金鹰添裕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：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰添裕纯债债券
基金主代码	003733
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日
报告期末基金份额总额	2,228,196,596.35 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性，在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。在资产配置中，本基金以债券为主，通过密切关注债券市场变化，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，在确保资产稳定增值的基础上，通过积极主动的资产配

	置，力争实现超越业绩基准的投资收益。		
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%		
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于较低预期收益、较低预期风险的证券投资基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。		
基金管理人	金鹰基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	金鹰添裕纯债债券 A	金鹰添裕纯债债券 C	金鹰添裕纯债债券 D
下属分级基金的交易代码	003733	012622	024109
报告期末下属分级基金的份额总额	458,810,880.90 份	122,043,729.64 份	1,647,341,985.81 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)		
	金鹰添裕纯债债券 A	金鹰添裕纯债债券 C	金鹰添裕纯债债券 D
1.本期已实现收益	3,121,139.49	695,292.05	9,038,310.82
2.本期利润	4,509,636.46	1,066,961.58	13,828,692.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0099	0.0105	0.0104
4.期末基金资产净值	502,977,573.01	136,077,231.44	1,808,485,085.76
5.期末基金份额净值	1.0963	1.1150	1.0978

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；

2、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、上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；

4、本基金自 2021 年 6 月 8 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2021 年 6 月 9 日；

5、本基金自 2025 年 4 月 18 日起增设 D 类基金份额，D 类基金份额首次确认日为 2025 年 4 月 23 日。

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

金鹰添裕纯债债券 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	0.91%	0.02%	0.49%	0.02%	0.42%	0.00%
过去六个月	2.20%	0.03%	1.07%	0.03%	1.13%	0.00%
过去一年	4.75%	0.03%	1.49%	0.03%	3.26%	0.00%
过去三年	12.65%	0.06%	5.46%	0.06%	7.19%	0.00%
过去五年	13.52%	0.09%	8.11%	0.05%	5.41%	0.04%
过去七年	18.71%	0.08%	10.54%	0.05%	8.17%	0.03%
自基金合同生效起至今	33.61%	0.08%	11.65%	0.06%	21.96%	0.02%

金鹰添裕纯债债券 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	0.90%	0.02%	0.49%	0.02%	0.41%	0.00%
过去六个月	2.19%	0.03%	1.07%	0.03%	1.12%	0.00%

过去一年	4.74%	0.03%	1.49%	0.03%	3.25%	0.00%
过去三年	12.56%	0.06%	5.46%	0.06%	7.10%	0.00%
过去五年	13.82%	0.09%	8.11%	0.05%	5.71%	0.04%
自基金合同生效起至今	14.44%	0.09%	9.01%	0.05%	5.43%	0.04%

金鹰添裕纯债债券 D

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	0.91%	0.02%	0.49%	0.02%	0.42%	0.00%
过去六个月	2.20%	0.03%	1.07%	0.03%	1.13%	0.00%
过去一年	4.75%	0.03%	1.49%	0.03%	3.26%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.78%	0.04%	0.63%	0.04%	5.15%	0.00%

注：1、本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）*20%；

2、本基金自 2021 年 6 月 8 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2021 年 6 月 9 日；

3、本基金自 2025 年 4 月 18 日起增设 D 类基金份额，D 类基金份额首次确认日为 2025 年 4 月 23 日。

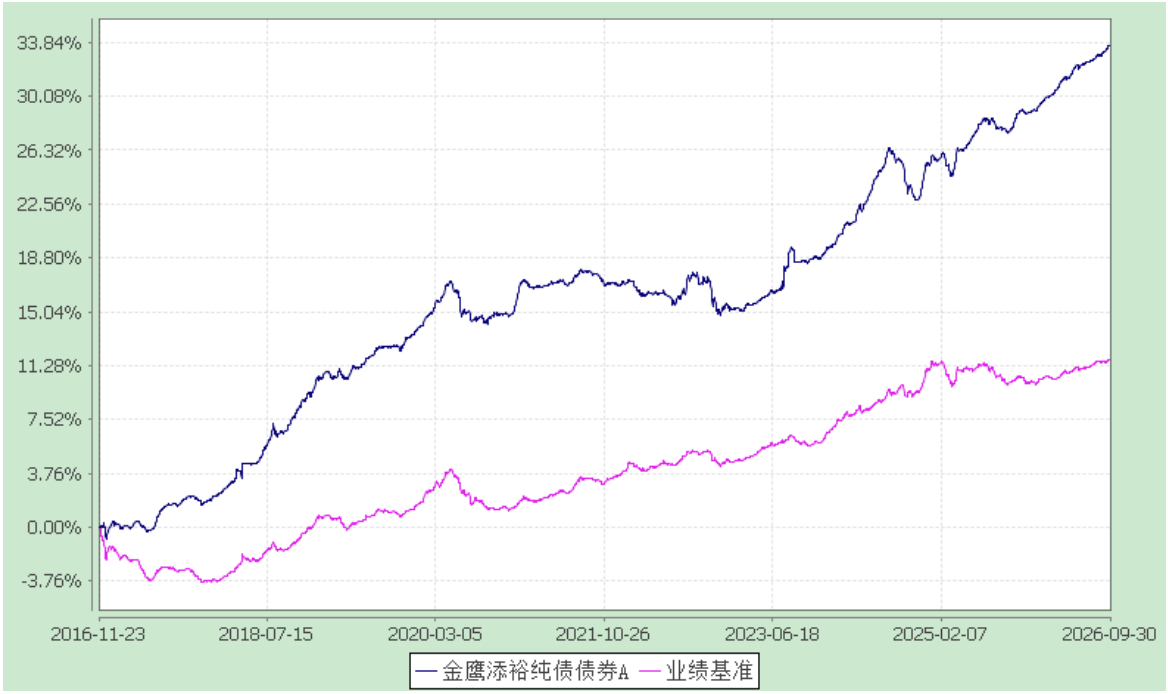
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰添裕纯债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

（2016 年 11 月 23 日至 2026 年 9 月 30 日）

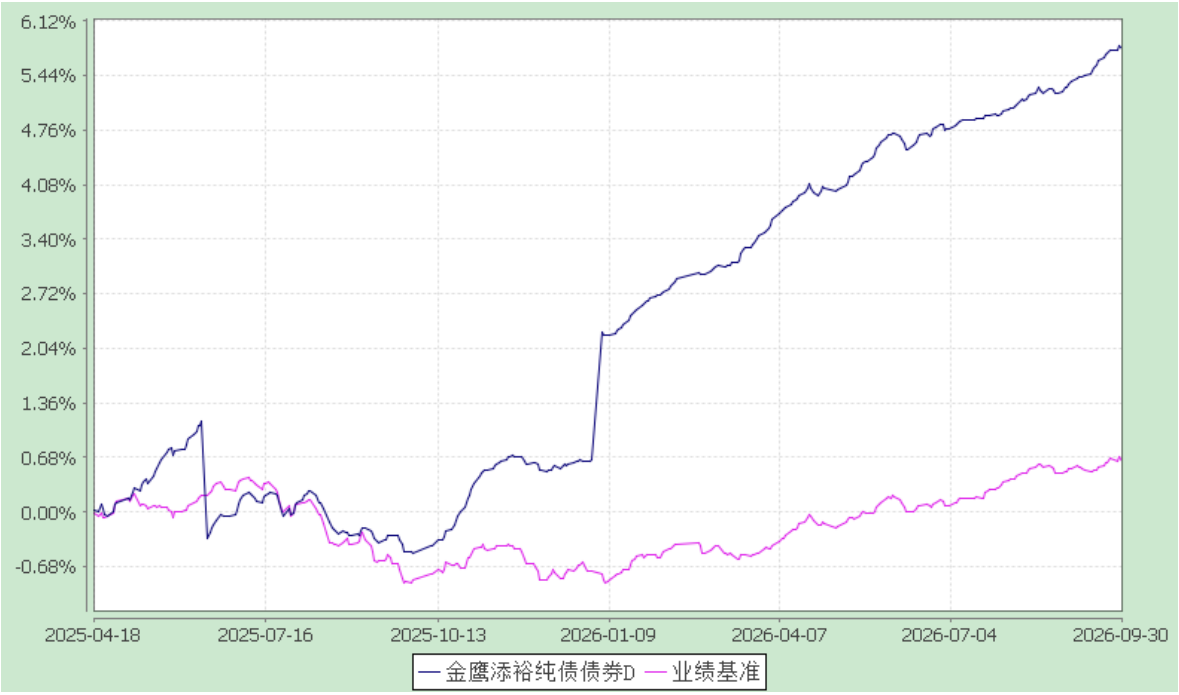
金鹰添裕纯债债券 A



金鹰添裕纯债债券 C



金鹰添裕纯债债券 D



注：1、本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）*20%；

2、本基金自 2021 年 6 月 8 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2021 年 6 月 9 日；

3、本基金自 2025 年 4 月 18 日起增设 D 类基金份额，D 类基金份额首次确认日为 2025 年 4 月 23 日。

§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		
邹卫	本基金的基金经理，公司固定收益研究部总经理	2022-08-03	-	15	邹卫先生，西南财经大学经济学硕士。历任中信证券华南股份有限公司研究员，广州广证恒生市场研究有限公司研究员，中信证券华南股份有限公司资产管理部投资经理，金鹰基金管理有

					限公司风险管理部副总监，广州金鹰资产管理有限公司总经理助理。2017 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司，历任固定收益研究部总经理、特定资产投资管理部总经理、投资经理，现任固定收益研究部总经理、基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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》和其他有关法律法规及其各项实施准则、本基金基金合同等法律文件的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无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

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易，不断强化事后监控分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下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。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

复盘 2026 年三季度，债券市场整体呈现“基本面弱现实”与“货币宽松预期”共振下的震荡走强格局。宽松政策信号与央行流动性呵护共同构筑了做多主线，出口韧性、输入性通胀担忧以及机构止盈需求则带来阶段性回调。整季度来看，收益率曲线趋于平坦化，短端小幅上行，中长端和超长端普遍下行，信用债收益率与利率债波动趋同，各等级信用利差延续收窄。

分阶段看，7 月中上旬债市围绕资金面与政策预期震荡博弈，下旬在“存款降息”预期发酵及中央政治局会议释放宽松信号的推动下，收益率突破向下至 1.70%附近。8 月中上旬，长端延续强势，但随后受止盈情绪升温影响，长端小幅回调。9 月债市先围绕 1.68%关口反复拉锯，中下旬在公积金降息预期与跨季流动性呵护下，超长端领衔突破，30 年期国债收益率一度下探至 2.107%附近。月末，房贷贴息、PSL 降息等政策组合拳落地，叠加 9 月 PMI 重回扩张区间及节前止盈情绪，债市转入回调，10 年期国债收益率收于 1.675%。

展望 2026 年四季度，宏观经济或仍处于新旧动能切换的关键阶段。财政端盘活地方政府债务结存限额、加快形成实物工作量，有助于托底基建和稳增长；但房地产、传统基建与居民消费修复仍需时间，实体融资需求整体偏弱，经济 K 型分化特征仍较明显。货币政策预计延续适度宽松导向，流动性维持合理充裕，但全面降息预期有所减弱，政策更可能通过结构性工具与流动性管理协同财政发力。债券收益率继续大幅下行的空间可能受限，市场更可能呈现低位震荡、波段博弈特征。

本基金为纯债型产品，将在严格匹配组合流动性、守住风险安全边际的前提下，保持适度杠杆和适度久期。组合仍以城投债为核心配置方向，同时适度布局具备估值性价比的商金债、券商普通债及其他高等级信用品种，在锁定稳定票息收益的基础上，把握调整带来的波段资本利得机会，增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0963 元，本报告期份额净值增长为 0.91%，同期业绩比较基准增长率为 0.49%；C 类基金份额净值为 1.1150 元，本

报告期份额净值增长为 0.90%，同期业绩比较基准增长率为 0.49%；D 类基金份额净值为 1.0978 元，本报告期份额净值增长为 0.91%，同期业绩比较基准增长率为 0.49%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期无应说明预警事项。

§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	2,746,246,497.67	98.10
	其中：债券	2,686,297,865.00	95.96
	资产支持证券	59,948,632.67	2.14
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	50,502,045.00	1.80
	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	1,425,123.85	0.05
7	其他资产	1,364,696.04	0.05
8	合计	2,799,538,362.56	100.00

注：其他资产包括：存出保证金、应收利息、应收证券清算款、应收申购款、待摊费用、其他应收款。

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 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	84,212,856.00	3.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,233,247,112.05	50.39
	其中：政策性金融债	169,345,773.97	6.92
4	企业债券	31,510,188.49	1.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,337,327,708.46	54.64
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,686,297,865.00	109.76

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	240403	24 农发 03	800,000.00	81,239,254.79	3.32
2	102602034	26 河钢集 MTN014	800,000.00	80,719,513.42	3.30
3	102681624	26 桂交投 MTN003	800,000.00	80,582,071.23	3.29
4	09240202	24 国开清发 02	770,000.00	77,995,198.63	3.19
5	102480717	24 济宁城投 MTN003B	700,000.00	74,521,367.12	3.04

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	146531	市中 01 优	300,000.00	30,239,210.96	1.24
2	112799	静安府优	300,000.00	29,709,421.71	1.21

注：本基金本报告期末仅持有 2 只资产支持证券。

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

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

无。

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。

5.11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之一的中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的阳光人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

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 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,576.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,362,119.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,364,696.04

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	金鹰添裕纯债债券A	金鹰添裕纯债债券C	金鹰添裕纯债债券D
报告期期初基金份额总额	451,964,757.96	85,034,173.44	1,120,030,449.35
报告期期间基金总申购份额	8,000,309.62	49,065,136.52	564,374,094.77
减：报告期期间基金总赎回份额	1,154,186.68	12,055,580.32	37,062,558.31
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	458,810,880.90	122,043,729.64	1,647,341,985.81

§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

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

无交易。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§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	20260701-20260930	463,026,369.35	183,711,968.19	0.00	646,738,337.54	29.03%
	2	20260701-20260904	389,671,276.06	0.00	0.00	389,671,276.06	17.49%
产品特有风险							
本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险： 1）基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动； 2）巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，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；							

3）流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；
4）基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。
5）基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。
6）份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1备查文件目录

1、中国证监会注册的金鹰添裕纯债债券型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰添裕纯债债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰添裕纯债债券型证券投资基金托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

10.2存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

10.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：http://www.gefund.com.cn。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日