

华夏鼎利债券型发起式证券投资基金
2026 年第 2 季度报告
2026 年 6 月 30 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：二〇二六年七月二十一日

§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约定，于 2026 年 7 月 17 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 4 月 1 日起至 6 月 30 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	9,160,538,614.93 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
报告期末下属分级基金的份额总额	7,900,699,914.81 份	1,259,838,700.12 份

§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 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C
1.本期已实现收益	104,357,447.94	20,376,889.36
2.本期利润	174,829,789.31	32,251,179.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0215	0.0199
4.期末基金资产净值	12,479,436,464.49	1,980,638,353.13
5.期末基金份额净值	1.5795	1.5721

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 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	1.58%	0.30%	0.62%	0.04%	0.96%	0.26%
过去六个月	4.35%	0.37%	0.91%	0.04%	3.44%	0.33%
过去一年	17.15%	0.42%	-0.56%	0.06%	17.71%	0.36%
过去三年	26.06%	0.43%	5.12%	0.08%	20.94%	0.35%
过去五年	25.39%	0.41%	8.48%	0.07%	16.91%	0.34%
过去七年	74.26%	0.51%	10.29%	0.07%	63.97%	0.44%
自基金合同生 效起至今	103.80%	0.48%	9.91%	0.07%	93.89%	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	1.56%	0.30%	0.62%	0.04%	0.94%	0.26%
过去六个月	4.29%	0.37%	0.91%	0.04%	3.38%	0.33%
过去一年	17.02%	0.42%	-0.56%	0.06%	17.58%	0.36%
过去三年	25.67%	0.43%	5.12%	0.08%	20.55%	0.35%
过去五年	24.61%	0.41%	8.48%	0.07%	16.13%	0.34%
过去七年	72.83%	0.51%	10.29%	0.07%	62.54%	0.44%
自基金合同生 效起至今	101.59%	0.48%	9.91%	0.07%	91.68%	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历史走势对比图

（2016 年 11 月 18 日至 2026 年 6 月 30 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		

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 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 20 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 报告期内基金投资策略和运作分析

债券方面，2026 年二季度，国内债券市场整体呈现震荡偏强的慢牛走势，行情表现超出市场普遍预期。整体宽松的市场流动性、温和偏弱的宏观基本面，叠加市场资产配置需求偏紧的环境，共同支撑债市整体向好，市场利率整体下行。临近年中，受场内资金环境小幅收紧、机构获利了结操作影响，债市迎来阶段性回调修整。从品类表现来看，利率债本季度走强趋势显著，长周期品种行情表现优于短周期品种，推动债券收益率曲线逐步走平。信用债整体同样保持利率下行态势，其中中长期二级资本债凭借供需格局的优势，走出亮眼行情，板块韧性突出。从阶段走势拆分，二季度债市行情呈现明显的两段式特征：四五月份，外部地缘风险趋于缓和，国内经济基本面小幅走弱，叠加充裕的市场流动性，为债市上行提供了良好基础。随着短端债券交易热度趋于饱和，市场投资策略逐步从短久期向长久期切换，期限利差持续收窄，长债资产迎来一轮强势行情，创下年内行情高点。进入六月后，债市转入高位震荡格局。央行适度收紧流动性投放，扭转了市场此前过度宽松的资金预期，带动市场利率先抬升后回落，多空博弈愈发激烈，整体行情陷入反复拉锯的状态，市场整体走势趋于谨慎。

股票方面，2026 年二季度，国际方面，中东地缘冲突反复推动原油价格中枢上移，全球经济面临滞胀约束加大，主要经济体货币政策保持审慎，年内原有的降息预期已转变为加息预期。国内方面，受 AI 算力基建进程提速、输入性通胀和政策脉冲效应消退等多重因素影响，经济稳中向好但有所分化，就业物价水平总体稳定，新质生产力加速壮大，高端制造出口延续景气，而内需消费和地产基建等传统动能偏弱。市场方面，在中东冲突风险边界确立和 AI 硬件业绩超预期上修影响下，市场回归 Risk on 模式，主线聚焦以 AI 算力为代表的科技产业，期间地缘冲突和流动性波动对市场造成若干次扰动，但并未改变科技板块上升趋势。电子、通信、建筑材料、机械设备等行业涨幅靠前，农林牧渔、石油石化等行业表现较差。成长风格相对价值风格的超额收益显著扩大，甚至出现科技成长对传统价值的资金虹吸现象，期间量化策略表现一般。

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。对于股票资产，本基金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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，华夏鼎利债券 A 基金份额净值为 1.5795 元，本报告期份额净值增长率为 1.58%；华夏鼎利债券 C 基金份额净值为 1.5721 元，本报告期份额净值增长率为 1.56%，同期业绩比较基准增长率为 0.62%。

4.6 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	2,836,791,369.19	16.59
	其中：股票	2,836,791,369.19	16.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,738,041,797.90	80.36
	其中：债券	13,738,041,797.90	80.36
	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	312,410,900.05	1.83
8	其他各项资产	209,400,027.81	1.22
9	合计	17,096,644,094.95	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	15,555,295.40	0.11
B	采矿业	237,451,517.67	1.64
C	制造业	1,759,149,384.56	12.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,707,218.00	0.15
E	建筑业	29,651,644.00	0.21
F	批发和零售业	48,532,216.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	127,629,295.03	0.88

H	住宿和餐饮业	4,979,088.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	150,471,075.35	1.04
J	金融业	277,717,220.98	1.92
K	房地产业	15,130,047.00	0.10
L	租赁和商务服务业	46,193,943.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	29,642,161.60	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	47,556,853.60	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,283,592.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,143,837.00	0.16
S	综合	996,980.00	0.01
	合计	2,836,791,369.19	19.62

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	688498	源杰科技	25,100	47,338,600.00	0.33
2	601857	中国石油	3,247,700	28,190,036.00	0.19
3	300604	长川科技	79,900	27,279,458.00	0.19
4	601398	工商银行	3,572,600	25,258,282.00	0.17
5	002281	光迅科技	92,100	23,664,174.00	0.16
6	601988	中国银行	3,908,800	22,358,336.00	0.15
7	601869	长飞光纤	40,800	22,272,720.00	0.15
8	301377	鼎泰高科	39,800	21,925,820.00	0.15
9	601699	潞安环能	1,450,900	20,718,852.00	0.14
10	601225	陕西煤业	971,800	19,776,130.00	0.14

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	1,706,830,084.17	11.80

2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,812,888,116.17	33.28
	其中：政策性金融债	1,317,186,575.35	9.11
4	企业债券	2,565,960,100.01	17.75
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,969,127,474.53	20.53
7	可转债（可交换债）	1,683,236,023.02	11.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,738,041,797.90	95.01

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	879,108,021.92	6.08
2	242680002	26 招商银行永续债 01	5,000,000	505,452,328.77	3.50
3	092280086	22 农行永续债 02	4,100,000	428,521,486.03	2.96
4	019835	26 国债 09	4,100,000	410,674,758.89	2.84
5	232480033	24 建行二级资本债 02A	3,100,000	321,730,688.77	2.22

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，招商银行股份有限公司、中国农业发展银行、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约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,252,259.48
2	应收证券清算款	195,991,776.65
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,155,991.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209,400,027.81

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	118035	国力转债	18,110,689.97	0.13
2	118011	银微转债	17,515,768.58	0.12
3	118042	奥维转债	17,011,727.00	0.12

4	123133	佩蒂转债	16,969,229.92	0.12
5	113680	丽岛转债	16,888,041.71	0.12
6	127068	顺博转债	16,844,925.85	0.12
7	127095	广泰转债	16,839,968.05	0.12
8	118052	浩瀚转债	16,832,814.22	0.12
9	118032	建龙转债	16,766,796.56	0.12
10	123131	奥飞转债	16,744,993.49	0.12
11	127088	赫达转债	16,737,356.78	0.12
12	123225	翔丰转债	16,722,999.78	0.12
13	118037	上声转债	16,711,571.77	0.12
14	113681	镇洋转债	16,658,705.04	0.12
15	123220	易瑞转债	16,655,941.91	0.12
16	127054	双箭转债	16,642,797.07	0.12
17	118007	山石转债	16,629,031.80	0.11
18	123196	正元转 02	16,627,389.73	0.11
19	123192	科思转债	16,613,875.28	0.11
20	123180	浙矿转债	16,609,012.03	0.11
21	123193	海能转债	16,598,197.98	0.11
22	127062	垒知转债	16,596,608.63	0.11
23	111009	盛泰转债	16,594,388.89	0.11
24	123199	山河转债	16,593,288.07	0.11
25	123214	东宝转债	16,553,940.20	0.11
26	111004	明新转债	16,546,111.82	0.11
27	113062	常银转债	16,542,774.78	0.11
28	123168	惠云转债	16,513,866.60	0.11
29	110097	天润转债	16,512,411.68	0.11
30	127078	优彩转债	16,511,402.09	0.11
31	111014	李子转债	16,509,371.50	0.11
32	127053	豪美转债	16,497,552.05	0.11
33	127056	中特转债	16,484,083.30	0.11

34	123224	宇邦转债	16,478,068.90	0.11
35	113649	丰山转债	16,455,771.88	0.11
36	113646	永吉转债	16,455,481.07	0.11
37	123229	艾录转债	16,385,451.80	0.11
38	123215	铭利转债	16,325,427.48	0.11
39	113056	重银转债	16,323,383.54	0.11
40	111022	锡振转债	16,308,625.31	0.11
41	123237	佳禾转债	16,269,230.51	0.11
42	113686	泰瑞转债	16,269,163.96	0.11
43	113665	汇通转债	16,251,642.63	0.11
44	127082	亚科转债	16,251,083.00	0.11
45	123138	丝路转债	16,237,705.58	0.11
46	123150	九强转债	16,097,285.94	0.11
47	123195	蓝晓转 02	16,015,019.19	0.11
48	118012	微芯转债	15,991,523.93	0.11
49	110086	精工转债	15,947,181.62	0.11
50	113647	禾丰转债	15,930,085.17	0.11
51	127059	永东转 2	15,752,524.08	0.11
52	113674	华设转债	15,716,294.70	0.11
53	113631	皖天转债	15,468,478.77	0.11
54	118044	赛特转债	15,421,304.81	0.11
55	123209	聚隆转债	15,325,079.39	0.11
56	111003	聚合转债	15,250,513.05	0.11
57	123151	康医转债	15,150,562.84	0.10
58	118022	锂科转债	15,125,199.52	0.10
59	113070	渝水转债	15,060,473.31	0.10
60	110090	爱迪转债	14,993,333.57	0.10
61	113671	武进转债	14,840,632.95	0.10
62	127044	蒙娜转债	14,633,638.25	0.10
63	111020	合顺转债	14,464,744.06	0.10

64	113695	华辰转债	14,382,739.59	0.10
65	118013	道通转债	14,231,482.84	0.10
66	127110	广核转债	13,974,314.89	0.10
67	113670	金 23 转债	13,711,481.42	0.09
68	127099	盛航转债	13,467,017.33	0.09
69	111021	奥锐转债	13,255,356.33	0.09
70	113692	保隆转债	13,127,658.04	0.09
71	113636	甬金转债	13,113,767.39	0.09
72	123188	水羊转债	13,021,550.18	0.09
73	123165	回天转债	13,015,659.50	0.09
74	118050	航宇转债	12,573,095.03	0.09
75	113627	太平转债	12,529,830.36	0.09
76	127040	国泰转债	12,517,594.26	0.09
77	113640	苏利转债	12,477,871.52	0.09
78	127085	韵达转债	12,437,571.37	0.09
79	111018	华康转债	12,189,202.52	0.08
80	113656	嘉诚转债	11,513,124.97	0.08
81	113679	芯能转债	11,436,478.28	0.08
82	123183	海顺转债	11,346,513.14	0.08
83	127047	帝欧转债	10,924,000.90	0.08
84	123171	共同转债	10,906,532.89	0.08
85	113693	志邦转债	10,699,355.31	0.07
86	118040	宏微转债	10,537,154.09	0.07
87	113661	福 22 转债	10,187,939.28	0.07
88	113694	清源转债	10,085,323.16	0.07
89	123252	银邦转债	9,676,828.78	0.07
90	113058	友发转债	9,647,446.20	0.07
91	127069	小熊转债	9,624,066.21	0.07
92	127104	姚记转债	9,340,112.22	0.06
93	113052	兴业转债	9,308,288.63	0.06

94	113660	寿 22 转债	9,042,599.21	0.06
95	123158	宙邦转债	8,701,424.00	0.06
96	113696	伯 25 转债	8,680,100.00	0.06
97	118039	煜邦转债	8,622,146.01	0.06
98	123122	富瀚转债	8,620,389.22	0.06
99	111002	特纸转债	8,537,104.00	0.06
100	123211	阳谷转债	8,381,816.48	0.06
101	123179	立高转债	8,239,415.29	0.06
102	127103	东南转债	8,236,043.34	0.06
103	110087	天业转债	8,225,095.54	0.06
104	123222	博俊转债	8,219,657.68	0.06
105	113658	密卫转债	8,199,328.84	0.06
106	123216	科顺转债	8,180,152.23	0.06
107	113652	伟 22 转债	8,013,788.56	0.06
108	113659	莱克转债	7,999,412.05	0.06
109	127045	牧原转债	7,999,173.57	0.06
110	127060	湘佳转债	7,911,026.64	0.05
111	127083	山路转债	7,820,842.56	0.05
112	111015	东亚转债	7,544,367.08	0.05
113	113067	燃 23 转债	7,029,721.01	0.05
114	123223	九典转 02	6,647,148.76	0.05
115	123160	泰福转债	6,610,710.15	0.05
116	123142	申昊转债	6,471,109.34	0.04
117	123253	永贵转债	6,363,893.69	0.04
118	127102	浙建转债	6,229,532.90	0.04
119	118051	皓元转债	6,200,162.07	0.04
120	127064	杭氧转债	5,900,614.54	0.04
121	123257	安克转债	5,871,718.93	0.04
122	127049	希望转 2	5,641,518.08	0.04
123	113655	欧 22 转债	4,979,930.98	0.03

124	127067	恒逸转 2	4,880,151.36	0.03
125	123157	科蓝转债	4,538,733.51	0.03
126	113673	岱美转债	4,431,016.43	0.03
127	123155	中陆转债	4,371,249.11	0.03
128	110093	神马转债	3,946,872.85	0.03
129	113066	平煤转债	3,847,313.58	0.03
130	127084	柳工转 2	3,521,518.84	0.02
131	127061	美锦转债	3,437,330.29	0.02
132	113638	台 21 转债	3,404,041.68	0.02
133	123144	裕兴转债	3,364,074.99	0.02
134	118010	洁特转债	3,284,758.70	0.02
135	127072	博实转债	3,208,820.36	0.02
136	113691	和邦转债	2,692,305.20	0.02
137	123173	恒锋转债	2,676,379.15	0.02
138	123117	健帆转债	2,613,731.50	0.02
139	113650	博 22 转债	2,371,872.60	0.02
140	110084	贵燃转债	2,302,925.89	0.02
141	123247	万凯转债	2,240,536.91	0.02
142	118005	天奈转债	1,947,776.46	0.01
143	127092	运机转债	1,912,322.05	0.01
144	118053	正帆转债	1,825,348.82	0.01
145	111017	蓝天转债	1,634,301.11	0.01
146	110098	南药转债	1,568,796.44	0.01
147	123213	天源转债	1,299,209.46	0.01
148	123235	亿田转债	1,192,915.87	0.01
149	123250	嘉益转债	1,184,395.50	0.01
150	123194	百洋转债	1,084,891.18	0.01
151	118016	京源转债	897,534.67	0.01
152	127050	麒麟转债	825,622.43	0.01
153	123207	冠中转债	734,782.51	0.01

154	123187	超达转债	232,649.25	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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	7,295,856,643.54	1,419,731,950.47
报告期期间基金总申购份额	3,188,200,002.29	1,125,134,253.29
减：报告期期间基金总赎回份额	2,583,356,731.02	1,285,027,503.64
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	7,900,699,914.81	1,259,838,700.12

§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

本基金本报告期无需要披露的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 6 月 26 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2026 年 6 月 26 日发布华夏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。

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、首批公募 REITs 指数基金管理人，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

二〇二六年七月二十一日