

# 华夏鼎沛债券型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 22 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏鼎沛债券	
基金主代码	005886	
交易代码	005886	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日	
报告期末基金份额总额	150,926,959.67 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，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、权证投资策略、资产支持证券投资策略等。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80% + 沪深 300 指数收益率×10% + 经汇率调整的恒生指数收益率×10%。	
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型基金、混合型基金，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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏鼎沛债券 A	华夏鼎沛债券 C
下属分级基金的交易代码	005886	005887
报告期末下属分级基金的份额总额	44,957,111.22 份	105,969,848.45 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 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)
--------	---

	华夏鼎沛债券 A	华夏鼎沛债券 C
1.本期已实现收益	-455,997.01	-1,173,419.17
2.本期利润	1,329,416.83	2,943,759.37
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0289	0.0270
4.期末基金资产净 值	49,933,297.88	115,039,380.41
5.期末基金份额净 值	1.1107	1.0856

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

华夏鼎沛债券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	2.78%	0.34%	3.52%	0.24%	-0.74%	0.10%
过去六个月	2.48%	0.27%	5.03%	0.21%	-2.55%	0.06%
过去一年	3.75%	0.26%	5.66%	0.21%	-1.91%	0.05%
过去三年	-20.26%	0.48%	3.20%	0.24%	-23.46%	0.24%
过去五年	1.58%	0.58%	6.78%	0.24%	-5.20%	0.34%
自基金合同生效起至今	19.78%	0.58%	10.93%	0.24%	8.85%	0.34%

华夏鼎沛债券C：

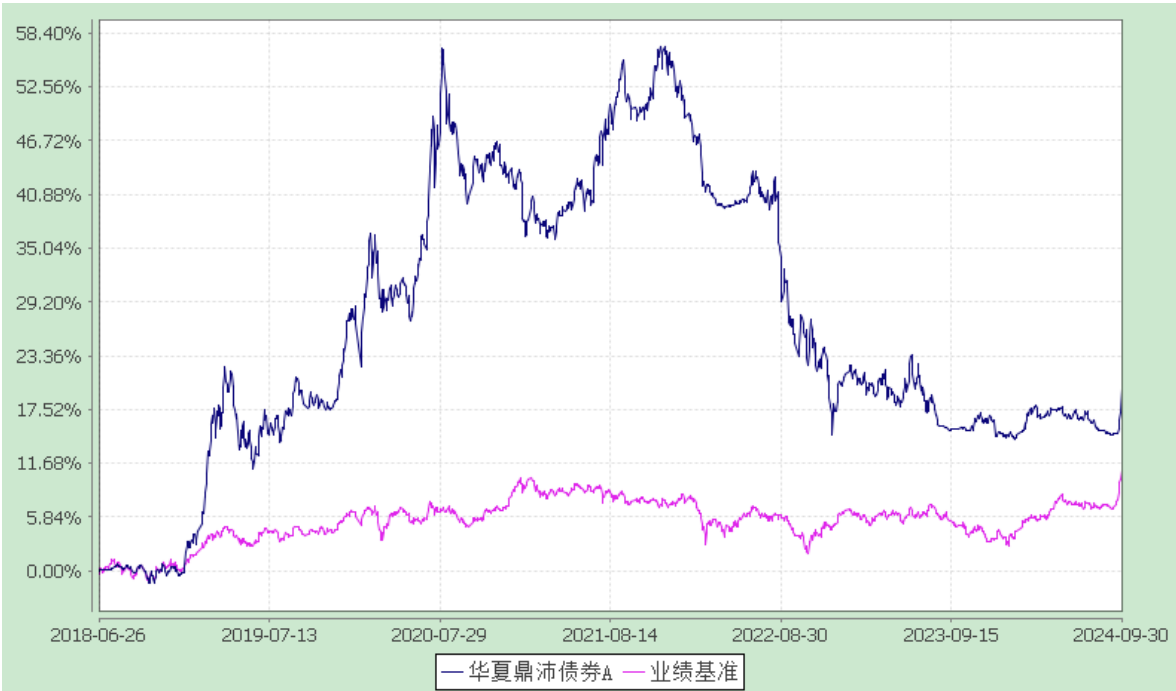
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①－③	②－④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个 月	2.68%	0.34%	3.52%	0.24%	-0.84%	0.10%
过去六个 月	2.27%	0.28%	5.03%	0.21%	-2.76%	0.07%
过去一年	3.33%	0.26%	5.66%	0.21%	-2.33%	0.05%
过去三年	-21.22%	0.48%	3.20%	0.24%	-24.42%	0.24%
过去五年	-0.44%	0.58%	6.78%	0.24%	-7.22%	0.34%
自基金合 同生效起 至今	16.81%	0.58%	10.93%	0.24%	5.88%	0.34%

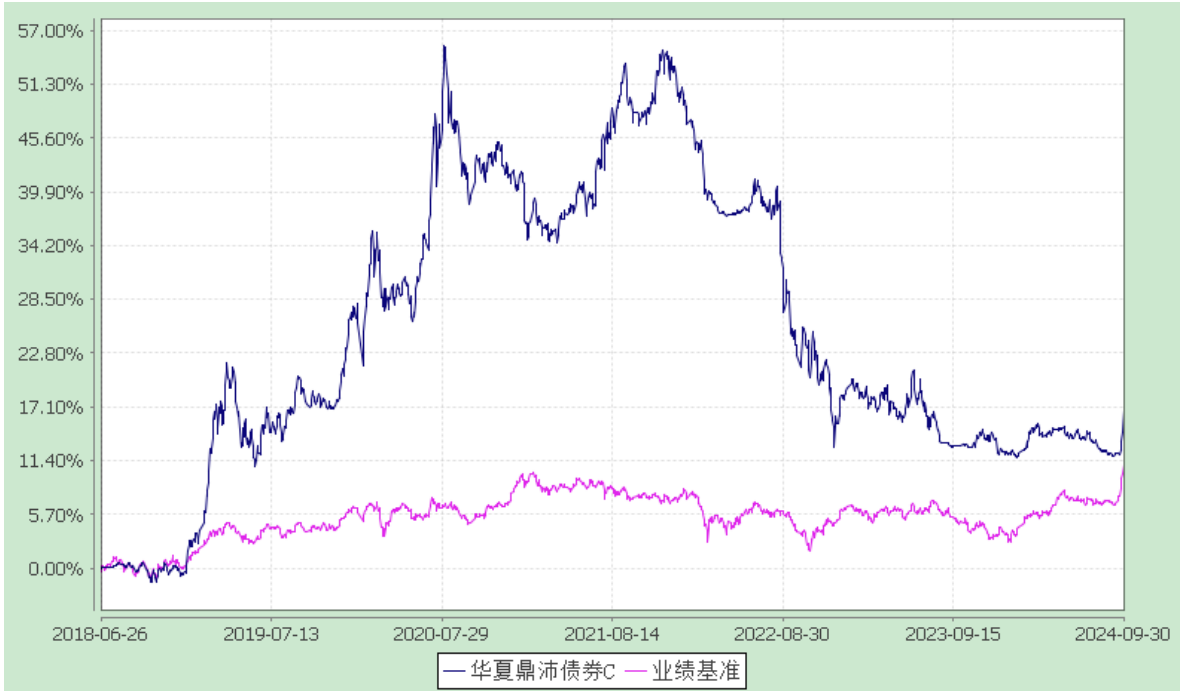
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎沛债券型证券投资基金  
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  
(2018 年 6 月 26 日至 2024 年 9 月 30 日)

华夏鼎沛债券 A:



华夏鼎沛债券 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		
韩丽楠	本基金的基金经理	2022-02-09	-	14 年	硕士。曾任诺德基金管理有限公司研究员,上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监,西部利得基金管理有限公司基金经理等。2021 年 10 月加入华夏基金管理有限公司。华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2022 年 2 月 9 日至 2023 年 4 月 6 日期间)、华夏鼎源债券型证

					券投资基金基金经理（2022 年 2 月 9 日至 2023 年 4 月 26 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（2022 年 2 月 9 日至 2023 年 4 月 26 日期间）、华夏鼎润债券型证券投资基金基金经理（2022 年 2 月 9 日至 2023 年 9 月 5 日期间）等。
--	--	--	--	--	--

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 52 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

三季度以来，美国经济增长整体表现好于预期，尽管就业数据不及市场预期引发衰退担忧，但相关数据偏弱主要是由于恶劣飓风天气的影响，而且仅凭单月数据也无法断言衰退已至。除就业数据外，大部分实体经济数据表现仍较为稳健。9 月美联储开启降息通道，顺应市场预期，一次性降息 50BP。受美元指数下跌和中美利差快速收窄的影响，人民币汇率连续升值，扭转了此前市场的悲观预期。

7 月召开的三中全会明确了改革的重点方向，更加注重党的领导，强调安全和共同富裕。新一轮的财税体制改革，有助于地方政府财权和事权的进一步匹配，减轻地方政府的债务压力。针对国内需求偏弱的问题，总量政策仍有较大的发挥空间。当前全球货币政策已经边际转松，为我国进一步降息提供了较为友好的外部环境。9 月一行一局一会联合发布政策组合拳，降准配合降息，存量按揭利率调整落地，政策力度和节奏均超市场预期，有利于国内经济的企稳回升。央行创设了新的货币政策工具和股票回购增持专项再贷款，支持权益市场的稳定发展，打通人民银行和资本市场的资金传导通道，有助于改善权益市场的流动性和提高上市公司回购股票的积极性。从近期政策表态来看，政府控制系统性风险决心较大，后续大概率会加大财政政策刺激力度。

报告期内，债市整体表现强势，利率曲线总体趋向平坦，超长期限国债利率屡创新低。权益市场风险偏好较低，各大宽基指数缩量震荡下行，上证指数在 9 月中旬一度跌破 2700 点整数关口。9 月末金融政策组合拳的发布体现了全力支持金融稳定的思路，有助于提振市场信心和平抑资本市场波动，权益市场受政策利好刺激出现大幅反弹。

报告期内，股票方面，本基金在较为震荡波动的市场环境下，着重控制回撤风险，根据市场情况保持了适度的权益仓位；债券方面，在保证较低信用风险的前提下，在投资配置上兼顾组合的流动性和收益性。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 9 月 30 日，华夏鼎沛债券 A 基金份额净值为 1.1107 元，本报告期份额净



值增长率为 2.78%；华夏鼎沛债券 C 基金份额净值为 1.0856 元，本报告期份额净值增长率为 2.68%，同期业绩比较基准增长率为 3.52%。

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	30,783,454.35	15.65
	其中：股票	30,783,454.35	15.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	152,746,546.94	77.64
	其中：债券	152,746,546.94	77.64
	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	4,583,910.94	2.33
8	其他资产	8,614,750.74	4.38
9	合计	196,728,662.97	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 6,069,632.86 元，占基金资产净值比例为 3.68%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,950,638.00	6.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	618,000.00	0.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,926,583.49	1.77
J	金融业	11,218,600.00	6.80
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	24,713,821.49	14.98

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
金融	3,005,666.07	1.82
非必需消费品	2,975,907.00	1.80
信息技术	88,059.79	0.05
保健	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
房地产	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
能源	-	-
通讯服务	-	-
合计	6,069,632.86	3.68

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

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	601878	浙商证券	260,000	3,746,600.00	2.27
2	09988	阿里巴巴－W	30,000	2,975,907.00	1.80
3	06881	中国银河	330,000	2,160,508.48	1.31
3	601881	中国银河	50,000	769,500.00	0.47
4	300308	中际旭创	17,900	2,771,994.00	1.68
5	600519	贵州茅台	1,400	2,447,200.00	1.48
6	600536	中国软件	53,939	2,260,583.49	1.37
7	002594	比亚迪	7,000	2,151,170.00	1.30
8	300502	新易盛	15,000	1,949,550.00	1.18
9	600036	招商银行	50,000	1,880,500.00	1.14
10	601601	中国太保	45,000	1,759,500.00	1.07

注：所用证券代码采用当地市场代码。

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	14,432,159.35	8.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,528,421.49	6.38
	其中：政策性金融债	5,208,254.82	3.16
4	企业债券	55,868,820.23	33.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	39,822,150.24	24.14
7	可转债（可交换债）	32,094,995.63	19.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	152,746,546.94	92.59

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	185858	国新 YK01	100,000	10,373,821.92	6.29
2	138506	22 京投 Y2	100,000	10,246,842.74	6.21
3	102380658	23 中节能 MTN001	100,000	10,232,427.40	6.20
4	102000938	20 粤交投 MTN001	100,000	10,229,837.26	6.20
5	149883	22 湘路 04	100,000	10,158,822.47	6.16

#### 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 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	28,505.43
2	应收证券清算款	8,546,846.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	39,398.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,614,750.74

## 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	127037	银轮转债	4,067,443.36	2.47
2	113061	拓普转债	3,661,016.71	2.22
3	113021	中信转债	3,596,695.89	2.18
4	127022	恒逸转债	3,319,168.77	2.01
5	127045	牧原转债	2,891,774.66	1.75
6	127043	川恒转债	1,661,954.64	1.01
7	127085	韵达转债	1,645,225.07	1.00
8	113052	兴业转债	1,641,889.73	1.00
9	123212	立中转债	1,550,209.83	0.94
10	127030	盛虹转债	1,538,467.81	0.93
11	110079	杭银转债	1,216,092.05	0.74
12	128081	海亮转债	1,118,987.95	0.68
13	113055	成银转债	1,031,322.08	0.63
14	113660	寿 22 转债	830,501.46	0.50
15	127032	苏行转债	626,327.40	0.38
16	113062	常银转债	590,472.74	0.36
17	113065	齐鲁转债	569,691.37	0.35
18	113056	重银转债	537,754.11	0.33

## 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	华夏鼎沛债券A	华夏鼎沛债券C
本报告期期初基金份额总额	47,073,452.45	111,627,672.40
报告期期间基金总申购份额	255,065.42	331,419.64
减：报告期期间基金总赎回份额	2,371,406.65	5,989,243.59
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	44,957,111.22	105,969,848.45

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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

本基金本报告期内无需要披露的主要事项。

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、首批公募 MOM 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，国内首家承诺“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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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。

### 9.2 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。

### 9.3 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

二〇二四年十月二十五日