# 金鹰鑫日享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：中国民生银行股份有限公司**

**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。

基金托管人中国民生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 | 金鹰鑫日享债券 |
| 基金主代码 | 006974 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 3 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,026,163,673.30 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争使基金份额持有人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。<br>本基金在对宏观经济形势以及微观市场充分研判的基础上，采取积极主动的投资管理策略，积极进行资产组合配置。对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响信用债券投资价值的因素进行评估，主动调整债券组合。 | |
| 业绩比较基准 | 中债-综合全价（1-3 年）指数收益率×95%+一年期定期存款基准利率×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 金鹰基金管理有限公司 | |
| 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 | 金鹰鑫日享债券 A | 金鹰鑫日享债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006974 | 006975 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,985,985,485.52 份 | 40,178,187.78 份 |

注：自2026年9月21日起，本基金业绩比较基准由“中债综合（全价）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%”调整为“中债-综合全价（1-3年）指数收益率×95%+一年期定期存款基准利率×5%”。

## §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) | |
|---|---|---|
| | 金鹰鑫日享债券 A | 金鹰鑫日享债券 C |
| 1.本期已实现收益 | 11,035,370.21 | 179,720.72 |
| 2.本期利润 | 10,124,106.90 | 171,515.15 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0050 | 0.0046 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,265,487,778.61 | 43,774,482.55 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0936 | 1.0895 |

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；

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。

## 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、金鹰鑫日享债券 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 | 0.44% | 0.02% | 0.42% | 0.02% | 0.02% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.21% | 0.02% | 1.00% | 0.03% | 0.21% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.09% | 0.04% | 1.42% | 0.03% | 1.67% | 0.01% |
| 过去三年 | 8.02% | 0.05% | 5.38% | 0.06% | 2.64% | -0.01% |
| 过去五年 | 13.84% | 0.05% | 8.01% | 0.05% | 5.83% | 0.00% |
| 过去七年 | 27.78% | 0.07% | 10.43% | 0.05% | 17.35% | 0.02% |
| 成立至今 | 30.13% | 0.07% | 10.92% | 0.05% | 19.21% | 0.02% |

**2、金鹰鑫日享债券 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 | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | ④ | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.41% | 0.02% | 0.42% | 0.02% | -0.01% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.17% | 0.02% | 1.00% | 0.03% | 0.17% | -0.01% |
| 过去一年 | 2.99% | 0.04% | 1.42% | 0.03% | 1.57% | 0.01% |
| 过去三年 | 7.67% | 0.05% | 5.38% | 0.06% | 2.29% | -0.01% |
| 过去五年 | 13.23% | 0.05% | 8.01% | 0.05% | 5.22% | 0.00% |
| 过去七年 | 26.83% | 0.07% | 10.43% | 0.05% | 16.40% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.10% | 0.07% | 10.92% | 0.05% | 18.18% | 0.02% |

注：自2026年9月21日起，本基金业绩比较基准由“中债综合（全价）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%”调整为“中债-综合全价（1-3年）指数收益率×95%+一年期定期存款基准利率×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

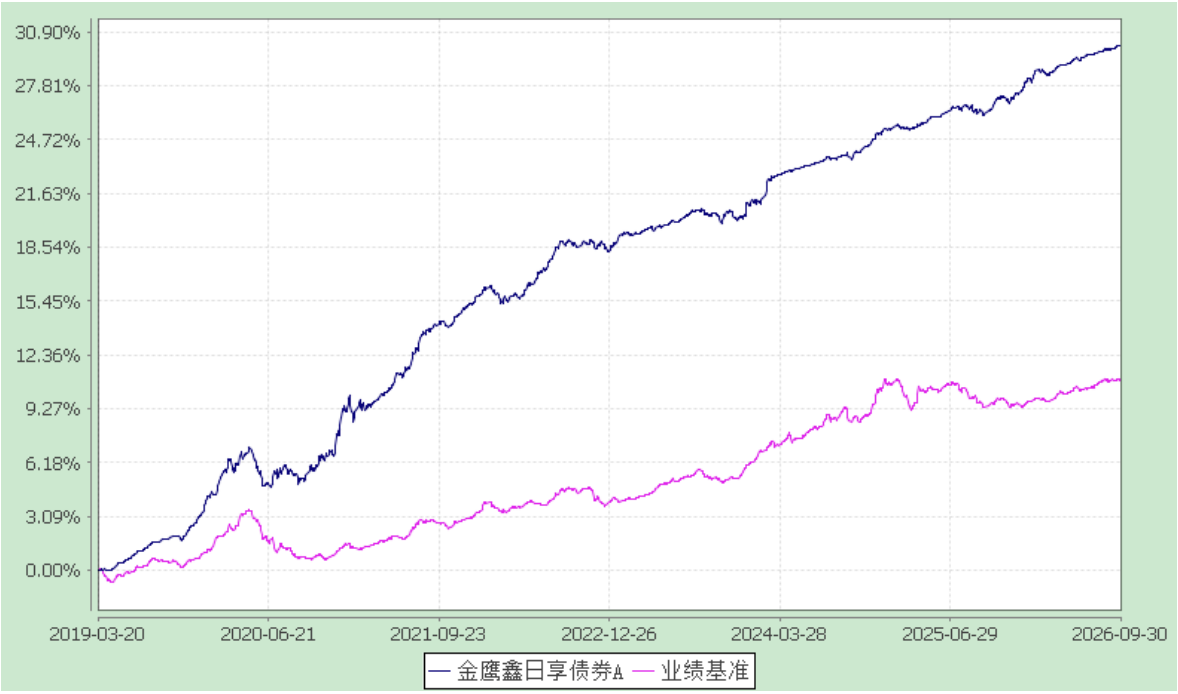
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰鑫日享债券型证券投资基金

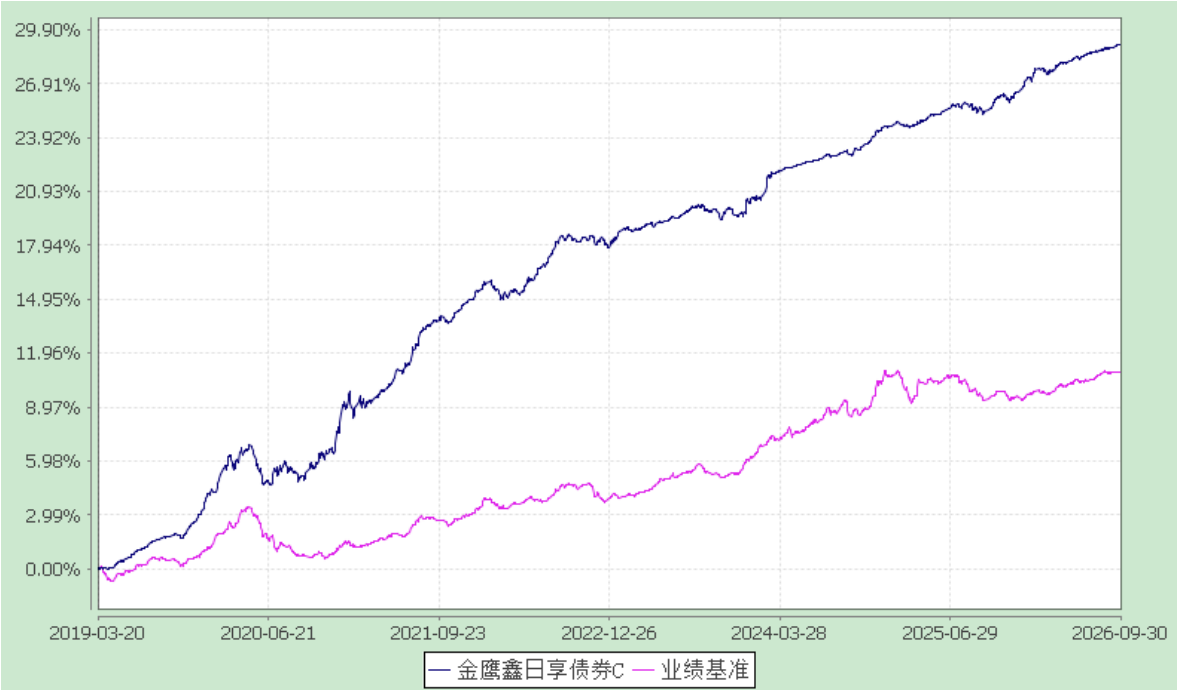
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 3 月 20 日至 2026 年 9 月 30 日)

1．金鹰鑫日享债券 A：




2．金鹰鑫日享债券 C：




注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合（全价）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%”调整为“中债-综合全价（1-3 年）指数收益率×95%+一年期定期存款基准利率×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

# §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 | | |
| 孙倩倩 | 本基金的基金经理，公司绝对收益投资部副总经理 | 2026-04-25 | - | 15 | 孙倩倩女士，南开大学经济学硕士。曾任招商证券策略研究分析师、债券研究分析师，中欧基金管理有限公司基金经理等职，2018 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司 ，现任绝对收益投资部副总经理、基金经理。 |
| 吕雅楠 | 本基金的基金经理 | 2026-06-12 | - | 6 | 吕雅楠女士，华东理工大学经济学硕士。2018 年 3 月至 2019 年 11 月曾任上海新世纪资信评估投资服务有限公司助理分析师。2019 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任固定收益研究部研究员、基金经理助理，现任固定收益研究部基金经理。 |

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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

2026 年 3 季度权益市场受海外流动性与科技产业景气预期扰动，整体涨少跌多，TMT 板块调整显著，煤炭、石油、农业、金融等板块相对占优。宽基层面，科创 50、创业板指等科创成长指数深度回调，大盘价值、红利板块逆势走强。季初市场震荡后快速下杀，科技板块集中调整，红利、消费阶段性反弹；伴随杠杆资金加速出清，8 月初市场迎来超跌反弹，海外企业季报落地，资金重新定价 AI 增长逻辑，8 月中旬起指数转入高位震荡，PCB、光通信产业链行情持续演绎。9 月美联储加息落地，但美债利率高位运行持续压制分母端，叠加节前避险情绪升温，市场再度加速下行。

权益走弱环境下，可转债期权价值承压，中证转债指数持续调整；叠加超预期赎回、到期转债供给增加，全市场转股溢价率中枢趋于压缩。季初转债转股价

值随权益行情回落，转股溢价率被动抬升；8 月权益反弹阶段，转股溢价率得到消化，转债整体价格横盘，未能同步跟涨，仅部分新券上市短期交易活跃。后续股市再度调整，科创、创业板相关转债随正股下行，转债估值同步收缩。

债券市场方面，2026 年 3 季度利率债震荡走强，收益率曲线维持平坦下行，超长端表现突出，行情主线围绕基本面弱现实、宽货币预期与资产荒展开。7 月债市先抑后扬。上旬央行公开市场净回笼，叠加政府债供给压力、政治局会议政策预期及资金面扰动，市场调整后维持极致窄幅震荡，多空博弈均衡，交易盘逢调整仍具备配置意愿。下旬跨月流动性转充裕，政治局会议释放偏积极货币政策信号，PMI 回落至荣枯线下方；资产荒背景下机构博弈宽松预期，做多情绪集中释放，长端与超长端收益率快速下行。8 月债市延续平坦下行走势。上半月虽受特别国债供给、政策表态担忧、免税传闻扰动，但充裕资金面与旺盛配置需求快速消化利空；叠加基本面与金融数据偏弱、摊余债基重启申报、公积金新规催化，行情快速走强，10 年期国债活跃券一度下探至 1.66%附近。此后财政发力与政府债供给预期升温，资金边际收敛，止盈压力上升，长端收益率自低位回调，市场分歧加大。9 月上旬利率波动有限；下旬美联储加息落地，央行强化双节前流动性呵护，叠加机构欠配与资产荒共振，10 年期国债收益率继续下探并创下年内新低。

组合层面，本基金延续历史上高胜率、低回撤的策略，主要配置于中短端资产，同时通过在长端利率资产和可转债资产领域采取波动操作，稳健增厚收益。

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 1.0936 元，本报告期份额净值增长率为 0.44%，同期业绩比较基准增长率为 0.42%；C 类基金份额净值为 1.0895 元，本报告期份额净值增长率为 0.41%，同期业绩比较基准增长率为 0.42%。

**4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**

本报告期内无应当说明的预警事项。

# §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 | 3,245,948,573.80 | 94.02 |
| | 其中：债券 | 3,245,948,573.80 | 94.02 |
| | 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 | 199,410,619.64 | 5.78 |
| | 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 | 6,180,758.09 | 0.18 |
| 7 | 其他各项资产 | 916,094.03 | 0.03 |
| 8 | 合计 | 3,452,456,045.56 | 100.00 |

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

## 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投资。

### 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投资。

**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 | 2,067,303,885.47 | 62.47 |
| | 其中：政策性金融债 | 293,537,939.72 | 8.87 |
| 4 | 企业债券 | 97,123,305.76 | 2.93 |
| 5 | 企业短期融资券 | 20,144,214.79 | 0.61 |
| 6 | 中期票据 | 732,463,430.67 | 22.13 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 32,381,441.58 | 0.98 |
| 8 | 同业存单 | 296,532,295.53 | 8.96 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,245,948,573.80 | 98.09 |

**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 | 232280003 | 22 成都银行二级资本债 01 | 1,000,000.00 | 105,924,547.95 | 3.20 |
| 2 | 092280139 | 22 交行二级资本债 02A | 1,000,000.00 | 104,355,150.68 | 3.15 |
| 3 | 092280069 | 22 华夏银行二级资本债 01 | 1,000,000.00 | 101,741,397.26 | 3.07 |
| 4 | 092280080 | 22 光大银行二级资本债 01A | 1,000,000.00 | 101,714,219.18 | 3.07 |
| 5 | 112620111 | 26 广发银行 CD111 | 1,000,000.00 | 98,927,967.03 | 2.99 |

**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、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。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的华夏银行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。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国光大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广发银行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、国家外汇管理局广东省分局的处罚。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中国工商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、中国人民银行、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中国农业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。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中国建设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北京市分局、国家金融监督管理总局、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其他各项资产构成**

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 90,209.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 825,884.11 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 916,094.03 |

**5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 127056 | 中特转债 | 4,656,252.90 | 0.14 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 4,360,880.29 | 0.13 |
| 3 | 127110 | 广核转债 | 2,650,118.03 | 0.08 |
| 4 | 127089 | 晶澳转债 | 2,385,566.46 | 0.07 |
| 5 | 113053 | 隆 22 转债 | 2,345,777.19 | 0.07 |
| 6 | 118031 | 天 23 转债 | 2,331,384.63 | 0.07 |
| 7 | 110087 | 天业转债 | 1,800,067.81 | 0.05 |
| 8 | 110086 | 精工转债 | 1,536,245.24 | 0.05 |
| 9 | 123178 | 花园转债 | 1,395,571.23 | 0.04 |
| 10 | 127102 | 浙建转债 | 1,196,782.19 | 0.04 |
| 11 | 113691 | 和邦转债 | 891,356.33 | 0.03 |
| 12 | 113643 | 风语转债 | 695,114.38 | 0.02 |
| 13 | 110100 | 龙建转债 | 582,526.16 | 0.02 |
| 14 | 118065 | 艾为转债 | 385,261.40 | 0.01 |
| 15 | 123263 | 鼎捷转债 | 53,860.88 | 0.00 |

**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 | 金鹰鑫日享债券A | 金鹰鑫日享债券C |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,750,603,330.22 | 30,432,630.17 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,006,449,602.23 | 24,522,858.27 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,771,067,446.93 | 14,777,300.66 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,985,985,485.52 | 40,178,187.78 |

## §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。

## §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 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人决定自 2026 年 9 月 21 日起调整本基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订，详见本基金管理人于 2026 年 8 月 22 日发布的《金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》及其后续相关公告。

## §10 备查文件目录

### 10.1备查文件目录

1、中国证监会批准基金发行及募集的文件。

2、《金鹰鑫日享债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰鑫日享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

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