东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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	东吴鼎泰纯债债券	
基金主代码	006026	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日	
报告期末基金份额总额	788,713,998.78 份	
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金在对宏观经济和债券市场综合研判的基础上，通过自上而下的宏观分析和自下而上的个券研究，使用主动管理、数量投资和组合投资的投资手段，追求基金资产长期稳健的增值。	
业绩比较基准	中国债券综合财富指数收益率	
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型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东吴鼎泰纯债债券 A	东吴鼎泰纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	006026	014570
报告期末下属分级基金的份额总额	196,728,977.79 份	591,985,020.99 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）	
	东吴鼎泰纯债债券 A	东吴鼎泰纯债债券 C
1.本期已实现收益	1,055,265.08	3,631,309.81
2.本期利润	955,592.69	3,108,913.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0053
4.期末基金资产净值	227,765,216.71	675,602,408.78
5.期末基金份额净值	1.1578	1.1412

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。

3.2 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

东吴鼎泰纯债债券 A

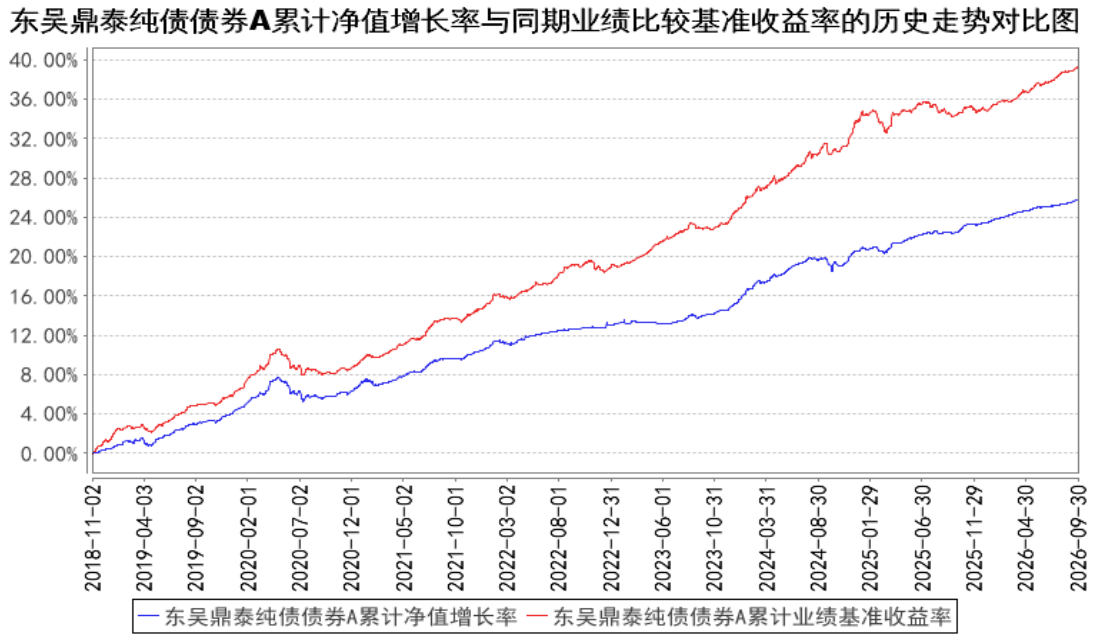
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.55%	0.01%	1.07%	0.03%	-0.52%	-0.02%
过去六个月	1.10%	0.01%	2.27%	0.03%	-1.17%	-0.02%
过去一年	2.82%	0.01%	3.67%	0.04%	-0.85%	-0.03%
过去三年	10.31%	0.04%	13.24%	0.07%	-2.93%	-0.03%
过去五年	14.71%	0.04%	22.36%	0.07%	-7.65%	-0.03%
过去七年	21.87%	0.05%	32.54%	0.07%	-10.67%	-0.02%
自基金合同生效起至今	25.79%	0.05%	39.18%	0.07%	-13.39%	-0.02%

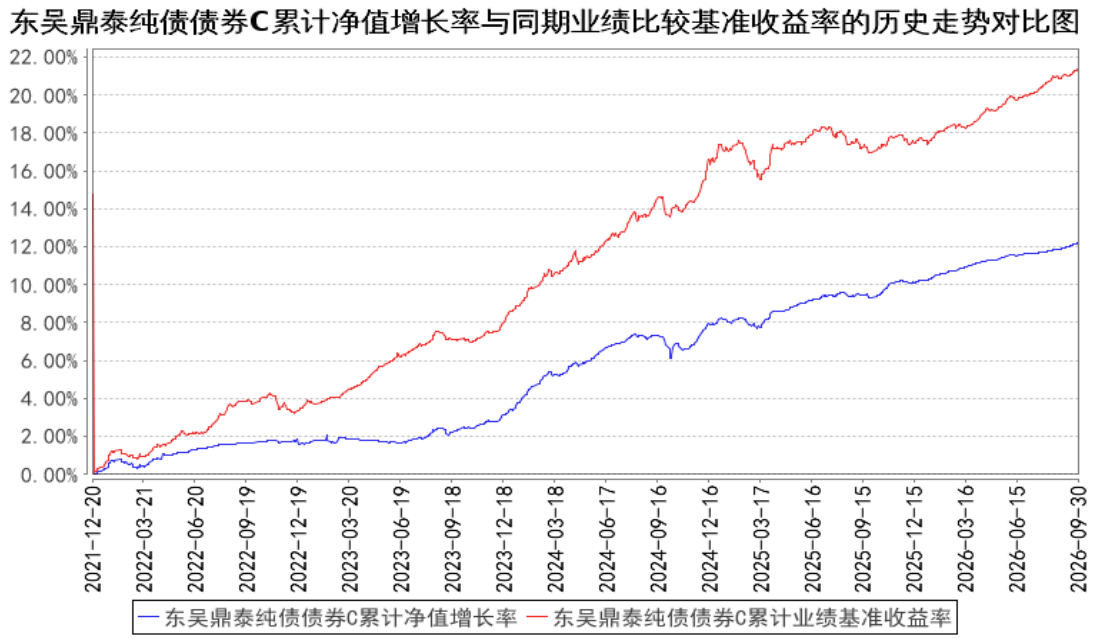
东吴鼎泰纯债债券 C

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	0.48%	0.01%	1.07%	0.03%	-0.59%	-0.02%

过去六个月	0.98%	0.01%	2.27%	0.03%	-1.29%	-0.02%
过去一年	2.61%	0.01%	3.67%	0.04%	-1.06%	-0.03%
过去三年	9.60%	0.04%	13.24%	0.07%	-3.64%	-0.03%
自基金合同生效起至今	12.18%	0.04%	21.29%	0.07%	-9.11%	-0.03%

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





注：1、本基金于 2021 年 12 月 20 日开始分为 A、C 两类。

2、本基金 C 类份额在 2021 年 12 月 23 日前无有效份额，故该份额的净值增长率与同期业绩比较基准收益率均于 2021 年 12 月 23 日起计算。

§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		
邵笛	基金经理	2022 年 5 月 9 日	-	20 年	邵笛先生，中国国籍，上海财经大学工商管理硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职上海广大律师事务所；上海文筑建筑咨询公司；上海永一房产咨询有限公司。2006 年 9 月起加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2018 年 4 月 23 日至 2021 年 9 月 1 日及 2022 年 12 月 2 日至 2025 年 1 月 21 日担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月 2 日至 2020 年 7 月 7 日担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月 2 日至 2021 年 7 月 28 日担任东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月 2 日至 2023 年 7 月 27 日担任东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至 2024 年 4 月 10 日担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理，2018 年 4 月 11 日至 2023 年 9 月 28 日及 2024 年 9 月 25 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2014 年 10 月 30 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 12 月 2 日至今担任东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月 6 日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 7 月 21 日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2024 年 9 月 25 日至今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理，2024 年 9 月 25 日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持

					有期证券投资基金基金经理，2025 年 6 月 17 日至今担任东吴中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。
杜澄楷	固定收益总部副总经理（主持工作）兼固收投资部总经理、基金经理	2023 年 10 月 26 日	-	18 年	杜澄楷先生，中国国籍，厦门大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职红塔证券股份有限公司研究员、金融工程师、投资经理、投资主管；东吴证券股份有限公司债券投资部。2023 年 8 月加入东吴基金管理有限公司，现任固定收益总部副总经理（主持工作）兼固收投资部总经理、基金经理。2023 年 10 月 26 日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理，2024 年 4 月 10 日至今担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理，2024 年 8 月 1 日至今担任东吴恒益纯债债券型证券投资基金基金经理，2026 年 4 月 30 日至今担任东吴优利债券型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、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》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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金不存在违反法律法规、基金合同和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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。本报告期内，本

基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现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%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，债券市场整体呈现震荡走强态势，收益率低位运行、曲线平坦化。7 月初，受部分经济数据阶段性企稳及机构止盈影响，10 年期国债收益率在 1.74%附近中枢窄幅波动，月末在机构做多期货、宽货币预期推动下有所下行。8 月，国内消费和投资修复节奏放缓、实体经济融资需求偏弱，“资产荒”格局延续，叠加央行货币政策维持适度宽松、流动性总体合理充裕，10 年期国债收益率先行下破 1.70%，随后始终保持在相对低位运行。9 月，在基本面偏弱、宽松预期与政府债供给压力显现、资金面阶段性收敛、外部利率约束等多重因素拉锯下，10 年期国债收益率中枢进一步下移至 1.68%附近小幅震荡（数据来源：Wind）。三季度长短端收益率走势显著分化，短端受资金面和银行负债端压力制约有所上行，长端震荡下行，期限利差明显收窄、曲线平坦化。信用债方面，三季度收益率整体下行、信用利差压缩至历史相对低位，长端及中低等级品种调整后估值吸引力提升，城投债整体平稳、区域表现分化，科创债延续扩容，摊余成本法债基与理财扩容带来增量配置资金。

本基金在报告期内对组合的配置主要是通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整投资组合，致力严控投资组合信用风险，控制组合久期，持续优化组合配置，通过信用挖掘在防范风险的前提下努力提升组合静态收益，力求获得与风险匹配的投资收益。在实际操作中，考察各债券品种的收益率曲线结构，主要考虑各品种曲线的静态收益率和骑乘效应以及未来可能上行的合理幅度，致力利用债券长久期的高收益率及陡峭的骑乘收益来对冲收益率曲线可能上行的负面影响；致力通过深入研究及调研，提升高收益个券的挖掘能力，努力提高组合的静态配置收益率；同时利用高流动性品种的特有品性，在收益率偏离合理均衡位置时进行统计套利，以力争获取相对于静态配置更高的组合收益率。

在操作上，三季度本基金根据市场变化和宏观环境进行了灵活调整。债券配置方面，考虑到三季度收益率整体处于历史相对低位、曲线平坦化且波动加大，产品在控制久期和杠杆的基础上，适度参与超长端及中高等级品种的相对价值机会，并结合申赎情况和资金面变化对持仓进行了灵活调仓；信用方面延续信用挖掘思路，重点增配基本面相对稳健、估值具备性价比的中高等级品种，严控信用风险下沉，努力把握收益率调整过程中出现的配置窗口，在严格控制回撤的前提下，力争为持有人增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东吴鼎泰纯债债券 A 的基金份额净值为 1.1578 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%；截至本报告期末东吴鼎泰纯债债券 C 的基金份额净值为 1.1412 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%。

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	936,439,847.32	94.35
	其中：债券	936,439,847.32	94.35
	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	11,670.35	0.00
8	其他资产	56,069,239.27	5.65
9	合计	992,520,756.94	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	215,245,846.57	23.83
	其中：政策性金融债	60,651,928.77	6.71
4	企业债券	30,446,455.34	3.37
5	企业短期融资券	50,611,198.90	5.60
6	中期票据	640,136,346.51	70.86
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	936,439,847.32	103.66

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	232580017	25 农行二级资本债 01B(BC)	500,000	51,008,945.21	5.65
2	09240202	24 国开清发 02	400,000	40,516,986.30	4.49
3	232380020	23 稠州商行二级资本债 01	300,000	31,839,673.97	3.52
4	2123016	21 阳光财险	300,000	31,253,753.42	3.46
5	102485434	24 云建投 MTN018	300,000	30,936,575.34	3.42

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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中“25 农行二级资本债 01B(BC)（证券代码：232580017）、23 稠州商行二级资本债 01（证券代码：232380020）、24 云建投 MTN018（证券代码：102485434）、26 成都农商行二级资本债 01（证券代码：232680035）”的发行主体在报告编制日前一年内受到监管部门的处罚。

经分析，上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响，本基金对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。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的其他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。

5.10.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,339.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	56,066,899.28
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	56,069,239.27

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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	东吴鼎泰纯债债券 A	东吴鼎泰纯债债券 C
报告期期初基金份额总额	158,165,274.67	794,773,039.54
报告期期间基金总申购份额	53,966,654.71	455,421,984.39
减:报告期期间基金总赎回份额	15,402,951.59	658,210,002.94
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	196,728,977.79	591,985,020.99

§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

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金设立的文件；

2、《东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

5、报告期内东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金在中国证监会指定媒介上披露的各项公告。

9.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：http：//www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666/400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日