

金鹰鑫日享债券型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 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：二〇二六年七月二十一日

§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 7 月 20 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 4 月 1 日起至 6 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	1,781,035,960.39 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。 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）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	1,750,603,330.22 份	30,432,630.17 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 4 月 1 日-2026 年 6 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	8,070,028.95	150,827.35

2.本期利润	11,294,170.89	222,040.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.0085	0.0080
4.期末基金资产净值	1,906,091,295.65	33,019,150.74
5.期末基金份额净值	1.0888	1.0850

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	0.77%	0.03%	0.57%	0.03%	0.20%	0.00%
过去六个月	1.73%	0.04%	0.88%	0.03%	0.85%	0.01%
过去一年	2.50%	0.05%	-0.15%	0.04%	2.65%	0.01%
过去三年	7.90%	0.05%	5.02%	0.06%	2.88%	-0.01%
过去五年	16.10%	0.05%	8.35%	0.05%	7.75%	0.00%
过去七年	28.34%	0.07%	10.45%	0.05%	17.89%	0.02%
自基金合同生效起至今	29.56%	0.07%	10.45%	0.05%	19.11%	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④	①—③	②—④
过去三个	0.75%	0.03%	0.57%	0.03%	0.18%	0.00%

月						
过去六个月	1.68%	0.04%	0.88%	0.03%	0.80%	0.01%
过去一年	2.40%	0.05%	-0.15%	0.04%	2.55%	0.01%
过去三年	7.55%	0.05%	5.02%	0.06%	2.53%	-0.01%
过去五年	15.49%	0.05%	8.35%	0.05%	7.14%	0.00%
过去七年	27.39%	0.07%	10.45%	0.05%	16.94%	0.02%
自基金合同生效起至今	28.57%	0.07%	10.45%	0.05%	18.12%	0.02%

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%。

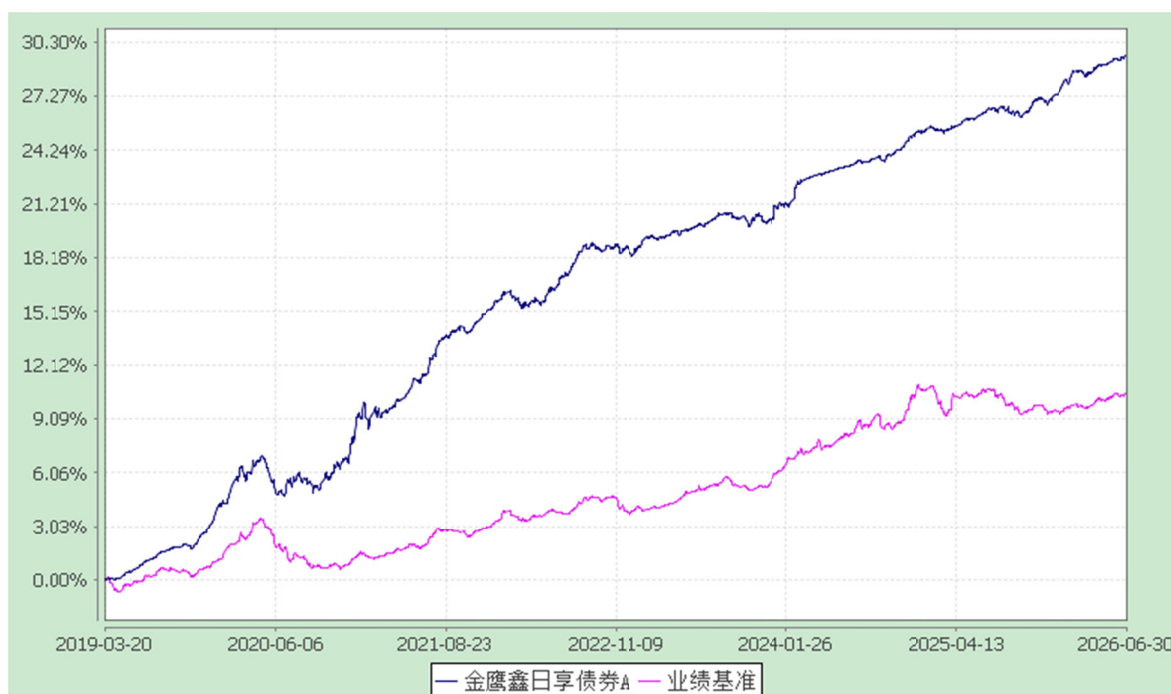
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰鑫日享债券型证券投资基金

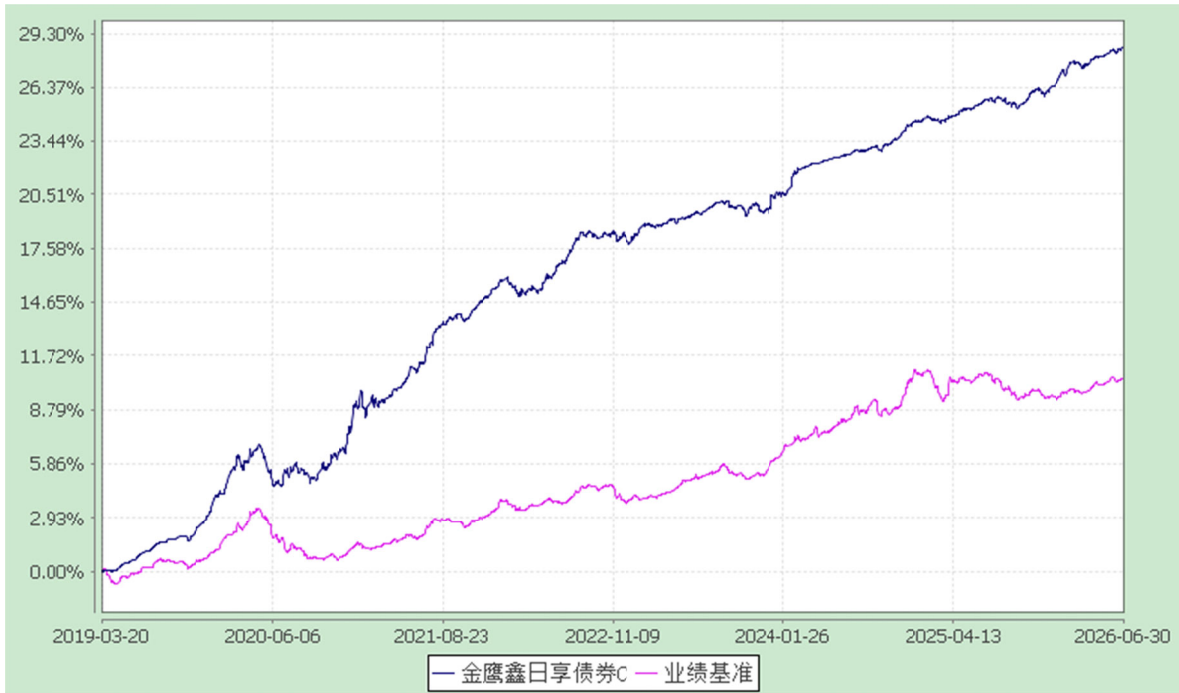
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 3 月 20 日至 2026 年 6 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		
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	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

	经理				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。
林晔	本基金的基金经理，公司绝对收益投资部副总经理	2019-06-26	2026-05-19	16	林晔先生，上海大学经济学硕士。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等职务。2018 年 6 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任投资经理、绝对收益投资部副总经理、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

二季度股票市场整体呈现震荡上行但结构分化的特征。4 月初市场交易冲击修复，地缘冲突对风险偏好形成扰动，呈现在红利、周期与科技资产之间轮动的行情。随着一季度业绩逐步落地，AI 方向盈利与资本开支的改善强化市场对产业趋势的认知，业绩主线落在科技成长方向。5 月份随着海外云厂商资本开支指引落地，以光模块、PCB 等方向为核心的海外科技链领涨，创业板指与科创 50 等指数表现强势。6 月份科技行情持续往上游涨价链扩散，存储、光纤、CCL 等方向继续表现强势，随着海外存储巨头财报与扩产规划落地，市场围绕扩产确定性交易半导体设备、材料及零部件等方向，国产算力的预期同步上修，科技与非科技方向的分化持续加剧。

可转债同样存在明显的结构分化特征，二季度中高价可转债整体表现优于低价可转债。在 4 月初整体修复的行情之后结构分化开始，低价可转债由于剩余期限、负债端压力以及行业特征影响持续走低，中高价可转债则受益于科技主线资产预期的上修表现强势。随着分化的持续加剧，5 月后半段以来的可转债市场整体走弱，价格中位数持续下行，高价可转债主动提升转股溢价率，低价可转债被动累积转股溢价率，整体转股溢价率水平提升。

债券市场则主要围绕境外输入性通胀、资金面松紧、超长债供给冲击、宏观经济弱修复等核心因素波动,全季度 10 年期国债收益率运行区间 1.70%-1.82%,季度末较季初下行 8BP 左右。4 月初,债市整体呈震荡格局。超长期特别国债集中发行带来供给冲击,叠加中东地缘冲突推升国际油价,输入性通胀预期升温,持续压制市场情绪。4 月中旬至 5 月中旬,随着地缘冲突缓和,通胀对债市的约束边际减弱,债市开启由资金面主导的行情,超长债表现领涨。期间流动性极度宽松,DR001 一度低至 1.2%,创近年新低,非银机构资金充裕,市场买盘旺盛;与此同时,宏观基本面呈现明显 K 型分化,地产、消费、信贷需求持续偏弱,资产荒逻辑进一步强化,长端利率债、二永债迎来阶段性强势行情。5 月下旬至 6 月底,资金面边际收紧,市场多空分歧加大,债市转入区间震荡。利空主要来自:临近季末部分机构止盈落袋,叠加央行前期多次回收长期流动性,季末月份资金面边际趋紧,债市出现小幅回调;6 月下旬,央行逐步加大流动性投放,有效缓和资金紧张预期,债市随之企稳修复。

组合层面选择高胜率、低回撤的策略应对当前负债端的要求,主要配置于中短端信用债及小仓位转债资产,在长久期资产方面采取波动操作,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 1.0888 元,本报告期份额净值增长率为 0.77%,同期业绩比较基准增长率为 0.57%;C 类基金份额净值为 1.0850 元,本报告期份额净值增长率为 0.75%,同期业绩比较基准增长率为 0.57%。

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	2,012,057,591.34	96.31
	其中：债券	2,012,057,591.34	96.31
	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	50,002,260.27	2.39
	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	27,092,675.29	1.30
7	其他各项资产	99,793.79	0.00
8	合计	2,089,252,320.69	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	24,521,959.10	1.26
2	央行票据	-	-

3	金融债券	1,351,048,153.41	69.67
	其中：政策性金融债	101,026,465.75	5.21
4	企业债券	76,746,819.16	3.96
5	企业短期融资券	10,024,712.33	0.52
6	中期票据	425,576,200.55	21.95
7	可转债（可交换债）	25,440,669.39	1.31
8	同业存单	98,699,077.40	5.09
9	其他	-	-
10	合计	2,012,057,591.34	103.76

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	2228039	22 建设银行 二级 01	700,000.00	71,390,104.1 1	3.68
2	2228017	22 邮储银行 二级 01	600,000.00	61,501,364.3 8	3.17
3	2421001	24 中山农商 小微债	500,000.00	50,514,545.2 1	2.61
4	312410001	24 中行 TLAC 非资 本债 01A	500,000.00	50,463,561.6 4	2.60
5	212480011	24 浙商银行 小微债 03	500,000.00	50,459,972.6 0	2.60

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中国邮政储蓄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山农村商业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中山市分行的处罚。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浙商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农业发展银行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东莞农村商业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广东省分行的处罚。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兴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、中国银行间市场交易商协会的处罚。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青岛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青岛监管局、中国人民银行青岛市分行的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

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	67,988.92
2	应收证券清算款	2,439.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,364.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,793.79

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	127025	冀东转债	4,213,731.51	0.22
2	127070	大中转债	3,765,754.79	0.19
3	123158	宙邦转债	2,979,939.73	0.15
4	118059	顾中转债	2,565,252.05	0.13
5	113056	重银转债	2,491,358.90	0.13
6	111000	起帆转债	2,363,338.08	0.12
7	113052	兴业转债	2,301,752.88	0.12
8	128135	洽洽转债	2,214,832.14	0.11
9	127049	希望转 2	2,171,903.01	0.11
10	127109	电化转债	372,806.30	0.02

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	1,456,345,164.08	26,979,577.00
报告期期间基金总申购份额	2,171,613,026.59	9,101,335.87
减：报告期期间基金总赎回份额	1,877,354,860.45	5,648,282.70
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	1,750,603,330.22	30,432,630.17

§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

二〇二六年七月二十一日