

华夏鼎利债券型发起式证券投资基金

2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年四月二十二日

§1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏鼎利债券	
基金主代码	002459	
交易代码	002459	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 18 日	
报告期末基金份额总额	8,715,588,594.01 份	
投资目标	在有效控制风险的前提下，追求持续、稳定的收益。	
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、债券类属配置策略、久期管理策略、收益率曲线策略、信用债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略等。	
业绩比较基准	中债综合指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C
下属分级基金的交易代码	002459	002460
报告期末下	7,295,856,643.54 份	1,419,731,950.47 份

属分级基金 的份额总额		
----------------	--	--

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日)	
	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C
1.本期已实现收益	734,427,456.42	192,659,678.43
2.本期利润	146,910,988.45	46,608,072.66
3.加权平均基金份 额本期利润	0.0230	0.0291
4.期末基金资产净 值	11,344,332,910.62	2,197,722,278.78
5.期末基金份额净 值	1.5549	1.5480

注：①所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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

华夏鼎利债券A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.72%	0.44%	0.29%	0.04%	2.43%	0.40%

过去六个月	3.19%	0.41%	0.33%	0.05%	2.86%	0.36%
过去一年	16.87%	0.45%	-0.12%	0.07%	16.99%	0.38%
过去三年	24.64%	0.43%	5.45%	0.08%	19.19%	0.35%
过去五年	25.55%	0.41%	8.29%	0.07%	17.26%	0.34%
自基金合同生效起至今	100.63%	0.48%	9.23%	0.07%	91.40%	0.41%

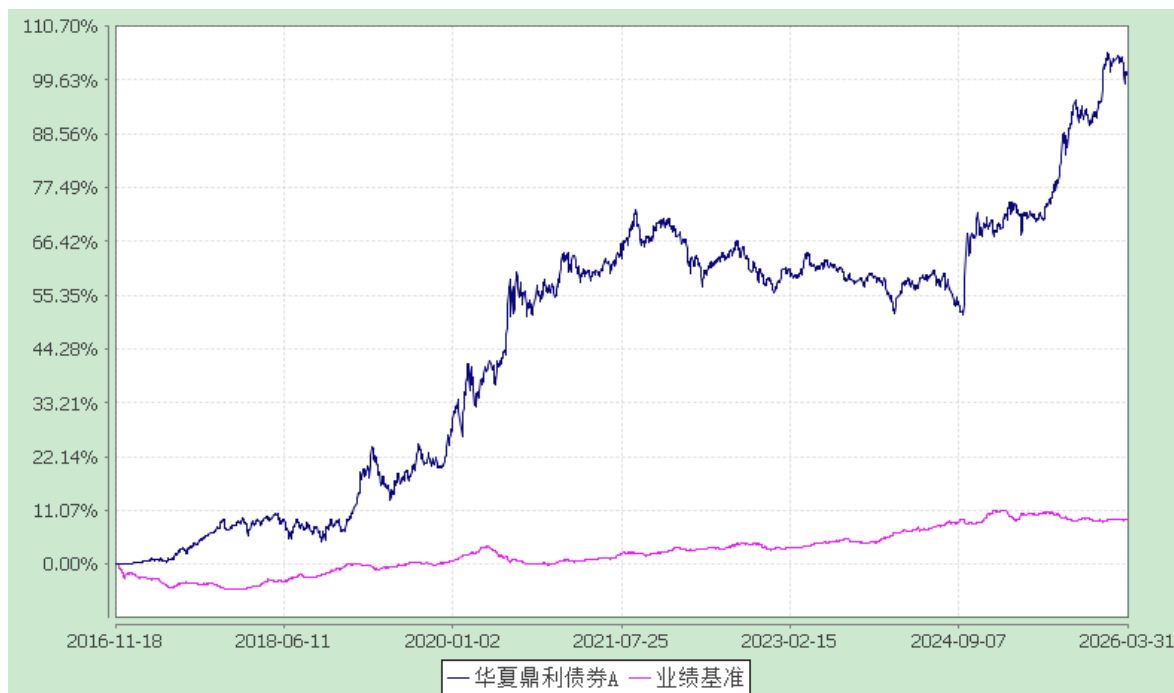
华夏鼎利债券C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.69%	0.44%	0.29%	0.04%	2.40%	0.40%
过去六个月	3.14%	0.41%	0.33%	0.05%	2.81%	0.36%
过去一年	16.76%	0.45%	-0.12%	0.07%	16.88%	0.38%
过去三年	24.29%	0.43%	5.45%	0.08%	18.84%	0.35%
过去五年	24.82%	0.41%	8.29%	0.07%	16.53%	0.34%
自基金合同生效起至今	98.50%	0.48%	9.23%	0.07%	89.27%	0.41%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎利债券型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016 年 11 月 18 日至 2026 年 3 月 31 日)

华夏鼎利债券 A:



华夏鼎利债券 C:



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

何家琪	本基金的基金经理	2016-11-18	2026-01-26	14 年	<p>硕士。2012 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任固定收益部研究员、基金经理助理、华夏新锦泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 5 月 25 日期间）、华夏新锦鸿灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 7 月 23 日期间）、华夏新起航灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 7 月 30 日期间）、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 12 月 17 日期间）、华夏永康添福混合型证券投资基金基金经理（2018 年 2 月 1 日至 2019 年 7 月 18 日期间）、华夏新锦程灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至</p>
-----	----------	------------	------------	------	---

					<p>2019年12月17日期间)、华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年9月28日至2020年3月12日期间)、华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年12月17日至2020年3月12日期间)、华夏新锦顺灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年12月17日至2020年3月12日期间)、华夏鼎略债券型证券投资基金基金经理(2019年1月25日至2020年3月12日期间)、华夏鼎顺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年8月6日至2020年5月7日期间)、华夏鼎福三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年9月21日至2020年5月7</p>
--	--	--	--	--	--

					日期间)、华夏鼎琪三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2019年7月24日至2021年1月27日期间)、华夏恒益18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(2019年9月4日至2021年1月27日期间)、华夏鼎润债券型证券投资基金基金经理(2021年3月19日至2022年4月25日期间)、华夏债券投资基金基金经理(2017年1月18日至2023年11月9日期间)、华夏希望债券型证券投资基金基金经理(2017年9月8日至2023年11月9日期间)等。
刘明宇	本基金的基金经理、公募固定收益投资总监、投委会成员	2026-01-26	-	17年	硕士。2009年6月加入华夏基金管理有限公司。历任机构债券投资部研究员、投资经理助理、投资经理、华夏鼎实债券型证券投资基金基金经理(2017年12月

					<p>19 日至 2018 年 3 月 14 日期间)、华夏鼎盛债券型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 19 日至 2019 年 1 月 7 日期间)、华夏稳定双利债券型证券投资基金基金经理 (2018 年 12 月 17 日至 2020 年 3 月 24 日期间)、华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 11 日至 2020 年 6 月 23 日期间)、华夏鼎隆债券型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 11 日至 2021 年 1 月 27 日期间)、华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 11 日至 2021 年 1 月 27 日期间)、华夏鼎瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 11 日至 2021 年 1 月 27 日期</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>间)、华夏鼎智债券型证券投资基金基金经理(2017年12月11日至2021年1月27日期间)、华夏鼎兴债券型证券投资基金基金经理(2018年2月12日至2021年1月27日期间)、华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理(2018年5月30日至2021年1月27日期间)、华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年5月30日至2021年1月27日期间)、华夏3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2018年7月30日至2021年1月27日期间)、华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>理（2018 年 10 月 11 日至 2021 年 1 月 27 日期间）、华夏鼎通债券型证券投资基金基金经理（2018 年 10 月 23 日至 2021 年 1 月 27 日期间）、华夏鼎康债券型证券投资基金基金经理（2019 年 1 月 24 日至 2021 年 1 月 27 日期间）、华夏鼎略债券型证券投资基金基金经理（2019 年 3 月 21 日至 2021 年 1 月 27 日期间）、华夏中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理（2019 年 4 月 25 日至 2021 年 1 月 27 日期间）、华夏恒融一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（2019 年 5 月 10 日至 2021 年 1 月 27 日期间）、华夏中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理（2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 27 日期间）、华夏恒利 3 个月定期开</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>放债券型证券投资基金基金经理（2019 年 11 月 29 日至 2021 年 1 月 27 日期间）、华夏鼎福三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2020 年 5 月 7 日至 2021 年 6 月 9 日期间）、华夏鼎顺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2020 年 5 月 7 日至 2021 年 6 月 9 日期间）、华夏稳福六个月持有期混合型证券投资基金基金经理（2021 年 12 月 21 日至 2023 年 3 月 21 日期间）、华夏稳健增利 4 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理（2021 年 5 月 19 日至 2023 年 8 月 23 日期间）、华夏稳鑫增利 80 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理（2021 年 12 月 13 日至 2023 年 8 月 23 日期间）、华夏</p>
--	--	--	--	--	--

					永利一年持有期混合型证券投资基金基金经理(2022 年 1 月 27 日至 2024 年 6 月 20 日期间)、华夏鼎昭利率债债券型证券投资基金基金经理(2024 年 2 月 6 日至 2025 年 2 月 24 日期间)、华夏永润六个月持有期混合型证券投资基金基金经理(2021 年 10 月 29 日至 2025 年 5 月 30 日期间)、华夏鼎淳债券型证券投资基金基金经理(2019 年 8 月 21 日至 2025 年 12 月 3 日期间)等。
孙蒙	本基金的基金经理	2026-01-26	-	12 年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 25 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债券方面，2026 年第一季度，宏观经济层面的高频数据依旧保持着较高的景气度，债券市场整体以区间震荡为主。在相对充裕的流动性环境支撑下，中短期利率债估值较去年年末有所下移。整个一季度，关键期限的国债利率大多在相对低位震荡运行，季末略有波动；长周期利率品种则出现一定上行，使得整条收益率曲线明显陡峭化，期限利差有所走阔。分月份看，1 月市场流动性平稳，叠加信贷相关预期有所调整，债市迎来修复行情，品种和久期层面均呈现轮动特征。2 月利率走势先抑后扬，配置型资金进场推动长端品种率先修复，随后部分获利了结盘出现，利率有所反弹。进入 3 月，受海外地缘冲突影响，大宗商品价格有所上行，通胀预期有所抬升，带动债市长短端明显分化：长端利率承压调整，而中短端在宽松资金面和配置需求支撑下表现相对稳健。整体来看，年初以来债券市场呈现出明显的结构特征：信用类资产整体表现好于利率类资产，侧重持有票息的策略效果优于主动拉长久期的策略，收益率曲线整体呈现陡峭化运行态势。

股票方面，一季度，国际方面，地缘冲突升级引发国际油价剧烈波动，全球经济复苏节奏受扰，主要经济体货币政策保持谨慎，降息预期持续延后。国内方面，作为“十五五”开局首季，面对国际环境跌宕起伏、外部风险外溢加剧、政策靠前发力，以及经济实现起步有力、开局良好的发展态势，生产较快增长，国内需求扩大，外贸增势良好，就业物价总体稳定，新动能加快成长。市场方面，A 股市场震荡调整，主题行情快速轮动。行业方面，煤炭、石油石化、公用事业等周期类行业表现较好，而非银金融、商贸零售、美容护理等行业表现较差。市场风格方面，小市值、高成长等因子表现较好，估值、盈利等因子表现较差，期间量化策略整体表现一般。

报告期内，本基金对债券资产配置了合理的仓位和久期，并根据市场情况进行了一定的波段操作。股票资产方面，以多因子量化投资策略为主，依据量化模型进行股票和可转债投资决策。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 3 月 31 日，华夏鼎利债券 A 基金份额净值为 1.5549 元，本报告期份额净值增长率为 2.72%；华夏鼎利债券 C 基金份额净值为 1.5480 元，本报告期份额净值增长率为 2.69%，同期业绩比较基准增长率为 0.29%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,605,547,133.40	16.42
	其中：股票	2,605,547,133.40	16.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,940,887,299.10	81.54
	其中：债券	12,940,887,299.10	81.54
	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	217,920,097.08	1.37
8	其他资产	105,743,562.84	0.67
9	合计	15,870,098,092.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	33,004,016.35	0.24
B	采矿业	280,634,006.46	2.07
C	制造业	1,420,283,895.07	10.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	75,616,268.00	0.56
E	建筑业	9,787,215.72	0.07
F	批发和零售业	26,625,434.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	141,274,357.64	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	140,239,036.35	1.04
J	金融业	337,395,529.57	2.49
K	房地产业	7,186,012.00	0.05
L	租赁和商务服务业	26,947,480.50	0.20
M	科学研究和技术服务业	42,214,143.74	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	18,778,113.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	287,140.00	0.00
Q	卫生和社会工作	11,877,526.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	33,396,959.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	2,605,547,133.40	19.24

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	126,500	49,707,150.00	0.37
2	601225	陕西煤业	1,322,000	33,829,980.00	0.25
3	601919	中远海控	2,100,200	31,524,002.00	0.23
4	601398	工商银行	3,896,200	29,766,968.00	0.22
5	601088	中国神华	597,400	27,928,450.00	0.21
6	000933	神火股份	815,700	25,123,560.00	0.19
7	601318	中国平安	427,000	24,245,060.00	0.18
8	601328	交通银行	3,343,360	23,403,520.00	0.17
9	601857	中国石油	1,856,600	22,631,954.00	0.17
10	601939	建设银行	2,178,900	21,026,385.00	0.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,264,381,375.42	9.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,759,347,296.99	35.14
	其中：政策性金融债	1,292,814,608.22	9.55
4	企业债券	2,586,946,279.80	19.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,775,586,332.08	20.50
7	可转债（可交换债）	1,554,626,014.81	11.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,940,887,299.10	95.56

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	250220	25 国开 20	8,600,000	862,542,536.99	6.37

2	092280086	22 农行永续债 02	4,100,000	426,380,207.67	3.15
3	092280083	22 建行永续债 01	4,000,000	416,335,671.23	3.07
4	2228023	22 中国银行永续债 01	3,500,000	369,782,000.00	2.73
5	232480033	24 建行二级资本债 02A	3,100,000	319,093,242.74	2.36

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中, 中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、国家开发银行、中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,341,270.23
2	应收证券清算款	20,853,962.86
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	83,548,329.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,743,562.84

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118010	洁特转债	15,807,292.89	0.12
2	118044	赛特转债	15,676,907.61	0.12
3	123196	正元转 02	15,657,568.65	0.12
4	127095	广泰转债	15,637,188.63	0.12
5	123171	共同转债	15,595,007.57	0.12
6	113062	常银转债	15,591,551.81	0.12
7	110097	天润转债	15,584,657.39	0.12
8	111009	盛泰转债	15,530,302.92	0.11
9	113624	正川转债	15,494,121.47	0.11
10	127044	蒙娜转债	15,478,947.10	0.11
11	113649	丰山转债	15,466,840.10	0.11
12	113052	兴业转债	15,465,098.41	0.11
13	123220	易瑞转债	15,462,164.85	0.11
14	123112	万讯转债	15,454,530.91	0.11
15	123180	浙矿转债	15,447,984.90	0.11
16	118041	星球转债	15,446,843.91	0.11
17	123198	金埔转债	15,443,632.62	0.11
18	118007	山石转债	15,436,787.28	0.11
19	127054	双箭转债	15,429,983.04	0.11
20	123193	海能转债	15,396,399.94	0.11
21	127093	章鼓转债	15,344,015.68	0.11

22	127047	帝欧转债	15,320,540.53	0.11
23	111015	东亚转债	15,311,898.08	0.11
24	113686	泰瑞转债	15,307,712.04	0.11
25	127068	顺博转债	15,297,072.31	0.11
26	127105	龙星转债	15,294,799.26	0.11
27	111018	华康转债	15,289,385.30	0.11
28	110086	精工转债	15,281,535.40	0.11
29	111005	富春转债	15,278,947.36	0.11
30	113665	汇通转债	15,276,580.78	0.11
31	123214	东宝转债	15,255,382.96	0.11
32	118032	建龙转债	15,248,400.98	0.11
33	113688	国检转债	15,235,374.67	0.11
34	127034	绿茵转债	15,225,204.52	0.11
35	127059	永东转 2	15,219,419.39	0.11
36	127053	豪美转债	15,218,949.67	0.11
37	123175	百畅转债	15,190,846.64	0.11
38	113654	永 02 转债	15,171,955.38	0.11
39	113674	华设转债	15,116,545.32	0.11
40	118036	力合转债	15,060,140.16	0.11
41	123165	回天转债	15,048,138.58	0.11
42	123142	申昊转债	14,970,899.65	0.11
43	113667	春 23 转债	14,959,291.12	0.11
44	111020	合顺转债	14,901,677.70	0.11
45	127040	国泰转债	14,849,572.71	0.11
46	118035	国力转债	14,812,017.11	0.11
47	123209	聚隆转债	14,724,028.16	0.11
48	123138	丝路转债	14,531,160.12	0.11
49	123173	恒锋转债	14,512,407.46	0.11
50	118052	浩瀚转债	14,400,558.77	0.11
51	118040	宏微转债	14,372,067.16	0.11
52	113058	友发转债	14,340,863.76	0.11
53	127055	精装转债	14,260,431.68	0.11
54	118006	阿拉转债	14,060,195.18	0.10
55	110098	南药转债	13,903,350.57	0.10
56	113681	镇洋转债	13,835,770.33	0.10
57	127056	中特转债	13,690,577.34	0.10
58	113070	渝水转债	13,461,779.95	0.10
59	113056	重银转债	13,182,410.02	0.10
60	113652	伟 22 转债	13,151,019.60	0.10
61	127062	垒知转债	13,095,610.76	0.10
62	123199	山河转债	12,970,974.54	0.10
63	113632	鹤 21 转债	12,888,520.78	0.10
64	127045	牧原转债	12,583,119.28	0.09

65	113640	苏利转债	12,574,918.36	0.09
66	123144	裕兴转债	12,440,050.46	0.09
67	127084	柳工转 2	12,244,481.59	0.09
68	123107	温氏转债	12,217,807.95	0.09
69	113647	禾丰转债	11,752,986.23	0.09
70	111004	明新转债	11,625,793.57	0.09
71	113636	甬金转债	11,391,169.24	0.08
72	123229	艾录转债	11,355,160.77	0.08
73	118039	煜邦转债	11,312,834.10	0.08
74	111021	奥锐转债	11,310,547.81	0.08
75	113625	江山转债	11,212,794.12	0.08
76	123195	蓝晓转 02	11,072,454.17	0.08
77	118015	芯海转债	10,921,264.17	0.08
78	118024	冠宇转债	10,671,378.33	0.08
79	113673	岱美转债	10,641,808.65	0.08
80	127104	姚记转债	9,490,344.15	0.07
81	113650	博 22 转债	9,315,036.17	0.07
82	127064	杭氧转债	9,259,278.82	0.07
83	127060	湘佳转债	9,144,378.24	0.07
84	127082	亚科转债	9,014,664.55	0.07
85	113658	密卫转债	8,420,195.26	0.06
86	113644	艾迪转债	8,381,154.86	0.06
87	127038	国微转债	8,376,051.22	0.06
88	123157	科蓝转债	8,375,336.71	0.06
89	118013	道通转债	8,075,240.84	0.06
90	123160	泰福转债	8,011,026.06	0.06
91	123194	百洋转债	7,847,929.60	0.06
92	123133	佩蒂转债	7,746,460.51	0.06
93	118030	睿创转债	7,719,681.58	0.06
94	127083	山路转债	7,715,662.60	0.06
95	113631	皖天转债	7,662,035.46	0.06
96	118012	微芯转债	7,578,925.77	0.06
97	127078	优彩转债	7,484,170.17	0.06
98	123237	佳禾转债	7,089,945.43	0.05
99	123236	家联转债	6,981,590.62	0.05
100	113670	金 23 转债	6,953,531.33	0.05
101	127092	运机转债	6,897,772.12	0.05
102	123168	惠云转债	6,686,638.99	0.05
103	113656	嘉诚转债	6,670,737.73	0.05
104	111003	聚合转债	6,642,693.68	0.05
105	123188	水羊转债	6,433,521.69	0.05
106	127102	浙建转债	6,425,344.83	0.05
107	123211	阳谷转债	6,242,220.69	0.05

108	123213	天源转债	6,241,490.55	0.05
109	111014	李子转债	6,189,585.76	0.05
110	113049	长汽转债	6,078,746.03	0.04
111	113680	丽岛转债	5,953,121.47	0.04
112	118011	银微转债	5,908,699.44	0.04
113	118003	华兴转债	5,844,411.25	0.04
114	123223	九典转 02	5,805,423.01	0.04
115	118025	奕瑞转债	5,731,174.67	0.04
116	123178	花园转债	5,671,758.50	0.04
117	118050	航宇转债	5,654,410.91	0.04
118	127085	韵达转债	5,469,407.50	0.04
119	123216	科顺转债	5,268,571.33	0.04
120	113693	志邦转债	5,075,480.27	0.04
121	111000	起帆转债	4,854,247.23	0.04
122	123235	亿田转债	4,811,396.35	0.04
123	113659	莱克转债	4,713,948.70	0.03
124	111001	山玻转债	4,526,303.95	0.03
125	123252	银邦转债	4,486,659.78	0.03
126	123207	冠中转债	4,385,347.08	0.03
127	127069	小熊转债	4,368,748.43	0.03
128	127049	希望转 2	4,260,031.54	0.03
129	118016	京源转债	4,157,618.89	0.03
130	113660	寿 22 转债	4,145,304.67	0.03
131	127031	洋丰转债	4,011,126.70	0.03
132	111010	立昂转债	3,969,167.55	0.03
133	123179	立高转债	3,941,890.82	0.03
134	127050	麒麟转债	3,802,315.20	0.03
135	113648	巨星转债	3,725,222.69	0.03
136	123253	永贵转债	3,688,869.81	0.03
137	118022	锂科转债	3,655,801.64	0.03
138	118037	上声转债	3,498,195.93	0.03
139	113692	保隆转债	3,366,849.07	0.02
140	123225	翔丰转债	3,240,160.68	0.02
141	110090	爱迪转债	3,187,852.72	0.02
142	123187	超达转债	3,181,122.60	0.02
143	123183	海顺转债	2,982,248.03	0.02
144	113627	太平转债	2,925,286.19	0.02
145	123151	康医转债	2,808,446.74	0.02
146	118051	皓元转债	2,795,385.31	0.02
147	113655	欧 22 转债	2,628,517.35	0.02
148	123245	集智转债	2,627,547.22	0.02
149	113067	燃 23 转债	2,604,792.73	0.02
150	113066	平煤转债	2,532,360.33	0.02

151	118049	汇成转债	2,494,131.36	0.02
152	127079	华亚转债	2,358,825.82	0.02
153	123109	昌红转债	2,331,720.00	0.02
154	118053	正帆转债	2,289,395.35	0.02
155	123113	仙乐转债	2,063,335.29	0.02
156	123247	万凯转债	1,842,215.03	0.01
157	111017	蓝天转债	1,828,248.76	0.01
158	123154	火星转债	1,780,829.23	0.01
159	123215	铭利转债	1,774,980.69	0.01
160	123124	晶瑞转 2	1,380,015.88	0.01
161	113666	爱玛转债	1,379,331.60	0.01
162	123122	富瀚转债	1,274,034.19	0.01
163	113682	益丰转债	1,260,121.51	0.01
164	123222	博俊转债	1,200,187.45	0.01
165	127090	兴瑞转债	1,101,800.86	0.01
166	123172	漱玉转债	525,011.31	0.00
167	110087	天业转债	498,797.85	0.00
168	127072	博实转债	126,006.05	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	35,045,100.00	0.26	非公开流通受限

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏鼎利债券A	华夏鼎利债券C
报告期期初基金份额总额	5,066,388,999.53	1,316,129,067.13
报告期期间基金总申购份额	4,828,125,707.11	1,057,209,230.46
减：报告期期间基金总赎回份额	2,598,658,063.10	953,606,347.12
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	7,295,856,643.54	1,419,731,950.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2019 年 11 月 18 日，华夏鼎利债券型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2026 年 1 月 28 日发布华夏基金管理有限公司关于调整华夏鼎利债券型发起式证券投资基金基金经理的公告。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人、首批浮动管理费基金管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇二六年四月二十二日