金鹰添盈纯债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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	金鹰添盈纯债债券
基金主代码	003384
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 11 日
报告期末基金份额总额	2,558,850,087.26 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，力争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。 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，属于较低预期收益、较低预期风险的证券投资基金品种，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	金鹰添盈纯债债券 A	金鹰添盈纯债债券 C	金鹰添盈纯债债券 D	金鹰添盈纯债债券 E
下属分级基金的交易代码	003384	012623	021954	021955
报告期末下属分级基金的份额总额	593,169,063.80 份	1,305,086,040.71 份	658,554,279.09 份	2,040,703.66 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)			
	金鹰添盈纯债债券 A	金鹰添盈纯债债券 C	金鹰添盈纯债债券 D	金鹰添盈纯债债券 E
1. 本期已实现	2,649,482.07	5,016,158.07	3,396,822.51	6,920.12

收益				
2.本期利润	3,891,208.07	7,756,676.15	5,064,550.61	9,009.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0099	0.0095	0.0076
4.期末基金资产净值	626,906,013.68	1,384,681,509.23	695,372,727.23	2,146,046.47
5.期末基金份额净值	1.0569	1.0610	1.0559	1.0516

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 2021 年 6 月 8 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2021 年 6 月 9 日；

5、本基金自 2024 年 8 月 1 日起增设 D、E 类基金份额，D、E 类基金份额首次确认日为 2024 年 8 月 2 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

金鹰添盈纯债债券 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	0.87%	0.02%	0.49%	0.02%	0.38%	0.00%
过去六个月	1.85%	0.02%	1.07%	0.03%	0.78%	-0.01%
过去一年	3.48%	0.03%	1.49%	0.03%	1.99%	0.00%
过去三年	7.43%	0.05%	5.46%	0.06%	1.97%	-0.01%
过去五年	142.56%	3.81%	8.11%	0.05%	134.45%	3.76%

过去七年	126.34%	3.23%	10.54%	0.05%	115.80%	3.18%
自基金合同生效起至今	161.37%	2.73%	13.22%	0.05%	148.15%	2.68%

金鹰添盈纯债债券 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	0.87%	0.02%	0.49%	0.02%	0.38%	0.00%
过去六个月	1.84%	0.02%	1.07%	0.03%	0.77%	-0.01%
过去一年	3.47%	0.03%	1.49%	0.03%	1.98%	0.00%
过去三年	7.39%	0.05%	5.46%	0.06%	1.93%	-0.01%
过去五年	135.16%	3.83%	8.11%	0.05%	127.05%	3.78%
自基金合同生效起至今	119.14%	3.71%	9.01%	0.05%	110.13%	3.66%

金鹰添盈纯债债券 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	0.86%	0.02%	0.49%	0.02%	0.37%	0.00%
过去六个月	1.85%	0.02%	1.07%	0.03%	0.78%	-0.01%
过去一年	3.46%	0.03%	1.49%	0.03%	1.97%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.62%	0.05%	2.07%	0.06%	1.55%	-0.01%

金鹰添盈纯债债券 E

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	0.74%	0.02%	0.49%	0.02%	0.25%	0.00%
过去六个	1.65%	0.02%	1.07%	0.03%	0.58%	-0.01%

月						
过去一年	3.14%	0.03%	1.49%	0.03%	1.65%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.21%	0.05%	2.07%	0.06%	0.14%	-0.01%

注：1、本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）*20%；

2、本基金自 2021 年 6 月 8 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2021 年 6 月 9 日；

3、本基金自 2024 年 8 月 1 日起增设 D、E 类基金份额，D、E 类基金份额首次确认日为 2024 年 8 月 2 日。

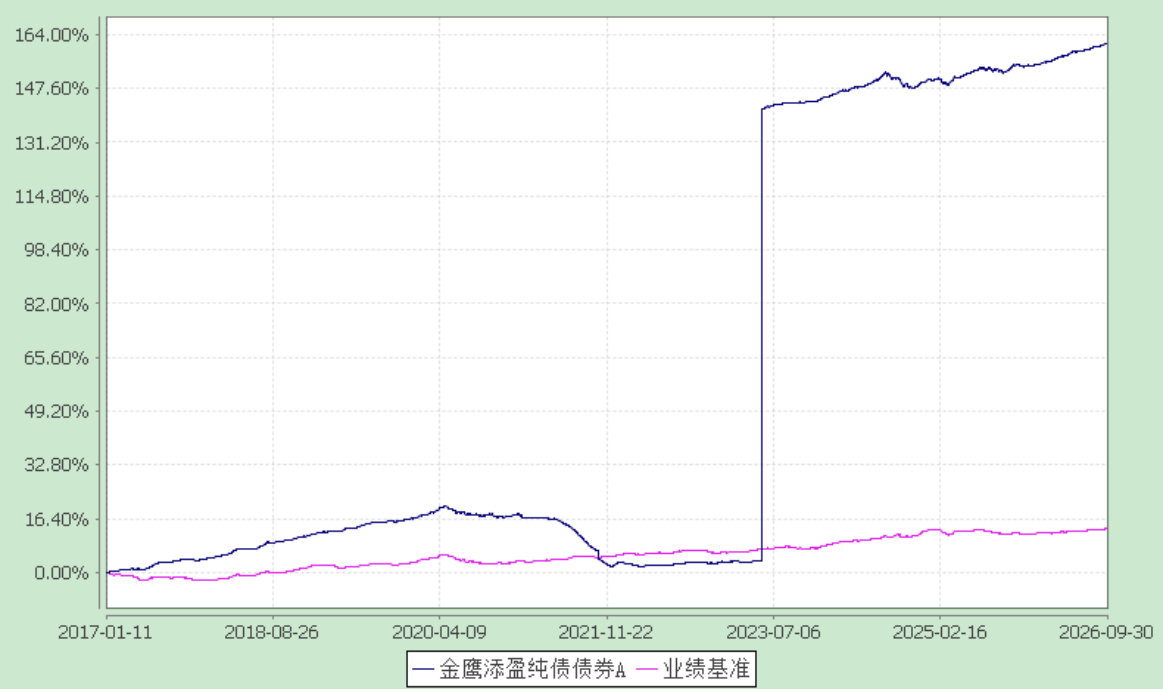
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰添盈纯债债券型证券投资基金

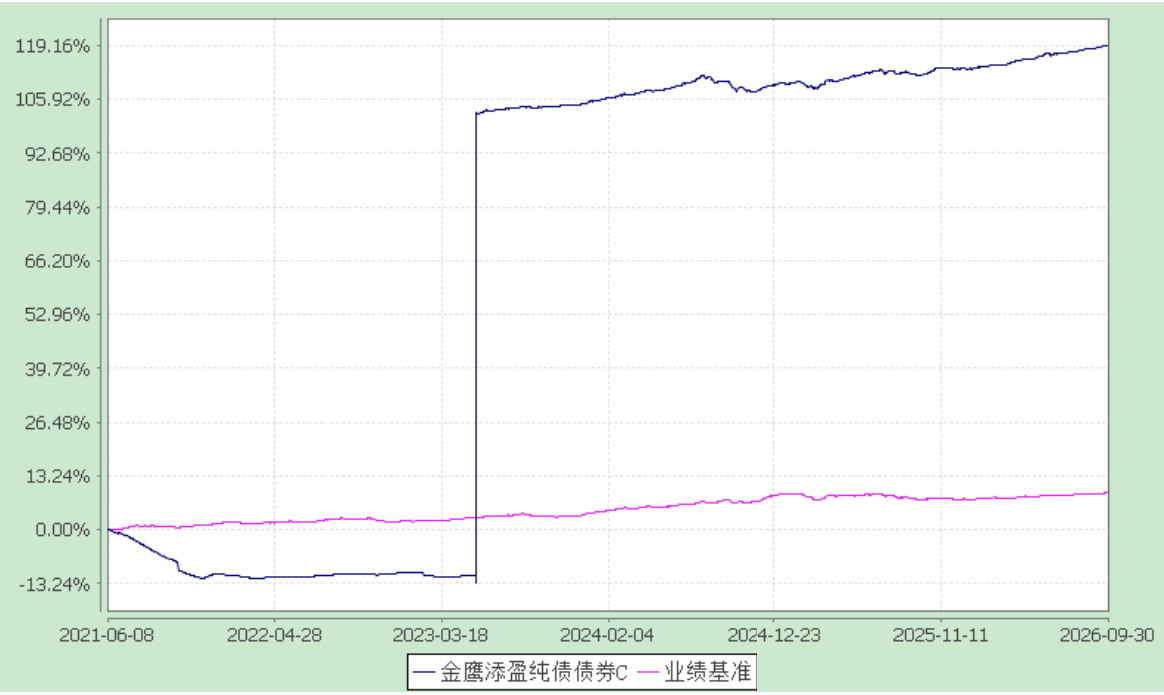
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2017 年 1 月 11 日至 2026 年 9 月 30 日）

金鹰添盈纯债债券 A



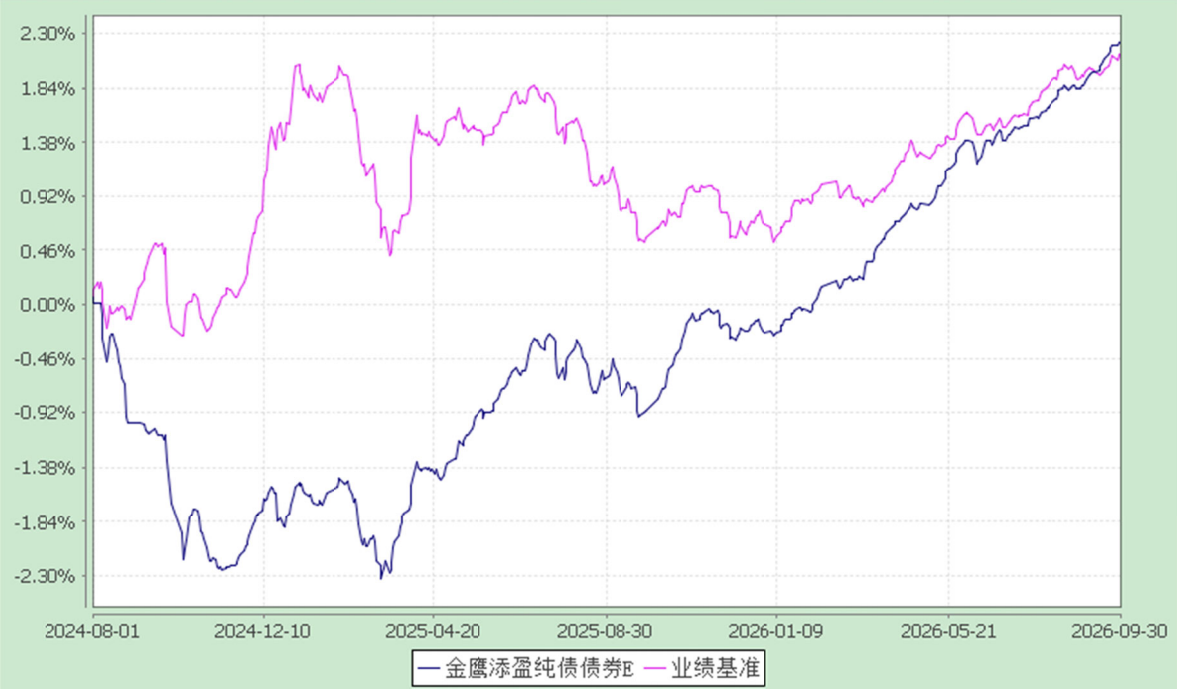
金鹰添盈纯债债券 C



金鹰添盈纯债债券 D



金鹰添盈纯债债券 E



注：1、本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）*20%；

2、本基金自 2021 年 6 月 8 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2021 年 6 月 9 日；

3、本基金自 2024 年 8 月 1 日起增设 D、E 类基金份额，D、E 类基金份额首次确认日为 2024 年 8 月 2 日。

§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		
陈双双	本基金的基金经理	2022-07-27	-	10	陈双双女士，中南财经政法大学经济学硕士。2016 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任交易员、基金经理助理，现任固定收益部基金经理。
邹卫	本基金的基金经理，公司固定收益研究部总经理	2024-06-15	-	15	邹卫先生，西南财经大学经济学硕士。历任中信证券华

					南股份有限公司研究员，广州广证恒生市场研究有限公司研究员，中信证券华南股份有限公司资产管理部投资经理，金鹰基金管理有限公司风险管理部副总监，广州金鹰资产管理有限公司总经理助理。2017 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司，历任固定收益研究部总经理、特定资产投资管理部总经理、投资经理，现任固定收益研究部总经理、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、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，债券市场呈现显著的“期限分化行情”。长端收益率在基本面偏弱与货币宽松预期驱动下震荡下行，创下年内新低；短端品种受资金面扰动与同业存单供给约束逆势走高，收益率曲线持续走向平坦化，产品收益主要来源于久期策略与曲线形态交易。

宏观方面，国内经济延续“外强内弱、K 型分化”格局。生产端呈现一定韧性，需求端持续走弱；社融增速边际放缓，资金活化程度偏低，存款定期化特征延续。物价层面，CPI 同比处于温和低位回升区间，PPI 同比虽持续上行，但主要是输入性因素扰动，向核心通胀传导有限。政策方面，三季度宽松货币政策方向明确，整体秉持“总量克制、结构精准”的调控思路。7 月政治局会议提出"加快财政支出和债券资金使用进度""综合运用并适时调整货币政策工具""及时谋划出台务实管用的增量政策"，为三季度债市偏强运行奠定了政策基调。9 月底一揽子工具落地，PSL 利率下调 25BP 至 1.5%，科创与技改再贷款增 2000 亿元、支农支小再贷款增 5000 亿元等。

市场方面，三季度资产荒格局延续，交易盘持续拉久期，大行对 10 年以上品种维持净卖出，全市场久期水平创下历史新高。7 月初资金面偏紧叠加政策观望情绪，10 年国债围绕 1.73-1.75% 窄幅波动；月末受政治局会议宽松信号推动，长端收益率快速下行。8 月中上旬在宽松资金面推动下，长债收益率进一步下行，止盈情绪升温，出现小幅回调；9 月上旬收益率维持低位拉锯，下旬跨季资金呵护叠加公积金降息预期升温，超长债率先突破下行，月末随着政策组合拳落地、PMI 重回扩张与节前止盈压力释放，10 年国债收益率小幅回调。信用端走势跟随利率债下行，整体信用利差压缩至历史低位，二永债比价关系持续修复，在低风险偏好下，机构资金继续向高等级与长久期品种集中。

资金面，三季度银行间市场流动性总量保持充裕，但受政府债券缴款、信贷投放

加快及季末时点等因素扰动，资金利率中枢较二季度小幅抬升，呈现"量松价稳、中枢小幅抬升"的特征。央行货币政策操作延续“总量克制、结构精准”基调，配合财政发行节奏灵活调节流动性。7 月先紧后松，8 月保持流动性充裕，9 月跨季期间通过买断式回购、隔夜逆回购等多种政策工具灵活对冲资金波动，全季对债市杠杆形成温和约束。

操作方面，本基金在报告期内根据对市场判断和负债端变化，合理安排组合久期和杠杆，积极寻找曲线凸点并增强资产配置的灵活性，严控防范信用尾部风险，在保持较好的流动性前提下，力争为持有人创造稳定的投资回报。

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 1.0569 元，本报告期份额净值增长率为 0.87%，同期业绩比较基准增长率为 0.49%；C 类基金份额净值为 1.0610 元，本报告期份额净值增长率为 0.87%，同期业绩比较基准增长率为 0.49%；D 类基金份额净值为 1.0559 元，本报告期份额净值增长率为 0.86%，同期业绩比较基准增长率为 0.49%；E 类基金份额净值为 1.0516 元，本报告期份额净值增长率为 0.74%，同期业绩比较基准增长率为 0.49%。

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	2,804,192,471.47	97.80
	其中：债券	2,804,192,471.47	97.80
	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	56,002,408.82	1.95
	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	2,655,587.55	0.09
7	其他资产	4,338,632.29	0.15
8	合计	2,867,189,100.13	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。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,516,432,099.80	55.98
	其中：政策性金融债	241,707,476.25	8.92
4	企业债券	184,704,033.97	6.82
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,051,186,963.85	38.80

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	51,869,373.85	1.91
10	合计	2,804,192,471.47	103.51

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	232580006	25 民生银行二级资本债 01	900,000.00	92,924,063.01	3.43
2	232480003	24 恒丰银行二级资本债 01	600,000.00	63,026,958.90	2.33
3	200220	20 国开 20	500,000.00	62,555,205.48	2.31
4	232580002	25 建行二级资本债 01BC	600,000.00	61,477,772.05	2.27
5	220402	22 农发 02	600,000.00	61,338,904.11	2.26

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中国民生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宁波监管局、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外汇管理局北京市分局、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农业发展银行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宁波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宁波市分行的处罚。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四川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四川省分行的处罚。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中国工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、中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。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成都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四川省分行、国家外汇管理局四川省分局的处罚。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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,260.40
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,331,371.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,338,632.29

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	金鹰添盈纯债债券A	金鹰添盈纯债债券C	金鹰添盈纯债债券D	金鹰添盈纯债债券E
本报告期期初基金份额总额	356,230,576.19	553,147,974.52	366,645,030.05	1,935,359.55
报告期期间基金总申购份额	256,242,759.79	962,003,158.04	302,471,311.94	4,824,659.10
减：报告期期间基金总赎回份额	19,304,272.18	210,065,091.85	10,562,062.90	4,719,314.99
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	593,169,063.80	1,305,086,040.71	658,554,279.09	2,040,703.66

§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、中国证监会注册的金鹰添盈纯债债券型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰添盈纯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

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