

金鹰元祺信用债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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	金鹰元祺债券
基金主代码	002490
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 8 日
报告期末基金份额总额	413,926,655.81 份
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。
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，本基金以信用债为主，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，力争实现超越业绩比较

	基准的投资收益。	
业绩比较基准	中债信用债总财富(总值)指数收益率×80%+一年定期存款利率（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	金鹰元祺债券 A	金鹰元祺债券 C
下属分级基金的交易代码	002490	022484
报告期末下属分级基金的份额总额	292,197,950.34 份	121,728,705.47 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)	
	金鹰元祺债券 A	金鹰元祺债券 C
1.本期已实现收益	7,451,545.55	1,763,067.06
2.本期利润	38,150,549.79	9,994,110.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.1176	0.1534
4.期末基金资产净值	519,628,944.35	215,799,136.93
5.期末基金份额净值	1.7783	1.7728

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。

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、金鹰元祺债券 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	7.19%	0.49%	0.74%	0.01%	6.45%	0.48%
过去六个月	7.78%	0.48%	1.51%	0.01%	6.27%	0.47%
过去一年	11.67%	0.42%	2.20%	0.02%	9.47%	0.40%
过去三年	19.76%	0.31%	9.15%	0.03%	10.61%	0.28%
过去五年	31.09%	0.29%	16.39%	0.03%	14.70%	0.26%
过去七年	61.87%	0.30%	24.71%	0.03%	37.16%	0.27%
自基金合同生效起至今	74.68%	0.28%	35.25%	0.03%	39.43%	0.25%

2、金鹰元祺债券 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	7.12%	0.49%	0.74%	0.01%	6.38%	0.48%
过去六个月	7.63%	0.48%	1.51%	0.01%	6.12%	0.47%
过去一年	11.34%	0.42%	2.20%	0.02%	9.14%	0.40%
自基金合同生效起至今	17.93%	0.38%	4.48%	0.02%	13.45%	0.36%

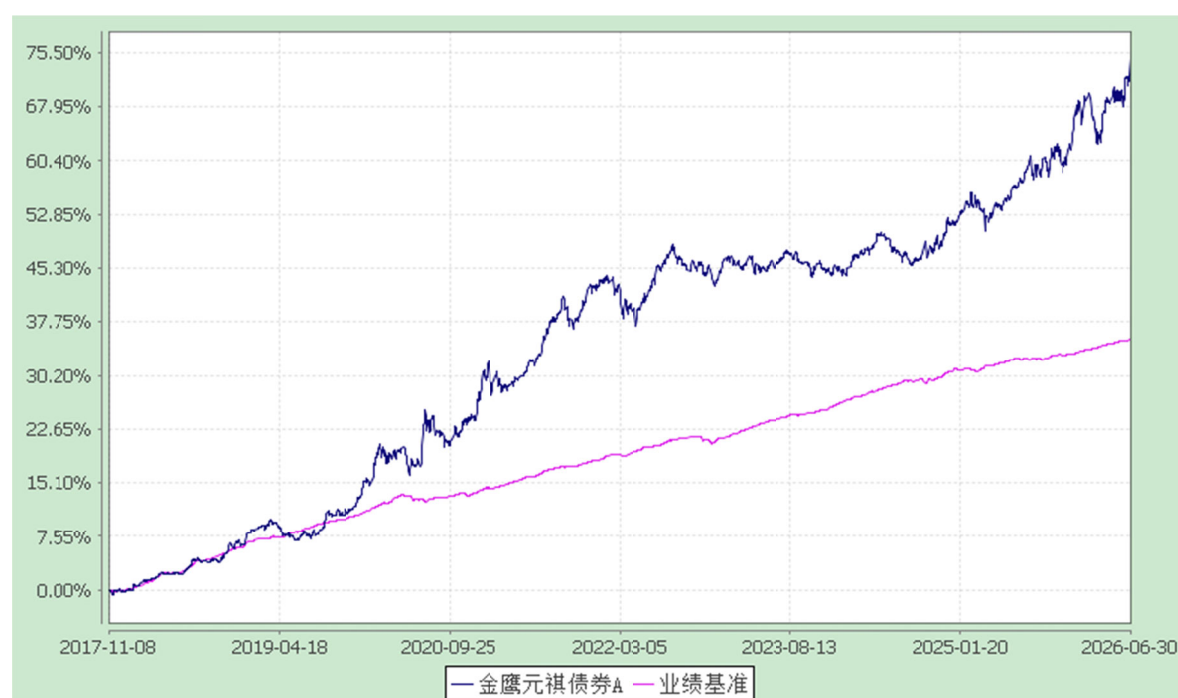
注：1、本基金的业绩比较基准是：中债信用债总财富(总值)指数收益率*80%+一年定期存款利率(税后)*20%；

2、本基金自2024年11月1日起增设C类基金份额，首次确认日为2024年11月4日。

3.2.2 自基金转型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

金鹰元祺信用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
(2017 年 11 月 8 日至 2026 年 6 月 30 日)

1. 金鹰元祺债券 A:



2. 金鹰元祺债券 C:



注：1、本基金由原金鹰元祺保本混合型证券投资基金于 2017 年 11 月 8 日转型而来；

2、本基金自 2024 年 11 月 1 日起增设 C 类基金份额，首次确认日为 2024 年 11 月 4 日；

3、本基金的业绩比较基准是：中债信用债总财富(总值)指数收益率*80%+一年定期存款利率(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		
林曄	本基金的基金经理，公司绝对收益投资	2019-10-18	2026-05-19	16	林曄先生，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

	部副 总经 理				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。
林龙军	本基金的基金 经理，公司总 经理助理、绝 对收益投资部 总经理	2018-06- 02	-	17	林龙军先生，上海财经大学经济学硕士。曾任兴全基金管理有限公司产品经理、研究员、基金经理助理、投资经理兼固收投委会委员等职务。2018 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，现任总经理助理、绝对收益投资部总经理、基金经理。
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

债券方面，二季度债市收益率整体呈震荡走强趋势。4 月初供给担忧升温，长端高位震荡，4 月中旬资金宽松叠加地缘缓和，债市修复。5 月受基本面数据偏弱、MLF 超额投放等因素影响推动债市走强。6 月进入多空交织的阶段，长端利率窄幅震荡。

受股票震荡上行但结构分化的特征影响，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。

组合可转债资产配置方面，在市场大分化的背景下积极调整资产结构，增配有产业趋势的中高价科技方向可转债，减少了存在期权价值调整压力的低价可转债配置，同时根据市场的估值位置做积极的仓位管理。债券部分维持中等久期配置思路。

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 1.7783 元，本报告期份额净值收益率为 7.19%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%；C 类份额净值为 1.7728 元，本报告期份额净值收益率为 7.12%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

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	745,129,981.53	98.01
	其中：债券	745,129,981.53	98.01
	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	14,580,988.21	1.92

7	其他各项资产	519,693.64	0.07
8	合计	760,230,663.38	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	105,112,462.46	14.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	280,589,664.94	38.15
	其中：政策性金融债	20,170,728.77	2.74
4	企业债券	30,479,079.45	4.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	90,881,671.24	12.36
7	可转债（可交换债）	238,067,103.44	32.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	745,129,981.53	101.32

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	102580206	25 中石化 MTN002	400,000.00	40,080,683.8 4	5.45
2	272380004	23 农银人寿 资本补充债 01	300,000.00	31,332,009.8 6	4.26
3	102583043	25 南电 MTN012	300,000.00	30,550,997.2 6	4.15
4	184803	24 铁道 01	300,000.00	30,479,079.4 5	4.14
5	019827	26 国债 01	300,000.00	30,194,457.5 3	4.11

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成都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四川监管局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

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	69,022.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	450,670.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	519,693.64

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	113043	财通转债	14,322,659.81	1.95
2	118058	微导转债	12,002,412.82	1.63
3	123176	精测转 2	9,133,722.74	1.24
4	118060	瑞可转债	9,105,133.81	1.24
5	118059	颀中转债	8,721,856.99	1.19
6	123255	鼎龙转债	8,375,083.56	1.14

7	123158	宙邦转债	8,343,831.23	1.13
8	118030	睿创转债	8,152,346.30	1.11
9	123257	安克转债	8,079,673.29	1.10
10	118053	正帆转债	7,841,593.97	1.07
11	118062	天准转债	7,488,434.63	1.02
12	113677	华懋转债	7,372,676.71	1.00
13	123124	晶瑞转 2	7,257,112.25	0.99
14	123251	华医转债	6,687,934.93	0.91
15	123258	胜蓝转 02	6,661,296.93	0.91
16	123259	锦浪转 02	6,358,090.36	0.86
17	113667	春 23 转债	6,137,161.37	0.83
18	113694	清源转债	6,125,682.19	0.83
19	127098	欧晶转债	5,645,472.00	0.77
20	127072	博实转债	5,326,284.93	0.72
21	123149	通裕转债	4,648,118.90	0.63
22	113646	永吉转债	4,560,831.78	0.62
23	127070	大中转债	4,518,905.75	0.61
24	123211	阳谷转债	3,933,446.30	0.53
25	127103	东南转债	3,601,558.22	0.49
26	127102	浙建转债	3,554,316.99	0.48
27	113066	平煤转债	3,533,535.62	0.48
28	113048	晶科转债	2,907,486.71	0.40
29	113632	鹤 21 转债	2,740,232.33	0.37
30	123114	三角转债	2,583,465.75	0.35
31	113058	友发转债	2,554,938.08	0.35
32	111000	起帆转债	2,532,147.95	0.34
33	123241	欧通转债	2,503,994.74	0.34
34	127109	电化转债	2,423,240.96	0.33
35	123235	亿田转债	2,350,573.15	0.32
36	123247	万凯转债	2,251,795.89	0.31
37	123262	神宇转债	2,104,628.22	0.29
38	110098	南药转债	1,982,472.33	0.27
39	113616	韦尔转债	1,835,957.18	0.25
40	113697	应流转债	1,589,714.79	0.22
41	113678	中贝转债	1,499,706.85	0.20
42	123224	宇邦转债	1,066,341.68	0.14

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	金鹰元祺债券A	金鹰元祺债券C
本报告期期初基金份额总额	349,961,537.61	59,064,905.31
报告期期间基金总申购份额	43,516,944.49	89,198,408.08
减：报告期期间基金总赎回份额	101,280,531.76	26,534,607.92
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	292,197,950.34	121,728,705.47

§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、中国证监会批准发行及募集的文件。

- 2、《金鹰元祺信用债债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰元祺信用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

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