金鹰悦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：浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商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	金鹰悦享债券
基金主代码	018644
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 1 月 30 日
报告期末基金份额总额	251,318,879.59 份
投资目标	本基金在严格控制风险及保持良好流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币政策和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征的变化，据此确定投资组合中固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间的配置比例并根

	据市场环境变化动态调整。		
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率×5%		
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。		
基金管理人	金鹰基金管理有限公司		
基金托管人	浙商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	金鹰悦享债券 A	金鹰悦享债券 C	金鹰悦享债券 D
下属分级基金的交易代码	018644	018645	021729
报告期末下属分级基金的份额总额	10,977,621.04 份	3,545,460.69 份	236,795,797.86 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)		
	金鹰悦享债券 A	金鹰悦享债券 C	金鹰悦享债券 D
1.本期已实现收益	-30,644.25	-11,329.57	-755,856.07
2.本期利润	-510,848.28	-230,770.32	-10,861,009.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0499	-0.0589	-0.0485
4.期末基金资产净值	11,560,308.82	3,703,174.03	249,468,027.96

5.期末基金份额净值	1.0531	1.0445	1.0535

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、本基金合同于 2024 年 1 月 30 日生效。

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

金鹰悦享债券 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	-5.04%	0.46%	-0.13%	0.15%	-4.91%	0.31%
过去六个月	0.03%	0.43%	1.60%	0.16%	-1.57%	0.27%
过去一年	-0.60%	0.35%	1.73%	0.16%	-2.33%	0.19%
自基金合同生效起至今	5.31%	0.22%	15.01%	0.16%	-9.70%	0.06%

金鹰悦享债券 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	-5.11%	0.46%	-0.13%	0.15%	-4.98%	0.31%
过去六个月	-0.12%	0.43%	1.60%	0.16%	-1.72%	0.27%
过去一年	-0.94%	0.35%	1.73%	0.16%	-2.67%	0.19%
自基金合同生效起至今	4.45%	0.22%	15.01%	0.16%	-10.56%	0.06%

金鹰悦享债券 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	-5.05%	0.46%	-0.13%	0.15%	-4.92%	0.31%
过去六个月	0.03%	0.43%	1.60%	0.16%	-1.57%	0.27%
过去一年	-0.61%	0.35%	1.73%	0.16%	-2.34%	0.19%
自基金合同生效起至今	4.27%	0.24%	10.72%	0.16%	-6.45%	0.08%

注：本基金自 2024 年 6 月 19 日起增设 D 类基金份额，D 类基金份额首次确认日为 2024 年 6 月 20 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

金鹰悦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

（2024 年 1 月 30 日至 2026 年 9 月 30 日）

金鹰悦享债券 A



金鹰悦享债券 C



金鹰悦享债券 D



注：1、本基金自 2024 年 6 月 19 日起增设 D 类基金份额，D 类基金份额首次确认日为 2024 年 6 月 20 日；

2、本基金业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率×5%

§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		
吴海峰	本基金的基金经理	2026-04-30	-	6	吴海峰先生，复旦大学金融硕士。曾任国金证券股份有限公司上海投资咨询分公司研究助理。2020 年 6 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任绝对收益投资部研究员、基金经理助理，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，严格遵守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

受海外流动性与科技产业景气度预期变化影响，三季度市场涨少跌多，TMT 风格调整明显，但煤炭、石油以及农业、金融等行业有所表现。宽基指数方面科创 50、创业板指等科创方向深度调整，大盘价值及红利等方向上涨。三季度初市场在震荡后急跌，科技方向集中调整，红利与消费等方向反弹，随着杠杆资金的加速出清，8 月初市场超跌反弹，海外季报披露，市场重新交易 AI 带来的增长逻辑，至 8 月中旬开始指数高位震荡，但 PCB 与光通信方向逻辑继续演绎。9 月份市场加息落地，但美债利率高企持续给分母端造成压力，叠加节前避险情绪的影响，市场再度加速下行。

债券市场三季度超长端品种在 7 月下旬和 9 月下旬走出两波强势行情，其余时间整体偏震荡，短端资金利率刚性的制约下表现相对钝化。其中，7 月下旬受资金面抢跑拉久期影响长债表现强势，9 月下旬则是在央行超额续作 MLF、隔夜逆回购规模上限扩容等利好催化下长端利率进一步下行。

组合股票部分延续科技主线的配置思路，整体仍以创业板指、科创 50、上证 50 中的核心科技制造大盘权重股为主，同时也关注大金融、新技术等方向的配置机会，保持中等的股票仓位配置。债券部分顺应行情压缩了久期水平，维持中低久期的配置策略。

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 类份额净值为 1.0531 元，本报告期份额净值增长率为-5.04%，同期业绩比较基准增长率为-0.13%；C 类基金份额净值为 1.0445 元，本报告期份额净值增长率为-5.11%，同期业绩比较基准增长率为-0.13%；D 类基金份额净

值为 1.0535 元，本报告期份额净值增长率为-5.05%，同期业绩比较基准增长率为-0.13%。

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	36,041,951.78	13.52
	其中：股票	36,041,951.78	13.52
2	固定收益投资	224,770,949.27	84.31
	其中：债券	224,770,949.27	84.31
	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	5,711,879.73	2.14
7	其他资产	61,649.22	0.02
8	合计	266,586,430.00	100.00

注：1、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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,872,191.80	10.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	325,440.00	0.12
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,458,749.98	1.68
J	金融业	2,367,450.00	0.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,120.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	36,041,951.78	13.61

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300033	同花顺	7,500	1,477,950.00	0.56
2	688981	中芯国际	10,000	1,119,900.00	0.42
3	688025	杰普特	2,500	1,048,625.00	0.40
4	002837	英维克	19,000	1,025,050.00	0.39

5	688008	澜起科技	5,000	1,011,550.00	0.38
6	688012	中微公司	3,000	955,650.00	0.36
7	300059	东方财富	50,000	889,500.00	0.34
8	688347	华虹宏力	4,000	831,680.00	0.31
9	300308	中际旭创	1,000	808,440.00	0.31
10	688256	寒武纪	798	805,189.98	0.30

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	214,703,478.04	81.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,067,471.23	3.80
	其中：政策性金融债	10,067,471.23	3.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	224,770,949.27	84.91

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	019840	26 国债 11	440,000.00	44,204,738.63	16.70
2	019835	26 国债 09	360,000.00	36,148,231.23	13.65
3	019832	26 国债 06	330,000.00	33,253,060.28	12.56
4	019797	25 国债 24	320,000.00	32,387,375.34	12.23
5	019796	25 国债 23	250,000.00	25,374,760.28	9.59

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

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 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 报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,631.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,649.22

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	金鹰悦享债券A	金鹰悦享债券C	金鹰悦享债券D
报告期期初基金份额总额	2,957,628.05	4,094,157.77	158,120,296.29
报告期期间基金总申购份额	8,725,372.51	1,140,944.05	142,757,931.80
减：报告期期间基金总赎回份额	705,379.52	1,689,641.13	64,082,430.23
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	10,977,621.04	3,545,460.69	236,795,797.86

§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 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悦享债券型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰悦享债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰悦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

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