

# 新华鼎利债券型证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

2024 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：二〇二四年七月十八日

## §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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

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
报告期末基金份额总额	921,061,815.26 份
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、权证投资策略、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。		
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		
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	916,726,791.96 份	4,276,047.45 份	58,975.85 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 (2024 年 4 月 1 日-2024 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
1. 本期已实现收益	7,302,572.26	25,184.12	368.04
2. 本期利润	16,646,357.13	55,378.71	920.14
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0182	0.0144	0.0156
4. 期末基金资产净值	1,085,481,899.52	4,965,561.80	64,053.81
5. 期末基金份额净值	1.1841	1.1613	1.0861

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、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。

### 3.2基金净值表现

#### 3.2.1本报告期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

##### 1、新华鼎利债券 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	1.56%	0.05%	0.75%	0.07%	0.81%	-0.02%
过去六个月	2.74%	0.04%	2.31%	0.09%	0.43%	-0.05%
过去一年	4.22%	0.04%	1.96%	0.09%	2.26%	-0.05%
过去三年	12.13%	0.05%	2.00%	0.11%	10.13%	-0.06%
过去五年	20.63%	0.32%	7.21%	0.12%	13.42%	0.20%
自基金合同 生效起至今	20.86%	0.32%	7.71%	0.12%	13.15%	0.20%

##### 2、新华鼎利债券 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	1.47%	0.05%	0.75%	0.07%	0.72%	-0.02%
过去六个月	2.54%	0.04%	2.31%	0.09%	0.23%	-0.05%
过去一年	3.80%	0.04%	1.96%	0.09%	1.84%	-0.05%
过去三年	10.75%	0.05%	2.00%	0.11%	8.75%	-0.06%
过去五年	18.04%	0.32%	7.21%	0.12%	10.83%	0.20%
自基金合同 生效起至今	18.24%	0.32%	7.71%	0.12%	10.53%	0.20%

##### 3、新华鼎利债券 E：

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	1.46%	0.05%	0.75%	0.07%	0.71%	-0.02%
过去六个月	2.54%	0.04%	2.31%	0.09%	0.23%	-0.05%
过去一年	3.79%	0.04%	1.96%	0.09%	1.83%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	9.24%	0.04%	1.84%	0.11%	7.40%	-0.07%

### 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

新华鼎利债券型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2019 年 6 月 12 日至 2024 年 6 月 30 日)

#### 1. 新华鼎利债券 A:



#### 2. 新华鼎利债券 C:



#### 3. 新华鼎利债券 E:



注：1、报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

2、本产品自 2021 年 11 月 17 日起增加 E 类基金份额。

## §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		
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。	2023-05-12	-	11	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。

注：1、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。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

#### 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

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，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》以及其他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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理办法》，以避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。

本报告期内，公平交易管理执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内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

二季度，海外地缘政治冲突延续，美联储降息预期较此前弱化，国内宏观经济企稳存在波折，总体仍然偏弱。数据上看，国内消费和出口数据延续修复，房地产和基建数据仍然较弱，制造业 PMI 重回收缩区间，CPI 低位运行，内需偏弱，汇率仍存在一定压力。目前来看今年政策取向总

体稳健，货币政策保持流动性合理充裕，地方债发行进度较预期缓，超长期特别国债发行节奏平均，预计债券市场供给冲击不强。多地陆续推出房地产相关政策，住房公积金贷款利率和商业性个人住房贷款首付比例下调，有利于房地产市场的企稳。债券市场走势来看，二季度资产荒延续，债券收益率总体震荡下行，10 年期国债下行 8bp 至 2.21%，1 年期国债下行 18bp 至 1.54%，利率债收益率水平已降至历史低位，信用债相对利率债存在票息优势，二季度信用利差压缩明显，信用债总体走势强于利率债。

本报告期内，本基金继续维持中性配置策略，在仓位和久期上进行了适度提升，以为投资者提供稳定回报为目标。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.1841 元，本报告期份额净值增长率为 1.56%，同期比较基准的增长率为 0.75%；C 净值为 1.1613 元，本报告期份额净值增长率为 1.47%，同期比较基准的增长率为 0.75%；E 类份额净值为 1.0861 元，本报告期份额净值增长率为 1.46%，同期比较基准的增长率为 0.75%。

#### 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交易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	固定收益投资	1,227,477,557.41	99.54
	其中：债券	1,227,477,557.41	99.54
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,631,475.07	0.46
7	其他各项资产	24,899.19	0.00
8	合计	1,233,133,931.67	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

本报告期末本基金无港股通股票投资。

## 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	484,072,123.40	44.39
	其中：政策性金融债	103,363,888.43	9.48
4	企业债券	347,772,901.46	31.89
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	395,632,532.55	36.28
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,227,477,557.41	112.56

**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	222280001	22 交行绿债 02	1,000,000	103,150,459.02	9.46
2	2220085	22 南京银行绿色债	1,000,000	103,032,513.66	9.45
3	2220082	22 郑州银行 01	1,000,000	102,973,442.62	9.44
4	163464	20 铁发 02	900,000	97,497,616.44	8.94
5	092280138	22 长沙银行债 01	700,000	71,551,819.67	6.56

**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**

本报告期末本基金无贵金属投资。

**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**

本报告期末，本基金无股指期货投资。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

**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**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本报告期末本基金无国债期货投资。

### 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，交通银行股份有限公司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；南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局江苏省分局的行政处罚；长沙银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局湖南监管局的处罚。

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券的发行主体没有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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

#### 5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,642.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,256.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,899.19

#### 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

本报告期末本基金无流通受限股票。

#### 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	新华鼎利债券A	新华鼎利债券C	新华鼎利债券E
本报告期期初基金份额总额	915,592,276.50	2,602,229.50	58,975.85
报告期期间基金总申购份额	1,496,026.18	4,591,807.79	-
减：报告期期间基金总赎回份额	361,510.72	2,917,989.84	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	916,726,791.96	4,276,047.45	58,975.85

### §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

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

## §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	20240401-20240630	912,241,379.31	-	-	912,241,379.31	99.04%

#### 产品特有风险

- 1、本基金为债券型基金，对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，本基金需承担债券市场的系统性风险，以及因个别债券违约所形成的信用风险。
- 2、本基金投资于可转换债券，可转换债券的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，对这些条款研究不足导致的事件可能为本基金带来损失。例如，当可转换债券的价格明显高于其赎回价格时，若本基金未能在可转换债券被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。
- 3、本基金投资流通受限证券，可能面临流动性风险、法律风险、道德风险和操作风险。本公司将制订严格的投资决策流程和风险控制制度，根据公司净资本规模，以及基金的投资风格和流动性特点，兼顾基金投资的安全性、流动性和收益性，合理控制基金投资流通受限证券的比例。
- 4、本基金投资于中小企业私募债券所面临的信用风险及流动性风险。信用风险主要是由目前国内中小企业的发展状况所导致的发行人违约、不按时偿付本金或利息的风险；流动性风险主要是由债券非公开发行和转让所导致的无法按照合理的价格及时变现的风险。由于中小企业私募债券的特殊性，本基金的总体风险将有所提高。本基金在选择投资标的时，将充分考虑上述风险给投资者带来的不利影响，在投资比例和标的的选择上进行严格的风险控制，最大程度降低投资中小企业私募债券对本基金整体运作的影响。
- 5、基金合同提前终止的风险：如出现《基金合同》第五部分第三条约定的资产规模过小、基金份额持有人人数较少等情形的，《基金合同》将终止。
- 6、基金投资存托凭证的风险：与存托凭证相关的风险、与创新企业发行相关的风险、与境外发行人相关的风险、与交易机制相关的风险。

### 8.2 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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华鼎利债券型证券投资基金募集的文件
- (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) 《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六) 更新的《新华鼎利债券型证券投资基金招募说明书》
- (七) 《新华鼎利债券型证券投资基金产品资料概要》(更新)
- (八) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (九) 基金托管人业务资格批件及营业执照

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

## 9.3 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

二〇二四年七月十八日