。

§ 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，本基金托管人在对诺安鼎利混合型证券投资基金的托管过程中，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，不存在任何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，诺安鼎利混合型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安鼎利混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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鼎利混合型证券投资基金2021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核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：诺安鼎利混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,380,167.95	1,323,052.36
结算备付金		54,052.31	5,877.45
存出保证金		1,998.22	1,546.27
交易性金融资产	6.4.7.2	14,827,895.86	19,024,906.03
其中：股票投资		1,862,997.40	2,220,741.38
基金投资		-	-
债券投资		12,964,898.46	16,804,164.65
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	148,949.15	174,459.19
应收股利		-	-
应收申购款		4,763.14	1,190.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,417,826.63	20,531,031.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		104,484.67	43,674.33
应付管理人报酬		13,435.65	17,409.59
应付托管费		3,358.89	4,352.41
应付销售服务费		6,690.01	7,799.58
应付交易费用	6.4.7.7	3,389.14	1,436.03
应交税费		368.49	132.50
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	24,868.27	32,008.88
负债合计		156,595.12	106,813.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	13,961,993.04	17,611,363.64
未分配利润	6.4.7.10	2,299,238.47	2,812,854.34
所有者权益合计		16,261,231.51	20,424,217.98
负债和所有者权益总计		16,417,826.63	20,531,031.30

注：报告截止日2021年06月30日，诺安鼎利混合A基金份额净值1.1796元，基金份额总额2,342,451.63份；诺安鼎利混合C基金份额净值1.1617元，基金份额总额11,619,541.41份。诺安鼎利混合份额总额合计为13,961,993.04份。

6.2 利润表

会计主体：诺安鼎利混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		283,154.65	2,353,720.91
1. 利息收入		129,545.08	146,211.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,155.53	9,168.62
债券利息收入		124,878.96	137,043.19

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,510.59	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		627,849.98	5,292,057.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	272,747.05	187,794.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	343,505.84	5,068,291.48
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	11,597.09	35,971.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-476,543.16	-3,105,149.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,302.75	20,600.56
减：二、费用		197,471.30	384,579.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	83,579.61	182,858.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,894.86	45,714.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	40,717.11	55,997.30
4. 交易费用	6.4.7.19	8,426.10	10,040.58
5. 利息支出		16.81	13,196.68
其中：卖出回购金融资产支出		16.81	13,196.68
6. 税金及附加		124.10	469.37
7. 其他费用	6.4.7.20	43,712.71	76,303.22

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		85,683.35	1,969,141.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		85,683.35	1,969,141.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安鼎利混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	17,611,363.64	2,812,854.34	20,424,217.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	85,683.35	85,683.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,649,370.60	-599,299.22	-4,248,669.82
其中：1. 基金申购款	517,411.89	81,588.66	599,000.55
2. 基金赎回款	-4,166,782.49	-680,887.88	-4,847,670.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	13,961,993.04	2,299,238.47	16,261,231.51
项 目	上年度可比期间		

	2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	67,152,434.00	4,914,538.06	72,066,972.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,969,141.17	1,969,141.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-45,744,655.64	-4,174,042.30	-49,918,697.94
其中：1. 基金申购款	4,519,392.98	471,104.90	4,990,497.88
2. 基金赎回款	-50,264,048.62	-4,645,147.20	-54,909,195.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	21,407,778.36	2,709,636.93	24,117,415.29

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

基金管理人负责人

____ 田冲

主管会计工作负责人

____ 薛有为

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安鼎利混合型证券投资基金(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〔2018〕774号《关于准予诺安鼎利混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函〔2018〕2952号《关于诺安鼎利混合型证券投资基金延期募集备案的回函》注册，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《诺安鼎利混合型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 322,154,278.13 元。经向中国证监会备案，《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 28 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 322,344,765.76 份基金份额，其中认购资金利息折合 190,487.63 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、从本类别基金资产中不计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于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）、债券（包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、次级债等）、债券回购、货币市场工具、同业存单、权证、资产支持证券、国债期货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）。本基金可投资于持有可转债、可交换债券转股所得的股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，也可直接从二级市场上买入股票和权证。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-30%；债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于 70%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 20% + 中证综合债指数收益率 \times 80%。

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》、各项具体会计准则及相关规定（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》、《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方

式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2021年06月30日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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2021年06月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金在本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	活期存款	1,380,167.95
定期存款	-	
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	-	
合计	1,380,167.95	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		1,784,390.43	1,862,997.40	78,606.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	9,989,495.06	9,978,998.46	-10,496.60
	银行间市场	2,975,538.02	2,985,900.00	10,361.98
	合计	12,965,033.08	12,964,898.46	-134.62
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		14,749,423.51	14,827,895.86	78,472.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	135.27
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	21.96
应收债券利息	148,791.11
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-

其他	0.81
合计	148,949.15

注：此处列示“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	2,781.64
银行间市场应付交易费用	607.50
合计	3,389.14

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付赎回费	-
预提费用	24,868.27
合计	24,868.27

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 诺安鼎利混合A

金额单位：人民币元

项目 (诺安鼎利混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	4,348,131.89	4,348,131.89
本期申购	223,839.59	223,839.59
本期赎回(以“-”号填列)	-2,229,519.85	-2,229,519.85
本期末	2,342,451.63	2,342,451.63

6.4.7.9.2 诺安鼎利混合C

金额单位：人民币元

项目 (诺安鼎利混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,263,231.75	13,263,231.75
本期申购	293,572.30	293,572.30
本期赎回(以“-”号填列)	-1,937,262.64	-1,937,262.64
本期末	11,619,541.41	11,619,541.41

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 诺安鼎利混合A

单位：人民币元

项目 (诺安鼎利混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,184,379.64	-442,958.01	741,421.63
本期利润	102,362.27	-85,612.72	16,749.55
本期基金份额交易产生的变动数	-547,348.02	209,838.86	-337,509.16
其中：基金申购款	61,606.62	-26,003.57	35,603.05
基金赎回款	-608,954.64	235,842.43	-373,112.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	739,393.89	-318,731.87	420,662.02

6.4.7.10.2 诺安鼎利混合C

单位：人民币元

项目 (诺安鼎利混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,408,744.22	-1,337,311.51	2,071,432.71
本期利润	459,864.24	-390,930.44	68,933.80
本期基金份额交易产生的变动数	-426,456.45	164,666.39	-261,790.06
其中：基金申购款	78,385.45	-32,399.84	45,985.61
基金赎回款	-504,841.90	197,066.23	-307,775.67

本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,442,152.01	-1,563,575.56	1,878,576.45

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
活期存款利息收入	2,976.33	
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	164.27	
其他	14.93	
合计	3,155.53	

注：此处“其他”列示的是存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
卖出股票成交总额	3,016,864.93	
减：卖出股票成本总额	2,744,117.88	
买卖股票差价收入	272,747.05	

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,966,305.51	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,423,281.93	
减：应收利息总额	199,517.74	
买卖债券差价收入	343,505.84	

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	11,597.09
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	11,597.09

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-476,543.16
——股票投资	-219,512.49
——债券投资	-257,030.67
——资产支持证券投资	-
——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	-476,543.16

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
----	-------------------------------

基金赎回费收入	2,211.78
转换费收入	90.97
合计	2,302.75

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	7,666.10
银行间市场交易费用	760.00
合计	8,426.10

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	15,868.27
信息披露费	-
汇划手续费	244.44
账户维护费	27,600.00
合计	43,712.71

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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、基金销售机构、登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联方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内未通过关联方交易单元进行股票交易。

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内未通过关联方交易单元进行权证交易。

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内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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	83,579.61	182,858.06
其中：支付销售机构的客户维护费	39,144.55	104,259.85

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	20,894.86	45,714.53

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安鼎利混合A	诺安鼎利混合C	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	0.00	179.36	179.36
中国工商银行股份有限公司(托管人)	0.00	38,442.95	38,442.95
合计	0.00	38,622.31	38,622.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安鼎利混合A	诺安鼎利混合C	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	0.00	354.26	354.26
中国工商银行股份有限公司(托管人)	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	354.26	354.26

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的年销售服务费率为0.6%。C类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间内未运用自有资金投资本基金。

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

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
中国工商银行股份有限公司	1,380,167.95	2,976.33	1,332,274.67	8,256.18

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工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内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 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（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金未持有期末暂时停牌流通受限股票。

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2021年6月30日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金未持有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

本基金是混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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中国工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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,000,500.00	-
合计	1,000,500.00	-

注：未评级债券为超短期融资券。

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	3,776,219.46	3,610,446.95
AAA以下	1,966,459.00	6,128,831.30
未评级	6,221,720.00	7,064,886.40
合计	11,964,398.46	16,804,164.65

注：未评级长期债券投资为中期票据、国债投资和政策性金融债投资。

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于约定开放日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2021年06月30日，本基金所承担的全部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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即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公司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2021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2021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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等生息资产，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 2021年0 6月30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						
银行存款	1,380,167.95	-	-	-	-	1,380,167.95
结算备付金	54,052.31	-	-	-	-	54,052.31
存出保证金	1,998.22	-	-	-	-	1,998.22
交易性金融资产	4,309,300.00	1,911,120.00	5,117,439.46	1,627,039.00	1,862,997.40	14,827,895.86
应收利息	-	-	-	-	148,949.15	148,949.15
应收申购款	-	-	-	-	4,763.14	4,763.14
资产总计	5,745,518.48	1,911,120.00	5,117,439.46	1,627,039.00	2,016,709.69	16,417,826.63
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	104,484.67	104,484.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	13,435.65	13,435.65
应付托管费	-	-	-	-	3,358.89	3,358.89
应付销售服务费	-	-	-	-	6,690.01	6,690.01
应付交易费用	-	-	-	-	3,389.14	3,389.14
应交税费	-	-	-	-	368.49	368.49
其他负债	-	-	-	-	24,868.27	24,868.27
负债总计	-	-	-	-	156,595.12	156,595.12
利率敏感度缺口	5,745,518.48	1,911,120.00	5,117,439.46	1,627,039.00	1,860,114.57	16,261,231.51
上年度末 2020年1 2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						
银行存款	1,323,052.36	-	-	-	-	1,323,052.36

结算备付金	5,877.45	-	-	-	-	5,877.45
存出保证金	1,546.27	-	-	-	-	1,546.27
交易性金融资产	-	1,821,420.00	6,427,459.65	8,555,285.00	2,220,741.38	19,024,906.03
应收利息	-	-	-	-	174,459.19	174,459.19
应收申购款	-	-	-	-	1,190.00	1,190.00
资产总计	1,330,476.08	1,821,420.00	6,427,459.65	8,555,285.00	2,396,390.57	20,531,031.30
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	43,674.33	43,674.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	17,409.59	17,409.59
应付托管费	-	-	-	-	4,352.41	4,352.41
应付销售服务费	-	-	-	-	7,799.58	7,799.58
应付交易费用	-	-	-	-	1,436.03	1,436.03
应交税费	-	-	-	-	132.50	132.50
其他负债	-	-	-	-	32,008.88	32,008.88
负债总计	-	-	-	-	106,813.32	106,813.32
利率敏感度缺口	1,330,476.08	1,821,420.00	6,427,459.65	8,555,285.00	2,289,577.25	20,424,217.98

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	市场利率发生变化		
	假设市场利率发生变化		
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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率下降27个基点	63,171.53	231,825.81
	市场利率上升27个基点	-63,171.53	-231,825.81

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：股票资产占基金资产的比例为0-30%；债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于70%，权证投资比例不高于基金资产净值的3%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券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 2021年06月30日		上年度末 2020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	1,862,997.40	11.46	2,220,741.38	10.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,862,997.40	11.46	2,220,741.38	10.87

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2021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11.46%(2020年12月31日：10.87%)，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(2020年12月31日：同)。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为4,611,575.86元，属于第二层次的余额为10,216,320.00元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次的余额为10,636,676.43元，属于第二层次的余额为8,388,229.60元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 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股票和债券，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年06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(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	1,862,997.40	11.35
	其中：股票	1,862,997.40	11.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,964,898.46	78.97
	其中：债券	12,964,898.46	78.97
	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	1,434,220.26	8.74
8	其他各项资产	155,710.51	0.95
9	合计	16,417,826.63	100.00

7.2 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	336,024.00	2.07

C	制造业	1,165,963.40	7.17
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	158,688.00	0.98
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	86,625.00	0.53
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	115,697.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,862,997.40	11.46

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	002353	杰瑞股份	9,500	424,650.00	2.61
2	601808	中海油服	23,400	336,024.00	2.07
3	002236	大华股份	13,700	289,070.00	1.78
4	300294	博雅生物	4,600	166,290.00	1.02
5	000423	东阿阿胶	4,600	165,186.00	1.02
6	600297	广汇汽车	55,100	158,688.00	0.98
7	688155	先惠技术	1,014	120,767.40	0.74

8	002044	美年健康	12,700	115,697.00	0.71
9	300271	华宇软件	4,500	86,625.00	0.53

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	002236	大华股份	326,051.00	1.60
2	601808	中海油服	325,574.00	1.59
3	002353	杰瑞股份	322,200.00	1.58
4	601233	桐昆股份	321,665.96	1.57
5	300059	东方财富	301,340.00	1.48
6	600519	贵州茅台	198,490.00	0.97
7	600297	广汇汽车	164,198.00	0.80
8	300294	博雅生物	161,773.00	0.79
9	002044	美年健康	161,541.00	0.79
10	000423	东阿阿胶	160,908.00	0.79
11	688155	先惠技术	81,145.43	0.40
12	300271	华宇软件	81,000.00	0.40

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，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	300059	东方财富	499,464.00	2.45
2	002439	启明星辰	337,783.23	1.65
3	601233	桐昆股份	284,206.61	1.39
4	603916	苏博特	251,732.61	1.23
5	600519	贵州茅台	212,223.00	1.04
6	601878	浙商证券	99,940.68	0.49

7	601318	中国平安	81,400.00	0.40
8	000568	泸州老窖	75,576.00	0.37
9	603288	海天味业	60,487.20	0.30
10	600036	招商银行	59,444.00	0.29
11	000858	五粮液	56,808.00	0.28
12	002714	牧原股份	50,851.00	0.25
13	600809	山西汾酒	39,400.00	0.19
14	002304	洋河股份	34,486.00	0.17
15	601166	兴业银行	33,405.00	0.16
16	601012	隆基股份	27,824.00	0.14
17	600031	三一重工	26,508.00	0.13
18	000538	云南白药	23,408.00	0.11
19	002311	海大集团	23,215.00	0.11
20	603799	华友钴业	23,019.00	0.11

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，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	2,605,886.39
卖出股票收入（成交）总额	3,016,864.93

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，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	3,306,600.00	20.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,913,320.00	11.77
	其中：政策性金融债	1,913,320.00	11.77
4	企业债券	2,007,500.00	12.35
5	企业短期融资券	1,000,500.00	6.15
6	中期票据	1,985,400.00	12.21
7	可转债(可交换债)	2,751,578.46	16.92

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,964,898.46	79.73

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	010107	21国债(7)	33,000	3,306,600.00	20.33
2	149225	20创投S1	10,000	1,005,200.00	6.18
3	108604	国开1805	10,000	1,002,700.00	6.17
4	112307	15投资01	10,000	1,002,300.00	6.16
5	102101097	21今世缘MTN001	10,000	1,001,800.00	6.16

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股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体，本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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	1,998.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	148,949.15
5	应收申购款	4,763.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	155,710.51

7.12.4 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	110067	华安转债	322,260.00	1.98
2	128129	青农转债	320,580.00	1.97
3	123073	同和转债	230,160.00	1.42
4	128106	华统转债	222,940.00	1.37
5	127024	盈峰转债	220,020.00	1.35
6	128107	交科转债	217,120.00	1.34
7	127005	长证转债	139,279.46	0.86
8	113606	荣泰转债	125,200.00	0.77
9	128109	楚江转债	117,740.00	0.72
10	123086	海兰转债	110,800.00	0.68
11	128034	江银转债	105,200.00	0.65

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§ 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

份额级别	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
诺安鼎利混合A	343	6,829.31	0.00	0.00%	2,342,451.63	100.00%
诺安鼎利混合C	393	29,566.26	0.00	0.00%	11,619,541.41	100.00%
合计	736	18,970.10	0.00	0.00%	13,961,993.04	100.00%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	诺安鼎利混合A	0.00	0.00%
	诺安鼎利混合C	32.10	0.0003%
	合计	32.10	0.0002%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	诺安鼎利混合A	0
	诺安鼎利混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安鼎利混合A	0
	诺安鼎利混合C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安鼎利混合A	诺安鼎利混合C
基金合同生效日(2019年03月28日)基金份额总额	171,722,863.16	150,621,902.60
本报告期期初基金份额总额	4,348,131.89	13,263,231.75
本报告期基金总申购份额	223,839.59	293,572.30
减：本报告期基金总赎回份额	2,229,519.85	1,937,262.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,342,451.63	11,619,541.41

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。

§ 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

截至本报告披露日，本基金管理人重大人事变动情况如下：

李强先生担任公司董事长、于东升先生担任公司副总经理、总经理齐斌先生代任公司督察长；秦维舟先生不再担任公司董事长、马宏先生不再担任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

本报告期内，公司收到深圳证监局关于子公司及相关人员的监管措施，公司按要求落实。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
国信证券	1	2,860,173.73	50.87%	2,663.73	72.63%	-
广发证券	1	2,762,577.59	49.13%	1,003.98	27.37%	-

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单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1)、实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于3 亿元人民币。
- (2)、财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3)、经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4)、内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5)、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, 并能为本基金提供全面的信息服。
- (6)、研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

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
国信证券	13,436,318.14	50.53%	-	-	-	-	-	-
广发证券	13,154,855.32	49.47%	5,800,000.00	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关于旗下基金参加平安银行开展的基金申购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》	2021-01-04
2	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加申万宏源证券、申万宏源西部证券开展的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》	2021-01-04
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基	《证券时报》、	2021-01-05

	金参加中国银行开展的基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	
4	诺安基金管理有限公司关于终止泰信财富基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-01-16
5	诺安基金管理有限公司旗下基金2020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》	2021-01-22
6	诺安鼎利混合型证券投资基金2020年第4季度报告	基金管理人网站	2021-01-22
7	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿为代销机构并开通定投、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》	2021-02-08
8	诺安基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021-02-08
9	诺安基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统汇款交易业务基金申（认）购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》	2021-03-12
10	诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》	2021-03-15
11	诺安鼎利混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-03-15

12	诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第1期	基金管理人网站	2021-03-15
13	诺安基金管理有限公司关于深圳总部办公地址恢复办公及西部营销中心办公地址变更的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-03-29
14	诺安基金管理有限公司关于调整个人投资者在盈米基金的申购起点金额、最低赎回（转换、保有）份额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-03-31
15	诺安基金管理有限公司旗下基金2020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》	2021-03-31
16	诺安鼎利混合型证券投资基金2020年年度报告	基金管理人网站	2021-03-31
17	诺安基金管理有限公司关于终止成都万华源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》	2021-04-01
18	诺安基金管理有限公司关于诺安鼎利混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	《证券时报》	2021-04-22
19	诺安基金管理有限公司旗下基金2021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》	2021-04-22
20	诺安鼎利混合型证券投资基金2021年第1季度报告	基金管理人网站	2021-04-22

21	诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》	2021-04-26
22	诺安鼎利混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-04-26
23	诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第2期	基金管理人网站	2021-04-26
24	诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告	《中国证券报》	2021-04-28
25	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》	2021-05-29
26	诺安基金管理有限公司关于终止部分代销机构代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-11
27	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-15
28	诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2021-06-15
29	诺安鼎利混合型证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2021-06-15
30	诺安鼎利混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-06-15
31	诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第3期	基金管理人网站	2021-06-15
32	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》	2021-06-26
33	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的基金申购及定投手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-30

		》	
34	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加基煜基金开展的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》	2021-06-30

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20210104-20210630	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	71.62%
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

根据2020年8月1日起施行的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的规定，本基金管理人于2021年6月15日披露了《诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告》，在本基金基金合同、托管协议中增加了侧袋机制的相关条款，并同步更新了招募说明书、基金产品资料概要，更新后的法律文件同日在本基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站披露。

§ 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鼎利混合型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安鼎利混合型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诺安鼎利混合型证券投资基金2021年中期报告正文。
- ⑥报告期内诺安鼎利混合型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
二〇二一年八月三十一日