华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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。

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过 50%，本基金不向个人投资者销售。

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 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏鼎禄三个月定开债券	
基金主代码	005862	
交易代码	005862	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2018 年 10 月 11 日	
报告期末基金份额总额	2,454,259,793.74 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求持续、稳定的收益。	
投资策略	封闭期投资策略：主要投资策略包括债券类属配置策略、久期管理策略、收益率曲线策略、信用债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略等。 开放期投资策略：开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，主要投资于具有较高流动性的投资品种。	
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，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏鼎禄三个月定开债券 A	华夏鼎禄三个月定开债券 C
下属分级基金的交易代码	005862	005863
报告期末下属分级基金的份额总额	2,454,259,793.74 份	-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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	华夏鼎禄三个月定开债券 A	华夏鼎禄三个月定开债券 C
1.本期已实现收益	11,773,688.33	-
2.本期利润	18,638,077.73	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0076	-
4.期末基金资产净值	2,539,983,012.72	-

5.期末基金份额净值	1.0349	-

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

华夏鼎禄三个月定开债券 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.73%	0.05%	0.52%	0.03%	0.21%	0.02%
过去六个月	1.56%	0.05%	1.15%	0.03%	0.41%	0.02%
过去一年	2.79%	0.04%	1.48%	0.04%	1.31%	0.00%
过去三年	11.32%	0.07%	5.66%	0.07%	5.66%	0.00%
过去五年	21.10%	0.07%	8.15%	0.07%	12.95%	0.00%
过去七年	31.25%	0.07%	10.36%	0.07%	20.89%	0.00%
自基金合同生效起至今	37.10%	0.07%	13.17%	0.07%	23.93%	0.00%

华夏鼎禄三个月定开债券 C：

2018 年 10 月 11 日至 2026 年 9 月 30 日期间，华夏鼎禄三个月定开债券 C 类基金份额为零。

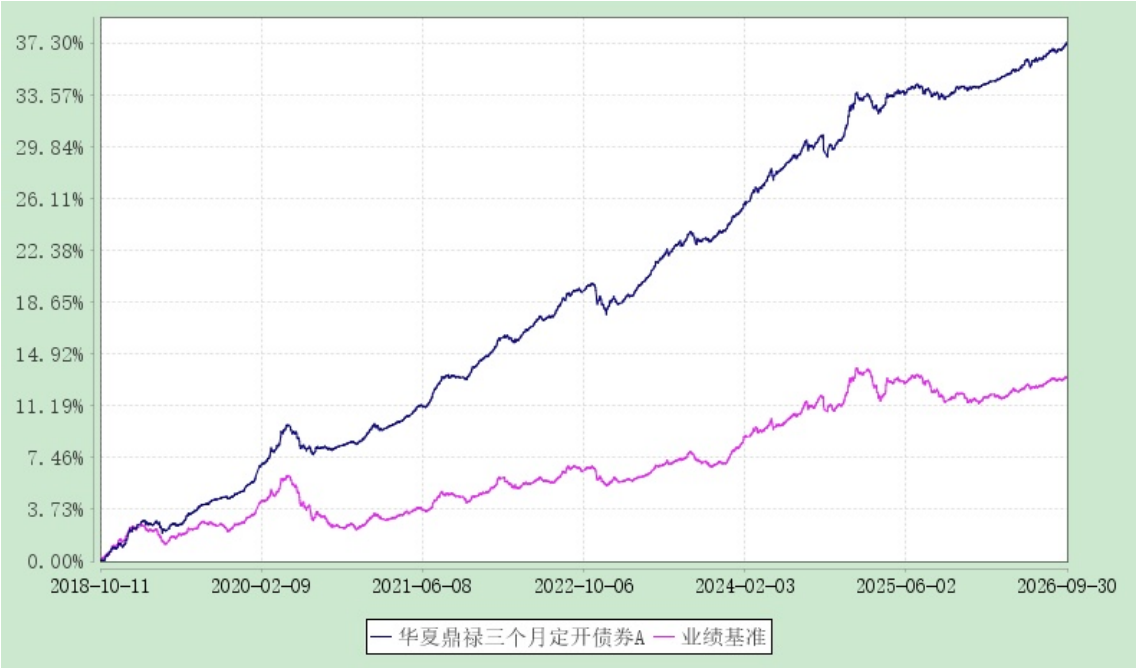
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2018 年 10 月 11 日至 2026 年 9 月 30 日）

华夏鼎禄三个月定开债券 A：



华夏鼎禄三个月定开债券 C：

2018 年 10 月 11 日至 2026 年 9 月 30 日期间，华夏鼎禄三个月定开债券 C 类基金份额为零。

§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		
孙蕾	本基金的基金经理	2022-02-14	-	11 年	硕士。2015 年 5 月加入华夏基金管理有限公司。历任固定收益部研究员、基金经理助理、华夏鼎佳债券型证券投资基金基金经理（2022 年 6 月 29 日至 2023 年 9 月 5 日期间)、华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投

					资基金基金经理（2021年8月16日至2024年4月9日期间）、华夏鼎略债券型证券投资基金基金经理（2022年2月14日至2024年11月25日期间）、华夏鼎智债券型证券投资基金基金经理（2022年2月14日至2024年11月25日期间）、华夏鼎明债券型证券投资基金基金经理（2022年6月29日至2024年11月25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（2024年4月9日至2025年4月29日期间）、华夏卓享债券型证券投资基金基金经理（2023年3月21日至2025年12月3日期间）、华夏恒融债券型证券投资基金基金

					经理（2021年10月21日至2026年1月26日期间）、华夏鼎福三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2022年6月29日至2026年1月26日期间）、华夏鼎源债券型证券投资基金基金经理（2023年4月6日至2026年1月26日期间）、华夏鼎润债券型证券投资基金基金经理（2023年9月5日至2026年1月26日期间）、华夏安康信用优选债券型证券投资基金基金经理（2024年7月12日至2026年1月26日期间）、华夏鼎丰债券型证券投资基金基金经理（2021年10月21日至2026年6月11日期间）、华夏鼎隆债券型证券投资基金基金

					经理（2022 年 2 月 14 日至 2026 年 6 月 11 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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 32 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度国内经济呈现 K 型分化特征：外需与高技术产业保持较强韧性，地产、消费及民间投资则相对偏弱，内需偏弱的环境对债市形成基本面支撑。7 月至 8 月的债市行情，交易盘是主导力量，超长债表现亮眼，收益率持续下行，30Y 与 10Y 估值利差逐步收窄；进入 8 月下旬，央行通过隔夜逆回购操作、MLF 缩量续作，传递出防范利率过快下行的信号，交易资金随之止盈兑现，长端利率开始面临上行压力；9 月政府债券供给集中放量，叠加季末流动性扰动，政策端出台的增量举措多偏向结构性工具，整体刺激力度有限，债市由此转入区间震荡，全月 10 年期国债收益率在低位区间

波动，收益率曲线进一步走平。纵观三季度利率债表现，期限分化特征显著，收益率曲线整体平坦化，超长端期限利差压缩较为明显；信用债收益率整体下行，中长久期品种表现更为突出，受益于资产荒环境下利差持续压缩，叠加 9 月摊余成本法债基新增获批，进一步增强了信用债配置需求。

报告期内，本基金对债券资产配置了合理的仓位和久期，并根据市场情况进行了一定的波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 9 月 30 日，华夏鼎禄三个月定开债券 A 基金份额净值为 1.0349 元，本报告期份额净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准增长率为 0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,046,255,686.56	99.84
	其中：债券	3,046,255,686.56	99.84
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,778,387.61	0.16
8	其他各项资产	-	-
9	合计	3,051,034,074.17	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。

5.3 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

5.3.1 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	300,696,219.71	11.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,745,559,466.85	108.09
	其中：政策性金融债	2,023,554,202.74	79.67
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,046,255,686.56	119.93

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	190210	19 国开 10	2,500,000	267,600,000.00	10.54
2	240208	24 国开 08	2,600,000	264,003,287.67	10.39
3	230210	23 国开 10	2,300,000	249,733,621.92	9.83
4	200205	20 国开 05	2,000,000	214,188,493.15	8.43
5	230420	23 农发 20	1,500,000	165,992,465.75	6.54

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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、国家开发银行、温州银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

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

项目	华夏鼎禄三个月定开债券 A	华夏鼎禄三个月定开债券 C
报告期期初基金份额总额	2,454,252,294.65	-

报告期期间基金总申购份额	7,508.88	-
减：报告期期间基金总赎回份额	9.79	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	2,454,259,793.74	-

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2021 年 10 月 11 日，华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2026-07-01 至 2026-09-30	2,453,925,223.61	-	-	2,453,925,223.61	99.99%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持							

续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2026 年 8 月 28 日发布华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金第十三次分红公告。

2026 年 9 月 29 日发布华夏基金管理有限公司关于限制华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金申购及转换转入业务的公告。

2026 年 9 月 29 日发布华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人、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。

§10 备查文件目录

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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

二〇二六年十月二十七日