

新华鼎利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：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月二十八日

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。

基金托管人中国民生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
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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
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所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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的情况	50
9 开放式基金份额变动	50
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	51
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	51
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
10.8 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	51
10.9 其他重大事件	53
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
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
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	新华鼎利债券型证券投资基金		
基金简称	新华鼎利债券		
基金主代码	004647		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 日		
基金管理人	新华基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	80,302,910.37 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	新华鼎利债券 A	新华鼎利债券 C	新华鼎利债券 E
下属分级基金的交易代码	004647	006892	014265
报告期末下属分级基金的 份额总额	70,903,815.75 份	505,797.50 份	8,893,297.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险并保持较高资产流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略主要通过国内外宏观经济运行状况、市场利率走势、国家财政和货币政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，评估未来一段时间股票、债券和现金类资产的相对收益率，在股票、债券和现金类资产之间进行动态配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，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		新华基金管理股份有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	林盛
	联系电话	010-68779688	010-58560666
	电子邮箱	qiyang@ncfund.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95568
传真		010-68779528	010-57093382

注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街2 号
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层,北京市西 城区平安里西大街26号新时代 大厦9层、11层	北京市西城区复兴门内大街2 号
邮政编码	400010	100031
法定代表人	银国宏	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼 19 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 日至 2026 年 6 月 30 日）		
	新华鼎利债券 A	新华鼎利债券 C	新华鼎利债券 E
本期已实现收益	417,555.34	10,836.55	9,699.22
本期利润	-648,679.19	39,365.98	-25,907.15
加权平均基金份额本期利 润	-0.0103	0.0209	-0.0044
本期加权平均净值利润率	-0.84%	1.74%	-0.40%
本期基金份额净值增长率	-0.33%	-0.52%	-0.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	新华鼎利债券 A	新华鼎利债券 C	新华鼎利债券 E
期末可供分配利润	16,249,117.99	99,084.33	1,082,201.68
期末可供分配基金份额利 润	0.2292	0.1959	0.1217
期末基金资产净值	87,152,933.74	604,881.83	9,975,498.80

期末基金份额净值	1.2292	1.1959	1.1217
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	新华鼎利债券 A	新华鼎利债券 C	新华鼎利债券 E
基金份额累计净值增长率	25.46%	21.77%	12.83%

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；

2、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、对期末可供分配利润，采用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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

新华鼎利债券 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	1.28%	0.35%	1.74%	0.14%	-0.46%	0.21%
过去六个月	-0.33%	0.34%	1.62%	0.12%	-1.95%	0.22%
过去一年	-0.69%	0.24%	1.98%	0.11%	-2.67%	0.13%
过去三年	8.19%	0.16%	7.80%	0.11%	0.39%	0.05%
过去五年	16.40%	0.13%	7.84%	0.11%	8.56%	0.02%
过去七年	25.22%	0.29%	13.34%	0.12%	11.88%	0.17%
自基金合同生效起至今	25.46%	0.29%	13.87%	0.12%	11.59%	0.17%

新华鼎利债券 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	1.18%	0.35%	1.74%	0.14%	-0.56%	0.21%
过去六个月	-0.52%	0.34%	1.62%	0.12%	-2.14%	0.22%
过去一年	-1.08%	0.23%	1.98%	0.11%	-3.06%	0.12%
过去三年	6.89%	0.16%	7.80%	0.11%	-0.91%	0.05%
过去五年	14.05%	0.13%	7.84%	0.11%	6.21%	0.02%
过去七年	21.56%	0.29%	13.34%	0.12%	8.22%	0.17%
自基金合同生效起至今	21.77%	0.29%	13.87%	0.12%	7.90%	0.17%

新华鼎利债券 E

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	1.18%	0.35%	1.74%	0.14%	-0.56%	0.21%
过去六个月	-0.55%	0.34%	1.62%	0.12%	-2.17%	0.22%
过去一年	-0.82%	0.24%	1.98%	0.11%	-2.80%	0.13%
过去三年	7.20%	0.16%	7.80%	0.11%	-0.60%	0.05%
自基金合同生效起至今	12.83%	0.13%	7.67%	0.11%	5.16%	0.02%

注：本基金自 2021 年 11 月 17 日起增加 E 类基金份额（基金代码：014265）。

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

新华鼎利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
(2019 年 6 月 12 日至 2026 年 6 月 30 日)

新华鼎利债券 A



新华鼎利债券 C



新华鼎利债券 E



注：本基金自 2021 年 11 月 17 日起增加 E 类基金份额（基金代码：014265）。

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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家公募基金管理公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金、新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、新华科技优选混合型发起式证券投资基金、新华低碳经济混合型发起式证券投资基金、新华医疗创新混合型发起式证券投资基金、新华大盘成长量化选股混合型发起式证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、新华锦利债券型证券投资基金、新华科技甄选混合型发起式证券投资基金、新华数字经

济混合型发起式证券投资基金、新华中证科创创业 50 指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
李晓然	本基金基金经理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、新华双利债券型证券投资基金基金经理。	2023-05-12	-	13	金融与投资硕士，曾任大公国际资信评估有限公司分析师、行业组长、经理，新华基金管理股份有限公司信用研究员、基金经理助理。
林翟	本基金基金经理，新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华双利债券型证券投资基金基金经理、新华行业龙头主题股票型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华大盘成长量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理、新华锦利债券型证券投资	2026-01-16	-	16	金融工程硕士，曾任华农财产保险股份有限公司投资经理、中英人寿保险有限公司投资经理、新时代证券股份有限公司高级投资经理、北信瑞丰基金管理有限公司基金经理。

	资基金基金经 理。				
朱韦康	本基金基金经 理助理，新华 纯债添利债券 型发起式证券 投资基金基金 经理助理、新 华安享惠金定 期开放债券型 证券投资基金 基金经理助理 、新华活期 添利货币市场 基金基金经 理助理、新华壹 诺宝货币市场 基金基金经 理助理、新华鑫 日享中短债债 券型证券投资 基金基金经 理助理、新华安 享惠泽 39 个 月定期开放债 券型证券投资 基金基金经 理助理、新华丰 利债券型证券 投资基金基金 经理助理、新 华安享惠融 88 个月定期 开放债券型证 券投资基金基 金经理助理、 新华中债 1-5 年农发行债券 指数证券投资 基金基金经 理助理、新华利 率债债券型证 券投资基金基 金经理助理、 新华红利回报	2022-12-2 8	2026-02-12	8	经济学博士，曾任中国国际金融股 份有限公司固定收益分析师，建信 信托有限责任公司投资经理。

	混合型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理助理。				
--	---	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.3 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

本报告期末不存在基金经理同时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，新华基金管理股份有限公司作为新华鼎利债券型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鼎利债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

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》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；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，未发生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%情形。

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，权益与债券市场均呈现阶段性波动。A 股一季度先升后震荡，二季度人工智能、半导体等硬科技方向快速上涨，5 月中下旬以后高位板块波动加大，市场整体呈现少数成长板块占优、传统行业及多数个股相对偏弱的结构。债券市场总体震荡偏强，收益率受基本面、供给和资金面变化影响区间波动；可转债随权益市场先涨后调，估值与溢价率维持较高水平，个券交易属性增强。

股票部分以量化多因子策略为核心，整体保持大盘均衡风格，在大市值、成长、估值、盈利、动量和反转等因子维度进行分散配置；可转债部分重点关注转股价值较高、溢价率相对可控的品种；纯债部分主要配置短久期利率债，以获取基础收益并降低组合波动。

一季度权益建仓时点相对偏晚，未充分参与年初上涨，随后市场调整对组合净值造成一定影响。二季度组合净值有所修复，但由于权益持仓较为分散、风格较为均衡，在收益高度集中于科技成长的市场环境中，超额收益相对有限，上半年基金净值小幅回撤。报告期内，管理人持续补充了现金流、盈利质量和单季度经营变化等因子，并控制了可转债估值风险与债券久期风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.2292 元，本报告期份额净值增长率为-0.33%，同期业绩比较基准收益率为 1.62%；C 类基金份额净值为 1.1959 元，本报告期份额净值增长率为-0.52%，同期业绩比较基准收益率为 1.62%；E 类基金份额净值为 1.1217 元，本报告期份额净值增长率为-0.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.62%。

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，权益市场可能由估值修复逐步转向盈利验证，科技成长仍具产业趋势，但高估值和高拥挤度将增加波动；若宏观数据与企业盈利边际改善，低估值、高现金流及顺周期方向可能获得更多关注。债券市场的配置价值仍在，但在收益率较低背景下，应关注宽信用、供给节奏及资金面变化对中长久期品种的影响。

本基金将延续大盘均衡的权益配置思路，进一步强化现金流、盈利质量和估值约束，避免单一风格过度集中。债券部分仍以流动性较好的短久期利率债和高等级品种为主，审慎管理久期；可转债部分将坚持转股价值与溢价率并重，在估值可控的前提下保留适度增强收益的能力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期末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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、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方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“关

联方证券出借”、“各关联方投资本基金的情况”、“关联方承销证券”和“金融工具风险及管理”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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华鼎利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	573,964.34	365,164.44
结算备付金		904,650.68	197,735.65
存出保证金		12,471.96	2,058.31
交易性金融资产	6.4.7.2	96,855,978.13	14,076,697.95
其中：股票投资		16,566,692.60	-
基金投资		-	-
债券投资		80,289,285.53	14,076,697.95
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	-	999,736.74
应收清算款		227,679.06	164,222.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	20,017.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		98,574,744.17	15,825,633.40
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		700,000.00	-
应付清算款		34.14	7,538.30
应付赎回款		2,835.13	6,079.79
应付管理人报酬		23,995.44	4,122.81

应付托管费		7,998.48	1,374.30
应付销售服务费		3,469.94	3,910.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		613.57	36.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	102,483.10	121,916.90
负债合计		841,429.80	144,978.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	80,302,910.37	12,954,728.90
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	17,430,404.00	2,725,926.34
净资产合计		97,733,314.37	15,680,655.24
负债和净资产总计		98,574,744.17	15,825,633.40

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 80,302,910.37 份。其中：A 类基金份额净值 1.2292 元，基金份额 70,903,815.75 份；C 类基金份额净值 1.1959 元，基金份额 505,797.50 份；E 类基金份额净值 1.1217 元，基金份额 8,893,297.12 份。

6.2 利润表

会计主体：新华鼎利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		-374,355.22	1,766,342.14
1.利息收入		6,656.19	229,271.39
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,047.44	25,658.98
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		1,608.75	203,612.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		691,763.05	25,643,082.62
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-22,328.55	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	594,315.17	25,643,082.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	119,776.43	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,073,311.47	-24,109,127.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	537.01	3,115.56
减：二、营业总支出		260,865.14	2,333,927.16
1. 管理人报酬		128,041.08	1,028,335.95
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		42,680.30	342,778.67
3. 销售服务费		16,798.32	25,700.47
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		45,981.11	811,119.93
其中：卖出回购金融资产支出		45,981.11	811,119.93
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		303.99	19,048.24
8. 其他费用	6.4.7.20	27,060.34	106,943.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-635,220.36	-567,585.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-635,220.36	-567,585.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-635,220.36	-567,585.02

6.3 净资产变动表

会计主体：新华鼎利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	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	12,954,728.90	-	2,725,926.34	15,680,655.24
二、本期期初净资产	12,954,728.90	-	2,725,926.34	15,680,655.24
三、本期增减变动 额（减少以“-” 号填列）	67,348,181.47	-	14,704,477.66	82,052,659.13
（一）、综合收益 总额	-	-	-635,220.36	-635,220.36
（二）、本期基金	67,348,181.47	-	15,339,698.02	82,687,879.49

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	78,356,220.85	-	17,645,129.91	96,001,350.76
2.基金赎回款	-11,008,039.38	-	-2,305,431.89	-13,313,471.27
（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	80,302,910.37	-	17,430,404.00	97,733,314.37
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	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	936,001,113.35	-	191,352,754.70	1,127,353,868.05
二、本期期初净资产	936,001,113.35	-	191,352,754.70	1,127,353,868.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-924,922,153.62	-	-188,823,185.41	-1,113,745,339.03
（一）、综合收益总额	-	-	-567,585.02	-567,585.02
（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）	-924,922,153.62	-	-188,255,600.39	-1,113,177,754.01
其中：1.基金申购款	8,424,965.24	-	1,850,623.43	10,275,588.67
2.基金赎回款	-933,347,118.86	-	-190,106,223.82	-1,123,453,342.68
（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	11,078,959.73	-	2,529,569.29	13,608,529.02

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：银国宏，主管会计工作负责人：王宇成，会计机构负责人：涂运华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华鼎利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1850 号文的核准，由新华基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2019 年 6 月 12 日正式生效，首次设立募集规模为 218,837,246.26 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“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”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华鼎利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本基金编制的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的财务状况、经营成果和净资产变动情况等相关信息。

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

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致，所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

自 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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，

其股息红利所得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，暂减按 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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	573,964.34
等于：本金	573,816.01
加：应计利息	148.33
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	573,964.34

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	17,545,628.59	-	16,566,692.60	-978,935.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所 市场	17,924,139.98	142,777.68	17,924,715.68	-142,201.98
	银行间 市场	61,426,840.00	893,569.85	62,364,569.85	44,160.00
	合计	79,350,979.98	1,036,347.53	80,289,285.53	-98,041.98
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		96,896,608.57	1,036,347.53	96,855,978.13	-1,076,977.97

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	84,771.49
其中：交易所市场	83,570.99
银行间市场	1,200.50

应付利息	-
应付账户维护费	9,000.00
应付审计费	8,711.61
合计	102,483.10

6.4.7.7 实收基金

新华鼎利债券 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	账面金额
上年度末	3,449,031.35	3,449,031.35
本期申购	69,265,063.64	69,265,063.64
本期赎回（以“-”号填列）	-1,810,279.24	-1,810,279.24
本期末	70,903,815.75	70,903,815.75

新华鼎利债券 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	账面金额
上年度末	9,504,449.79	9,504,449.79
本期申购	199,055.00	199,055.00
本期赎回（以“-”号填列）	-9,197,707.29	-9,197,707.29
本期末	505,797.50	505,797.50

新华鼎利债券 E

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	账面金额
上年度末	1,247.76	1,247.76
本期申购	8,892,102.21	8,892,102.21
本期赎回（以“-”号填列）	-52.85	-52.85

本期末	8,893,297.12	8,893,297.12
-----	--------------	--------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

新华鼎利债券 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	1,448,961.61	-644,442.82	804,518.79
本期期初	1,448,961.61	-644,442.82	804,518.79
本期利润	417,555.34	-1,066,234.53	-648,679.19
本期基金份额交易产生的变动数	28,412,143.01	-12,318,864.62	16,093,278.39
其中：基金申购款	29,177,467.21	-12,681,456.25	16,496,010.96
基金赎回款	-765,324.20	362,591.63	-402,732.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,278,659.96	-14,029,541.97	16,249,117.99

新华鼎利债券 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	3,667,821.15	-1,746,573.20	1,921,247.95
本期期初	3,667,821.15	-1,746,573.20	1,921,247.95
本期利润	10,836.55	28,529.43	39,365.98
本期基金份额交易产生的变动数	-3,481,182.36	1,619,652.76	-1,861,529.60
其中：基金申购款	77,003.38	-35,840.42	41,162.96
基金赎回款	-3,558,185.74	1,655,493.18	-1,902,692.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	197,475.34	-98,391.01	99,084.33

新华鼎利债券 E

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	268.04	-108.44	159.60
本期期初	268.04	-108.44	159.60
本期利润	9,699.22	-35,606.37	-25,907.15
本期基金份额交易产生的变动数	1,934,640.61	-826,691.38	1,107,949.23
其中：基金申购款	1,934,651.99	-826,696.00	1,107,955.99
基金赎回款	-11.38	4.62	-6.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,944,607.87	-862,406.19	1,082,201.68

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	2,868.80
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	1,257.64
其他	921.00
合计	5,047.44

注：本项结算备付金利息收入包含保证金利息收入。

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	57,220,605.26
减：卖出股票成本总额	57,155,611.92
减：交易费用	87,321.89
买卖股票差价收入	-22,328.55

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

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	741,040.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-146,725.54
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	594,315.17

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	155,929,788.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	153,534,583.64
减：应计利息总额	2,537,117.61
减：交易费用	4,812.30
买卖债券差价收入	-146,725.54

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

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	119,776.43
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	119,776.43

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	-1,073,311.47
——股票投资	-978,935.99
——债券投资	-94,375.48
——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	-1,073,311.47

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	537.01
合计	537.01

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 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	8,711.61
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,294.69
存托服务费	8.04
账户维护费	15,800.00
查询费	246.00
合计	27,060.34

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准日，本基金无需要披露的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

本报告期内本基金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
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
金融街证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
恒泰资本投资有限责任公司	基金管理人股东的控股子公司

注：1、自 2025 年 9 月 9 日起，公司控股股东恒泰证券股份有限公司更名为金融街证券股份有限公司。

2、以下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		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	
	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
金融街证券股份有 限公司	2,414,449.68	1.83%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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	
	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
金融街证券股份有限 公司	16,825,660.37	14.08%	-	-

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		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	
	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
金融街证券股份有限 公司	102,400,000.00	12.34%	-	-

6.4.10.1.5 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
金融街证券股份有限 公司	1,076.63	2.14%	1,076.63	1.29%
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
金融街证券股份有限 公司	-	-	-	-

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算。

2、根据《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的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得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	128,041.08	1,028,335.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,686.58	10,379.95
应支付基金管理人的净管理费	123,354.50	1,017,956.00

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值 0.3%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×年费率/当年天数；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，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	42,680.30	342,778.67

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=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			
	新华鼎利债券 A	新华鼎利债券 C	新华鼎利债券 E	合计
中国民生银 行股份有限 公司	-	225.82	-	225.82
新华基金管 理股份有限 公司	-	-	12,336.40	12,336.40
合计	-	225.82	12,336.40	12,562.22

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			
	新华鼎利债券 A	新华鼎利债券 C	新华鼎利债券 E	合计
中国民生银 行股份有限 公司	-	312.87	-	312.87
新华基金管 理股份有限 公司	-	-	129.41	129.41
合计	-	312.87	129.41	442.28

注：本基金 C 类、E 类基金的销售服务费按前一日 C 类、E 类基金资产净值 0.4%的年费率分别计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日 C 类、E 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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

新华鼎利债券 E

份额单位：份

关联方名称	新华鼎利债券E本期末 2026年6月30日		新华鼎利债券E上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例

恒泰资本投资有限 责任公司	8,892,050.51	99.99%	-	-
------------------	--------------	--------	---	---

注：对于分级基金，下属分级份额占比的分母采用各自级别的份额。

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
中国民生银行股份有限公司	573,964.34	2,868.80	101,538.37	25,624.80

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券产生的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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，本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 700,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会下设的审计委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的投资备选库制度、交易对手库管理和分散化投资方式防范信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	33,457,521.92	12,024,382.13
合计	33,457,521.92	12,024,382.13

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年末 2025年12月31日
AAA	701,865.94	107,057.15
AAA 以下	2,887,840.28	165,812.61
未评级	43,242,057.39	1,779,446.06
合计	46,831,763.61	2,052,315.82

- 注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
- 2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	不计息	合计
资产					
货币资金	573,964.34	-	-	-	573,964.34
结算备付金	904,650.68	-	-	-	904,650.68
存出保证金	12,471.96	-	-	-	12,471.96
交易性金融资产	79,082,655.53	1,206,630.00	-	16,566,692.60	96,855,978.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	227,679.06	227,679.06
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	80,573,742.51	1,206,630.00	-	16,794,371.66	98,574,744.17
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资	700,000.00	-	-	-	700,000.00

产款					
应付清算款	-	-	-	34.14	34.14
应付赎回款	-	-	-	2,835.13	2,835.13
应付管理人报酬	-	-	-	23,995.44	23,995.44
应付托管费	-	-	-	7,998.48	7,998.48
应付销售服务费	-	-	-	3,469.94	3,469.94
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	613.57	613.57
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	102,483.10	102,483.10
负债总计	700,000.00	-	-	141,429.80	841,429.80
利率敏感度缺口	79,873,742.51	1,206,630.00	-	16,652,941.86	97,733,314.37
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	365,164.44	-	-	-	365,164.44
结算备付金	197,735.65	-	-	-	197,735.65
存出保证金	2,058.31	-	-	-	2,058.31
交易性金融资产	12,799,585.73	1,277,112.22	-	-	14,076,697.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	999,736.74	-	-	-	999,736.74
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	164,222.89	164,222.89
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	20,017.42	20,017.42
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,364,280.87	1,277,112.22	-	184,240.31	15,825,633.40
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	7,538.30	7,538.30
应付赎回款	-	-	-	6,079.79	6,079.79
应付管理人报酬	-	-	-	4,122.81	4,122.81
应付托管费	-	-	-	1,374.30	1,374.30
应付销售服务费	-	-	-	3,910.00	3,910.00
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	36.06	36.06
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	121,916.90	121,916.90
负债总计	-	-	-	144,978.16	144,978.16
利率敏感度缺口	14,364,280.87	1,277,112.22	-	39,262.15	15,680,655.24

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点。		
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
	市场利率上升 25.00 bp	-581,516.25	-137,178.99
	市场利率下降 25.00 bp	593,712.95	43,999.88

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。本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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	16,566,692.60	16.95	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	80,289,285.53	82.15	14,076,697.95	89.77
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	96,855,978.13	99.10	14,076,697.95	89.77

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准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
	业绩比较基准上升 5%	11,578,163.63	82,841.37
	业绩比较基准下降 5%	-11,578,163.63	-82,841.37

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	20,156,398.82	258,412.60
第二层次	76,699,579.31	13,818,285.35
第三层次	-	-
合计	96,855,978.13	14,076,697.95

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

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	16,566,692.60	16.81

	其中：股票	16,566,692.60	16.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,289,285.53	81.45
	其中：债券	80,289,285.53	81.45
	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	1,478,615.02	1.50
8	其他各项资产	240,151.02	0.24
9	合计	98,574,744.17	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	914,120.00	0.94
C	制造业	10,732,246.60	10.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	196,472.00	0.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	623,628.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	696,465.00	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	874,651.00	0.89
J	金融业	1,861,036.00	1.90
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	238,909.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	429,165.00	0.44
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	16,566,692.60	16.95

7.2.2 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通过港股通投资的股票。

7.3 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	300223	北京君正	1,700	423,130.00	0.43
2	688012	中微公司	894	418,839.00	0.43
3	603986	兆易创新	500	407,500.00	0.42
4	600460	士兰微	7,100	388,086.00	0.40
5	301308	江波龙	500	351,900.00	0.36
6	688525	佰维存储	700	346,311.00	0.35
7	300857	协创数据	1,000	339,900.00	0.35
8	688008	澜起科技	1,000	309,900.00	0.32
9	600497	驰宏锌锗	25,200	305,172.00	0.31
10	000783	长江证券	29,900	291,525.00	0.30
11	688220	翱捷科技	2,300	285,936.00	0.29
12	300390	天华新能	3,000	280,530.00	0.29
13	601872	招商轮船	15,300	268,821.00	0.28
14	300458	全志科技	6,660	262,803.60	0.27
15	600601	方正科技	18,900	261,576.00	0.27
16	601233	桐昆股份	12,000	259,800.00	0.27
17	688213	思特威	2,400	256,968.00	0.26
18	300059	东方财富	12,500	254,750.00	0.26
19	000703	恒逸石化	18,500	251,045.00	0.26
20	300474	景嘉微	4,100	247,968.00	0.25
21	002414	高德红外	18,700	247,962.00	0.25
22	300142	沃森生物	18,900	245,511.00	0.25
23	600061	国投资本	37,000	242,350.00	0.25
24	000415	渤海租赁	58,700	238,909.00	0.24

25	002266	浙富控股	47,000	237,820.00	0.24
26	002738	中矿资源	4,000	235,960.00	0.24
27	000792	盐湖股份	7,800	235,482.00	0.24
28	000987	越秀资本	29,900	233,818.00	0.24
29	002466	天齐锂业	3,800	233,016.00	0.24
30	002709	天赐材料	4,500	231,435.00	0.24
31	603858	步长制药	15,800	230,680.00	0.24
32	688475	萤石网络	8,400	229,740.00	0.24
33	002670	国盛证券	20,700	227,700.00	0.23
34	600884	杉杉股份	16,700	226,285.00	0.23
35	600026	中远海能	12,600	226,044.00	0.23
36	000301	东方盛虹	19,600	224,420.00	0.23
37	600535	天士力	16,700	220,941.00	0.23
38	603077	和邦生物	95,200	220,864.00	0.23
39	603766	隆鑫通用	18,400	219,512.00	0.22
40	002261	拓维信息	7,800	218,478.00	0.22
41	002756	永兴材料	3,800	215,232.00	0.22
42	603233	大参林	14,300	214,929.00	0.22
43	000408	藏格矿业	3,100	214,892.00	0.22
44	301358	湖南裕能	2,800	212,436.00	0.22
45	603799	华友钴业	4,400	212,344.00	0.22
46	600095	湘财股份	28,100	211,593.00	0.22
47	002423	中粮资本	25,600	210,688.00	0.22
48	600655	豫园股份	50,700	208,377.00	0.21
49	002439	启明星辰	16,400	207,460.00	0.21
50	603699	纽威股份	4,100	206,230.00	0.21
51	600499	科达制造	14,900	205,620.00	0.21
52	000709	河钢股份	105,800	205,252.00	0.21
53	002271	东方雨虹	17,100	202,977.00	0.21
54	300073	当升科技	4,200	201,768.00	0.21
55	600233	圆通速递	12,800	201,600.00	0.21
56	601061	中信金属	18,600	200,322.00	0.20
57	000155	川能动力	16,400	196,472.00	0.20
58	688100	威胜信息	6,400	195,776.00	0.20
59	600489	中金黄金	10,800	194,940.00	0.20
60	688111	金山办公	900	191,745.00	0.20
61	300140	节能环保	38,500	191,345.00	0.20
62	600988	赤峰黄金	7,200	189,504.00	0.19
63	600816	建元信托	77,300	188,612.00	0.19
64	000807	云铝股份	8,200	181,548.00	0.19
65	000426	兴业银锡	5,400	177,984.00	0.18
66	601899	紫金矿业	7,000	175,980.00	0.18
67	002128	电投能源	7,600	175,712.00	0.18
68	002532	天山铝业	15,900	170,607.00	0.17

69	000933	神火股份	7,800	165,360.00	0.17
----	--------	------	-------	------------	------

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	600460	士兰微	668,726.00	4.26
2	603067	振华股份	552,287.16	3.52
3	603766	隆鑫通用	527,634.00	3.36
4	000783	长江证券	513,602.00	3.28
5	603233	大参林	509,207.00	3.25
6	688213	思特威	508,198.84	3.24
7	688183	生益电子	503,415.20	3.21
8	688100	威胜信息	500,442.40	3.19
9	603379	三美股份	494,867.00	3.16
10	300474	景嘉微	491,854.00	3.14
11	300969	恒帅股份	487,092.19	3.11
12	603699	纽威股份	485,403.00	3.10
13	688475	萤石网络	480,853.60	3.07
14	300059	东方财富	476,536.00	3.04
15	300001	特锐德	464,602.00	2.96
16	300628	亿联网络	463,569.00	2.96
17	003022	联泓新科	462,290.00	2.95
18	688281	华秦科技	461,852.90	2.95
19	002152	广电运通	458,237.00	2.92
20	000166	申万宏源	457,137.00	2.92
21	688187	时代电气	455,512.60	2.90
22	600150	中国船舶	453,938.00	2.89
23	601633	长城汽车	453,927.00	2.89
24	601799	星宇股份	453,635.00	2.89
25	601966	玲珑轮胎	451,467.00	2.88
26	002138	顺络电子	450,147.00	2.87
27	601995	中金公司	450,010.00	2.87
28	688220	翱捷科技	447,077.60	2.85
29	601018	宁波港	446,842.00	2.85
30	600061	国投资本	445,153.00	2.84
31	600109	国金证券	443,875.00	2.83
32	601899	紫金矿业	440,337.00	2.81
33	000725	京东方 A	435,947.00	2.78
34	600166	福田汽车	434,463.00	2.77

35	605589	圣泉集团	434,423.00	2.77
36	601066	中信建投	433,898.00	2.77
37	600999	招商证券	433,499.00	2.76
38	600031	三一重工	432,979.00	2.76
39	601211	国泰海通	431,963.00	2.75
40	688002	睿创微纳	431,417.60	2.75
41	301536	星宸科技	431,101.00	2.75
42	300458	全志科技	430,031.00	2.74
43	688469	芯联集成	424,251.40	2.71
44	000582	北部湾港	333,440.25	2.13
45	002738	中矿资源	324,038.00	2.07

注：本项“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

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	688183	生益电子	552,042.21	3.52
2	603067	振华股份	550,915.92	3.51
3	605589	圣泉集团	548,481.00	3.50
4	603379	三美股份	513,068.00	3.27
5	600150	中国船舶	509,319.32	3.25
6	003022	联泓新科	509,301.00	3.25
7	300001	特锐德	499,342.00	3.18
8	300628	亿联网络	489,309.00	3.12
9	300969	恒帅股份	489,116.00	3.12
10	301536	星宸科技	488,986.00	3.12
11	600460	士兰微	474,136.00	3.02
12	002138	顺络电子	471,614.00	3.01
13	600166	福田汽车	465,395.00	2.97
14	601995	中金公司	460,321.00	2.94
15	600031	三一重工	450,607.00	2.87
16	000166	申万宏源	450,488.00	2.87
17	601066	中信建投	447,210.00	2.85
18	688187	时代电气	446,031.75	2.84
19	688469	芯联集成	443,616.50	2.83
20	600999	招商证券	441,355.00	2.81
21	601018	宁波港	438,296.00	2.80
22	688295	中复神鹰	437,175.64	2.79
23	601966	玲珑轮胎	435,539.00	2.78
24	000725	京东方 A	434,993.00	2.77

25	601633	长城汽车	434,468.00	2.77
26	600109	国金证券	427,952.00	2.73
27	002152	广电运通	427,477.00	2.73
28	601211	国泰海通	424,122.00	2.70
29	601799	星宇股份	418,804.00	2.67
30	688002	睿创微纳	403,700.94	2.57
31	688281	华秦科技	376,259.70	2.40
32	688336	三生国健	337,330.70	2.15
33	000582	北部湾港	332,869.28	2.12
34	603296	华勤技术	321,146.00	2.05

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

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

买入股票的成本（成交）总额	74,701,240.51
卖出股票的收入（成交）总额	57,220,605.26

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）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	14,335,009.46	14.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	62,364,569.85	63.81
	其中：政策性金融债	62,364,569.85	63.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,589,706.22	3.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	80,289,285.53	82.15
----	----	---------------	-------

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	250423	25 农发 23	200,000	20,375,358.90	20.85
2	019792	25 国债 19	110,000	11,115,415.62	11.37
3	220215	22 国开 15	100,000	11,050,213.70	11.31
4	240215	24 国开 15	100,000	10,609,854.79	10.86
5	220402	22 农发 02	100,000	10,187,087.67	10.42

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家

金融监督管理总局的处罚；国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期末，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 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	12,471.96
2	应收清算款	227,679.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	240,151.02

7.12.4 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	123213	天源转债	339,460.90	0.35
2	127078	优彩转债	250,299.17	0.26
3	127084	柳工转 2	247,510.11	0.25
4	127067	恒逸转 2	245,742.22	0.25
5	113691	和邦转债	241,144.30	0.25
6	113661	福 22 转债	237,807.18	0.24
7	127110	广核转债	237,053.69	0.24
8	127108	太能转债	236,765.25	0.24
9	113631	皖天转债	236,460.82	0.24

10	127103	东南转债	230,499.73	0.24
11	113681	镇洋转债	222,517.47	0.23
12	127040	国泰转债	219,971.39	0.23
13	113051	节能转债	217,302.14	0.22
14	113058	友发转债	217,169.74	0.22
15	123243	严牌转债	210,002.11	0.21

7.12.5 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的情况。

7.12.6 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
新华鼎利债券 A	311	227,986.55	68,647,053.67	96.82%	2,256,762.08	3.18%
新华鼎利债券 C	285	1,774.73	0.00	0.00%	505,797.50	100.00%
新华鼎利债券 E	9	988,144.12	8,892,050.51	99.99%	1,246.61	0.01%
合计	605	132,732.08	77,539,104.18	96.56%	2,763,806.19	3.44%

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	新华鼎利债券 A	210.40	0.00%

	新华鼎利债券 C	92.31	0.02%
	新华鼎利债券 E	227.31	0.00%
	合计	530.02	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的情况

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	新华鼎利债券 A	0
	新华鼎利债券 C	0
	新华鼎利债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华鼎利债券 A	0
	新华鼎利债券 C	0
	新华鼎利债券 E	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华鼎利债券 A	新华鼎利债券 C	新华鼎利债券 E
基金合同生效日（2019 年 6 月 12 日）基金份额总额	118,175,008.24	100,662,238.02	-
本报告期期初基金份额总额	3,449,031.35	9,504,449.79	1,247.76
本报告期基金总申购份额	69,265,063.64	199,055.00	8,892,102.21
减：本报告期基金总赎回份额	1,810,279.24	9,197,707.29	52.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	70,903,815.75	505,797.50	8,893,297.12

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人于 2026 年 2 月 25 日发布公告，自 2026 年 2 月 24 日起张鹏先生担任公司副总经理兼财务负责人，徐端骞先生离任公司副总经理兼首席信息官。基金管理人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，自 2026 年 4 月 20 日起王宇成先生担任公司副总经理兼首席信息官。上述事项经基金管理人董事会审议通过，并按照现行法律法规履行备案程序。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未有涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期未有基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受到调查或处罚等情况。

10.7.2 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无受到调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

10.8 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

10.8.1 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	
光大证券	1	76,902,489.81	58.29%	26,384.64	52.37%	-
平安证券	1	52,604,906.28	39.88%	22,915.28	45.49%	-
金融街证券	2	2,414,449.68	1.83%	1,076.63	2.14%	本报告期新增 2 个

注：一、交易单元的选择标准：

（一）基本情况：财务状况良好，财务指标符合证券公司监管要求；

（二）合规风控：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

（三）研究服务实力方面需满足以下条件：1、有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；2、能根据公司所管理基金的特定要求，提供专题研究报告；3、具备较强的服务意识，能主动为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

（四）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

二、交易单元的选择程序：

（一）公司研究部根据上述标准考察后确定合作的证券公司名单。

（二）公司与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、本基金管理人已根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）及证券业协会测算结果完成佣金调整工作。本部分数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。

10.8.2 基金租用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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
光大证券	73,538,668.84	61.53%	727,680,000.00	87.66%	-	-
平安证券	29,156,415.75	24.39%	-	-	-	-
金融街证券	16,825,660.3	14.08%	102,400,0	12.34%	-	-

	7		00.00			
--	---	--	-------	--	--	--

10.9 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	新华基金管理股份有限公司新华鼎利债券型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-17
2	新华鼎利债券型证券投资基金招募说明书(更新)	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-20
3	新华鼎利债券型证券投资基金产品资料概要(更新)	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-20
4	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
5	新华鼎利债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
6	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-25
7	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
8	新华鼎利债券型证券投资基金 2025 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
9	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
10	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
11	新华鼎利债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
12	新华基金管理股份有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-01

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

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	20260108-20260630	-	28,286,072.89	-	28,286,072.89	35.22%
	2	20260101-20260121	8,289,124.67	-	8,289,124.67	0.00	0.00%
	3	20260122-20260630	-	32,281,486.56	-	32,281,486.56	40.20%
产品特有风险							
1、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予新华鼎利债券型证券投资基金注册的文件
- （二）《关于申请募集新华鼎利债券型证券投资基金之法律意见书》
- （三）《新华鼎利债券型证券投资基金托管协议》
- （四）《新华鼎利债券型证券投资基金基金合同》
- （五）《新华鼎利债券型证券投资基金招募说明书》（更新）
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二六年八月二十八日