

华夏鼎利债券型发起式证券投资基金
2026 年中期报告
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

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	20
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	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	22
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
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	22
§5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
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	23
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	23
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	23
6.1 资产负债表	23
6.2 利润表	25
6.3 净资产变动表	26
6.4 报表附注	27
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	65
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	65
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	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 本报告期投资基金情况	65
7.13 投资组合报告附注	65

§8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	72
§9 开放式基金份额变动	72
§10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4 基金投资策略的改变	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
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	73
10.8 其他重大事件	75
§11 影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
§12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	76
12.3 查阅方式	76

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏鼎利债券型发起式证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	9,160,538,614.93 份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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。

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		华夏基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	滕菲菲
	联系电话	400-818-6666	400-680-0000
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-818-6666	95558
传真		010-63136700	010-85230024

注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址	北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	100101	100020
法定代表人	邹迎光	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5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1月1日-2026年6月30日）	
	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C
本期已实现收益	838,784,904.36	213,036,567.79
本期利润	321,740,777.76	78,859,252.49
加权平均基金份额本期利润	0.0441	0.0489
本期加权平均净值利润率	2.80%	3.11%
本期基金份额净值增长率	4.35%	4.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C
期末可供分配利润	1,977,534,880.75	307,788,700.88
期末可供分配基金份额利润	0.2503	0.2443
期末基金资产净值	12,479,436,464.49	1,980,638,353.13
期末基金份额净值	1.5795	1.5721

3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C
基金份额累计净值增长率	103.80%	101.59%

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期末可供分配利润为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

华夏鼎利债券 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	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	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	1.56%	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%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

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

华夏鼎利债券型发起式证券投资基金
份额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

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、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。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,形成了覆盖宽基指数、港股(QDII)指数、港股(港股通)指数、行业主题指数、策略指数、跨境指数、固收指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》,截至 2026 年 6 月 30 日,华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名靠前(基金排名不作为产品未来表现的保证):

主动权益产品:在混合型 FOF(权益资产 30%-60%)(A 类)中,华夏聚源优选三个月持有混合(FOF)(A 类)排名第 1/25;在低碳环保行业股票型基金(A 类)中,华夏节能环保股票(A 类)排名第 1/10;在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中,华夏数字产业混合(A 类)排名第 2/64;在低碳环保偏股型基金(A 类)中,华夏低碳经济一年持有混合(A 类)排名第 3/32;在债券型 FOF(A 类)中,华夏聚源优选六个月持有债券(FOF)(A 类)排名第 3/24;在养老目标日期 FOF(2045)(A 类)中,华夏养老 2045 三年持有混合(FOF)(A 类)排名第 3/18;在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中,华夏养老 2050 五年持有混合(FOF)(A 类)排名第 3/15;在 QDII 混合基金(A 类)中,华夏移动互联混合(QDII)排名第 3/56、华夏新时代混合(QDII)排名第 5/56、华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 7/56;在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中,华夏成长混合排名第 13/149;在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中,华夏乐享健康混合(A 类)排名第 15/89;在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中,

华夏线上经济主题精选混合排名第 25/220；在标准股票型基金(A 类)中，华夏创新前沿股票(A 类)排名第 43/354、华夏领先股票排名第 49/354、华夏经济转型股票排名第 57/354、华夏潜龙精选股票排名第 66/354；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中，华夏磐晟混合（LOF）排名第 35/397、华夏新锦程混合(A 类)排名第 62/397、华夏稳增混合排名第 79/397；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中，华夏高端制造混合(A 类)排名第 36/478；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 23/1941、华夏科技创新混合(A 类)排名第 78/1941、华夏成长先锋一年持有混合(A 类)排名第 116/1941、华夏核心科技 6 个月定开混合(A 类)排名第 191/1941、华夏产业升级混合(A 类)排名第 212/1941、华夏国企创新混合发起式（A 类）排名第 249/1941、华夏成长机会一年持有混合排名第 268/1941、华夏创业板两年定开混合排名第 276/1941、华夏盛世混合排名第 292/1941、华夏创新驱动混合(A 类)排名第 365/1941、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 372/1941、华夏行业景气混合(A 类)排名第 374/1941。

固收与固收+产品：在可转换债券型基金(A 类)中，华夏可转债增强债券 A 排名第 1/38；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏双债债券 A 排名第 1/280、华夏聚利债券 A 排名第 4/280、华夏债券 AB 排名第 74/280；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中，华夏永康添福混合 A 排名第 2/307、华夏兴源稳健一年持有混合 A 排名第 17/307、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 31/307；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏安益短债债券 A 排名第 7/133、华夏 30 天滚动短债债券发起式 A 排名第 8/133；在利率债纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎昭利率债债券 A 排名第 7/98；在普通债券型基金(二级)(A 类)中，华夏鼎沛债券 A 排名第 10/540、华夏鼎清债券 A 排名第 12/540、华夏鼎利债券 A 排名第 47/540；在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中，华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 17/245、华夏永泓一年持有混合 A 排名第 28/245；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎富债券 A 排名第 61/1041、华夏鼎航债券 A 排名第 67/1041、华夏鼎信债券 A 排名第 115/1041、华夏纯债债券 A 排名第 234/1041、华夏鼎茂债券 A 排名第 268/1041；在标准偏债型基金(股票上下限 10%-30%)(A 类)中，华夏稳进增益一年持有混合 A 排名第 11/71。

在客户服务方面，2026 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端优化基金详情展示，增强信息可读性，从客户投资需求出发，进一步提升使用体验；（2）与国贸期货、新华信通等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（3）开展“未来，我们继续一起走过”、“选择难度大？给你支个招”、“当前科技股的三国博弈”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

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		
何家琪	本基金的基金经理	2016-11-18	2026-01-26	14 年	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 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 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。
孙蒙	本基金的基金经理、投委会成员	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。
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 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。
叶津佐	本基金的基金经理助理	2026-01-23	-	9 年	博士。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究员、基金经理助理。
尚吉	本基金的基金经理助理	2026-01-23	-	20 年	硕士。2006 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任投资研究部研究员。

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 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

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，本基金管理人严格执行了《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 45 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 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

债券方面，2026 年上半年，国内债券市场整体呈现超预期的偏强震荡慢牛格局，行情结构性特征十分显著：短端利率下行态势突出，长端收益率整体震荡下移，信用利差持续收窄，收益率曲线阶段性走出陡峭化行情。本轮债市走强，依托于宽裕的市场流动性、经济基本面温和偏弱以及持续的资产荒环境，带动全市场收益率整体下行。步入年中，受资金面边际收紧、机构止盈兑现行为影响，市场出现阶段性回调。细分品类表现来看，利率债上半年走势偏强，长端品种行情更占优势，收益率曲线整体陡峭化运行。其中长端国债持续低位运行，年内多次触及阶段低位；信用债同步跟随大势走暖，在资产荒延续的背景下，高等级品种利差持续压缩，短端信用利差不断下探；银行二级资本债依托较好的供需结构，行情韧性十足，表现相对强势。阶段行情节奏拆分来看：年初 1-2 月市场维持高位震荡走势。前期经济基本面景气度相对偏高，叠加政府债供给扩容预期、权益市场回暖，对长端利率形成明显压制，而短端受益于宽松资金面保持稳定，曲线短暂走陡后逐步回归平稳；3-5 月市场进入典型慢牛行情。经济修复力度偏弱、资金利率持续低位运行，叠加非银增量资金持续入场，推动长端利率持续走低，市场做多情绪集中释放；6 月市场再度切换为高位震荡模式。资金环境出现边际收敛，收益率短暂反弹后再度回落，市场多空博弈明显升温，长端利率在低位区间反复拉锯。

股票方面，2026 年上半年，全球经济在地缘冲突扰动和 AI 基建加速两条主线影响下呈现 K 型分化。油价先扬后抑、上半年中枢较去年四季度整体上移，叠加地缘风险溢价，推高全球通胀压力并影响传统经济复苏；AI Agent 驱动下 AI 产业链投资构建增长核心动能。主要经济体受供给冲击和需求韧性差异表现分化，货币政策由前期宽松转向“按兵不动+紧缩预期”并明显分化。国内方面，“十五五”开局之年延续高质量发展趋势，上半年保持一定增长韧性，物价呈结构性复苏，输入型通胀特征显现；货币政策保持适度宽松，但 M2、社融增速边际回落；总体供强需弱矛盾突出，经济向好基础仍需巩固。市场方面，2026 年上半年 A 股在科技主线引领下延续宽幅震荡上行，呈现标准 K 型结构性牛市特征，指数分层显著。行业层面极致割裂，31 个申万一级行业仅约 10 个上涨，电子、通信、建筑材料、机械设备等 AI 相关行业领涨，而商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料、医药生物等消费医药内需行业表现落后。市场风格方面，受成长板块基本面优势领先、AI/算力产业链远期景气预期上修及流动性宽松环境等因素影响，成长风格相对价值风格的超额收益极为突出，期间量化策略整体表现出现分化。

报告期内，债券方面，本基金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。股票方面，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。

4.4.2 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 4.35%；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 4.29%，同期业绩比较基准增长率为 0.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，债市方面，行情核心逻辑将切换为基本面定价叠加赔率博弈，整体延续震荡偏强趋势。伴随财政刺激力度逐步退坡，后续经济基本面大概率延续弱势修复态势，为债券收益率下行提供基本面支撑，收益率中枢仍存在小幅下移空间。但目前利率整体处于低位，下行赔率相对有限，叠加稳增长政策预期反复、机构交易行为扰动，市场难以走出单边下行行情，整体将以宽幅震荡为主。股票方面，科技板块继续大幅上涨的可能性较小，市场较大可能迎来行业或者风格上的再平衡。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对华夏鼎利债券型发起式证券投资基金报告期的投资运作，

进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在华夏鼎利债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏鼎利债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	110,811,887.51	54,895,826.08
结算备付金		201,599,012.54	23,076,371.03
存出保证金		1,252,259.48	785,655.02
交易性金融资产	6.4.7.2	16,574,833,167.09	10,226,526,993.33
其中：股票投资		2,836,791,369.19	1,918,183,283.11
基金投资		-	-
债券投资		13,738,041,797.90	8,308,343,710.22
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	-	76,984,093.70
应收清算款		195,991,776.65	115,619,882.88
应收股利		-	-
应收申购款		12,155,991.68	26,530,626.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		17,096,644,094.95	10,524,419,449.00
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 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		2,460,000,000.00	670,959,618.23
应付清算款		2,926,908.87	38,685,013.40
应付赎回款		159,111,358.90	154,053,151.04
应付管理人报酬		7,779,220.83	4,858,967.94
应付托管费		1,296,536.79	809,828.00
应付销售服务费		195,876.64	172,662.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		506,642.09	224,557.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	4,752,733.21	1,495,225.08
负债合计		2,636,569,277.33	871,259,023.75
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	9,160,538,614.93	6,382,518,066.66
未分配利润	6.4.7.8	5,299,536,202.69	3,270,642,358.59
净资产合计		14,460,074,817.62	9,653,160,425.25
负债和净资产总计		17,096,644,094.95	10,524,419,449.00

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，华夏鼎利债券 A 基金份额净值 1.5795 元，华夏鼎利债券 C 基金份额净值 1.5721 元；华夏鼎利债券基金份额总额 9,160,538,614.93 份（其中 A 类 7,900,699,914.81 份，C 类 1,259,838,700.12 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏鼎利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		461,065,234.65	122,668,844.36
1.利息收入		1,067,007.07	463,334.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,023,844.42	288,874.88
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		43,162.65	174,459.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,109,476,135.10	163,160,139.37
其中：股票投资收益	6.4.7.1 0	584,850,170.74	51,281,144.92
基金投资收益	6.4.7.1 1	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	497,255,958.94	108,797,781.69
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	-	-
股利收益	6.4.7.1 6	27,370,005.42	3,081,212.76
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-651,221,441.90	-41,961,117.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	1,743,534.38	1,006,488.45
减：二、营业总支出		60,465,204.40	23,710,376.30
1.管理人报酬		41,648,966.68	13,824,010.54
2.托管费		6,941,494.46	2,304,001.69
3.销售服务费		1,260,435.07	233,804.85
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		10,228,204.31	7,057,423.90
其中：卖出回购金融资产支出		10,228,204.31	7,057,423.90
6.信用减值损失	6.4.7.2 0	-	-
7.税金及附加		256,146.10	169,616.26
8.其他费用	6.4.7.2 1	129,957.78	121,519.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		400,600,030.25	98,958,468.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		400,600,030.25	98,958,468.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		400,600,030.25	98,958,468.06

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏鼎利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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	6,382,518,066.66	3,270,642,358.59	9,653,160,425.25
二、本期期初净资产	6,382,518,066.66	3,270,642,358.59	9,653,160,425.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,778,020,548.27	2,028,893,844.10	4,806,914,392.37
（一）、综合收益总额	-	400,600,030.25	400,600,030.25
（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	2,778,020,548.27	1,628,293,813.85	4,406,314,362.12

填列)			
其中：1.基金申购款	10,198,669,193.15	5,881,301,299.20	16,079,970,492.35
2.基金赎回款	-7,420,648,644.88	-4,253,007,485.35	-11,673,656,130.23
(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	9,160,538,614.93	5,299,536,202.69	14,460,074,817.62
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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	4,408,664,050.96	1,391,102,010.85	5,799,766,061.81
二、本期期初净资产	4,408,664,050.96	1,391,102,010.85	5,799,766,061.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,230,012,815.80	-285,633,742.98	-1,515,646,558.78
(一)、综合收益总额	-	98,958,468.06	98,958,468.06
(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)	-1,230,012,815.80	-384,592,211.04	-1,614,605,026.84
其中：1.基金申购款	2,194,512,412.97	712,114,744.40	2,906,627,157.37
2.基金赎回款	-3,424,525,228.77	-1,096,706,955.44	-4,521,232,184.21
(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	3,178,651,235.16	1,105,468,267.87	4,284,119,503.03

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：

基金管理人负责人：邹迎光，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏鼎利债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]265 号《关于准予华夏鼎利债券型发起式证券投资基金注册的批复》及机构部函[2016]2503 号《关于华夏鼎利债券型发起式证券投资基金延期募集备案的回函》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏鼎利债券型发起式证券投资基金基金

合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2016 年 11 月 14 日至 2016 年 11 月 15 日共募集 11,427,091.31 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2016）验字第 60739337_A01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏鼎利债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 11,429,132.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,041.08 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏鼎利债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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（含存托凭证）、债券、货币市场工具、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相关规定）。本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债和公司债（含中小企业私募债券）、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、债券回购、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

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颁布和修订的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、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》编制，同时在信息披露方面也参考了中国证监会、中国基金业协会发布的基金行业实务操作的其他有关规定。

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本报告期末的财务状况以及本报告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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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《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[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《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交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税。

(2) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；对证券投资基金从证券市场中取得的买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(3) 存款利息收入不征收增值税。

(4) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。

(5) 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，继续免征增值税直至债券到期。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，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。对基金通过沪港通/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/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。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 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。基金通过沪港通/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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 6 月 30 日
活期存款	110,811,887.51
等于：本金	110,754,210.75
加：应计利息	57,676.76
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	110,811,887.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,883,730,357.33	-	2,836,791,369.19	-46,938,988.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,302,815,419.30	37,142,495.73	5,268,371,125.77	-71,586,789.26
	银行间市场	8,316,359,700.19	90,051,672.13	8,469,670,672.13	63,259,299.81
	合计	13,619,175,119.49	127,194,167.86	13,738,041,797.90	-8,327,489.45
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		16,502,905,476.82	127,194,167.86	16,574,833,167.09	-55,266,477.59

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

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,596,292.91
其中：交易所市场	4,564,765.45
银行间市场	31,527.46
应付利息	-
预提费用	156,440.30
合计	4,752,733.21

6.4.7.7 实收基金

华夏鼎利债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,066,388,999.53	5,066,388,999.53
本期申购	8,016,325,709.40	8,016,325,709.40
本期赎回（以“-”号填列）	-5,182,014,794.12	-5,182,014,794.12
本期末	7,900,699,914.81	7,900,699,914.81

华夏鼎利债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,316,129,067.13	1,316,129,067.13
本期申购	2,182,343,483.75	2,182,343,483.75
本期赎回（以“-”号填列）	-2,238,633,850.76	-2,238,633,850.76
本期末	1,259,838,700.12	1,259,838,700.12

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 未分配利润

华夏鼎利债券 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	574,822,823.94	2,028,028,820.31	2,602,851,644.25
本期期初	574,822,823.94	2,028,028,820.31	2,602,851,644.25
本期利润	838,784,904.36	-517,044,126.60	321,740,777.76
本期基金份额交易产生的变动数	563,927,152.45	1,090,216,975.22	1,654,144,127.67
其中：基金申购款	1,699,517,808.94	2,935,113,348.25	4,634,631,157.19
基金赎回款	-1,135,590,656.49	-1,844,896,373.03	-2,980,487,029.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,977,534,880.75	2,601,201,668.93	4,578,736,549.68

华夏鼎利债券 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	143,218,431.06	524,572,283.28	667,790,714.34
本期期初	143,218,431.06	524,572,283.28	667,790,714.34
本期利润	213,036,567.79	-134,177,315.30	78,859,252.49
本期基金份额交易产生的变动数	-48,466,297.97	22,615,984.15	-25,850,313.82
其中：基金申购款	449,016,547.14	797,653,594.87	1,246,670,142.01
基金赎回款	-497,482,845.11	-775,037,610.72	-1,272,520,455.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	307,788,700.88	413,010,952.13	720,799,653.01

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	582,931.61
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	188,278.09

其他	252,634.72
合计	1,023,844.42

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,273,677,927.64
减：卖出股票成本总额	10,677,132,132.39
减：交易费用	11,695,624.51
买卖股票差价收入	584,850,170.74

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	132,228,509.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	365,027,449.25
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	497,255,958.94

6.4.7.12.2 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1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,359,599,840.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,941,164,942.23
减：应计利息总额	53,006,672.01
减：交易费用	400,776.66
买卖债券差价收入	365,027,449.25

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	27,370,005.42
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	27,370,005.42

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-651,221,441.90
——股票投资	-431,664,543.28
——债券投资	-219,556,898.62
——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	-651,221,441.90
----	-----------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,743,534.38
合计	1,743,534.38

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	32,132.93
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	19,717.48
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	129,957.78

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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

本基金本报告期不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。

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
中信证券华南股份有限公司（“中信证券（华南）”）	基金管理人第一大股东的子公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人第一大股东的子公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	10,965,802,601.77	47.06%	1,682,456,212.81	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	3,785,215,961.40	37.26%	1,667,676,462.06	98.23%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	78,966,000,000.00	52.11%	28,634,097,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	2,148,244.84	47.06%	2,148,244.84	47.06%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	750,197.64	100.00%	750,197.64	73.44%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	41,648,966.68	13,824,010.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,453,102.94	1,566,357.30
应支付基金管理人的净管理费	36,195,863.74	12,257,653.24

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30 日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,941,494.46	2,304,001.69

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

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1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	562,944.33	562,944.33
中信银行	-	35,239.62	35,239.62
华夏财富	-	2,481.03	2,481.03
中信证券	-	345.20	345.20
中信证券（山东）	-	23.76	23.76
中信证券（华南）	-	1.29	1.29
合计	-	601,035.23	601,035.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	66,394.88	66,394.88
华夏财富	-	1,816.65	1,816.65
中信银行	-	1,475.35	1,475.35
中信证券	-	167.49	167.49

中信证券（华南）	-	64.98	64.98
中信证券（山东）	-	7.24	7.24
合计	-	69,926.59	69,926.59

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 年费率 / 当年天数。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行活期存款	110,811,887.51	582,931.61	5,904,454.33	177,687.07

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	001248	华润新能源	新股发行	1,000	10,110.00
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2026 年 6 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
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月内(含)	新发流通受限	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,460,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
货币资金	110,811,887.51	-	-	110,811,887.51
结算备付金	201,599,012.54	-	-	201,599,012.54

存出保证金	1,252,259.48	-	-	1,252,259.48
债券投资	3,277,214,788.50	8,302,585,256.73	2,158,241,752.67	13,738,041,797.90
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,460,000,000.00	-	-	2,460,000,000.00

上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
货币资金	54,895,826.08	-	-	54,895,826.08
结算备付金	23,076,371.03	-	-	23,076,371.03
存出保证金	785,655.02	-	-	785,655.02
债券投资	3,290,183,866.66	5,018,159,843.56	-	8,308,343,710.22
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	76,984,093.70	-	-	76,984,093.70
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	670,959,618.23	-	-	670,959,618.23

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	130,166,940.38	24,188,947.08
	利率上升 25 个基点	-126,390,503.76	-24,025,229.33

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以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 6 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	2,836,791,369.19	19.62	1,918,183,283.11	19.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,683,236,023.02	11.64	1,557,968,975.69	16.14
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	4,520,027,392.21	31.26	3,476,152,258.80	36.01

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证转债指数×80%+沪深 300 指数×20%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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	-5%	-274,470,434.99	-261,412,758.52
	+5%	274,470,434.99	261,412,758.52

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 6 月 30 日
第一层次	4,520,017,282.21
第二层次	12,054,815,884.88
第三层次	-
合计	16,574,833,167.09

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等导致流通受限的情况，本基金根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值所属层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

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	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

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	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

7.3 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

7.3.1 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	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
11	600919	江苏银行	1,728,300	18,631,074.00	0.13
12	600176	中国巨石	254,600	18,555,248.00	0.13
13	601288	农业银行	3,034,500	18,419,415.00	0.13
14	300919	中伟新材	410,460	17,957,625.00	0.12
15	000933	神火股份	817,600	17,333,120.00	0.12
16	300223	北京君正	69,600	17,323,440.00	0.12
17	600015	华夏银行	2,684,000	17,150,760.00	0.12
18	601229	上海银行	1,966,810	17,071,910.80	0.12
19	601088	中国神华	435,900	17,017,536.00	0.12
20	688778	厦钨新能	307,300	16,717,120.00	0.12
21	000408	藏格矿业	237,596	16,470,154.72	0.11
22	601077	渝农商行	2,636,000	16,105,960.00	0.11
23	603565	中谷物流	1,600,905	15,704,878.05	0.11

24	600971	恒源煤电	2,231,800	15,399,420.00	0.11
25	300308	中际旭创	12,000	15,240,000.00	0.11
26	688127	蓝特光学	154,800	15,108,480.00	0.10
27	300953	震裕科技	111,500	14,907,550.00	0.10
28	601939	建设银行	1,547,170	14,899,247.10	0.10
29	601919	中远海控	1,119,780	14,848,282.80	0.10
30	688025	杰普特	31,400	14,758,000.00	0.10
31	688536	思瑞浦	40,400	14,709,236.00	0.10
32	301086	鸿富瀚	70,160	14,683,084.80	0.10
33	002916	深南电路	32,000	14,652,800.00	0.10
34	002384	东山精密	55,600	14,586,660.00	0.10
35	688041	海光信息	39,218	14,522,425.40	0.10
36	301391	卡莱特	250,938	14,328,559.80	0.10
37	603083	剑桥科技	56,000	14,272,720.00	0.10
38	688521	芯原股份	38,400	14,251,776.00	0.10
39	600028	中国石化	3,193,300	14,242,118.00	0.10
40	601000	唐山港	3,402,030	14,118,424.50	0.10
41	688059	华锐精密	69,800	13,939,758.00	0.10
42	600938	中国海油	512,200	13,906,230.00	0.10
43	002475	立讯精密	196,800	13,854,720.00	0.10
44	002008	大族激光	92,000	13,810,120.00	0.10
45	301130	西点药业	575,730	13,806,005.40	0.10
46	002484	江海股份	131,000	13,755,000.00	0.10
47	603588	高能环境	705,800	13,551,360.00	0.09
48	603986	兆易创新	16,600	13,529,000.00	0.09
49	301002	崧盛股份	349,400	13,486,840.00	0.09
50	603511	爱慕股份	1,148,300	13,205,450.00	0.09
51	601169	北京银行	2,683,200	13,147,680.00	0.09
52	600801	华新建材	842,780	13,147,368.00	0.09
53	600985	淮北矿业	927,670	13,033,763.50	0.09

54	600113	浙江东日	388,400	12,887,112.00	0.09
55	688002	睿创微纳	82,000	12,684,580.00	0.09
56	000338	潍柴动力	460,400	12,545,900.00	0.09
57	002353	杰瑞股份	82,200	12,535,500.00	0.09
58	000932	华菱钢铁	3,496,600	12,133,202.00	0.08
59	300037	新宙邦	130,100	12,079,785.00	0.08
60	688231	隆达股份	327,450	12,027,238.50	0.08
61	600233	圆通速递	758,400	11,944,800.00	0.08
62	300502	新易盛	19,455	11,809,185.00	0.08
63	002841	视源股份	341,900	11,805,807.00	0.08
64	601318	中国平安	246,400	11,763,136.00	0.08
65	601668	中国建筑	2,706,400	11,745,776.00	0.08
66	688313	仕佳光子	62,900	11,614,485.00	0.08
67	300073	当升科技	241,600	11,606,464.00	0.08
68	000990	诚志股份	1,407,600	11,514,168.00	0.08
69	300427	红相股份	1,681,400	11,282,194.00	0.08
70	000776	广发证券	478,900	11,206,260.00	0.08
71	002126	银轮股份	223,600	11,135,280.00	0.08
72	601995	中金公司	307,300	11,108,895.00	0.08
73	001389	广合科技	46,800	11,103,300.00	0.08
74	300055	万邦达	1,723,400	11,081,462.00	0.08
75	603737	三棵树	458,020	11,038,282.00	0.08
76	301429	森泰股份	702,028	11,000,778.76	0.08
77	601061	中信金属	1,020,300	10,988,631.00	0.08
78	603162	海通发展	1,217,620	10,922,051.40	0.08
79	300947	德必集团	854,100	10,889,775.00	0.08
80	600739	辽宁成大	1,073,900	10,857,129.00	0.08
81	002738	中矿资源	183,800	10,842,362.00	0.07
82	301192	泰祥股份	565,900	10,695,510.00	0.07
83	002436	兴森科技	203,860	10,386,667.00	0.07

84	000892	欢瑞世纪	3,119,000	10,386,270.00	0.07
85	000975	山金国际	609,700	10,364,900.00	0.07
86	601963	重庆银行	1,026,500	10,347,120.00	0.07
87	601872	招商轮船	581,700	10,220,469.00	0.07
88	000001	平安银行	1,015,200	10,202,760.00	0.07
89	603836	海程邦达	1,287,660	10,172,514.00	0.07
90	301200	大族数控	28,000	10,098,200.00	0.07
91	601658	邮储银行	2,032,300	10,019,239.00	0.07
92	688469	芯联集成	942,100	9,995,681.00	0.07
93	688256	寒武纪	6,205	9,900,387.75	0.07
94	301358	湖南裕能	130,200	9,878,274.00	0.07
95	300115	长盈精密	352,800	9,857,232.00	0.07
96	001218	丽臣实业	443,500	9,783,610.00	0.07
97	603926	铁流股份	546,300	9,664,047.00	0.07
98	300207	欣旺达	508,500	9,656,415.00	0.07
99	600309	万华化学	141,073	9,650,803.93	0.07
100	605056	咸亨国际	603,100	9,649,600.00	0.07
101	600941	中国移动	112,000	9,646,560.00	0.07
102	601601	中国太保	333,300	9,505,716.00	0.07
103	000672	上峰材料	398,500	9,436,480.00	0.07
104	000959	首钢股份	2,610,900	9,164,259.00	0.06
105	002130	沃尔核材	476,200	9,028,752.00	0.06
106	603041	美思德	858,400	8,901,608.00	0.06
107	688568	中科星图	211,900	8,787,493.00	0.06
108	603259	药明康德	70,400	8,765,504.00	0.06
109	603096	新经典	652,900	8,735,802.00	0.06
110	600188	兖矿能源	476,900	8,474,513.00	0.06
111	002875	安奈儿	569,100	8,456,826.00	0.06
112	002540	亚太科技	1,797,112	8,392,513.04	0.06
113	600875	东方电气	287,700	8,277,129.00	0.06

114	000807	云铝股份	370,800	8,209,512.00	0.06
115	601916	浙商银行	3,100,200	8,153,526.00	0.06
116	603587	地素时尚	732,900	8,142,519.00	0.06
117	688513	苑东生物	184,500	8,110,620.00	0.06
118	601231	环旭电子	248,500	8,051,400.00	0.06
119	603057	紫燕食品	357,700	7,976,710.00	0.06
120	601898	中煤能源	650,200	7,919,436.00	0.05
121	600595	中孚实业	1,400,800	7,872,496.00	0.05
122	688173	希荻微	409,200	7,832,088.00	0.05
123	300837	浙矿股份	325,100	7,724,376.00	0.05
124	300843	胜蓝股份	49,300	7,703,125.00	0.05
125	300395	菲利华	57,600	7,702,848.00	0.05
126	002379	宏桥控股	520,900	7,693,693.00	0.05
127	301479	弘景光电	127,539	7,677,847.80	0.05
128	002712	思美传媒	1,849,600	7,675,840.00	0.05
129	688559	海目星	91,300	7,661,896.00	0.05
130	603061	金海通	15,200	7,633,744.00	0.05
131	688372	伟测科技	41,000	7,626,000.00	0.05
132	688388	嘉元科技	171,315	7,537,860.00	0.05
133	688262	国芯科技	174,000	7,522,020.00	0.05
134	002463	沪电股份	49,200	7,517,760.00	0.05
135	300661	圣邦股份	52,000	7,460,960.00	0.05
136	601156	东航物流	462,600	7,457,112.00	0.05
137	001359	平安电工	59,100	7,402,275.00	0.05
138	603200	上海洗霸	170,400	7,388,544.00	0.05
139	688311	盟升电子	281,800	7,380,342.00	0.05
140	688167	炬光科技	20,800	7,367,568.00	0.05
141	002745	木林森	586,700	7,363,085.00	0.05
142	688981	中芯国际	46,029	7,310,325.78	0.05
143	000557	西部创业	2,111,600	7,306,136.00	0.05

144	601208	东材科技	103,100	7,298,449.00	0.05
145	688700	东威科技	81,600	7,295,040.00	0.05
146	300548	长芯博创	26,200	7,283,600.00	0.05
147	688008	澜起科技	23,456	7,269,014.40	0.05
148	300775	三角防务	329,600	7,264,384.00	0.05
149	002415	海康威视	210,400	7,195,680.00	0.05
150	601138	工业富联	99,700	7,193,355.00	0.05
151	601825	沪农商行	959,200	7,184,408.00	0.05
152	002487	大金重工	123,700	7,170,889.00	0.05
153	688061	灿瑞科技	144,300	7,167,381.00	0.05
154	002371	北方华创	8,100	7,164,936.00	0.05
155	301511	德福科技	49,800	7,163,730.00	0.05
156	688228	开普云	92,300	7,138,482.00	0.05
157	688279	峰昭科技	31,800	7,137,192.00	0.05
158	688525	佰维存储	14,400	7,124,112.00	0.05
159	002969	嘉美包装	505,900	7,123,072.00	0.05
160	300450	先导智能	174,600	7,109,712.00	0.05
161	688196	卓越新能	197,900	7,104,610.00	0.05
162	300236	上海新阳	53,996	7,100,474.00	0.05
163	300442	润泽科技	85,000	7,060,950.00	0.05
164	600773	西藏城投	546,500	7,033,455.00	0.05
165	600331	宏达股份	639,700	7,030,303.00	0.05
166	600183	生益科技	40,500	7,022,700.00	0.05
167	001376	百通能源	671,900	6,987,760.00	0.05
168	605222	起帆电缆	299,500	6,984,340.00	0.05
169	688630	芯碁微装	12,700	6,977,253.00	0.05
170	002913	奥士康	109,000	6,969,460.00	0.05
171	688275	万润新能	54,600	6,964,230.00	0.05
172	000657	中钨高新	72,600	6,949,272.00	0.05
173	300408	三环集团	41,600	6,943,040.00	0.05

174	605060	联德股份	122,000	6,922,280.00	0.05
175	600546	山煤国际	633,299	6,921,958.07	0.05
176	002544	普天科技	379,200	6,909,024.00	0.05
177	002080	中材科技	76,700	6,903,000.00	0.05
178	600418	江淮汽车	264,900	6,842,367.00	0.05
179	300672	国科微	23,100	6,814,500.00	0.05
180	301166	优宁维	264,000	6,808,560.00	0.05
181	300750	宁德时代	17,300	6,799,073.00	0.05
182	002566	益盛药业	1,124,800	6,793,792.00	0.05
183	301353	普莱得	408,984	6,793,224.24	0.05
184	603382	海阳科技	395,900	6,789,685.00	0.05
185	603105	芯能科技	996,900	6,788,889.00	0.05
186	603829	洛凯股份	412,100	6,746,077.00	0.05
187	002001	新和成	235,647	6,697,087.74	0.05
188	002532	天山铝业	621,828	6,672,214.44	0.05
189	300136	信维通信	55,200	6,582,600.00	0.05
190	688258	卓易信息	55,400	6,567,116.00	0.05
191	300769	德方纳米	98,500	6,550,250.00	0.05
192	603988	中电电机	403,700	6,548,014.00	0.05
193	002518	科士达	122,000	6,537,980.00	0.05
194	300490	华自科技	489,400	6,474,762.00	0.04
195	605287	德才股份	155,300	6,443,397.00	0.04
196	002478	常宝股份	1,041,000	6,433,380.00	0.04
197	600026	中远海能	357,500	6,413,550.00	0.04
198	601033	永兴股份	476,900	6,390,460.00	0.04
199	002028	思源电气	36,300	6,279,900.00	0.04
200	600988	赤峰黄金	238,200	6,269,424.00	0.04
201	002197	证通电子	1,087,400	6,241,676.00	0.04
202	601168	西部矿业	229,000	6,215,060.00	0.04
203	000429	粤高速 A	453,724	6,193,332.60	0.04

204	002414	高德红外	463,759	6,149,444.34	0.04
205	000592	平潭发展	918,800	6,146,772.00	0.04
206	688679	通源环境	145,300	6,115,677.00	0.04
207	001360	南矿集团	343,100	6,069,439.00	0.04
208	002458	益生股份	775,780	6,027,810.60	0.04
209	001311	多利科技	372,480	6,008,102.40	0.04
210	600508	上海能源	803,640	5,922,826.80	0.04
211	002600	领益智造	335,700	5,821,038.00	0.04
212	301326	捷邦科技	40,900	5,700,233.00	0.04
213	601390	中国中铁	1,349,600	5,627,832.00	0.04
214	000686	东北证券	661,100	5,553,240.00	0.04
215	603059	倍加洁	227,100	5,507,175.00	0.04
216	300658	延江股份	481,100	5,498,973.00	0.04
217	601107	四川成渝	1,114,586	5,439,179.68	0.04
218	688510	航亚科技	227,400	5,430,312.00	0.04
219	300371	汇中股份	551,800	5,396,604.00	0.04
220	001326	联域股份	91,000	5,395,390.00	0.04
221	300970	华绿生物	291,760	5,333,372.80	0.04
222	301598	博科测试	107,700	5,333,304.00	0.04
223	688416	恒烁股份	38,090	5,332,600.00	0.04
224	300625	三雄极光	583,400	5,297,272.00	0.04
225	301662	宏工科技	52,000	5,268,640.00	0.04
226	600487	亨通光电	47,400	5,182,716.00	0.04
227	300394	天孚通信	17,120	5,181,881.60	0.04
228	301608	博实结	102,434	5,148,332.84	0.04
229	301519	舜禹股份	473,100	5,133,135.00	0.04
230	301567	贝隆精密	148,300	5,132,663.00	0.04
231	300971	博亚精工	274,700	5,125,902.00	0.04
232	600645	中源协和	298,100	5,100,491.00	0.04
233	300642	透景生命	431,700	5,094,060.00	0.04

234	301515	港通医疗	290,200	5,087,206.00	0.04
235	601126	四方股份	79,700	5,037,040.00	0.03
236	688653	康希通信	287,400	4,995,012.00	0.03
237	605108	同庆楼	438,300	4,979,088.00	0.03
238	301113	雅艺科技	332,150	4,952,356.50	0.03
239	605122	四方新材	449,500	4,845,610.00	0.03
240	301037	保立佳	403,700	4,844,400.00	0.03
241	600692	亚通股份	880,300	4,780,029.00	0.03
242	301156	美农生物	435,460	4,733,450.20	0.03
243	002266	浙富控股	924,800	4,679,488.00	0.03
244	002545	东方铁塔	288,100	4,672,982.00	0.03
245	603317	天味食品	356,900	4,643,269.00	0.03
246	601101	昊华能源	436,100	4,605,216.00	0.03
247	001203	大中矿业	153,700	4,603,315.00	0.03
248	600388	龙净环保	315,200	4,586,160.00	0.03
249	301390	经纬股份	141,900	4,577,694.00	0.03
250	601666	平煤股份	636,300	4,549,545.00	0.03
251	301057	汇隆新材	194,600	4,475,800.00	0.03
252	300407	凯发电气	412,700	4,457,160.00	0.03
253	300030	阳普医疗	757,500	4,401,075.00	0.03
254	601918	新集能源	511,100	4,390,349.00	0.03
255	002092	中泰化学	1,137,200	4,355,476.00	0.03
256	601298	青岛港	534,700	4,304,335.00	0.03
257	688658	悦康药业	331,000	4,256,660.00	0.03
258	301378	通达海	176,800	4,239,664.00	0.03
259	002772	众兴菌业	369,200	4,194,112.00	0.03
260	688676	金盘科技	49,400	4,181,216.00	0.03
261	000301	东方盛虹	362,100	4,146,045.00	0.03
262	600075	新疆天业	1,026,200	4,145,848.00	0.03
263	603558	健盛集团	372,000	4,125,480.00	0.03

264	301603	乔锋智能	28,600	4,112,680.00	0.03
265	301117	佳缘科技	176,100	4,111,935.00	0.03
266	600348	华阳股份	535,700	4,098,105.00	0.03
267	300213	佳讯飞鸿	675,100	4,091,106.00	0.03
268	688015	交控科技	265,900	4,089,542.00	0.03
269	603810	丰山集团	367,080	4,085,600.40	0.03
270	002425	凯撒文化	1,564,800	4,084,128.00	0.03
271	603151	邦基科技	369,300	4,058,607.00	0.03
272	002949	华阳国际	409,100	4,045,999.00	0.03
273	000761	本钢板材	1,881,400	4,045,010.00	0.03
274	605577	龙版传媒	456,500	4,021,765.00	0.03
275	600395	盘江股份	879,600	4,010,976.00	0.03
276	000877	天山股份	1,101,819	3,999,602.97	0.03
277	000166	申万宏源	908,000	3,995,200.00	0.03
278	600883	博闻科技	568,400	3,978,800.00	0.03
279	000869	张裕 A	254,769	3,969,301.02	0.03
280	300980	祥源新材	134,800	3,964,468.00	0.03
281	002402	和而泰	153,200	3,957,156.00	0.03
282	601233	桐昆股份	182,300	3,946,795.00	0.03
283	001965	招商公路	429,300	3,932,388.00	0.03
284	603113	金能科技	947,100	3,902,052.00	0.03
285	001202	炬申股份	285,400	3,867,170.00	0.03
286	300986	志特新材	223,000	3,824,450.00	0.03
287	000923	河钢资源	307,200	3,812,352.00	0.03
288	603833	欧派家居	125,600	3,781,816.00	0.03
289	600016	民生银行	1,164,900	3,750,978.00	0.03
290	300596	利安隆	71,300	3,741,824.00	0.03
291	603307	扬州金泉	159,485	3,723,974.75	0.03
292	300921	南凌科技	183,160	3,719,979.60	0.03
293	605155	西大门	311,300	3,685,792.00	0.03

294	002732	燕塘乳业	291,400	3,613,360.00	0.02
295	603969	银龙股份	482,900	3,510,683.00	0.02
296	301165	锐捷网络	43,540	3,502,793.00	0.02
297	601766	中国中车	670,900	3,488,680.00	0.02
298	002344	海宁皮城	990,200	3,465,700.00	0.02
299	600287	苏豪时尚	769,900	3,395,259.00	0.02
300	002866	传艺科技	203,900	3,333,765.00	0.02
301	688236	春立医疗	229,600	3,320,016.00	0.02
302	000983	山西焦煤	570,000	3,306,000.00	0.02
303	688569	铁科轨道	200,600	3,239,690.00	0.02
304	601001	晋控煤业	185,000	3,217,150.00	0.02
305	601377	兴业证券	525,700	3,175,228.00	0.02
306	301180	万祥科技	251,900	3,156,307.00	0.02
307	600025	华能水电	352,800	3,136,392.00	0.02
308	002241	歌尔股份	137,600	3,100,128.00	0.02
309	688361	中科飞测	7,200	3,096,000.00	0.02
310	601163	三角轮胎	242,600	3,078,594.00	0.02
311	000534	万泽股份	112,100	3,067,056.00	0.02
312	001336	楚环科技	138,800	3,056,376.00	0.02
313	688298	东方生物	170,700	3,048,702.00	0.02
314	601677	明泰铝业	178,455	2,962,353.00	0.02
315	301571	国科天成	45,200	2,946,136.00	0.02
316	600177	雅戈尔	384,912	2,898,387.36	0.02
317	300517	海波重科	296,600	2,793,972.00	0.02
318	688195	腾景科技	14,500	2,792,410.00	0.02
319	301206	三元生物	124,900	2,776,527.00	0.02
320	688265	南模生物	80,000	2,767,200.00	0.02
321	002264	新华都	489,300	2,759,652.00	0.02
322	600018	上港集团	584,600	2,759,312.00	0.02
323	002111	威海广泰	304,600	2,741,400.00	0.02

324	000858	五粮液	36,800	2,723,200.00	0.02
325	603619	中曼石油	143,200	2,679,272.00	0.02
326	601279	英利汽车	873,400	2,663,870.00	0.02
327	688182	灿勤科技	60,500	2,605,735.00	0.02
328	688626	翔宇医疗	58,300	2,580,358.00	0.02
329	002947	恒铭达	33,900	2,578,095.00	0.02
330	000708	中信特钢	204,100	2,575,742.00	0.02
331	688370	丛麟科技	122,300	2,558,516.00	0.02
332	600549	厦门钨业	29,900	2,547,480.00	0.02
333	300645	正元智慧	214,700	2,527,019.00	0.02
334	603258	电魂网络	207,300	2,485,527.00	0.02
335	301636	泽润新能	58,800	2,476,068.00	0.02
336	688690	纳微科技	54,900	2,421,090.00	0.02
337	300602	飞荣达	46,500	2,380,800.00	0.02
338	000967	盈峰环境	224,400	2,362,932.00	0.02
339	300418	昆仑万维	57,400	2,316,664.00	0.02
340	603909	建发合诚	271,300	2,314,189.00	0.02
341	002756	永兴材料	40,600	2,299,584.00	0.02
342	001289	龙源电力	146,700	2,292,921.00	0.02
343	600489	中金黄金	126,000	2,274,300.00	0.02
344	300855	图南股份	71,700	2,241,342.00	0.02
345	002493	荣盛石化	206,000	2,214,500.00	0.02
346	600029	南方航空	424,300	2,197,874.00	0.02
347	301189	奥尼电子	36,700	2,162,731.00	0.01
348	688766	普冉股份	2,800	2,146,480.00	0.01
349	301001	凯淳股份	98,300	2,130,161.00	0.01
350	300580	贝斯特	105,900	2,129,649.00	0.01
351	003816	中国广核	522,600	2,043,366.00	0.01
352	603237	五芳斋	163,700	2,026,606.00	0.01
353	600251	冠农股份	233,760	2,019,686.40	0.01

354	300766	每日互动	88,300	1,889,620.00	0.01
355	688046	药康生物	76,800	1,858,560.00	0.01
356	002133	广宇集团	756,900	1,808,991.00	0.01
357	688678	福立旺	74,500	1,800,665.00	0.01
358	601838	成都银行	101,100	1,789,470.00	0.01
359	603216	梦天家居	86,100	1,771,077.00	0.01
360	000060	中金岭南	233,300	1,766,081.00	0.01
361	001230	劲旅环境	113,260	1,739,673.60	0.01
362	300814	中富电路	8,300	1,697,350.00	0.01
363	600150	中国船舶	50,207	1,696,494.53	0.01
364	600104	上汽集团	172,600	1,684,576.00	0.01
365	301371	敷尔佳	64,700	1,682,200.00	0.01
366	000419	通程控股	372,000	1,677,720.00	0.01
367	002810	山东赫达	65,200	1,610,440.00	0.01
368	603515	欧普照明	97,800	1,598,052.00	0.01
369	002968	新大正	178,200	1,507,572.00	0.01
370	000987	越秀资本	192,700	1,506,914.00	0.01
371	688787	海天瑞声	10,900	1,465,505.00	0.01
372	603556	海兴电力	66,600	1,465,200.00	0.01
373	600648	外高桥	183,200	1,463,768.00	0.01
374	003016	欣贺股份	224,900	1,378,637.00	0.01
375	002429	兆驰股份	132,300	1,374,597.00	0.01
376	301061	匠心家居	38,000	1,332,660.00	0.01
377	605098	行动教育	23,700	1,283,592.00	0.01
378	300285	国瓷材料	12,000	1,238,160.00	0.01
379	601328	交通银行	191,960	1,234,302.80	0.01
380	301389	隆扬电子	12,800	1,110,912.00	0.01
381	600398	海澜之家	203,900	1,066,397.00	0.01
382	002645	华宏科技	37,100	1,020,621.00	0.01
383	002837	英维克	12,700	1,010,412.00	0.01

384	605118	力鼎光电	28,700	1,001,343.00	0.01
385	600620	天宸股份	252,400	996,980.00	0.01
386	600990	四创电子	55,900	985,517.00	0.01
387	605599	莱百股份	70,900	971,330.00	0.01
388	600908	无锡银行	187,166	950,803.28	0.01
389	300164	通源石油	115,400	923,200.00	0.01
390	600096	云天化	30,200	918,080.00	0.01
391	601818	光大银行	305,400	882,606.00	0.01
392	301173	毓恬冠佳	29,400	873,474.00	0.01
393	601059	信达证券	53,800	871,022.00	0.01
394	002497	雅化集团	40,600	827,022.00	0.01
395	001228	永泰运	31,800	812,490.00	0.01
396	301087	可孚医疗	17,000	810,050.00	0.01
397	002839	张家港行	194,200	757,380.00	0.01
398	002179	中航光电	16,200	748,440.00	0.01
399	600039	四川路桥	92,900	726,478.00	0.01
400	600000	浦发银行	83,200	716,352.00	0.00
401	301295	美硕科技	16,700	704,406.00	0.00
402	000651	格力电器	18,513	694,237.50	0.00
403	300666	江丰电子	1,800	663,480.00	0.00
404	003012	东鹏控股	140,100	610,836.00	0.00
405	600123	兰花科创	114,145	609,534.30	0.00
406	000619	海螺新材	136,800	601,920.00	0.00
407	300876	蒙泰高新	33,900	485,787.00	0.00
408	688110	东芯股份	2,305	469,528.50	0.00
409	600236	桂冠电力	51,000	447,780.00	0.00
410	002466	天齐锂业	6,800	416,976.00	0.00
411	603121	华培动力	35,200	413,600.00	0.00
412	002867	周大生	34,800	388,020.00	0.00
413	300054	鼎龙股份	3,600	381,492.00	0.00

414	600755	厦门国贸	53,600	290,512.00	0.00
415	603799	华友钴业	5,880	283,768.80	0.00
416	600498	烽火通信	3,700	272,320.00	0.00
417	000425	徐工机械	33,430	270,448.70	0.00
418	002222	福晶科技	2,600	239,928.00	0.00
419	002270	华明装备	12,700	239,395.00	0.00
420	688084	晶品特装	4,100	206,148.00	0.00
421	000501	武商集团	30,200	202,038.00	0.00
422	603115	海星股份	1,400	171,458.00	0.00
423	002865	钧达股份	2,800	167,104.00	0.00
424	301181	标榜股份	6,300	145,782.00	0.00
425	002601	龙佰集团	5,400	88,992.00	0.00
426	688211	中科微至	1,200	41,304.00	0.00
427	002574	明牌珠宝	6,200	25,730.00	0.00
428	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.00
429	603153	上海建科	95	1,204.60	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	601318	中国平安	118,277,976.00	1.23
2	600036	招商银行	99,179,379.00	1.03
3	601166	兴业银行	80,557,459.20	0.83
4	601398	工商银行	75,908,379.00	0.79
5	600938	中国海油	58,398,856.00	0.60
6	000933	神火股份	56,963,398.00	0.59
7	688256	寒武纪	55,658,941.15	0.58
8	601857	中国石油	55,159,695.00	0.57
9	601601	中国太保	53,079,230.50	0.55
10	600919	江苏银行	50,741,341.00	0.53

11	601225	陕西煤业	49,176,986.10	0.51
12	601088	中国神华	46,843,628.00	0.49
13	601328	交通银行	46,833,601.80	0.49
14	688498	源杰科技	46,273,730.59	0.48
15	601939	建设银行	45,732,443.50	0.47
16	601288	农业银行	44,373,801.00	0.46
17	300760	迈瑞医疗	42,906,966.00	0.44
18	601919	中远海控	41,756,081.60	0.43
19	601988	中国银行	39,281,931.00	0.41
20	601668	中国建筑	38,719,750.00	0.40

注：“买入金额”按买入成交金额（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	688256	寒武纪	205,946,122.98	2.13
2	601318	中国平安	169,720,728.00	1.76
3	002371	北方华创	135,929,362.80	1.41
4	688012	中微公司	128,358,788.76	1.33
5	688981	中芯国际	124,409,133.47	1.29
6	601601	中国太保	107,319,662.50	1.11
7	688521	芯原股份	102,289,043.85	1.06
8	600036	招商银行	97,413,200.00	1.01
9	688375	国博电子	93,957,890.93	0.97
10	001979	招商蛇口	92,252,030.00	0.96
11	688361	中科飞测	88,893,537.23	0.92
12	688281	华秦科技	81,694,053.69	0.85
13	300750	宁德时代	80,784,293.40	0.84
14	601166	兴业银行	76,113,037.71	0.79
15	688052	纳芯微	76,096,888.67	0.79
16	600426	华鲁恒升	70,566,025.00	0.73

17	601155	新城控股	67,078,416.00	0.69
18	300760	迈瑞医疗	66,176,535.22	0.69
19	688041	海光信息	63,355,844.10	0.66
20	688652	京仪装备	60,670,171.73	0.63

注：“卖出金额”按卖出成交金额（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	12,027,404,761.75
卖出股票收入（成交）总额	11,273,677,927.64

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（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	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

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	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

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 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。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,252,259.48

2	应收清算款	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

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	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

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 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。

§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
华夏鼎利 债券 A	31,405	251,574.59	7,545,082,562.39	95.50%	355,617,352.42	4.50%
华夏鼎利 债券 C	25,078	50,236.81	1,031,052,324.32	81.84%	228,786,375.80	18.16%
合计	56,483	162,182.23	8,576,134,886.71	93.62%	584,403,728.22	6.38%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并剔重。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏鼎利债券 A	2,357,577.89	0.03%
	华夏鼎利债券 C	41,018.51	0.00%
	合计	2,398,596.40	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏鼎利债券 A	0
	华夏鼎利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏鼎利债券 A	0
	华夏鼎利债券 C	0
	合计	0

8.4 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 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
基金合同生效日（2016 年 11 月 18 日）基金份额总额	11,175,156.60	253,975.79
本报告期期初基金份额总额	5,066,388,999.53	1,316,129,067.13
本报告期基金总申购份额	8,016,325,709.40	2,182,343,483.75
减：本报告期基金总赎回份额	5,182,014,794.12	2,238,633,850.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,900,699,914.81	1,259,838,700.12

§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，本基金无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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。

2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产的诉讼，中信银行股份有限公司托管业务未涉及诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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，本基金管理人未受到调查或处罚。

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未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务不涉及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，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

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	
中信证券	7	10,965,802,601.77	47.06%	2,148,244.84	47.06%	-
申万宏源证券	1	3,881,767,786.35	16.66%	760,426.52	16.66%	-
中金公司	1	3,609,734,847.14	15.49%	707,166.22	15.49%	-

长江证券	1	3,522,297,068.78	15.12%	690,032.39	15.12%	-
东方证券	1	1,321,470,275.35	5.67%	258,895.48	5.67%	-
招商证券	3	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择研究服务证券公司的标准，即：

i 投研部门根据证券公司的总体资质情况、财务状况、研究服务能力、经营行为及风控合规能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪评估，对合作库证券公司进行调整。

ii 投研部门牵头制定证券公司研究服务评价制度，建立健全对证券公司研究服务的定期评价机制。评价指标包括但不限于：业绩贡献、反馈速度、观点或数据质量等。

②为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择交易服务证券公司的标准，即：

i 投资部门根据证券公司的总体资质、财务状况、经营行为和合规风控能力、交易服务能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪监控，对合作库证券公司进行调整。

ii 投资部门牵头制定证券公司交易服务评价制度，建立健全对证券公司交易服务的定期评价机制。

iii 投资部门定期对证券公司的交易服务开展评价，评价指标包括但不限于：交易服务成本、交易服务能力、交易系统稳定性、交易系统支持能力、应急交易能力等。

③证券公司专用交易单元选择程序：

i 投资、研究部门牵头制定规范、合理的合作证券公司管理制度，明确证券公司准入标准、退出程序等。合规管理部门对合作证券公司管理制度进行合规性审查。

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

iii 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

④除本表列示外，本基金还选择了川财证券、东方财富证券、东吴证券、方正证券、国信证券、华林证券、华泰证券、平安证券、英大证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

⑤在上述租用的券商交易单元中，东方证券、东吴证券、方正证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期权证成交	成交金额	占当期基金成交

		的比例		总额的 比例		交总 额的 比例		交总 额的 比例
中信 证券	3,785,215,961.40	37.26%	78,966,000,000.00	52.11%	-	-	-	-
申万 宏源 证券	803,679,462.60	7.91%	60,120,000,000.00	39.67%	-	-	-	-
中金 公司	1,672,559,998.78	16.46%	449,000,000.00	0.30%	-	-	-	-
长江 证券	1,785,405,681.96	17.57%	11,806,894,000.00	7.79%	-	-	-	-
东方 证券	336,469,163.88	3.31%	200,000,000.00	0.13%	-	-	-	-
招商 证券	1,776,003,790.00	17.48%	-	-	-	-	-	-

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	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	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-28
2	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	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26
3	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	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26

§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

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。

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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

二〇二六年八月三十一日