

华夏鼎清债券型证券投资基金
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 本报告期投资基金情况	48
7.13 投资组合报告附注	49

§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	52
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏鼎清债券型证券投资基金	
基金简称	华夏鼎清债券	
基金主代码	010014	
交易代码	010014	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 3 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	
报告期末基金份额总额	10,915,434,969.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏鼎清债券 A	华夏鼎清债券 C
下属分级基金的交易代码	010014	010015
报告期末下属分级基金的份额总额	8,588,994,866.46 份	2,326,440,103.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，综合考虑基金资产的收益性、安全性、流动性，通过积极主动地投资管理，合理配置债券等固定收益类资产和权益类资产，追求基金资产的长期稳健增值。
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、股票投资策略、国债期货投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、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×20%
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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66596688
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-818-6666	95566

传真	010-63136700	010-66594942
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1号
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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	100101	100818
法定代表人	邹迎光	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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）	
	华夏鼎清债券 A	华夏鼎清债券 C
本期已实现收益	212,062,193.20	46,778,628.12
本期利润	1,017,279,170.02	233,836,216.04
加权平均基金份额本期利润	0.2630	0.3336
本期加权平均净值利润率	20.55%	26.08%
本期基金份额净值增长率	17.52%	17.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏鼎清债券 A	华夏鼎清债券 C
期末可供分配利润	1,673,757,678.69	391,857,279.11
期末可供分配基金份额利润	0.1949	0.1684
期末基金资产净值	12,033,067,508.92	3,187,426,323.41
期末基金份额净值	1.4010	1.3701

3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）	
	华夏鼎清债券 A	华夏鼎清债券 C
基金份额累计净值增长率	40.10%	37.01%

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

华夏鼎清债券 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	16.46%	0.64%	2.86%	0.26%	13.60%	0.38%
过去六个月	17.52%	0.59%	2.33%	0.23%	15.19%	0.36%
过去一年	29.26%	0.55%	4.56%	0.20%	24.70%	0.35%
过去三年	36.94%	0.42%	10.44%	0.21%	26.50%	0.21%
过去五年	37.64%	0.36%	7.04%	0.22%	30.60%	0.14%
自基金合同生效起至今	40.10%	0.34%	8.98%	0.22%	31.12%	0.12%

华夏鼎清债券 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	16.35%	0.64%	2.86%	0.26%	13.49%	0.38%
过去六个月	17.30%	0.59%	2.33%	0.23%	14.97%	0.36%
过去一年	28.74%	0.55%	4.56%	0.20%	24.18%	0.35%
过去三年	35.32%	0.42%	10.44%	0.21%	24.88%	0.21%
过去五年	34.92%	0.36%	7.04%	0.22%	27.88%	0.14%
自基金合同生效起至今	37.01%	0.34%	8.98%	0.22%	28.03%	0.12%

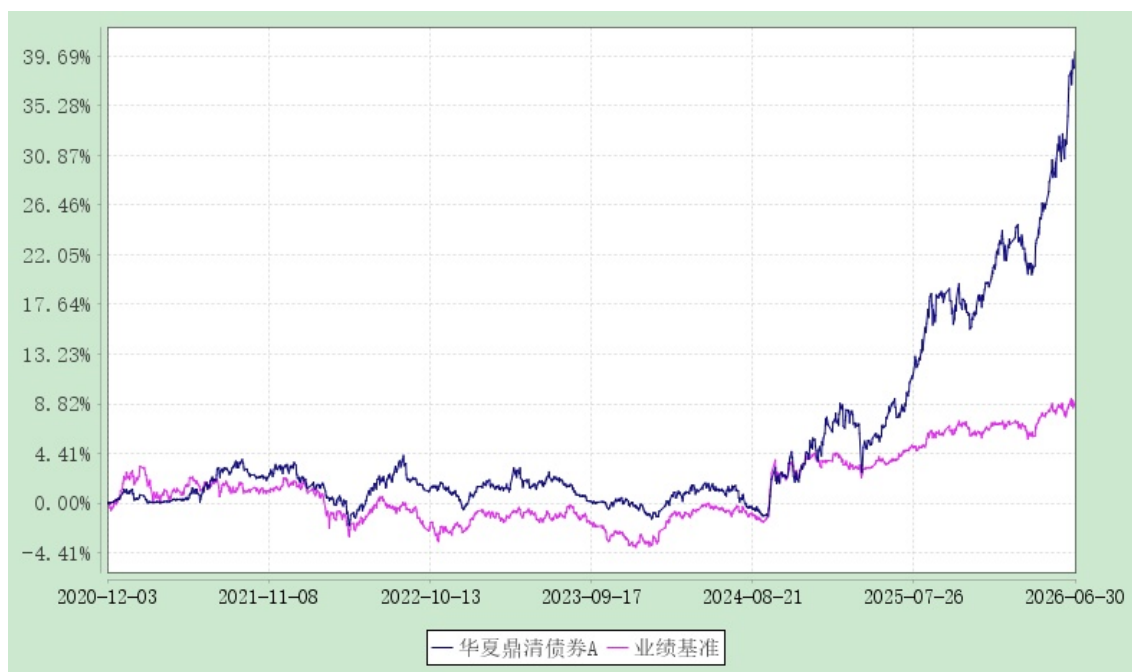
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎清债券型证券投资基金

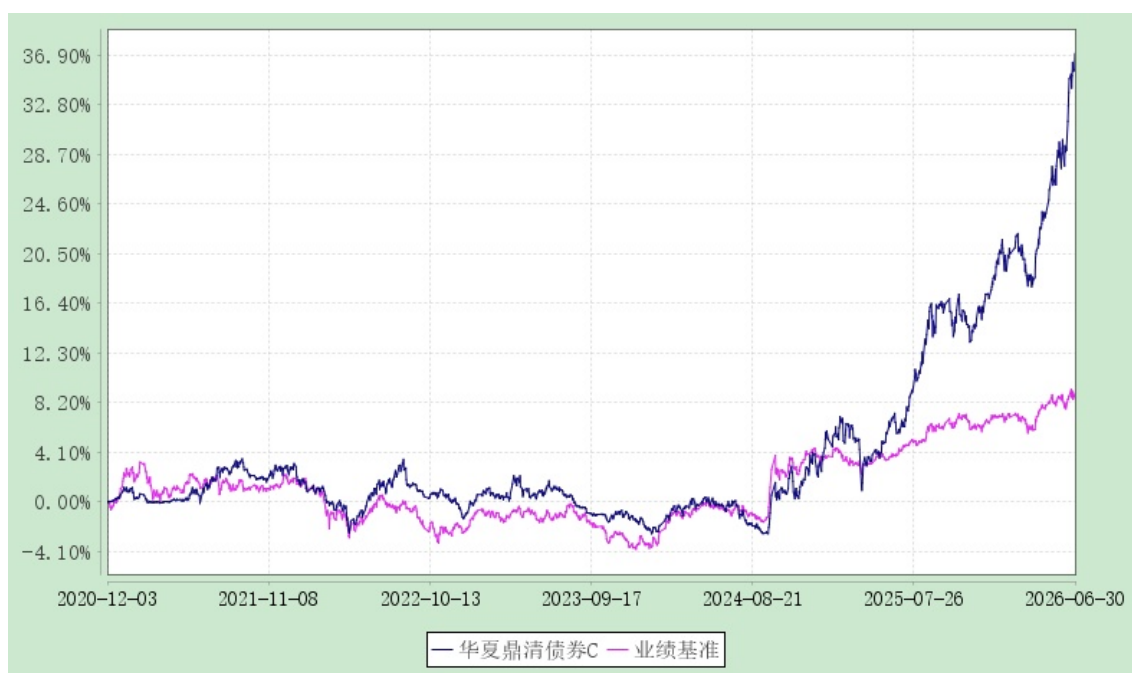
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 12 月 3 日至 2026 年 6 月 30 日)

华夏鼎清债券 A:



华夏鼎清债券 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		
柳万军	本基金的基金经理、投委会成员	2020-12-03	-	19 年	硕士。曾任中国人民银行上海总部副主任科员、泰康资产固定收益部投资经理、交银施罗德基金固定收益部基金经理助理等。2013 年 6 月加入华夏基金管理有限公司。历任固定收益部研究员、华夏货币市场基金基金经理（2013 年 12 月 31 日至 2017 年 8 月 7 日期间）、华夏薪金宝货币市场基金基金经理（2014 年 5 月 26 日至 2017 年 8 月 7 日期间）、华夏恒利 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2016 年 3 月 29 日至 2018 年 6 月 28 日期间）、华夏新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2016 年 2 月 23 日至 2018 年 12 月 17 日期

					间)、华夏鼎旺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4月24日至2019年7月29日期间)、华夏新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年3月30日至2019年11月29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(2018年6月29日至2019年11月29日期间)、亚债中国债券指数基金经理(2015年7月16日至2020年1月6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(2018年12月17日至2020年1月6日期间)、华夏鼎康债券型证券投资基金基金经理(2019年8
--	--	--	--	--	---

					月 12 日至 2020 年 8 月 25 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 2020 年 8 月 25 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 4 月 25 日至 2021 年 1 月 27 日期间)、华夏恒融债券型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)、华夏鼎源债券型证券投资基金基金经理 (2020 年 5 月 20 日至 2021 年 12 月 21 日期间)、华夏鼎沛债券型证券投资基金基金经理 (2018 年 6 月 26 日至 2022 年 2 月 9 日期间)、华夏卓享债券型证券投资基金基金经理 (2021 年 8 月 24 日至 2023 年 3 月
--	--	--	--	--	---

					21 日期间)、华夏安康信用优选债券型证券投资基金基金经理 (2014 年 5 月 5 日至 2024 年 7 月 12 日期间)、华夏鼎泰六个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (2018 年 4 月 13 日至 2024 年 11 月 25 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 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

2026 年上半年，从外部环境来看，地缘冲突推动通胀预期和风险偏好反复。美国经济整体存在韧性，AI 相关投资持续较高增速，消费保持稳健，通胀方面则是存在黏性，就业数据相对平稳，动能边际放缓。美联储态度由偏鸽观望逐步向谨慎鹰派收敛。国内方面，经济一季度实现开门红，二季度边际小幅走弱。新旧经济的结构性分化带来传统融资需求偏弱，整体内需仍需逆周期政策的持续托底发力。流动性方面，强劲的结汇资金与高息存款到期带来的银行负债端成本压降，使得资金面整体保持平稳宽松，且央行延续了支持性的货币政策，在此背景下，债券市场收益率普遍下行，信用利差压缩，曲线形态呈现陡峭化。

权益市场方面，上半年 A 股整体上涨，但行业分化明显。一季度市场先涨后跌，年初小盘成长、有色金属和科技板块占优，随后大盘价值、红利和能源板块表现相对较好。二季度，地缘风险缓解和 AI 产业景气上行，资金加速流向科技成长方向，创业板和科创板取得明显超额收益，传统行业和小市值风格表现偏弱。

可转债市场方面，上半年中证转债收益率 2.51%。年初转债价格和估值明显上行，3 月份随权益市场调整和强赎压力增加而回落；二季度高价股性转债受益于科技板块上涨，表现明显优于低价和弱资质品种。与此同时，转债供给偏少、存量市场持续收缩，个券稀缺对整体估值形成支撑，但也使部分品种的性价比显著下降。

报告期内，本基金维持中性久期，权益资产上维持了较高的科技板块参与比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，华夏鼎清债券 A 基金份额净值为 1.4010 元，本报告期份额净值增长率为 17.52%；华夏鼎清债券 C 基金份额净值为 1.3701 元，本报告期份额净值增长率为 17.30%，同期业绩比较基准增长率为 2.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济总量增长预期平稳略走弱，继续处于新旧动能切换的过程中，其中科技行业将继续维持较高的景气度。在此过程中，预期货币政策将保持流动性平稳宽松。债券市场有望继续取得持有收益，股票市场的 K 型分化则可能略有收敛，需要更注重股票本身的盈利驱动和估值

的匹配度。转债市场则继续面临强赎扰动，尽管新增供给也在逐步增加，但估值将维持较高的波动特征。

下半年组合债券仍以持有收益为主，权益类资产则将加大行业配置的灵活性。

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，本基金管理人为准确、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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏鼎清债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§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：华夏鼎清债券型证券投资基金

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	212,888,446.08	13,082,972.18
结算备付金		24,583,564.21	10,943,205.43
存出保证金		1,159,813.39	138,285.43
交易性金融资产	6.4.7.2	15,314,345,794.34	1,579,456,522.11
其中：股票投资		3,099,012,913.82	306,042,029.23
基金投资		-	-
债券投资		12,215,332,880.52	1,273,414,492.88
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		67,837,556.68	-
应收股利		-	-
应收申购款		443,016,324.72	1,167,236.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		16,063,831,499.42	1,604,788,221.26
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		200,000,000.00	16,744,553.45
应付清算款		-	7,431,125.27
应付赎回款		632,566,573.91	1,071,749.61
应付管理人报酬		5,056,251.27	619,974.03
应付托管费		1,415,750.35	173,592.76
应付销售服务费		925,133.75	13,517.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		269,067.93	9,194.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,104,889.88	971,852.59
负债合计		843,337,667.09	27,035,559.15
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	10,915,434,969.52	1,325,147,174.55
未分配利润	6.4.7.8	4,305,058,862.81	252,605,487.56
净资产合计		15,220,493,832.33	1,577,752,662.11
负债和净资产总计		16,063,831,499.42	1,604,788,221.26

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，华夏鼎清债券 A 基金份额净值 1.4010 元，华夏鼎清债券 C 基金份额净值 1.3701 元；华夏鼎清债券基金份额总额 10,915,434,969.52 份（其中 A 类 8,588,994,866.46 份，C 类 2,326,440,103.06 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏鼎清债券型证券投资基金

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		1,271,984,236.39	6,916,333.19
1.利息收入		643,343.87	143,253.85
其中：存款利息收入	6.4.7.9	562,982.88	107,877.37
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		80,360.99	35,376.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		278,263,121.14	57,449,182.86
其中：股票投资收益	6.4.7.1 0	179,232,568.94	10,862,065.08
基金投资收益	6.4.7.1 1	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	95,081,098.55	46,341,029.32
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	3,949,453.65	246,088.46
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	992,274,564.74	-50,728,801.85
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	803,206.64	52,698.33
减：二、营业总支出		20,868,850.33	1,776,520.60
1.管理人报酬		14,271,949.35	1,103,085.89
2.托管费		3,996,145.86	308,864.09
3.销售服务费		1,732,896.33	42,238.12
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		638,805.50	200,568.94
其中：卖出回购金融资产支出		638,805.50	200,568.94
6.信用减值损失	6.4.7.2	-	-

	0		
7.税金及附加		71,787.77	3,412.81
8.其他费用	6.4.7.2 1	157,265.52	118,350.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,251,115,386.06	5,139,812.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,251,115,386.06	5,139,812.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,251,115,386.06	5,139,812.59

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏鼎清债券型证券投资基金

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	1,325,147,174.55	252,605,487.56	1,577,752,662.11
二、本期期初净资产	1,325,147,174.55	252,605,487.56	1,577,752,662.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,590,287,794.97	4,052,453,375.25	13,642,741,170.22
（一）、综合收益总额	-	1,251,115,386.06	1,251,115,386.06
（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）	9,590,287,794.97	2,801,337,989.19	12,391,625,784.16
其中：1.基金申购款	12,676,683,113.93	3,716,048,788.79	16,392,731,902.72
2.基金赎回款	-3,086,395,318.96	-914,710,799.60	-4,001,106,118.56
（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	10,915,434,969.52	4,305,058,862.81	15,220,493,832.33
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	1,874,472,861.92	94,158,450.14	1,968,631,312.06
二、本期期初净资产	1,874,472,861.92	94,158,450.14	1,968,631,312.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,556,806,238.84	-68,001,432.63	-1,624,807,671.47
（一）、综合收益总额	-	5,139,812.59	5,139,812.59
（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）	-1,556,806,238.84	-73,141,245.22	-1,629,947,484.06
其中：1.基金申购款	90,666,648.19	6,899,862.26	97,566,510.45
2.基金赎回款	-1,647,472,887.03	-80,041,107.48	-1,727,513,994.51
（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	317,666,623.08	26,157,017.51	343,823,640.59

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

华夏鼎清债券型证券投资基金（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[2020]1636 号《关于准予华夏鼎清债券型证券投资基金注册的批复》，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》、《华夏鼎清债券型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 2020 年 11 月 25 日至 2020 年 12 月 1 日共募集 10,639,672,073.58 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（2020）验字第 60739337_A76 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏鼎清债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 12 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,641,511,756.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,839,682.78 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本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（包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、证券公司短期公司债券、

政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）、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)。

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	212,888,446.08
等于：本金	212,856,295.36
加：应计利息	32,150.72
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	212,888,446.08

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	2,115,361,374.67	-	3,099,012,913.82	983,651,539.15

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,830,528,566.34	10,431,457.83	2,876,922,603.23	35,962,579.06
	银行间市场	9,252,675,505.42	72,228,277.29	9,338,410,277.29	13,506,494.58
	合计	12,083,204,071.76	82,659,735.12	12,215,332,880.52	49,469,073.64
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		14,198,565,446.43	82,659,735.12	15,314,345,794.34	1,033,120,612.79

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	2,973,109.43
其中：交易所市场	2,919,973.93
银行间市场	53,135.50
应付利息	-
预提费用	131,780.45

合计	3,104,889.88
----	--------------

6.4.7.7 实收基金

华夏鼎清债券 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	1,245,027,745.95	1,245,027,745.95
本期申购	9,543,419,295.29	9,543,419,295.29
本期赎回（以“-”号填列）	-2,199,452,174.78	-2,199,452,174.78
本期末	8,588,994,866.46	8,588,994,866.46

华夏鼎清债券 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	80,119,428.60	80,119,428.60
本期申购	3,133,263,818.64	3,133,263,818.64
本期赎回（以“-”号填列）	-886,943,144.18	-886,943,144.18
本期末	2,326,440,103.06	2,326,440,103.06

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

华夏鼎清债券 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	191,030,106.56	48,112,969.87	239,143,076.43
本期期初	191,030,106.56	48,112,969.87	239,143,076.43
本期利润	212,062,193.20	805,216,976.82	1,017,279,170.02
本期基金份额交易产生的变动数	1,270,665,378.93	916,985,017.08	2,187,650,396.01
其中：基金申购款	1,652,168,650.55	1,177,944,749.43	2,830,113,399.98
基金赎回款	-381,503,271.62	-260,959,732.35	-642,463,003.97

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,673,757,678.69	1,770,314,963.77	3,444,072,642.46

华夏鼎清债券 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	10,436,819.59	3,025,591.54	13,462,411.13
本期期初	10,436,819.59	3,025,591.54	13,462,411.13
本期利润	46,778,628.12	187,057,587.92	233,836,216.04
本期基金份额交易产生的变动数	334,641,831.40	279,045,761.78	613,687,593.18
其中：基金申购款	473,837,735.92	412,097,652.89	885,935,388.81
基金赎回款	-139,195,904.52	-133,051,891.11	-272,247,795.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	391,857,279.11	469,128,941.24	860,986,220.35

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	227,748.16
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	38,560.86
其他	296,673.86
合计	562,982.88

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	2,426,403,397.64
减：卖出股票成本总额	2,242,634,044.82
减：交易费用	4,536,783.88
买卖股票差价收入	179,232,568.94

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	41,506,593.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	53,574,505.34
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	95,081,098.55

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	2,755,338,354.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,675,305,208.86
减：应计利息总额	26,337,798.69
减：交易费用	120,841.86
买卖债券差价收入	53,574,505.34

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	3,949,453.65
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	3,949,453.65

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	992,274,564.74
——股票投资	942,095,228.51
——债券投资	50,179,336.23
——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	992,274,564.74

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	803,206.64
合计	803,206.64

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	51,885.07
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	157,265.52

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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	-	-	3,080,858.00	0.40%

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	-	-	4,343,994.84	0.97%

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	-	-	270,100,000.00	12.20%

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	-	-	-	-
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	1,373.63	0.40%	1,373.63	0.28%
------	----------	-------	----------	-------

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	14,271,949.35	1,103,085.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,862,384.00	468,388.31
应支付基金管理人的净管理费	12,409,565.35	634,697.58

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 0.50%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	3,996,145.86	308,864.09

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 0.14%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		
	华夏鼎清债券 A	华夏鼎清债券 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	712,275.86	712,275.86
中国银行	-	22,388.69	22,388.69
华夏财富	-	4,079.53	4,079.53
中信证券（山东）	-	713.13	713.13
中信证券	-	208.32	208.32
中信证券（华南）	-	64.94	64.94
合计	-	739,730.47	739,730.47
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		
	华夏鼎清债券 A	华夏鼎清债券 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	13,163.32	13,163.32
中国银行	-	11,453.52	11,453.52
中信证券	-	23.82	23.82
中信证券（华南）	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-
华夏财富	-	-	-
合计	-	24,640.66	24,640.66

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 0.40% 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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		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
中国银行活期存款	212,888,446.08	227,748.16	3,009,534.61	84,689.39

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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	500	5,055.00
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	500	5,055.00	5,055.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026-06-23	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	1,070	107,000.00	107,001.88	期末估值单价为含息价格

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	879.53	2026-07-13	890.99	48,748	30,685,545.12	42,875,328.44	-

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 200,000,000.00 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	212,888,446.08	-	-	212,888,446.08
结算备付金	24,583,564.21	-	-	24,583,564.21
存出保证金	1,159,813.39	-	-	1,159,813.39
债券投资	4,665,193,794.98	6,328,780,895.39	1,221,358,190.15	12,215,332,880.52

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	200,000,000.00	-	-	200,000,000.00

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	13,082,972.18	-	-	13,082,972.18
结算备付金	10,943,205.43	-	-	10,943,205.43
存出保证金	138,285.43	-	-	138,285.43
债券投资	947,809,264.18	203,622,306.30	121,982,922.40	1,273,414,492.88
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	16,744,553.45	-	-	16,744,553.45

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	93,201,481.81	5,898,935.15
	利率上升 25 个基点	-91,725,071.06	-5,794,954.22

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	3,099,012,913.82	20.36	306,042,029.23	19.40
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	345,382,580.66	2.27	42,027,482.28	2.66
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	3,444,395,494.48	22.63	348,069,511.51	22.06

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	除沪深 300 指数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%	-296,753,326.22	-31,840,299.49
	+5%	296,753,326.22	31,840,299.49

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	3,401,408,109.16
第二层次	11,912,937,685.18
第三层次	-
合计	15,314,345,794.34

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	3,099,012,913.82	19.29
	其中：股票	3,099,012,913.82	19.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,215,332,880.52	76.04
	其中：债券	12,215,332,880.52	76.04
	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	237,472,010.29	1.48
8	其他各项资产	512,013,694.79	3.19
9	合计	16,063,831,499.42	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	-	-
B	采矿业	17,213,346.00	0.11
C	制造业	2,898,692,167.02	19.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,102.60	0.00
E	建筑业	30,058,210.00	0.20
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	153,043,088.20	1.01
J	金融业	-	-
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	3,099,012,913.82	20.36

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	002463	沪电股份	758,600	115,914,080.00	0.76
2	603986	兆易创新	124,700	101,630,500.00	0.67
3	002409	雅克科技	379,500	85,197,750.00	0.56
4	601138	工业富联	1,176,000	84,848,400.00	0.56
5	688048	长光华芯	166,446	83,555,892.00	0.55
6	300285	国瓷材料	785,600	81,058,208.00	0.53
7	688766	普冉股份	86,884	66,605,274.40	0.44
8	600183	生益科技	379,700	65,839,980.00	0.43
9	300476	胜宏科技	187,000	64,782,410.00	0.43
10	688630	芯碁微装	117,778	64,706,055.42	0.43
11	300548	长芯博创	220,300	61,243,400.00	0.40
12	688008	澜起科技	196,490	60,892,251.00	0.40
13	000962	东方钽业	659,300	59,732,580.00	0.39
14	688141	杰华特	362,079	55,579,126.50	0.37
15	000811	冰轮环境	981,900	55,202,418.00	0.36
16	688392	骄成超声	239,303	54,364,855.54	0.36
17	300811	铂科新材	568,080	53,905,111.20	0.35
18	300620	光库科技	141,140	53,379,148.00	0.35
19	002384	东山精密	196,837	51,640,186.95	0.34
20	688456	有研粉材	357,973	49,973,030.80	0.33
21	002436	兴森科技	974,000	49,625,300.00	0.33
22	300666	江丰电子	134,600	49,613,560.00	0.33
23	688700	东威科技	546,513	48,858,262.20	0.32
24	002938	鹏鼎控股	459,700	48,443,186.00	0.32
25	603678	火炬电子	569,100	47,235,300.00	0.31
26	688409	富创精密	149,846	45,890,337.50	0.30

27	688313	仕佳光子	238,352	44,011,696.80	0.29
28	688020	方邦股份	175,946	43,916,121.60	0.29
29	688300	联瑞新材	178,576	43,643,974.40	0.29
30	002916	深南电路	95,200	43,592,080.00	0.29
31	688072	拓荆科技	48,748	42,875,328.44	0.28
32	688548	广钢气体	814,196	42,419,611.60	0.28
33	688531	日联科技	238,525	42,419,286.00	0.28
34	605589	圣泉集团	605,000	38,459,850.00	0.25
35	603124	江南新材	205,100	38,349,598.00	0.25
36	300835	龙磁科技	163,200	37,452,768.00	0.25
37	000657	中钨高新	381,000	36,469,320.00	0.24
38	688328	深科达	381,070	36,468,399.00	0.24
39	300408	三环集团	215,000	35,883,500.00	0.24
40	605111	新洁能	342,296	33,935,225.44	0.22
41	300308	中际旭创	26,100	33,147,000.00	0.22
42	688508	芯朋微	334,110	31,058,865.60	0.20
43	688396	华润微	316,711	30,895,158.05	0.20
44	603929	亚翔集成	110,500	30,058,210.00	0.20
45	688183	生益电子	224,756	29,757,694.40	0.20
46	300679	电连技术	472,500	28,345,275.00	0.19
47	688627	精智达	39,111	27,964,365.00	0.18
48	301013	利和兴	384,600	27,787,350.00	0.18
49	300502	新易盛	45,640	27,703,480.00	0.18
50	688012	中微公司	58,393	27,357,120.50	0.18
51	002281	光迅科技	105,100	27,004,394.00	0.18
52	688170	德龙激光	278,260	26,715,742.60	0.18
53	300223	北京君正	106,500	26,507,850.00	0.17
54	688668	鼎通科技	69,203	25,833,479.90	0.17
55	002484	江海股份	243,400	25,557,000.00	0.17
56	688312	燕麦科技	291,248	24,461,919.52	0.16

57	301123	奕东电子	197,600	23,854,272.00	0.16
58	688702	盛科通信	58,390	22,771,516.10	0.15
59	600549	厦门钨业	265,300	22,603,560.00	0.15
60	688536	思瑞浦	60,409	21,994,312.81	0.14
61	688368	晶丰明源	99,940	21,639,008.80	0.14
62	301626	苏州天脉	55,500	21,309,780.00	0.14
63	003031	中瓷电子	110,800	19,977,240.00	0.13
64	000021	深科技	310,200	19,936,554.00	0.13
65	300604	长川科技	53,400	18,231,828.00	0.12
66	301018	申菱环境	155,820	18,014,350.20	0.12
67	600259	中稀有色	169,400	17,212,734.00	0.11
68	002008	大族激光	112,200	16,842,342.00	0.11
69	688205	德科立	75,156	15,646,727.64	0.10
70	301021	英诺激光	127,400	15,530,060.00	0.10
71	688535	华海诚科	81,108	15,167,196.00	0.10
72	688200	华峰测控	28,645	15,041,489.50	0.10
73	603688	石英股份	181,600	15,001,976.00	0.10
74	002957	科瑞技术	268,700	14,735,508.00	0.10
75	688143	长盈通	79,663	14,011,128.44	0.09
76	300747	锐科激光	257,000	13,644,130.00	0.09
77	603203	快克智能	144,820	11,119,279.60	0.07
78	002741	光华科技	310,900	11,111,566.00	0.07
79	300570	太辰光	42,100	10,386,491.00	0.07
80	002222	福晶科技	111,200	10,261,536.00	0.07
81	688037	芯源微	21,680	9,518,604.00	0.06
82	600601	方正科技	632,200	8,749,648.00	0.06
83	001359	平安电工	37,570	4,705,642.50	0.03
84	002440	闰土股份	12,200	125,050.00	0.00
85	688333	铂力特	410	41,984.00	0.00
86	603061	金海通	75	37,666.50	0.00

87	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00
88	300136	信维通信	41	4,889.25	0.00
89	600276	恒瑞医药	40	2,081.60	0.00
90	301201	诚达药业	40	1,454.40	0.00
91	002203	海亮股份	57	1,302.45	0.00
92	000338	潍柴动力	40	1,090.00	0.00
93	600642	申能股份	120	1,047.60	0.00
94	000807	云铝股份	44	974.16	0.00
95	002782	可立克	46	968.30	0.00
96	300919	中伟新材	20	875.00	0.00
97	000975	山金国际	36	612.00	0.00
98	300858	科拓生物	30	455.70	0.00
99	300257	开山股份	14	401.52	0.00
100	600941	中国移动	3	258.39	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	601138	工业富联	117,984,725.94	7.48
2	002463	沪电股份	68,444,036.00	4.34
3	000962	东方钽业	58,242,307.03	3.69
4	603986	兆易创新	57,799,456.00	3.66
5	002409	雅克科技	56,589,860.08	3.59
6	300476	胜宏科技	54,007,274.00	3.42
7	300811	铂科新材	51,537,567.32	3.27
8	002938	鹏鼎控股	49,176,564.00	3.12
9	300620	光库科技	48,669,246.80	3.08
10	603678	火炬电子	44,967,318.00	2.85
11	688392	骄成超声	44,938,160.48	2.85
12	000657	中钨高新	44,710,639.98	2.83

13	688498	源杰科技	43,495,672.00	2.76
14	688313	仕佳光子	42,151,531.46	2.67
15	605589	圣泉集团	41,790,322.00	2.65
16	300285	国瓷材料	41,667,495.00	2.64
17	002384	东山精密	41,349,317.86	2.62
18	688072	拓荆科技	38,170,143.17	2.42
19	002281	光迅科技	37,486,261.00	2.38
20	300666	江丰电子	36,561,446.41	2.32
21	002436	兴森科技	36,450,049.00	2.31
22	688141	杰华特	36,408,508.30	2.31
23	688478	晶升股份	36,297,455.80	2.30
24	688700	东威科技	36,188,274.93	2.29
25	688008	澜起科技	36,169,840.48	2.29
26	688548	广钢气体	36,024,535.18	2.28
27	688456	有研粉材	32,794,665.13	2.08
28	600498	烽火通信	32,239,032.00	2.04
29	600259	中稀有金	32,105,383.00	2.03
30	688531	日联科技	31,793,514.67	2.02
31	300408	三环集团	31,658,670.36	2.01
32	688048	长光华芯	31,639,465.00	2.01
33	688508	芯朋微	31,565,482.94	2.00

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	688498	源杰科技	73,036,656.31	4.63
2	301217	铜冠铜箔	63,333,709.00	4.01
3	688082	盛美上海	37,636,919.86	2.39
4	002922	伊戈尔	36,389,633.00	2.31
5	002636	金安国纪	33,883,288.35	2.15

6	601138	工业富联	33,180,785.00	2.10
7	002008	大族激光	32,655,717.96	2.07
8	688820	盛合晶微	31,888,649.78	2.02
9	688167	炬光科技	30,877,650.59	1.96
10	300395	菲利华	30,562,719.37	1.94
11	002409	雅克科技	30,248,787.40	1.92
12	002281	光迅科技	29,615,397.60	1.88
13	688478	晶升股份	29,232,494.67	1.85
14	603061	金海通	28,509,189.10	1.81
15	600498	烽火通信	28,116,556.00	1.78
16	000657	中钨高新	27,972,728.00	1.77
17	002273	水晶光电	26,124,725.00	1.66
18	300394	天孚通信	25,938,835.00	1.64
19	605060	联德股份	24,989,455.00	1.58
20	600875	东方电气	23,897,382.00	1.51

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	4,093,509,700.90
卖出股票收入（成交）总额	2,426,403,397.64

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	521,394,744.39	3.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,245,253,050.78	60.74
	其中：政策性金融债	3,530,272,974.58	23.19
4	企业债券	633,936,516.19	4.17
5	企业短期融资券	814,691,955.08	5.35

6	中期票据	654,674,033.42	4.30
7	可转债（可交换债）	345,382,580.66	2.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,215,332,880.52	80.26

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	6,000,000	613,331,178.08	4.03
2	312610010	26 建行 TLAC 非资本债 01A(BC)	5,000,000	500,087,041.10	3.29
3	250431	25 农发 31	3,600,000	364,568,745.21	2.40
4	242680012	26 邮储银行 永续债 01BC	3,500,000	350,424,391.78	2.30
5	260411	26 农发 11	3,400,000	341,651,561.64	2.24

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，中国民生银行股份有限公司、中国农业发展银行、中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、国家开发银行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	1,159,813.39
2	应收清算款	67,837,556.68
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	443,016,324.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	512,013,694.79

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	118058	微导转债	96,313,907.25	0.63
2	123158	宙邦转债	51,114,906.12	0.34
3	127109	电化转债	27,149,618.90	0.18
4	127103	东南转债	23,414,450.29	0.15
5	113659	莱克转债	20,369,296.54	0.13
6	113673	岱美转债	16,968,118.04	0.11
7	118053	正帆转债	15,890,118.90	0.10

8	118030	睿创转债	14,653,842.48	0.10
9	113697	应流转债	11,941,407.63	0.08
10	127037	银轮转债	11,074,912.02	0.07
11	123257	安克转债	6,662,057.88	0.04
12	127110	广核转债	6,341,186.15	0.04
13	123259	锦浪转 02	5,797,082.38	0.04
14	118034	晶能转债	5,527,059.14	0.04
15	113696	伯 25 转债	2,974,400.00	0.02
16	110097	天润转债	1,605,446.47	0.01
17	113671	武进转债	1,122,600.85	0.01
18	128128	齐翔转 2	802,343.39	0.01
19	113062	常银转债	608,656.44	0.00
20	110087	天业转债	7,153.29	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
华夏鼎清债券 A	6,474	1,326,690.59	8,315,576,500.98	96.82%	273,418,365.48	3.18%
华夏鼎清债券 C	7,261	320,402.16	2,169,940,108.69	93.27%	156,499,994.37	6.73%
合计	13,735	794,716.78	10,485,516,609.67	96.06%	429,918,359.85	3.94%

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	华夏鼎清债券 A	191,028.34	0.00%
	华夏鼎清债券 C	35.73	0.00%
	合计	191,064.07	0.00%

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	华夏鼎清债券 A	0
	华夏鼎清债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏鼎清债券 A	0
	华夏鼎清债券 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏鼎清债券 A	华夏鼎清债券 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 3 日）基金份额总额	10,391,723,605.63	249,788,150.73
本报告期期初基金份额总额	1,245,027,745.95	80,119,428.60
本报告期基金总申购份额	9,543,419,295.29	3,133,263,818.64
减：本报告期基金总赎回份额	2,199,452,174.78	886,943,144.18
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,588,994,866.46	2,326,440,103.06

§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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

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履职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

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	3	960,646,456.24	14.74%	428,349.20	14.74%	-
东方财富证券	1	805,673,726.38	12.36%	359,244.21	12.36%	-
国盛证券	2	797,064,749.28	12.23%	355,411.21	12.23%	-
浙商证券	1	793,917,873.18	12.18%	354,006.28	12.18%	-
华西证券	1	744,595,398.09	11.43%	332,015.25	11.43%	-
申万宏源证券	4	733,902,162.19	11.26%	327,249.75	11.26%	-
华泰证券	3	677,561,227.33	10.40%	302,125.04	10.40%	-
华源证券	1	437,966,883.91	6.72%	195,290.02	6.72%	-
野村东方国际证券	1	394,771,974.41	6.06%	176,030.10	6.06%	-

财通证券	2	111,315,662.09	1.71%	49,636.41	1.71%	-
中国银河证券	7	39,182,471.18	0.60%	17,471.18	0.60%	-
国信证券	3	20,200,796.00	0.31%	9,007.45	0.31%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

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，本基金还选择了东北证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高盛（中国）证券、广发证券、国金证券、国泰海通证券、华鑫证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、太平洋证券、万和证券、五矿证券、西部证券、信达证券、招商证券、中金公司、中信建投证券、中信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，国泰海通证券的部分交易单元、万和证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金 额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
长江证 券	429,521,089.98	16.89%	3,913,626,000.00	31.97%	-	-	-	-
东方财 富证券	78,440,246.67	3.08%	4,495,230,000.00	36.72%	-	-	-	-
国盛证 券	181,112,377.31	7.12%	1,692,685,000.00	13.83%	-	-	-	-
浙商证 券	146,014,345.56	5.74%	-	-	-	-	-	-
华西证 券	69,298,547.73	2.72%	18,162,000.00	0.15%	-	-	-	-
申万宏 源证券	175,036,496.56	6.88%	1,741,766,000.00	14.23%	-	-	-	-
华泰证 券	202,757,058.03	7.97%	-	-	-	-	-	-
华源证 券	76,077,182.71	2.99%	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	120,538,509.00	4.74%	-	-	-	-	-	-
财通证 券	30,929,428.39	1.22%	381,003,000.00	3.11%	-	-	-	-
中国银 河证券	743,419,512.90	29.23%	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	290,017,320.00	11.40%	-	-	-	-	-	-

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旗下华夏鼎清债券型证券投资基金开通同一基金不同类别基金份额间相互转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-20
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

§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