金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金

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	金鹰多元策略混合
基金主代码	002844
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 9 日
报告期末基金份额总额	82,812,862.05 份
投资目标	本基金通过灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争实现基金资产的稳健回报和长期增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等多个维度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票类资产、固定收益类资产等各类资产类别上的投资比例，最大限度的提高收

	益。股票投资方面，本基金根据不同市场环境灵活运用成长、主题、定向增发、动量、事件驱动等多种投资策略积极进行股票投资。此外还包括存托凭证投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、衍生品投资策略和资产支持证券投资策略。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金、低于股票型基金。	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金鹰多元策略混合 A	金鹰多元策略混合 C
下属分级基金的交易代码	002844	020217
报告期末下属分级基金的份额总额	72,045,956.47 份	10,766,905.58 份

注：自2026年7月27日起，本基金业绩比较基准由“沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%”调整为“沪深300指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%”。

§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)	
	金鹰多元策略混合 A	金鹰多元策略混合 C
1.本期已实现收益	-5,357,789.36	-568,552.47
2.本期利润	86,232.97	-115,320.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0012	-0.0115
4.期末基金资产净值	50,693,539.86	7,459,237.17
5.期末基金份额净值	0.7036	0.6928

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、本基金自2023年12月1日起增设C类基金份额，C类份额首次确认日为2023年12月6日。

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、金鹰多元策略混合 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	0.24%	1.14%	-7.18%	0.77%	7.42%	0.37%
过去六个月	-7.01%	0.96%	-1.05%	0.71%	-5.96%	0.25%
过去一年	-11.44%	0.83%	-2.27%	0.61%	-9.17%	0.22%
过去三年	-34.16%	1.04%	16.16%	0.58%	-50.32%	0.46%
过去五年	-72.79%	1.41%	6.29%	0.56%	-79.08%	0.85%
过去七年	-41.12%	1.62%	26.57%	0.59%	-67.69%	1.03%
过去十年	-29.97%	1.46%	45.70%	0.58%	-75.67%	0.88%
自基金合同生效起至今	-29.64%	1.45%	46.81%	0.58%	-76.45%	0.87%

2、金鹰多元策略混合 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	0.10%	1.14%	-7.18%	0.77%	7.28%	0.37%
过去六个月	-7.27%	0.96%	-1.05%	0.71%	-6.22%	0.25%
过去一年	-11.96%	0.83%	-2.27%	0.61%	-9.69%	0.22%
自基金合同生效起至今	-29.07%	1.01%	19.14%	0.59%	-48.21%	0.42%

注：自2026年7月27日起，本基金业绩比较基准由“沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%”调整为“沪深300指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%”。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

金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金

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

(2016 年 8 月 9 日至 2026 年 9 月 30 日)

1．金鹰多元策略混合 A：



2．金鹰多元策略混合 C：



注：1、本基金于 2023 年 12 月 1 日起增加 C 类份额类别，C 类份额首次确认日为 2023 年 12 月 6 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2、自 2026 年 7 月 27 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%”调整为“沪深 300 指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%”。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		
欧阳娟	本基金的基金经理	2023-12-14	-	9	欧阳娟女士，清华大学理学博士。历任东方基金管理有限责任公司助理研究员、金鹰基金管理有限公司研究员、诺安基金管理有限公司研究员。2022 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，担任研究员职务，现任权益投资部基金经理。

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，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

回顾 2026 年三季度，全球延续经济韧性、但流动性再收紧，中国经济内外分化延续，A 股由二季度的科技主导转入三季度的风格再平衡，结构上呈现科技估值出清、红利资源防御占优。具体来看，全球层面，海外在美伊冲突悬而未决的背景下，能源价格攀升，叠加美国增长与通胀韧性，触发美联储在 9 月重启加息，引发全球流动性定价锚重新回到偏紧；国内层面，生产强、需求弱的格局依然延续，面对内需偏弱的经济环境，财政在三季度加快投放节奏，9 月央行落地房贷贴息、PSL 降息等结构性政策工具，政策节奏加快为国内经济企稳修复提供支撑。

展望四季度，海外地缘、美国中期选举等不确定性仍有待明朗，海外流动性最紧张阶段可能过去，但高利率约束依然存在；国内货币政策维持“适度宽松”，政策重心更强调扩大内需、优化供给、新旧动能转换，在面对海外不确定时，国内政策留有空间，能为市场夯实底线。在此期间，A 股市场主线或将从纯估值扩张切向盈利验证与次年盈利换锚。

本基金坚持稳健风格，继续布局优质红利资产以及稳健成长类资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金报告期内 A 类份额净值为 0.7036 元，本报告期份

额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准增长为-7.18%；C 类基金份额净值为 0.6928 元，本报告期份额净值增长率为 0.10%，同期业绩比较基准增长率为-7.18%。

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	41,406,409.03	67.64
	其中：股票	41,406,409.03	67.64
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	19,776,561.77	32.30
7	其他各项资产	35,863.62	0.06
8	合计	61,218,834.42	100.00

注：其他资产包括：交易保证金、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

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

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	3,940,925.00	6.78
C	制造业	12,025,222.00	20.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,871,124.00	4.94
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	7,656,623.00	13.17
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	14,912,515.03	25.64
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	41,406,409.03	71.20

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	002821	凯莱英	30,600	5,771,772.00	9.93

2	603259	药明康德	33,600	5,622,624.00	9.67
3	300759	康龙化成	115,000	5,171,550.00	8.89
4	600036	招商银行	89,900	3,709,274.00	6.38
5	601318	中国平安	63,300	3,373,257.00	5.80
6	600900	长江电力	100,600	2,871,124.00	4.94
7	601899	紫金矿业	80,100	2,386,179.00	4.10
8	300502	新易盛	5,300	2,061,700.00	3.55
9	000333	美的集团	22,800	1,826,280.00	3.14
10	603127	昭衍新药	36,700	1,809,310.00	3.11

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的招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 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其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,710.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,153.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,863.62

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

本基金本期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	金鹰多元策略混合A	金鹰多元策略混合C
本报告期期初基金份额总额	73,583,378.56	332,400.65
报告期期间基金总申购份额	1,774,025.81	22,330,305.56
减：报告期期间基金总赎回份额	3,311,447.90	11,895,800.63
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	72,045,956.47	10,766,905.58

§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 7 月 27 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 6 月 26 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》及后续更新的法律文件。

§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多元策略灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰多元策略灵活配置混合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