汇安鼎利纯债债券型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年7月1日起至2026年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇安鼎利纯债		
基金主代码	006431		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019年03月20日		
报告期末基金份额总额	861,717,017.30份		
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	1、债券投资策略 2、资产支持证券投资策略 3、中小企业私募债投资策略 4、国债期货投资策略		
业绩比较基准	中债综合指数收益率		
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。		
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇安鼎利纯债A	汇安鼎利纯债C	汇安鼎利纯债D

下属分级基金的交易代码	006431	006432	028052
报告期末下属分级基金的份额总额	719,243,933.16份	142,471,269.79份	1,814.35份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026年07月01日 - 2026年09月30日)		
	汇安鼎利纯债A	汇安鼎利纯债C	汇安鼎利纯债D
1.本期已实现收益	4,402,596.62	740,590.86	6.57
2.本期利润	7,193,490.17	1,205,573.83	9.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0104	0.0109	0.0106
4.期末基金资产净值	797,797,314.49	157,728,442.29	2,010.78
5.期末基金份额净值	1.1092	1.1071	1.1083

注：1、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。

2、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。

3、本基金自2026年7月3日起新增D类份额。

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

汇安鼎利纯债A净值表现

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	0.94%	0.02%	0.52%	0.03%	0.42%	-0.01%
过去六个月	2.26%	0.02%	1.15%	0.03%	1.11%	-0.01%
过去一年	5.15%	0.03%	1.48%	0.04%	3.67%	-0.01%
过去三年	10.84%	0.05%	5.66%	0.07%	5.18%	-0.02%

过去五年	18.67%	0.05%	8.15%	0.07%	10.52%	-0.02%
过去七年	22.58%	0.05%	10.36%	0.07%	12.22%	-0.02%
自基金合同生效起至今	22.84%	0.05%	10.75%	0.07%	12.09%	-0.02%

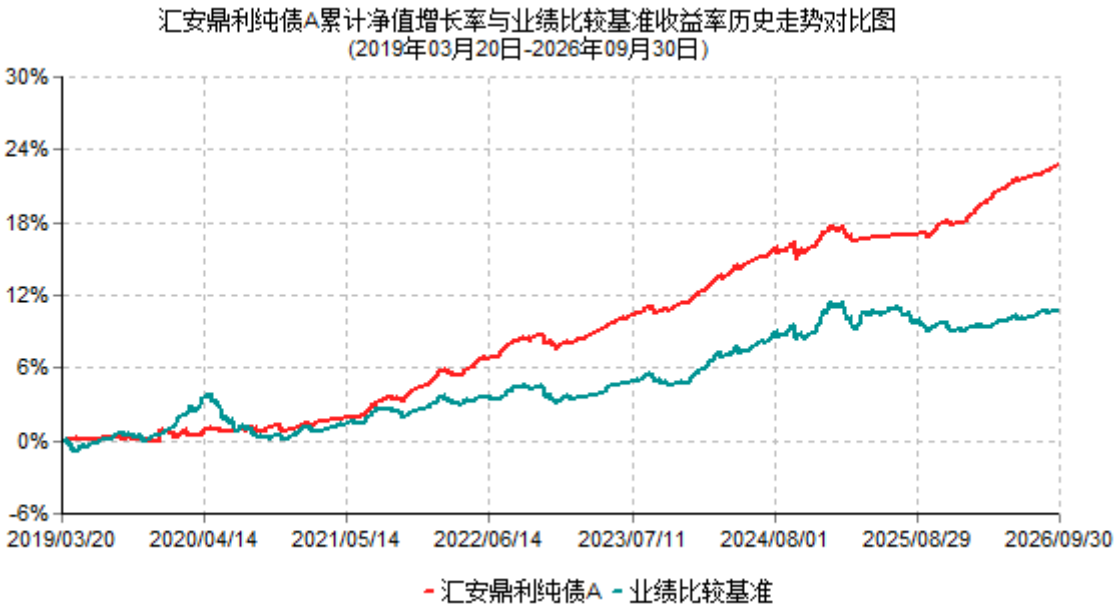
汇安鼎利纯债C净值表现

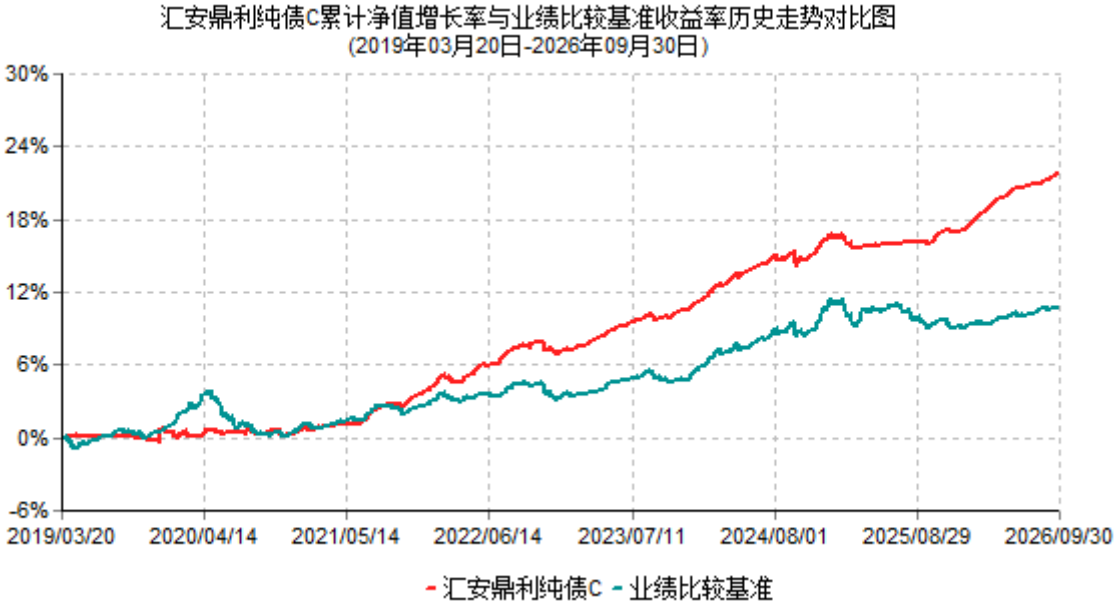
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.93%	0.02%	0.52%	0.03%	0.41%	-0.01%
过去六个月	2.25%	0.02%	1.15%	0.03%	1.10%	-0.01%
过去一年	5.14%	0.03%	1.48%	0.04%	3.66%	-0.01%
过去三年	10.81%	0.05%	5.66%	0.07%	5.15%	-0.02%
过去五年	18.62%	0.05%	8.15%	0.07%	10.47%	-0.02%
过去七年	21.81%	0.05%	10.36%	0.07%	11.45%	-0.02%
自基金合同生效起至今	21.87%	0.05%	10.75%	0.07%	11.12%	-0.02%

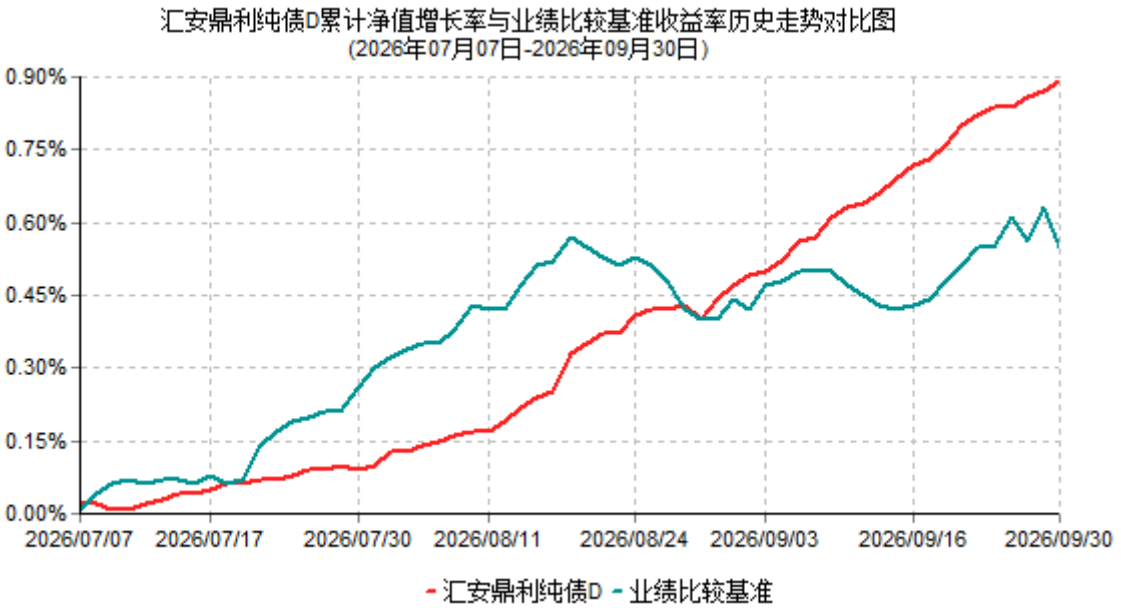
汇安鼎利纯债D净值表现

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
自基金合同生效起至今	0.89%	0.02%	0.55%	0.03%	0.34%	-0.01%

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


汇安鼎利纯债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年03月20日-2026年09月30日)
30%
24%
18%
12%
6%
0%
-6%
2019/03/20
2020/04/14
2021/05/14
2022/06/14
2023/07/11
2024/08/01
2025/08/29
2026/09/30
汇安鼎利纯债A
业绩比较基准


汇安鼎利纯债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年03月20日-2026年09月30日)
30%
24%
18%
12%
6%
0%
-6%
2019/03/20
2020/04/14
2021/05/14
2022/06/14
2023/07/11
2024/08/01
2025/08/29
2026/09/30
汇安鼎利纯债C
业绩比较基准



注：①本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

②本基金自2026年7月3日起新增D类份额。

§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		
金鸿峰	固定收益投资部基金经理、本基金的基金经理	2021-07-28	-	10年	金鸿峰女士，中央财经大学国防经济学硕士研究生，10年证券、基金行业从业经验。曾任北京市农产品电子商务公司市场部经理，2016年5月加入汇安基金管理有限责任公司，现任固定收益投资部基金经理。 2021年8月4日至2022年8月16日，任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至2025年3月4日，任汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证

					券投资基金基金经理；2024年9月25日至2025年12月1日，任汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理；2022年8月16日至2026年8月11日，任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至今，任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至今，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2021年7月23日至今，任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月28日至今，任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月28日至今，任汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年8月4日至今，任汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金基金经理；2022年11月8日至今，任汇安裕泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2025年3月4日至今，任汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理；2025年12月1日至今，任汇安质选增利债券型证券投资基金基金经理；2021年7月23日至2022年7月28日、2026年9月23日至今，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理。

上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债市收益率曲线平坦化，长端表现亮眼，特别是利率债超长端，表现出一定反季节性特征。交易的核心是宽货币预期加强，特别是税期、跨节、债券供给量增加等特殊时点，央行对市场流动性均有一定呵护。在基本面未出现大幅度转向的背景下，叠加资产荒和机构情绪助推，使得三季度债市行情整体偏暖。本产品报告期内继续以信用债配置为主，交易为辅，灵活调整久期和杠杆。往后看，债市大概率继续呈现出震荡态势。四季度长债的供给压力或将缓解，央行宽货币的态度依旧，但政策密集落地期，长端交易相对拥挤时，短期内需警惕阶段性小幅度调整。策略上逢高配置、积累票息；接近区间下限止盈，并审慎控制久期与杠杆。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安鼎利纯债A基金份额净值为1.1092元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.94%，同期业绩比较基准收益率为0.52%；截至报告期末汇安鼎利纯债C基金份额净值为1.1071元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.93%，同期业绩

比较基准收益率为0.52%；截至报告期末汇安鼎利纯债D基金份额净值为1.1083元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.89%，同期业绩比较基准收益率为0.55%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	899,373,903.64	94.03
	其中：债券	878,986,451.50	91.89
	资产支持证券	20,387,452.14	2.13
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	53,063,499.83	5.55
8	其他资产	4,074,570.17	0.43
9	合计	956,511,973.64	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,376,632.88	5.27
	其中：政策性金融债	50,376,632.88	5.27
4	企业债券	80,680,170.69	8.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	747,929,647.93	78.27
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	878,986,451.50	91.99

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	102581551	25即墨旅投MTN001	600,000	62,829,895.89	6.58
2	102601985	26海化集团MTN001	500,000	51,150,958.90	5.35
3	102682073	26青岛地铁MTN003A	500,000	50,369,882.19	5.27
4	102683669	26寿光金旭MTN007	500,000	50,038,753.42	5.24
5	102680122	26临沂投资MTN001	400,000	42,370,204.93	4.43

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	267630	潍信1优	200,000	20,338,246.58	2.13
2	146938	诚远2A1	100,000	49,205.56	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述2只资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，潍坊水务、水发集团在过去一年受过立案调查或公开处罚，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。

本基金投资的其余前十名证券的发行主体本期未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 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,074,570.17
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,074,570.17

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

	汇安鼎利纯债A	汇安鼎利纯债C	汇安鼎利纯债D
报告期期初基金份额总额	627,952,621.66	13,392,133.77	-
报告期期间基金总申购份额	108,758,132.79	191,407,597.16	1,814.35
减：报告期期间基金总赎回份额	17,466,821.29	62,328,461.14	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	719,243,933.16	142,471,269.79	1,814.35

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260701-20260930	627,684,248.23	-	-	627,684,248.23	72.84%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一基金份额持有人持有基金份额比例超过20%的情况，投资人在投资本基金时，可能面临本基金因持有人集中度较高而产生的相应风险，具体包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于5000万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将在基金运作中对以上风险进行严格的监控和管理，保护中小投资者利益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准汇安鼎利纯债债券型证券投资基金募集的文件

（2）《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金合同》

（3）《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金招募说明书》

（4）《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金托管协议》

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照

（6）在规定报刊及规定网站上披露的各项公告

（7）中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：http://www.huianfund.cn

汇安基金管理有限责任公司

2026年10月27日