

# 新华鼎利债券型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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：二〇二四年十月二十五日

## §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 10 月 24 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 7 月 1 日起至 9 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	920,078,451.17 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、资产支持证券投资策略、权证投资策略等。债券投资主要采取久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略及可转换债券投资策略，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

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	916,901,597.57 份	3,117,877.75 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 7 月 1 日-2024 年 9 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	8,004,048.15	27,619.81	407.53
2. 本期利润	1,147,674.73	2,021.12	3.48
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0013	0.0005	0.0001
4. 期末基金资产净值	1,086,837,625.47	3,620,613.73	64,057.29
5. 期末基金份额净值	1.1853	1.1612	1.0862

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	0.10%	0.06%	1.81%	0.13%	-1.71%	-0.07%
过去六个月	1.66%	0.06%	2.58%	0.11%	-0.92%	-0.05%
过去一年	3.83%	0.05%	4.20%	0.10%	-0.37%	-0.05%
过去三年	11.36%	0.05%	3.77%	0.11%	7.59%	-0.06%
过去五年	19.51%	0.31%	8.71%	0.12%	10.80%	0.19%
自基金合同 生效起至今	20.98%	0.31%	9.66%	0.12%	11.32%	0.19%

##### 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	-0.01%	0.06%	1.81%	0.13%	-1.82%	-0.07%
过去六个月	1.46%	0.06%	2.58%	0.11%	-1.12%	-0.05%
过去一年	3.40%	0.05%	4.20%	0.10%	-0.80%	-0.05%
过去三年	9.98%	0.05%	3.77%	0.11%	6.21%	-0.06%
过去五年	16.99%	0.31%	8.71%	0.12%	8.28%	0.19%
自基金合同 生效起至今	18.23%	0.31%	9.66%	0.12%	8.57%	0.19%

##### 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	0.01%	0.06%	1.81%	0.13%	-1.80%	-0.07%
过去六个月	1.47%	0.06%	2.58%	0.11%	-1.11%	-0.05%
过去一年	3.42%	0.05%	4.20%	0.10%	-0.78%	-0.05%
自基金合同	9.25%	0.04%	3.69%	0.11%	5.56%	-0.07%

生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

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9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：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、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。	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、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《证券投资基金经营机构董事、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。

#### 4.1.1 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

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，海外地缘政治冲突延续，美联储开启降息周期，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较为稳定，房地产和基建数据仍然较弱，制造业 PMI 仍处于收缩区间，CPI 低位运行，内需偏弱，汇率压力缓解。7 至 8 月政策基调延续稳健，9 月末政策取向则发生了较大变化，降准降息、降低存量房贷利率及创设新的货币政策工具落地，房地产政策也进一步放松，市场风险偏好转向，权益市场超预期上涨，股债跷跷板现象明显，债券市场波动上升，在收益率触及新低后开始回调。债券市场走势来看，随着 8 月央行开始公开市场国债买卖操作及 9 月政策取向的转变，三季度债券收益率波动较为剧烈，绝对收益水平方面，季度末 10 年期国债收益率下行 5bp 至 2.15%，1 年期国债收益率下行 17bp 至 1.37%，利率债收益率水平仍处于历史低位，信用债调整后票息优势上升，但流动性问题短期内制约了信用债的估值修复，三季度利率债走势强于信用债。

本报告期内，本基金继续维持中性配置策略，降低了组合仓位和久期，以力争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 9 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.1853 元，本报告期份额净值增长率为 0.10%，同期比较基准的增长率为 1.81%；本基金 C 类份额净值为 1.1612 元，本报告期份额净值增长率为 -0.01%，同期比较基准的增长率为 1.81%；本基金 E 类份额净值为 1.0862 元，本报告期份额净值增长率为 0.01%，同期比较基准的增长率为 1.81%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期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	固定收益投资	1,159,310,104.01	99.40
	其中：债券	1,159,310,104.01	99.40
	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	7,027,789.28	0.60
7	其他各项资产	2,741.35	0.00
8	合计	1,166,340,634.64	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通过港股通投资的股票。

## 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	485,282,684.64	44.50
	其中：政策性金融债	102,784,038.74	9.43

4	企业债券	314,179,271.11	28.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	359,848,148.26	33.00
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,159,310,104.01	106.31

#### 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	103,695,693.99	9.51
2	2220085	22 南京银行绿色债	1,000,000	103,565,737.70	9.50
3	2220082	22 郑州银行 01	1,000,000	103,386,666.67	9.48
4	163464	20 铁发 02	900,000	97,143,312.33	8.91
5	092280138	22 长沙银行债 01	700,000	71,850,547.54	6.59

#### 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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**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持有国债期货。

**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持有国债期货。

**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；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。

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

本基金本报告期末未投资股票，不存在所投资的前十名股票超出基金合同规定之备选股票库的情况。

**5.11.3 其他各项资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,513.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	227.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,741.35

#### 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	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	916,726,791.96	4,276,047.45	58,975.85
报告期期间基金总申购份额	903,975.99	1,980,096.59	-
减：报告期期间基金总赎回份额	729,170.38	3,138,266.29	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	916,901,597.57	3,117,877.75	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投资本基金。

### 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投资本基金。

## §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	20240701-20240930	912,241,379.31	-	-	912,241,379.31	99.15%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

### 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

## 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到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件,或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。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。

新华基金管理股份有限公司

二〇二四年十月二十五日