

诺安鼎利混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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：2026 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
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	16
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	16
§ 5	托管人报告	16
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真实、准确和完整发表意见	17
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 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	44
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	45
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55

7.12	投资组合报告附注	55
§ 8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	盈利投资者数量占比	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.4	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	57
§ 9	开放式基金份额变动	57
§ 10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	58
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	62
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

§ 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	365,607,009.01 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	诺安鼎利混合 D
下属分级基金的交易代码	006005	006006	022985
报告期末下属分级基金的份额总额	172,047,124.51 份	68,863,722.52 份	124,696,161.98 份

注：自 2025 年 3 月 17 日起，本基金增加 D 类基金份额，分设 A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额。

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	1、大类资产配置策略 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。 2、类属资产配置策略 受信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等不同因素的影响，国债、央票、金融债、企业债、公司债、短期融资券等不同类属的券种收益率变化特征存在明显的差异,并表现出不同的利差变化趋势。基金管理人将分析各类属券种的利差变化趋势，合理配置并灵活调整不同类属券种在组合中的构成比例,通过对类属的合理配置力争获取超越基准的收益率水平。 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)等指标衡量的估值水平相对偏低的上市公司。 7、存托凭证投资策略 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。 8、资产支持证券投资策略 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。 9、国债期货投资策略 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。 10、权证投资策略 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。 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	沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×80%

风险收益特征	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。
--------	---

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	李学君	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 55 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 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		夏宇	廖林

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		
	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D
本期已实现收益	5,804,522.33	1,955,156.92	4,664,832.78
本期利润	2,709,098.04	369,255.23	2,467,528.84
加权平均基金份额本期利润	0.0107	0.0036	0.0141
本期加权平均净值利润率	0.78%	0.27%	1.03%
本期基金份额净值增长率	-0.49%	-0.77%	-0.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）		

	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D
期末可供分配利润	60,792,629.89	20,210,657.08	43,683,398.68
期末可供分配基金份额利润	0.3533	0.2935	0.3503
期末基金资产净值	232,839,754.40	89,074,379.60	168,379,560.66
期末基金份额净值	1.3533	1.2935	1.3503
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）		
	诺安鼎利混合 A	诺安鼎利混合 C	诺安鼎利混合 D
基金份额累计净值增长率	35.33%	29.35%	4.00%

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

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
过去三个月	-0.90%	0.25%	3.33%	0.26%	-4.23%	-0.01%
过去六个月	-0.49%	0.27%	3.23%	0.23%	-3.72%	0.04%
过去一年	2.48%	0.23%	6.40%	0.20%	-3.92%	0.03%
过去三年	12.21%	0.30%	17.09%	0.21%	-4.88%	0.09%
过去五年	14.73%	0.26%	18.82%	0.22%	-4.09%	0.04%
过去七年	35.63%	0.52%	35.35%	0.23%	0.28%	0.29%
自基金合同生效起至今	35.33%	0.52%	36.89%	0.23%	-1.56%	0.29%

诺安鼎利混合 C

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
过去三个月	-1.05%	0.25%	3.33%	0.26%	-4.38%	-0.01%
过去六个月	-0.77%	0.27%	3.23%	0.23%	-4.00%	0.04%
过去一年	1.87%	0.23%	6.40%	0.20%	-4.53%	0.03%
过去三年	10.23%	0.30%	17.09%	0.21%	-6.86%	0.09%
过去五年	11.35%	0.26%	18.82%	0.22%	-7.47%	0.04%
过去七年	29.90%	0.52%	35.35%	0.23%	-5.45%	0.29%
自基金合同生效起至今	29.35%	0.52%	36.89%	0.23%	-7.54%	0.29%

诺安鼎利混合 D

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	率③	④		
过去三个月	-0.90%	0.25%	3.33%	0.26%	-4.23%	-0.01%
过去六个月	-0.49%	0.27%	3.23%	0.23%	-3.72%	0.04%
过去一年	2.47%	0.23%	6.40%	0.20%	-3.93%	0.03%
自基金合同生效起至今	4.00%	0.22%	7.95%	0.20%	-3.95%	0.02%

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



诺安鼎利混合 C



诺安鼎利混合 D



注：本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十五只开放式基金：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 A100 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、诺安智盈优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、诺安智泉量化选股混合型发起式证券投资基金、诺安悦鑫 90 天持有期债券型证券投资基金、诺安科技智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		
张立	本基金基金经理	2021 年 11 月 13 日	—	12 年	硕士，具有基金从业资格，曾任国泰君安证券股份有限公司高级经理、建银国际（深圳）有限公司项目经理、平安信托有限公司产品经理。2016 年 12 月加入诺安基金管理有限公司，历任基金经理助理。2020 年 5 月至 2025 年 8 月任诺安增利债券型证券投资基金基金经理。2021 年 11 月起任诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理。
孔宪政	多资产投资部总经理、本基金基金经理	2023 年 02 月 21 日	—	14 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，历任多资产投资部总经理兼国际业务部总经理，现任多资产投资部总经理。2023 年 2 月至 2024 年 8 月任诺安双利债券型发起式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 2 月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理、诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2023 年 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，2025 年 3 月起任诺安策略精选股票型证券投资基金基金经理，2026 年 3 月起任诺安智泉量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。
周颖恺	本基金基金经理	2023 年 05 月 20 日	-	8 年	硕士，具有基金从业资格。曾任兴证证券资产管理有限公司研究员、风险管理岗、上海浦东发展银行资产管理部投资研究岗。2022 年 6 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员。2023 年 5 月起任诺安鼎利混合型证券投资基金基金经理，2025 年 3 月起任诺安策略精选股票型证券投资基金基金经理。

注：①对于首任基金经理，上述“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对于非首任基金经理，上述“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

②证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了基金合同的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场

申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确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，并下达申购指令；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

2026 年上半年国内经济运行呈现“总量平稳、节奏前高后低、结构高度分化”的特征。上半年 GDP 同比增长 4.7%，其中一季度 5.0%、二季度 4.3%，显示年初稳增长政策前置、财政靠前发力与出口韧性共同推动经济实现“开门红”，但进入二季度后，财政投放边际放缓、地产拖累加深、消费走弱与中东冲突推升油价所带来的输入性成本压力交织，经济修复斜率明显放缓。结构上工业生产、出口、AI 链与高技术制造表现亮眼，但消费、民间投资、房地产和居民融资仍然偏弱；通胀方面，PPI 快速上行而 CPI 仅温和回升，价格改善更多来自能源与上游输入，而非终端需求全面回暖。海

外方面，中东地缘冲突及美联储货币政策框架重塑直接改变了各类资产的定价主线。

权益方面，报告期内产品整体维持中高仓位运作，至报告期末尾小幅下调了仓位。报告期初，市场延续了去年的上行趋势，但在一季度下旬美国和以色列在伊朗展开军事行动后，全球市场剧烈震荡下行。该事件对于全球金融资产造成了深远影响，演绎的烈度和持续性超出我们在报告期初的判断，且截至本报告期末本次冲突会以何种形式结束仍存在巨大不确定性。而报告期内外需与科技产业链支撑国内经济稳中向好，二季度期间以科创板为代表的科技类股票出现剧烈上涨，科创 50 指数上涨超 75%；而相反，非科技类股票出现单边下跌行情。市场宽基指数呈现上涨、大多数个股下跌的情形通常出现在牛市中后期阶段，因资金向高景气度行业集中而导致，也是二季度产品出现较大回撤的原因。从基本面角度看，科技硬件类产业得益于本轮 AI 发展确实处于业绩兑现阶段，且全球层面利好频出有利于估值的快速推升。但美伊冲突导致未来海外货币政策偏鹰，对于估值存在虚高的股票会造成一定压力，且近期海外科技龙头已经出现了大幅回撤调整。所以我们仍会将安全边际看作是股票持仓的重要考量标准，在个股风险和策略风险充分分散的基础上帮助持有人赚取稳定收益。

债券市场整体震荡偏强，10 年期国债收益率从年初 1.82%附近下行至 6 月初 1.70%的近年低点，半年末回升至 1.73%附近，尤其春节前后在保险开门红及配置力量驱动下，利率稳步下行，3 月中东地缘风险发酵带来阶段性扰动，4 月后随资金面持续宽松、非银“钱多”格局延续，叠加同业存款自律升级及内需偏弱，长短端利率先后下行，曲线陡峭化特征显著，信用利差整体以收窄为主，其中低评级和长期限品种压缩幅度更大，而期限利差表现为短端确定性更强、长端波动放大，“资产荒”成为贯穿上半年的核心逻辑；转债方面，中证转债指数上半年上涨 2.51%，其中高价与中低价分化明显，市场内部由科技主线和少数活跃个券主导，低价及价值类标的表现偏弱，上半年转债整体波动较大，目前仍未摆脱高价、高估值环境，预计未来仍将继续受到权益市场波动、风格切换及转债供给修复节奏的显著影响。操作上，组合根据市场变化，对转债仓位及纯债仓位、久期进行了灵活调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安鼎利混合 A 份额净值为 1.3533 元，本报告期诺安鼎利混合 A 份额净值增长率为-0.49%，同期业绩比较基准收益率为 3.23%；截至本报告期末诺安鼎利混合 C 份额净值为 1.2935 元，本报告期诺安鼎利混合 C 份额净值增长率为-0.77%，同期业绩比较基准收益率为 3.23%；截至本报告期末诺安鼎利混合 D 份额净值为 1.3503 元，本报告期诺安鼎利混合 D 份额净值增长率为-0.49%，同期业绩比较基准收益率为 3.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美伊军事冲突直接导致全球油价飙升，全球通胀持续高于央行目标，从而让全球多数经济体进入加息周期。这会造成海外衰退预期抬头并引起权益市场剧烈波动，被资金集中青睐的科技类股票反而容易受到更大影响。对于国内企业的经营而言，海外衰退预期可能压制出口需求，但国内相对稳定的利率市场和更为温和的通胀能给企业利润提供一定缓冲。综合来看，权益市场将长期进入高波动环境，股票安全边际的重要性会在未来凸显。从资金配置角度考虑，高股息类股票在市场波动放大的环境下会持续得到资金边际流入，而成长股因估值偏高，即便后续一段时间剧烈波动下仍可能整体呈现上行走势，但因风险放大，对于长期配置资金来说性价比边际减弱。未来产品会将权益仓位逐步向中性区间靠拢，并关注市场结构性的机会。纯债在基本面 K 型弱修复、货币政策定调不变背景下预计仍维持区间震荡格局；转债则因高估值、低利率及供需错配而具备交易价值。

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程序和技术。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，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。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

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《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》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合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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本基金 2026 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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安鼎利混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	25,060,309.96	86,130,579.51
结算备付金		1,967,741.79	3,526,972.10
存出保证金		223,089.49	154,009.75
交易性金融资产	6.4.7.2	579,729,768.65	1,260,471,877.23
其中：股票投资		102,605,405.84	234,702,211.32
基金投资		—	—
债券投资		477,124,362.81	1,025,769,665.91
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收清算款		570,783.96	9,670,554.54
应收股利		—	—

应收申购款		361,891.73	285,396.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		607,913,585.58	1,360,239,389.70
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025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		87,019,668.49	113,019,549.15
应付清算款		588,085.59	-
应付赎回款		28,957,745.68	15,657,768.59
应付管理人报酬		434,167.50	1,084,836.78
应付托管费		86,833.48	216,967.37
应付销售服务费		50,235.26	138,838.57
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16,725.65	19,108.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	466,429.27	760,325.80
负债合计		117,619,890.92	130,897,395.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	365,607,009.01	912,406,441.29
未分配利润	6.4.7.8	124,686,685.65	316,935,553.29
净资产合计		490,293,694.66	1,229,341,994.58
负债和净资产总计		607,913,585.58	1,360,239,389.70

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，诺安鼎利混合 A 基金份额净值 1.3533 元，基金份额总额 172,047,124.51 份；诺安鼎利混合 C 基金份额净值 1.2935 元，基金份额总额 68,863,722.52 份；诺安鼎利混合 D 基金份额净值 1.3503 元，基金份额总额 124,696,161.98 份。诺安鼎利混合份额总额合计为 365,607,009.01 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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		11,610,124.54	5,581,138.09

1. 利息收入		84,963.49	54,907.31
其中：存款利息收入	6.4.7.9	82,041.50	17,501.63
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		2,921.99	37,405.68
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,264,978.64	4,891,912.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,818,166.24	2,964,470.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	5,330,181.66	1,170,073.57
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	2,116,630.74	757,368.05
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	-6,878,629.92	604,371.11
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	1,138,812.33	29,947.40
减：二、营业总支出		6,064,242.43	1,264,581.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,618,451.79	674,376.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	723,690.33	134,875.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	404,572.92	359,033.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,187,801.67	56,072.06
其中：卖出回购金融资产支出		1,187,801.67	56,072.06
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		11,694.56	429.36
8. 其他费用	6.4.7.17	118,031.16	39,795.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,545,882.11	4,316,556.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,545,882.11	4,316,556.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,545,882.11	4,316,556.75

6.3 净资产变动表

会计主体：诺安鼎利混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	912,406,441.29	316,935,553.29	1,229,341,994.58

二、本期期初净资产	912,406,441.29	316,935,553.29	1,229,341,994.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-546,799,432.28	-192,248,867.64	-739,048,299.92
（一）、综合收益总额	-	5,545,882.11	5,545,882.11
（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）	-546,799,432.28	-197,794,749.75	-744,594,182.03
其中：1. 基金申购款	134,035,617.47	46,972,967.88	181,008,585.35
2. 基金赎回款	-680,835,049.75	-244,767,717.63	-925,602,767.38
（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	365,607,009.01	124,686,685.65	490,293,694.66
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	19,084,215.56	4,888,710.68	23,972,926.24
二、本期期初净资产	19,084,215.56	4,888,710.68	23,972,926.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	76,794,208.33	21,819,334.60	98,613,542.93
（一）、综合收益总额	-	4,316,556.75	4,316,556.75
（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）	76,794,208.33	17,502,777.85	94,296,986.18
其中：1. 基金申购款	291,079,173.32	73,050,334.92	364,129,508.24
2. 基金赎回款	-214,284,964.99	-55,547,557.07	-269,832,522.06
（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	95,878,423.89	26,708,045.28	122,586,469.17

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：

刘翔	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。

根据本基金的基金管理人诺安基金管理有限公司于 2025 年 3 月 17 日发布的《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加基金份额类别并修改基金合同、托管协议等法律文件部分条款的公告》以及更新的《诺安鼎利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2025 年 3 月 17 日起，本基金增加基金份额类别。本基金增加基金份额类别后，设 A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额三类基金份额。其中，A 类基金份额和 D 类基金份额在申购时收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从该类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从该类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类、C 类和 D 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、C 类基金份额和 D 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)、存托凭证、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。如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的投资组合比例为：股票、存托凭证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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。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、《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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》、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 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 06 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〔2014〕81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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〕127 号《财政部国家税

务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，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。

2027 年 12 月 31 日前，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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市

的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	25,060,309.96
等于：本金	25,057,240.18
加：应计利息	3,069.78
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	25,060,309.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		113,906,249.88	—	102,605,405.84	-11,300,844.04
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	77,432,598.78	864,999.36	78,779,209.36	481,611.22
	银行间市场	392,196,909.45	3,727,153.45	398,345,153.45	2,421,090.55
	合计	469,629,508.23	4,592,152.81	477,124,362.81	2,902,701.77

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	583,535,758.11	4,592,152.81	579,729,768.65	-8,398,142.27

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,223.40
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	369,125.42
其中：交易所市场	351,002.16
银行间市场	18,123.26
应付利息	-
预提费用	96,080.45
合计	466,429.27

6.4.7.7 实收基金

诺安鼎利混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	391,423,226.88	391,423,226.88
本期申购	35,788,119.22	35,788,119.22
本期赎回（以“-”号填列）	-255,164,221.59	-255,164,221.59
本期末	172,047,124.51	172,047,124.51

诺安鼎利混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	185,083,526.13	185,083,526.13
本期申购	52,987,152.93	52,987,152.93
本期赎回（以“-”号填列）	-169,206,956.54	-169,206,956.54
本期末	68,863,722.52	68,863,722.52

诺安鼎利混合 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	335,899,688.28	335,899,688.28
本期申购	45,260,345.32	45,260,345.32
本期赎回（以“-”号填列）	-256,463,871.62	-256,463,871.62
本期末	124,696,161.98	124,696,161.98

6.4.7.8 未分配利润

诺安鼎利混合 A

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	197,442,774.07	-56,574,769.03	140,868,005.04
本期期初	197,442,774.07	-56,574,769.03	140,868,005.04
本期利润	5,804,522.33	-3,095,424.29	2,709,098.04
本期基金份额交易产生的变动数	-113,023,202.51	30,238,729.32	-82,784,473.19
其中：基金申购款	18,608,554.90	-5,121,745.70	13,486,809.20
基金赎回款	-131,631,757.41	35,360,475.02	-96,271,282.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,224,093.89	-29,431,464.00	60,792,629.89

诺安鼎利混合 C

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	82,625,139.51	-26,426,122.68	56,199,016.83

本期期初	82,625,139.51	-26,426,122.68	56,199,016.83
本期利润	1,955,156.92	-1,585,901.69	369,255.23
本期基金份额交易产生的变动数	-52,791,765.95	16,434,150.97	-36,357,614.98
其中：基金申购款	24,010,725.41	-7,234,306.21	16,776,419.20
基金赎回款	-76,802,491.36	23,668,457.18	-53,134,034.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,788,530.48	-11,577,873.40	20,210,657.08

诺安鼎利混合 D

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	169,293,458.91	-49,424,927.49	119,868,531.42
本期期初	169,293,458.91	-49,424,927.49	119,868,531.42
本期利润	4,664,832.78	-2,197,303.94	2,467,528.84
本期基金份额交易产生的变动数	-108,626,709.08	29,974,047.50	-78,652,661.58
其中：基金申购款	23,634,875.73	-6,925,136.25	16,709,739.48
基金赎回款	-132,261,584.81	36,899,183.75	-95,362,401.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,331,582.61	-21,648,183.93	43,683,398.68

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	77,769.92
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	3,849.11
其他	422.47
合计	82,041.50

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,645,025,343.99
减：卖出股票成本总额	1,633,318,112.94
减：交易费用	1,889,064.81
买卖股票差价收入	9,818,166.24

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 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益--利息收入	6,363,830.59
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-1,033,648.93
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	5,330,181.66

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	657,522,379.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	650,056,521.12
减：应计利息总额	8,492,947.61
减：交易费用	6,560.00
买卖债券差价收入	-1,033,648.93

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 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,116,630.74
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	2,116,630.74

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1. 交易性金融资产	-6,878,629.92
--股票投资	-13,192,101.04
--债券投资	6,313,471.12

—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	-6,878,629.92

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,136,347.10
其他	2,465.23
合计	1,138,812.33

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
存托服务费	1.26
汇划手续费	12,649.45
账户维护费	18,600.00
合计	118,031.16

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、关联关系

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，本基金管理人子公司诺安控股（香港）有限公司、诺安基金（香港）有限公司已注销。除上述变化外，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、登记机构、基金销售机构
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 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,618,451.79	674,376.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,259,211.29	238,535.32
应支付基金管理人的净管理费	2,359,240.50	435,840.83

注：本基金的管理费率为年费率 1.00%。

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：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	723,690.33	134,875.15

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

6.4.10.2.3 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	诺安鼎利混 合 D	合计
诺安基金管理有限公司	-	27,334.77	-	27,334.77
中国工商银行股份有限公司	-	338,852.28	-	338,852.28
合计	-	366,187.05	-	366,187.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	诺安鼎利混 合 D	合计
诺安基金管理有限公司	-	0.65	-	0.65
中国工商银行股份有限公司	-	357,829.06	-	357,829.06
合计	-	357,829.71	-	357,829.71

注：本基金诺安鼎利混合 A 类基金份额和 D 类基金份额不收取销售服务费，诺安鼎利混合 C 类份额的销售服务费年费率为 0.60%。

诺安鼎利混合 C 的销售服务费计算方法如下：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

H 为诺安鼎利混合 C 每日应计提的销售服务费

E 为诺安鼎利混合 C 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固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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-活期存款	25,060,309.96	77,769.92	12,569,851.74	16,641.20

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

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（2026 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：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001257	盛龙股份	2026 年 03 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301666	大普微	2026 年 04 月 08 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	1,168	53,821.44	541,169.44	-
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 03 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-

301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026 年 01 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
68881	有研	2026 年	6 个月	新股锁	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

1	复材	04 月 01 日		定						
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	—
688816	易思维	2026 年 02 月 04 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	—
688818	电科蓝天	2026 年 02 月 03 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	—
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	1,076	21,175.68	152,243.24	—

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688121	*ST 卓然	2026 年 05 月 06 日	重大事项	6.48	2026 年 07 月 07 日	5.18	41,700	449,417.17	270,216.00	—

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 2026 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 87,019,668.49 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
102382441	23 物产中大 MTN001	2026 年 07 月 01 日	102.86	200,000	20,572,370.41
102583317	25 陆金开 MTN004	2026 年 07 月 01 日	101.78	32,000	3,256,823.93
200205	20 国开 05	2026 年 07 月 01 日	106.60	300,000	31,980,131.51
212580046	25 广州农	2026 年 07 月	101.69	200,000	20,337,600.00

	商行债 01	01 日			
232580006	25 民生银 行二级资本 债 01	2026 年 07 月 01 日	102.30	200,000	20,459,019.18
合计				932,000	96,605,945.03

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，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	90,924,071.78	115,362,865.21
合计	90,924,071.78	115,362,865.21

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央行票据或无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	154,876,314.55	440,249,296.39
AAA 以下	10,194,881.64	10,003,935.89
未评级	221,129,094.84	460,153,568.42

合计	386,200,291.03	910,406,800.70
----	----------------	----------------

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央行票据或无第三方机构评级的债券。

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 2026 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约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期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 2026 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 2026 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，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 2026 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	25,060,309.96	-	-	-	-	25,060,309.96
结算备付金	1,967,741.79	-	-	-	-	1,967,741.79
存出保证金	223,089.49	-	-	-	-	223,089.49
交易性金融资产	112,517,840.27	22,889,871.13	277,236,733.73	64,479,917.68	102,605,405.84	579,729,768.65
应收清算款	-	-	-	-	570,783.96	570,783.96
应收申购款	-	-	-	-	361,891.73	361,891.73
资产总计	139,768,981.51	22,889,871.13	277,236,733.73	64,479,917.68	103,538,081.53	607,913,585.58
负债						
卖出回购金融资产款	87,019,668.49	-	-	-	-	87,019,668.49
应付清算款	-	-	-	-	588,085.59	588,085.59
应付赎回款	-	-	-	-	28,957,745.68	28,957,745.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	434,167.50	434,167.50
应付托管费	-	-	-	-	86,833.48	86,833.48
应付销售服务费	-	-	-	-	50,235.26	50,235.26
应交税费	-	-	-	-	16,725.65	16,725.65
其他负债	-	-	-	-	466,429.27	466,429.27
负债总计	87,019,668.49	-	-	-	30,600,222.43	117,619,890.92
利率敏感度缺口	52,749,313.02	22,889,871.13	277,236,733.73	64,479,917.68	72,937,859.10	490,293,694.66
上年度末 2025 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	86,130,579.51	-	-	-	-	86,130,579.51
结算备付金	3,526,972.10	-	-	-	-	3,526,972.10
存出保证金	154,009.75	-	-	-	-	154,009.75
交易性金融资产	106,366,083.29	81,590,749.59	439,379,990.32	398,432,842.71	234,702,211.32	1,260,471,877.23
应收清算款	-	-	-	-	9,670,554.54	9,670,554.54
应收申购款	-	-	-	-	285,396.57	285,396.57
资产总计	196,177,644.65	81,590,749.59	439,379,990.32	398,432,842.71	244,658,162.43	1,360,239,389.70

负债						
卖出回购金融资产款	113,019,549.15	-	-	-	-	113,019,549.15
应付赎回款	-	-	-	-	15,657,768.59	15,657,768.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,084,836.78	1,084,836.78
应付托管费	-	-	-	-	216,967.37	216,967.37
应付销售服务费	-	-	-	-	138,838.57	138,838.57
应交税费	-	-	-	-	19,108.86	19,108.86
其他负债	-	-	-	-	760,325.80	760,325.80
负债总计	113,019,549.15	-	-	-	17,877,845.97	130,897,395.12
利率敏感度缺口	83,158,095.50	81,590,749.59	439,379,990.32	398,432,842.71	226,780,316.46	1,229,341,994.58

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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 27 个基点	2,587,217.84	8,728,720.01
	市场利率上升 27 个基点	-2,559,975.06	-8,557,866.02

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、存托凭证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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	102,605,405.84	20.93	234,702,211.32	19.09
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	102,605,405.84	20.93	234,702,211.32	19.09

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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(2026 年 06 月 30 日)	上年度末(2025 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	3,719,351.91	10,276,670.72
	业绩比较基准下降 5%	-3,719,351.91	-10,276,670.72

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	100,640,877.60	233,683,086.02
第二层次	477,394,578.81	1,025,769,665.91
第三层次	1,694,312.24	1,019,125.30
合计	579,729,768.65	1,260,471,877.23

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 2026 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(2025 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	102,605,405.84	16.88
	其中：股票	102,605,405.84	16.88
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	477,124,362.81	78.49
	其中：债券	477,124,362.81	78.49
	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	27,028,051.75	4.45
8	其他各项资产	1,155,765.18	0.19
9	合计	607,913,585.58	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	1,973,155.80	0.40
B	采矿业	3,516,932.82	0.72
C	制造业	55,340,456.96	11.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,704,943.00	0.76
E	建筑业	1,441,398.00	0.29
F	批发和零售业	5,582,218.60	1.14
G	交通运输、仓储和邮政业	3,628,574.46	0.74
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,191,274.20	1.67
J	金融业	9,105,302.00	1.86
K	房地产业	337,174.00	0.07
L	租赁和商务服务业	1,022,483.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	3,384,802.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	3,244,907.00	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	342,576.00	0.07
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,789,208.00	0.36

S	综合	-	-
	合计	102,605,405.84	20.93

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	688256	寒武纪	700	1,116,885.00	0.23
2	688037	芯源微	2,400	1,053,720.00	0.21
3	688017	绿的谐波	2,400	1,002,864.00	0.20
4	601336	新华保险	16,700	996,322.00	0.20
5	688291	金橙子	17,000	994,160.00	0.20
6	603508	思维列控	46,500	993,240.00	0.20
7	600177	雅戈尔	131,600	990,948.00	0.20
8	688002	睿创微纳	6,400	990,016.00	0.20
9	601318	中国平安	20,600	983,444.00	0.20
10	600406	国电南瑞	42,800	977,980.00	0.20
11	601328	交通银行	149,000	958,070.00	0.20
12	601311	骆驼股份	110,600	861,574.00	0.18
13	603589	口子窖	40,100	749,068.00	0.15
14	300770	新媒股份	21,100	664,439.00	0.14
15	000651	格力电器	17,300	648,750.00	0.13
16	301666	大普微	1,168	541,169.44	0.11
17	600011	华能国际	70,300	533,577.00	0.11
18	603733	仙鹤股份	19,100	515,891.00	0.11
19	603855	华荣股份	29,600	512,968.00	0.10
20	000848	承德露露	69,300	512,820.00	0.10
21	300193	佳士科技	61,900	503,866.00	0.10
22	603444	吉比特	1,400	501,788.00	0.10
23	600603	广汇物流	113,100	491,985.00	0.10
24	600704	物产中大	104,100	491,352.00	0.10
25	603816	顾家家居	21,800	487,448.00	0.10
26	002375	亚厦股份	143,900	486,382.00	0.10
27	600585	海螺水泥	28,600	484,770.00	0.10
28	301039	中集车辆	68,500	482,925.00	0.10
29	600461	洪城环境	52,900	479,274.00	0.10
30	001218	丽臣实业	21,700	478,702.00	0.10
31	603883	老百姓	43,600	477,856.00	0.10
32	603281	江瀚新材	11,700	475,371.00	0.10
33	601166	兴业银行	28,700	475,272.00	0.10

34	600352	浙江龙盛	38,800	469,868.00	0.10
35	601169	北京银行	92,300	452,270.00	0.09
36	600036	招商银行	12,300	436,650.00	0.09
37	688670	金迪克	25,400	430,276.00	0.09
38	603233	大参林	28,400	426,852.00	0.09
39	000719	中原传媒	37,200	425,196.00	0.09
40	002833	弘亚数控	21,900	422,451.00	0.09
41	600887	伊利股份	17,600	421,696.00	0.09
42	601998	中信银行	60,000	415,800.00	0.08
43	601838	成都银行	23,100	408,870.00	0.08
44	600919	江苏银行	37,600	405,328.00	0.08
45	600941	中国移动	4,600	396,198.00	0.08
46	000513	丽珠集团	13,600	392,904.00	0.08
47	603195	公牛集团	10,000	391,500.00	0.08
48	601077	渝农商行	64,000	391,040.00	0.08
49	603991	领先股份	2,700	381,105.00	0.08
50	002120	韵达股份	59,200	376,512.00	0.08
51	603368	柳药集团	25,600	375,552.00	0.08
52	300404	博济医药	42,500	372,300.00	0.08
53	601577	长沙银行	42,700	371,917.00	0.08
54	600583	海油工程	73,700	370,711.00	0.08
55	603393	新天然气	17,300	370,393.00	0.08
56	002192	融捷股份	4,100	366,540.00	0.07
57	600968	海油发展	109,800	365,634.00	0.07
58	688351	微电生理	16,100	364,826.00	0.07
59	601900	南方传媒	33,500	363,810.00	0.07
60	300564	筑博设计	30,000	360,300.00	0.07
61	601233	桐昆股份	16,600	359,390.00	0.07
62	300923	研奥股份	16,100	358,708.00	0.07
63	300640	德艺文创	63,600	358,068.00	0.07
64	600433	冠豪高新	111,000	356,310.00	0.07
65	688078	龙软科技	16,900	355,745.00	0.07
66	601677	明泰铝业	21,400	355,240.00	0.07
67	603650	彤程新材	3,600	352,728.00	0.07
68	002027	分众传媒	72,600	351,384.00	0.07
69	601019	山东出版	54,800	350,720.00	0.07
70	688108	赛诺医疗	18,900	350,217.00	0.07
71	002466	天齐锂业	5,700	349,524.00	0.07
72	300012	华测检测	25,200	349,272.00	0.07
73	301355	南王科技	35,700	349,146.00	0.07
74	002832	比音勒芬	16,900	348,816.00	0.07

75	301371	敷尔佳	13,400	348,400.00	0.07
76	605088	冠盛股份	12,300	346,614.00	0.07
77	300511	雪榕生物	68,900	346,567.00	0.07
78	600511	国药股份	13,300	346,332.00	0.07
79	688050	爱博医疗	9,500	346,275.00	0.07
80	300459	汤姆猫	102,100	346,119.00	0.07
81	301163	宏德股份	15,600	346,008.00	0.07
82	603860	中公高科	14,300	345,917.00	0.07
83	002873	新天药业	47,200	345,504.00	0.07
84	301110	青木科技	9,120	345,283.20	0.07
85	603214	爱婴室	28,500	345,135.00	0.07
86	600697	欧亚集团	35,500	345,060.00	0.07
87	000663	永安林业	67,500	344,250.00	0.07
88	301065	本立科技	19,500	344,175.00	0.07
89	002494	华斯股份	77,500	344,100.00	0.07
90	688472	阿特斯	31,800	344,076.00	0.07
91	300843	胜蓝股份	2,200	343,750.00	0.07
92	002820	桂发祥	40,900	343,560.00	0.07
93	002412	汉森制药	62,400	343,200.00	0.07
94	603029	天鹅股份	24,400	343,064.00	0.07
95	688638	誉辰智能	11,000	342,870.00	0.07
96	002817	黄山胶囊	58,500	342,810.00	0.07
97	300958	建工修复	32,200	342,608.00	0.07
98	600455	博通股份	15,600	342,576.00	0.07
99	300929	华骐环保	32,500	342,550.00	0.07
99	688067	爱威科技	17,000	342,550.00	0.07
101	688393	安必平	19,200	341,376.00	0.07
102	688288	鸿泉技术	19,200	341,184.00	0.07
103	600051	宁波联合	60,600	341,178.00	0.07
104	605567	春雪食品	42,700	341,173.00	0.07
105	300823	建科智能	23,400	341,172.00	0.07
106	603077	和邦生物	147,000	341,040.00	0.07
107	300568	星源材质	18,200	340,704.00	0.07
108	301101	明月镜片	12,500	340,500.00	0.07
109	301010	晶雪节能	20,900	340,461.00	0.07
110	300112	万讯自控	55,000	340,450.00	0.07
111	300621	维业股份	53,600	340,360.00	0.07
112	002696	百洋股份	68,400	339,948.00	0.07
113	301002	崧盛股份	8,800	339,680.00	0.07
114	301049	超越科技	19,000	339,340.00	0.07
115	300030	阳普医疗	58,400	339,304.00	0.07

116	002828	贝肯能源	32,100	339,297.00	0.07
117	600448	华纺股份	134,600	339,192.00	0.07
117	600706	曲江文旅	50,400	339,192.00	0.07
119	600099	林海股份	42,500	339,150.00	0.07
120	003042	中农联合	27,900	338,985.00	0.07
121	300675	建科院	28,600	338,910.00	0.07
122	300417	南华仪器	33,000	338,580.00	0.07
123	603073	彩蝶实业	22,700	338,457.00	0.07
124	300635	中达安	27,800	338,326.00	0.07
125	002760	凤形股份	20,600	338,252.00	0.07
126	600235	民丰特纸	68,000	337,960.00	0.07
127	603908	牧高笛	20,000	337,600.00	0.07
128	301131	聚赛龙	10,500	337,365.00	0.07
129	600202	哈空调	75,300	337,344.00	0.07
130	603506	南都物业	36,100	337,174.00	0.07
131	301113	雅艺科技	22,600	336,966.00	0.07
132	688681	科汇股份	24,100	336,918.00	0.07
133	301063	海锅股份	20,100	336,876.00	0.07
134	002144	宏达高科	34,200	336,870.00	0.07
135	300240	飞力达	67,500	336,825.00	0.07
136	000905	厦门港务	43,400	336,784.00	0.07
137	000856	冀东装备	47,100	336,765.00	0.07
138	301298	东利机械	29,100	336,687.00	0.07
139	300535	达威股份	24,700	336,661.00	0.07
140	300886	华业香料	16,900	336,310.00	0.07
141	301126	达嘉维康	39,300	336,015.00	0.07
142	300034	钢研高纳	19,600	335,944.00	0.07
143	301167	建研设计	27,100	335,769.00	0.07
144	002818	富森美	32,300	335,597.00	0.07
145	301390	经纬股份	10,400	335,504.00	0.07
146	600790	轻纺城	102,600	335,502.00	0.07
147	002982	湘佳股份	31,800	335,490.00	0.07
148	600561	江西长运	67,700	335,115.00	0.07
149	301006	迈拓股份	26,700	335,085.00	0.07
150	300614	百川畅银	34,600	334,928.00	0.07
151	301515	港通医疗	19,100	334,823.00	0.07
152	301037	保立佳	27,900	334,800.00	0.07
153	603709	中源家居	24,700	334,438.00	0.07
154	600137	浪莎股份	20,600	334,338.00	0.07
155	000757	浩物股份	98,000	334,180.00	0.07
156	300549	优德精密	25,600	333,312.00	0.07

157	600883	博闻科技	47,600	333,200.00	0.07
158	301519	舜禹股份	30,700	333,095.00	0.07
159	001336	楚环科技	15,100	332,502.00	0.07
160	003003	天元股份	33,400	332,330.00	0.07
161	600493	凤竹纺织	63,400	332,216.00	0.07
162	301001	凯淳股份	15,300	331,551.00	0.07
163	002752	昇兴股份	60,000	331,200.00	0.07
164	601139	深圳燃气	58,500	331,110.00	0.07
165	688466	金科环境	25,800	331,014.00	0.07
166	002838	道恩股份	10,800	330,696.00	0.07
167	688296	和达科技	28,900	330,616.00	0.07
168	688528	秦川物联	36,100	329,954.00	0.07
169	300645	正元智慧	28,000	329,560.00	0.07
170	300405	科隆股份	63,600	329,448.00	0.07
171	688329	艾隆科技	16,300	329,423.00	0.07
172	600998	九州通	70,200	329,238.00	0.07
173	603022	新通联	41,200	329,188.00	0.07
174	688021	奥福科技	17,000	329,120.00	0.07
175	300605	恒锋信息	35,600	328,944.00	0.07
176	600938	中国海油	12,100	328,515.00	0.07
177	601789	宁波建工	81,800	328,018.00	0.07
178	002486	嘉麟杰	153,100	327,634.00	0.07
179	688004	博汇科技	18,000	327,600.00	0.07
180	605189	富春染织	27,100	326,555.00	0.07
181	601857	中国石油	37,600	326,368.00	0.07
182	600346	恒力石化	18,400	325,864.00	0.07
183	601811	新华文轩	29,700	324,918.00	0.07
184	600757	长江传媒	44,400	324,564.00	0.07
185	301336	趣睡科技	8,120	324,394.00	0.07
186	688058	宝兰德	15,500	324,260.00	0.07
187	600600	青岛啤酒	6,200	323,826.00	0.07
188	600033	福建高速	100,200	322,644.00	0.07
189	603507	振江股份	9,800	322,322.00	0.07
190	300970	华绿生物	17,610	321,910.80	0.07
191	002714	牧原股份	9,200	321,908.00	0.07
192	301149	隆华新材	30,400	321,632.00	0.07
193	002415	海康威视	9,400	321,480.00	0.07
194	603638	艾迪精密	13,700	321,265.00	0.07
195	600028	中国石化	72,000	321,120.00	0.07
196	603132	金徽股份	20,600	320,948.00	0.07
197	601877	正泰电器	12,800	320,896.00	0.07

198	301500	飞南资源	12,300	320,415.00	0.07
199	600219	南山铝业	80,300	320,397.00	0.07
200	600483	福能股份	31,300	318,947.00	0.07
201	300444	双杰电气	26,100	318,681.00	0.06
202	000543	皖能电力	42,000	317,940.00	0.06
203	600713	南京医药	63,400	317,000.00	0.06
204	301068	大地海洋	13,300	316,540.00	0.06
205	300098	高新兴	68,700	315,333.00	0.06
206	002578	闽发铝业	99,800	314,370.00	0.06
207	603099	长白山	8,800	313,896.00	0.06
208	603799	华友钴业	6,500	313,690.00	0.06
209	601326	秦港股份	98,600	311,576.00	0.06
210	002237	恒邦股份	21,200	311,428.00	0.06
211	600251	冠农股份	35,900	310,176.00	0.06
212	600285	羚锐制药	16,000	310,080.00	0.06
213	002956	西麦食品	14,900	309,324.00	0.06
214	002084	海鸥住工	88,800	309,024.00	0.06
215	603383	顶点软件	11,600	308,096.00	0.06
216	000878	云南铜业	19,400	308,072.00	0.06
217	603899	晨光股份	14,900	307,387.00	0.06
218	603183	建研院	86,300	306,365.00	0.06
219	600380	健康元	32,500	306,150.00	0.06
220	603317	天味食品	23,500	305,735.00	0.06
221	603939	益丰药房	17,000	305,660.00	0.06
222	600587	新华医疗	25,700	305,316.00	0.06
223	000589	贵州轮胎	75,200	305,312.00	0.06
224	600927	永安期货	24,500	305,025.00	0.06
225	688659	元琛科技	29,200	304,848.00	0.06
226	603209	兴通股份	24,300	304,479.00	0.06
227	002458	益生股份	39,000	303,030.00	0.06
228	600816	建元信托	124,100	302,804.00	0.06
229	688565	力源科技	32,000	302,400.00	0.06
230	003008	开普检测	17,700	302,139.00	0.06
231	601069	西部黄金	13,700	301,400.00	0.06
232	605050	福然德	32,200	301,392.00	0.06
233	600900	长江电力	11,300	299,111.00	0.06
234	300717	华信新材	14,000	298,200.00	0.06
235	688426	康为世纪	16,200	297,108.00	0.06
236	601018	宁波港	93,500	294,525.00	0.06
237	600780	通宝能源	50,100	293,586.00	0.06
238	001872	招商港口	15,100	293,393.00	0.06

239	601688	华泰证券	14,100	290,742.00	0.06
240	600362	江西铜业	6,700	290,110.00	0.06
241	600999	招商证券	13,700	289,070.00	0.06
242	000596	古井贡酒	3,600	287,280.00	0.06
243	002060	广东建工	94,600	286,638.00	0.06
244	600323	瀚蓝环境	10,400	285,584.00	0.06
245	603689	皖天然气	41,100	284,823.00	0.06
246	300961	深水海纳	22,000	282,700.00	0.06
247	603987	康德莱	40,600	280,140.00	0.06
248	002910	庄园牧场	25,200	279,216.00	0.06
249	002608	江苏国信	40,100	276,690.00	0.06
250	000776	广发证券	11,800	276,120.00	0.06
251	601881	中国银河	21,700	272,769.00	0.06
252	688819	天能股份	12,200	270,840.00	0.06
253	601808	中海油服	25,000	270,250.00	0.06
254	688121	*ST 卓然	41,700	270,216.00	0.06
255	603556	海兴电力	12,200	268,400.00	0.05
256	600030	中信证券	9,300	267,189.00	0.05
257	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.05
258	600361	创新新材	72,300	260,280.00	0.05
259	601000	唐山港	62,300	258,545.00	0.05
260	000987	越秀资本	33,000	258,060.00	0.05
261	300832	新产业	6,000	252,000.00	0.05
262	600061	国投资本	35,800	234,490.00	0.05
263	603369	今世缘	9,700	229,987.00	0.05
264	002946	新乳业	15,300	215,424.00	0.04
265	688580	伟思医疗	3,900	207,753.00	0.04
266	605099	共创草坪	6,200	199,640.00	0.04
267	002039	黔源电力	10,600	199,492.00	0.04
268	688128	中国电研	8,200	194,668.00	0.04
269	688188	柏楚电子	1,740	185,658.00	0.04
270	000975	山金国际	10,000	170,000.00	0.03
271	002294	信立泰	5,300	169,017.00	0.03
272	300033	同花顺	700	168,700.00	0.03
273	300957	贝泰妮	5,200	163,852.00	0.03
274	688809	强一股份	259	161,357.00	0.03
275	688820	盛合晶微	1,076	152,243.24	0.03
276	601066	中信建投	5,000	145,350.00	0.03
277	001316	润贝航科	4,320	142,473.60	0.03
278	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
279	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.02

280	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02
281	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
282	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
283	688356	键凯科技	600	46,248.00	0.01
284	688111	金山办公	200	42,610.00	0.01
285	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
286	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
287	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.01
288	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
289	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
290	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
291	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
292	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
293	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
294	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
295	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
296	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
297	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
298	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
299	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
300	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
301	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
302	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
303	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
304	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
305	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	000333	美的集团	17,073,956.00	1.39
2	600519	贵州茅台	14,059,707.00	1.14
3	300750	宁德时代	9,655,466.00	0.79
4	000568	泸州老窖	8,739,500.63	0.71
5	688256	寒武纪	7,479,481.94	0.61
6	000858	五粮液	7,138,785.00	0.58
7	300308	中际旭创	6,769,746.00	0.55
8	601318	中国平安	6,121,475.00	0.50
9	000651	格力电器	5,567,745.00	0.45

10	002463	沪电股份	5,497,160.00	0.45
11	300502	新易盛	5,476,334.00	0.45
12	600887	伊利股份	5,125,953.00	0.42
13	300929	华骐环保	4,972,632.20	0.40
14	300364	中文在线	4,902,745.00	0.40
15	688626	翔宇医疗	4,867,773.71	0.40
16	600690	海尔智家	4,515,474.00	0.37
17	000938	紫光股份	4,418,272.00	0.36
18	002311	海大集团	4,418,125.00	0.36
19	688329	艾隆科技	4,373,603.16	0.36
20	301098	金埔园林	4,328,587.00	0.35

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	000333	美的集团	16,698,855.00	1.36
2	600519	贵州茅台	13,689,115.00	1.11
3	300750	宁德时代	9,708,221.00	0.79
4	000568	泸州老窖	8,628,204.00	0.70
5	300308	中际旭创	7,774,363.00	0.63
6	000651	格力电器	7,250,658.00	0.59
7	688256	寒武纪	6,980,547.16	0.57
8	000858	五粮液	6,933,264.00	0.56
9	688626	翔宇医疗	6,166,567.40	0.50
10	600887	伊利股份	5,782,046.00	0.47
11	300502	新易盛	5,765,326.06	0.47
12	002463	沪电股份	5,746,175.00	0.47
13	002311	海大集团	5,741,132.00	0.47
14	603833	欧派家居	5,226,473.00	0.43
15	601318	中国平安	5,214,524.00	0.42
16	300364	中文在线	5,213,940.00	0.42
17	600660	福耀玻璃	4,874,908.00	0.40
18	600941	中国移动	4,489,462.00	0.37
19	002475	立讯精密	4,483,993.76	0.36
20	600809	山西汾酒	4,434,403.64	0.36

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	1,514,413,408.50
卖出股票收入（成交）总额	1,645,025,343.99

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	4,397,581.67	0.90
2	央行票据	—	—
3	金融债券	256,892,679.21	52.40
	其中：政策性金融债	73,369,415.62	14.96
4	企业债券	2,043,960.00	0.42
5	企业短期融资券	70,666,756.71	14.41
6	中期票据	143,123,385.22	29.19
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	477,124,362.81	97.31

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	200205	20 国开 05	300,000	31,980,131.51	6.52
2	072510321	25 东海证券 CP002	300,000	30,303,378.08	6.18
3	232480054	24 重庆银行二级资本债 01	200,000	20,695,968.22	4.22
4	102382441	23 物产中大 MTN001	200,000	20,572,370.41	4.20
5	102400887	24 上海电气 MTN001	200,000	20,534,531.51	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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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中，中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的行政处罚，重庆银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局重庆监管局、国家外汇管理局重庆市分局的行政处罚，桂林银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会广西监管局、中国人民银行广西壮族自治区分行的行政处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

截至本报告期末，其余证券的发行主体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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

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	223,089.49
2	应收清算款	570,783.96
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	361,891.73
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,155,765.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

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，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

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	1,179	145,926.31	7,256.66	0.00%	172,039,867.85	100.00%
诺安鼎利 混合 C	3,522	19,552.45	3,832,111.01	5.56%	65,031,611.51	94.44%
诺安鼎利 混合 D	356	350,270.12	—	—	124,696,161.98	100.00%
合计	5,057	72,297.21	3,839,367.67	1.05%	361,767,641.34	98.95%

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 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	38.32%

8.3 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	220,475.42	0.1281%
	诺安鼎利混合 C	2,831.30	0.0041%
	诺安鼎利混合 D	8.47	0.0000%
	合计	223,315.19	0.0611%

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）。

8.4 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
	诺安鼎利混合 D	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	10~50
	诺安鼎利混合 C	0
	诺安鼎利混合 D	0
	合计	10~50

§ 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	诺安鼎利混合 D
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	391,423,226.88	185,083,526.13	335,899,688.28
本报告期基金总申购份额	35,788,119.22	52,987,152.93	45,260,345.32
减：本报告期基金总赎回份额	255,164,221.59	169,206,956.54	256,463,871.62
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	172,047,124.51	68,863,722.52	124,696,161.98

§ 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

本基金管理人重大人事变动情况如下：

截至本报告披露日，本基金管理人董事长（法定代表人）由李强先生变更为夏宇先生，总经理由齐斌先生变更为刘翔先生。

本报告期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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
德邦证券	1	151,125,664.23	4.79%	67,393.45	7.80%	—
广发证券	1	58,969,501.35	1.87%	25,704.07	2.97%	—
国信证券	1	1,428,662,121.52	45.25%	137,016.32	15.86%	—
申万宏源证券	1	1,395,329,839.77	44.19%	622,173.69	72.00%	—
首创证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	123,301,686.07	3.91%	11,826.30	1.37%	—

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）依法取得相关业务资格；
- （2）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；
- （3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合基金进行证券交易的需要；
- （4）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；
- （5）能根据基金投资的特定要求，提供个性化的研究服务；

基金管理人根据以上标准进行充分评估后，选定证券公司，并在完成公司内部审批流程后，与之签订相关协议。

10.7.2 基金租用或者通过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
德邦证券	20,195,343.84	54.20%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	10,106,519.18	27.12%	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	6,960,170.00	18.68%	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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	诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书（更新）2026 年第 1 期	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月19日
2	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	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月19日

	公告		
3	诺安鼎利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月19日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万和证券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	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月20日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源证券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	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月21日
6	诺安鼎利混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月22日
7	诺安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月22日
8	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信嘉利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	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月23日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华创证券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	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月28日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得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	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月28日
11	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加贵文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	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月29日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信嘉利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	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月11日
13	诺安鼎利混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月31日
14	诺安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月31日
15	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月31日
16	诺安基金管理有限公司关于“诺安基金”	中国证监会规定报刊及	2026年04月03日

	APP 业务迁移的公告	网站	
17	诺安基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月22日
18	诺安鼎利混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月22日
19	2025 年度诺安基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月30日
20	诺安基金管理有限公司关于终止中证金牛办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年05月29日
21	诺安基金管理有限公司关于调整旗下公募基金风险等级划分方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年06月13日

§ 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
个人	1	20260629-20260630	73,800,000.00	-	-	73,800,000.00	20.19%
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。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准调整为：中证综合债指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%。

§ 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《诺安鼎利混合型证券投资基金招募说明书》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥报告期内诺安鼎利混合型证券投资基金在规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

2026 年 08 月 31 日