

金鹰鑫日享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：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

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	1,298,332,291.77 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，

	<p>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。</p> <p>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。</p>	
业绩比较基准	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，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	1,274,519,689.40 份	23,812,602.37 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)	
	金鹰鑫日享债券 A	金鹰鑫日享债券 C
1.本期已实现收益	9,231,747.90	175,660.76

2.本期利润	5,356,298.10	100,587.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.0033	0.0031
4.期末基金资产净值	1,325,173,959.80	24,718,554.33
5.期末基金份额净值	1.0397	1.0380

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	0.30%	0.03%	0.28%	0.08%	0.02%	-0.05%
过去六个月	0.80%	0.02%	1.21%	0.07%	-0.41%	-0.05%
过去一年	2.70%	0.06%	3.12%	0.06%	-0.42%	0.00%
过去三年	8.23%	0.06%	5.70%	0.05%	2.53%	0.01%
过去五年	21.48%	0.08%	8.07%	0.05%	13.41%	0.03%
自基金合同生效起至今	23.72%	0.08%	8.55%	0.05%	15.17%	0.03%

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④	①—③	②—④
过去三个月	0.27%	0.03%	0.28%	0.08%	-0.01%	-0.05%

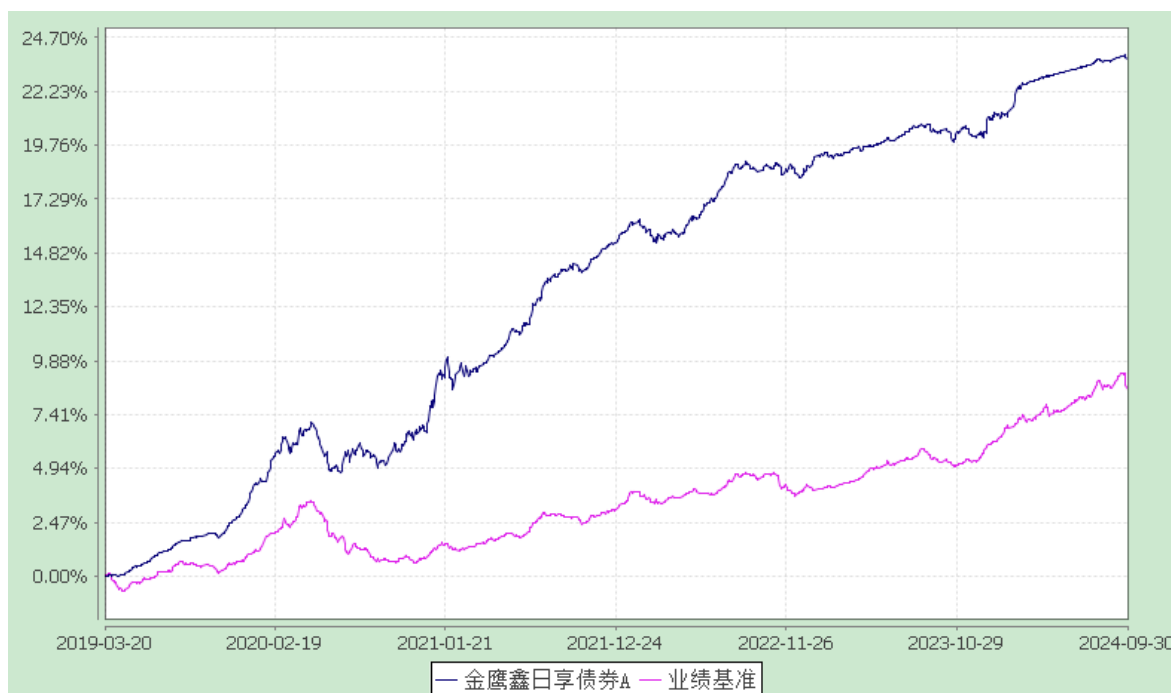
过去六个月	0.76%	0.02%	1.21%	0.07%	-0.45%	-0.05%
过去一年	2.58%	0.06%	3.12%	0.06%	-0.54%	0.00%
过去三年	7.88%	0.06%	5.70%	0.05%	2.18%	0.01%
过去五年	20.84%	0.08%	8.07%	0.05%	12.77%	0.03%
自基金合同生效起至今	23.00%	0.08%	8.55%	0.05%	14.45%	0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率×80%+1年期银行定期存款利率（税后）×20%。

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2024年9月30日)

1. 金鹰鑫日享债券 A:



2. 金鹰鑫日享债券 C:



注：本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率×80%+1 年期银行定期存款利率（税后）×20%。

§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		
林暉	本基金的基金经理，公司绝对收益投资部副总经理	2019-06-26	-	14	林暉先生,2010年4月至2012年12月曾任兴业证券股份有限公司交易员,2012年12月至2015年4月曾任中海基金管理有限公司基金经理助理,2015年4月至2016年8月曾任兴业证券股份有限公司投资经理,2016年8月至2018年6月曾任国泰君安证券资产管理有限公司投资经理。2018年6月加入金鹰基金管理有限公司,担任投资经理。现任绝对收益投资部基金经理。

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》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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内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

三季度全球经济变化加剧，海内外经济大多不及预期。美国经济意外放缓，通胀率如预期下降，9 月首次降息 50 个基点。国内经济面临更大压力，自 7 月起，经济和社融数据显著下滑，物价进一步走低。6 月至 8 月，M1 货币供应量从-5%降至-7.3%，PPI 从-0.8%降至-1.8%。消费市场疲软，社零消费同比增速连续三个月下滑。针对下行压力，7 月政治局会议强调完成全年经济目标的决心，随后降息 10 个基点，并安排 3000 亿特别国债支持“两新”领域。9 月，经济压力加大，悲观情绪升温，资产价格下跌。央行果断采取行动，9 月 24 日降准 0.5%，降息 20 个基点，并推出两项货币政策工具以提振股市信心。9 月政治局会议分析经济形势，直面挑战，提振社会预期，股市反弹，债市调整。

对应到债市，三季度利率呈现宽幅震荡。6 月底十年国债估值为 2.20%，最低下探至 2.02%，9 月底回升至 2.15%。总体看，十年国债下行 5.4bp，十年国开下行 4.6bp，30 年国债下行 7.32bp；信用债利率以上行为主，3 年期 AAA 中票估值上行 18.76bp。分节奏看，7 月债市主要受央行对长端利率态度和降息影响，利率先升后降；8 月则受央行买卖债调控和债市流动性紧缩影响，利率整体上行，信用债跌幅更为显著。9 月债市回调，主要受降息预期和政策发力以及风险偏好转变带来的负债扰动影响。

而三季度股票市场在普跌后大幅反弹，科技成长方向表现出较好的弹性。三季度初期在增量流动性匮乏、宏观基本面预期相对悲观、微观上市公司主体盈利预期下修的背景下，股票市场经历了一定幅度的调整。9 月中下旬陆续召开的国新办新闻发布会、政治局会议定调了政策方向，降息降准、创设新型货币政策工具、推动中长期资金入市等政策指引改善了市场关于流动性的预期，降低存量房贷利率、降低二套房首付比例、支持科技创新与小微企业等政策提振了市场对经济基本面的积极预期，股票市场大幅反弹。

受益于股票市场的表现，中证转债指数也回到年内正收益。三季度初股票市场承压，可转债被动定价信用偿付能力，出现了大量的非理性调整，随着压制股票市场、可转债市场表现的不利因素逐步解除，股票市场的反弹带动可转债权益部分的上涨，信用定价的折损也随基本面预期的改善而有所修复，可转债指数明显反弹。

组合层面选择高胜率，低回撤的策略应对当前债券曲线的平坦化，主要配置

于短期信用债，同时在信用风险缓和后，布局低价银行转债增收组合收益。

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 1.0397 元，本报告期份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准增长率为 0.28%；C 类基金份额净值为 1.0380 元，本报告期份额净值增长率为 0.27%，同期业绩比较基准增长率为 0.28%。

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	1,395,598,748.29	93.53
	其中：债券	1,395,598,748.29	93.53
	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	64,012,057.94	4.29
	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	3,456,929.69	0.23
7	其他各项资产	29,148,976.63	1.95
8	合计	1,492,216,712.55	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	143,498,603.04	10.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,168,697,738.05	86.58
	其中：政策性金融债	83,688,398.91	6.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,947,331.51	0.74
7	可转债（可交换债）	33,947,306.02	2.51
8	同业存单	39,507,769.67	2.93
9	其他	-	-
10	合计	1,395,598,748.29	103.39

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	1920066	19 上海银行 二级	900,000.00	93,546,236.0 7	6.93
2	1923009	19 太平财险	900,000.00	93,464,006.5 6	6.92
3	2023005	20 平安人寿	900,000.00	92,201,330.9 6	6.83
4	2028013	20 农业银行 二级 01	800,000.00	81,428,471.2 3	6.03
5	2028024	20 中信银行 二级	700,000.00	71,342,001.6 4	5.29

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上海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上海监管局的处罚。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平安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深圳市分行的处罚。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信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邮人寿保险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。

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规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	102,693.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,046,283.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	29,148,976.63
---	----	---------------

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	113037	紫银转债	10,788,684.93	0.80
2	128129	青农转债	10,486,975.34	0.78
3	113052	兴业转债	6,567,558.90	0.49
4	111014	李子转债	2,278,603.29	0.17
5	110064	建工转债	2,202,378.08	0.16
6	123133	佩蒂转债	1,128,002.74	0.08
7	127022	恒逸转债	495,102.74	0.04

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	1,557,709,740.08	33,306,614.39
报告期期间基金总申购份额	2,900,564,820.52	6,956,157.30
减：报告期期间基金总赎回份额	3,183,754,871.20	16,450,169.32
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	1,274,519,689.40	23,812,602.37

§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

无。

§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

二〇二四年十月二十五日