东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:东财基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27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。

基金托管人招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07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东财鑫享30天滚动持有中短债
基金主代码	026008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年12月08日
报告期末基金份额总额	2,633,328,671.44份
投资目标	本基金在严格管理风险的前提下，主要投资中短期债券，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略 采用专业的投资理念和分析方法，以系统化的研究为基础，通过对各类固定收益类资产的合理配置争取获取稳定收益。 2、债券投资策略 在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。 3、资产支持证券投资策略 4、国债期货交易策略
业绩比较基准	中债综合财富（1-3年）指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益高于

	货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。	
基金管理人	东财基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东财鑫享30天滚动持有中短债A	东财鑫享30天滚动持有中短债C
下属分级基金的交易代码	026008	026009
报告期末下属分级基金的份额总额	1,435,110,845.59份	1,198,217,825.85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07月01日 - 2026年09月30日)	
	东财鑫享30天滚动持有中短债A	东财鑫享30天滚动持有中短债C
1.本期已实现收益	2,910,007.78	5,395,557.03
2.本期利润	2,282,404.17	4,420,104.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.0036	0.0036
4.期末基金资产净值	1,655,142,999.96	1,363,286,869.22
5.期末基金份额净值	1.1533	1.1378

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所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 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

东财鑫享30天滚动持有中短债A净值表现

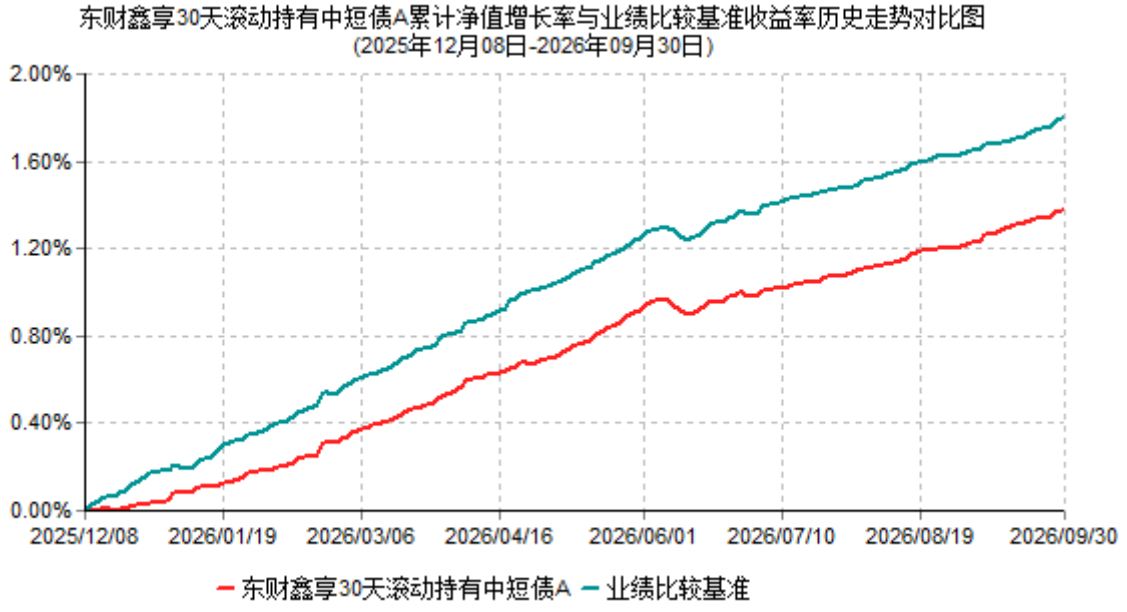
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.37%	0.01%	0.41%	0.01%	-0.04%	0.00%

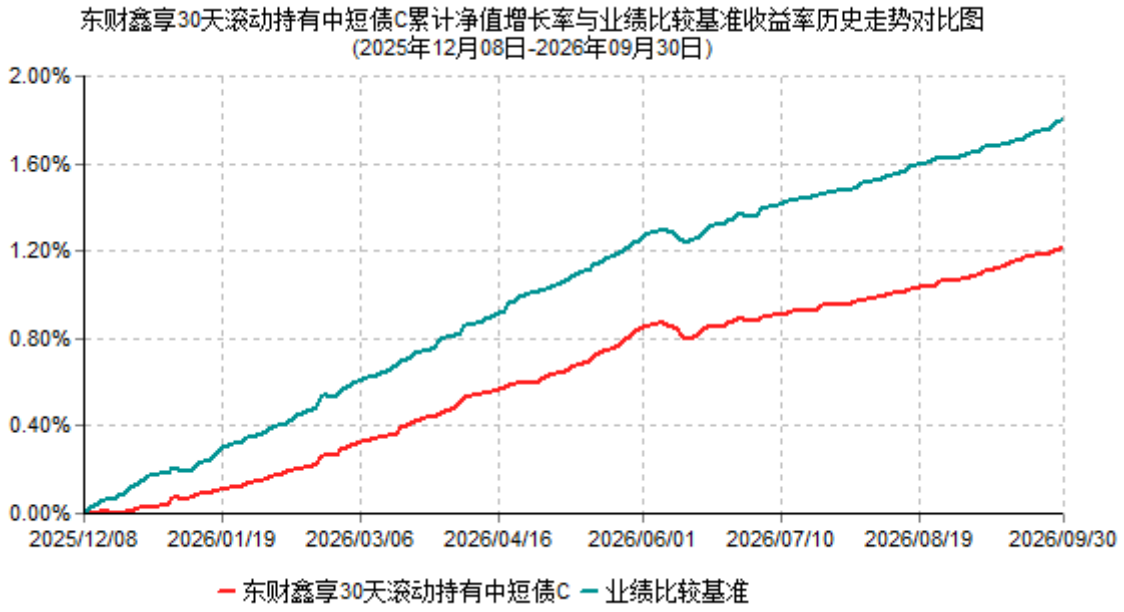
过去六个月	0.85%	0.01%	0.98%	0.01%	-0.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.38%	0.01%	1.80%	0.01%	-0.42%	0.00%

东财鑫享30天滚动持有中短债C净值表现

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	0.32%	0.01%	0.41%	0.01%	-0.09%	0.00%
过去六个月	0.74%	0.01%	0.98%	0.01%	-0.24%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.22%	0.01%	1.80%	0.01%	-0.58%	0.00%

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





注：1、本基金基金合同于2025年12月8日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、按本基金基金合同约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§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		
宝音	本基金基金经理	2025-12-08	-	13年	美国哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中国金融期货交易所助理经理、江苏昆山农村商业银行股份有限公司投资经理、华福证券有限责任公司高级投资经理、东方财富证券股份有限公司利率交易部负责人，现任东财基金管理有限公司总经理助理、固收投资部总监、基金经理。
楚芸	本基金基金经理	2025-	-	7年	香港中文大学理学硕士。曾

		12-18			任平安科技（深圳）有限公司数据分析师、东方金诚国际信用评估有限公司信评分析师，现任东财基金管理有限公司基金经理。
应洁茜	本基金基金经理	2026-02-06	-	13年	美国北卡罗来纳州立大学会计管理学硕士，浙江大学财务管理学士。曾任浙江浙商证券资产管理有限公司基金经理，东证融汇证券资产管理有限公司公募投资管理部负责人兼投资经理，现任东财基金管理有限公司基金经理。
郑铮	本基金基金经理	2026-02-06	-	10年	管理学学士。曾任金元顺安基金债券交易员、光大保德信基金债券交易员、东证融汇证券资产管理有限公司公募投资经理，现任东财基金管理有限公司基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“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。

3、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》等相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在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，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，基金管理人公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易管理要求的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易行为进行监督检查，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年三季度，国内债券收益率在内需走弱、输入性通胀扰动与政府债供给节奏的多重博弈中震荡下行，曲线呈现牛平形态。7月，市场在增量政策预期与流动性预期之间反复博弈，10年期国债活跃券收益率在1.70%-1.75%区间震荡；进入8月，信贷、消费及投资数据持续偏弱，基本面定价逻辑占主导，10年期国债活跃券下行突破1.70%关口；9月在政府债券供给高峰与跨季资金扰动下央行加大呵护，收益率在1.67%-1.69%区间窄幅波动，季末受稳增长政策组合落地及PMI重返扩张区间影响，收益率小幅回调收于1.68%，较上季度末下行约5BP。超长端表现更强，30年国债收益率由二季度末2.25%下行至2.10%附近。

货币政策方面，央行延续适度宽松基调，7天期逆回购操作利率维持1.40%不变，更多依靠数量型工具精细调节：三季度通过买断式逆回购和MLF合计净投放中长期资金约1.1万亿元，并逐步增加隔夜逆回购操作频率，DR007整体围绕政策利率窄幅波动。三季度货币政策委员会例会提出：“综合运用并适时调整货币政策工具”，9月29日央行下调抵押补充贷款（PSL）利率25BP至1.50%，以结构性工具精准支持扩大有效投资。宏观政策方面，7月中央政治局会议强调“宏观政策要发力提效”，要求及时谋划出台增量政策、加大逆周期调节力度；9月29日，多部门联合出台居民购房贷款贴息政策，进一步托底刚需购房。

宏观读数方面，三季度“外需强、内需弱”的分化格局进一步加剧。规模以上工业增加值同比由7月的4.5%回升至8月的5.2%，9月制造业PMI升至50.1%，重返扩张区间，从分项看主要由生产端拉动。社会消费品零售总额同比由6月的1.0%逐月回落至8月的0.4%；1-8月固定资产投资累计同比降幅扩大至7.2%，房地产开发投资降幅扩大至19.9%；7月新增人民币贷款为-3400亿元，实体融资需求偏弱。物价方面，7月、8月CPI同比分别上涨0.5%、0.8%，核心CPI同比稳定在1.0%左右；受油价上行带动，PPI同比维持在

3.5%-3.8%的较高水平。外需保持强劲，以美元计出口同比增速8月升至25.0%。整体来看，生产与出口韧性较强，消费、投资和信贷走弱，基本面供强需弱特征明显。

海外方面，美联储主席沃什表态将控制通胀置于首位，并呈现递进式偏鹰，9月议息会议加息25BP至3.75%-4.00%。地缘方面，美伊局势在二季度末短暂缓和后再度反复，布伦特原油价格由6月末的73美元/桶大幅上行至9月末的98美元/桶，全球输入性通胀压力重新抬头。美元指数震荡上涨至101.5附近，离岸人民币汇率保持基本稳定，季末美元兑人民币收于6.70附近。

本报告期内，本基金秉持既定的投资思路，在保持中短久期策略的基础上，密切跟踪资金面、宏观运行情况和机构行为变化，将防范信用和流动性风险放在产品运作的首位，并灵活把握杠杆套息、曲线骑乘策略等确定性较高的投资机会。力争在保证安全性和流动性的前提下增厚整体收益，报告期内本投资组合策略运行良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2026年09月30日，东财鑫享30天滚动持有中短债A份额净值为1.1533元，报告期内基金份额净值增长率为0.37%，同期业绩比较基准收益率为0.41%；东财鑫享30天滚动持有中短债C份额净值为1.1378元，报告期内基金份额净值增长率为0.32%，同期业绩比较基准收益率为0.41%。

4.6 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，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,091,562,547.73	99.37
	其中：债券	3,091,562,547.73	99.37
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,871,658.73	0.61
8	其他资产	846,508.99	0.03
9	合计	3,111,280,715.45	100.00

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境内股票。

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港股通投资股票。

5.3 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	1,246,242,517.26	41.29
	其中：政策性金融债	475,158,424.12	15.74
4	企业债券	454,267,466.32	15.05
5	企业短期融资券	241,839,428.50	8.01
6	中期票据	850,299,315.88	28.17
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	298,913,819.77	9.90
9	其他	-	-
10	合计	3,091,562,547.73	102.42

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	09260402	26农发清发02	1,000,000	100,310,547.95	3.32

2	222680028	26华夏银行绿债01	1,000,000	100,057,353.42	3.31
3	09260301	26进出清发01	1,000,000	99,980,630.14	3.31
4	112603128	26农业银行CD128	1,000,000	99,780,537.50	3.31
5	112605078	26建设银行CD078	1,000,000	99,573,256.73	3.30

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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金依据基金合同和风险控制原则，以套期保值为目的参与国债期货交易。对期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行密切跟踪，确保国债期货投资对基金总体风险可控。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-41,923.24
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

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本期是否出现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

2026年7月21日，国家外汇管理局北京市分局对中国农业发展银行处以行政处罚。

2025年11月26日，中国人民银行对华夏银行股份有限公司处以行政处罚。

2026年3月5日，国家外汇管理局北京市分局对中国进出口银行处以行政处罚。

2025年10月31日，国家金融监督管理总局对中国农业银行股份有限公司处以行政处罚。

2026年9月23日，国家外汇管理局北京市分局对中国建设银行股份有限公司处以行政处罚。2026年6月5日，国家金融监督管理总局对中国建设银行股份有限公司处以行政处罚。2026年2月12日，中国人民银行对中国建设银行股份有限公司处以行政处罚。

2026年9月8日，中国人民银行对中国邮政储蓄银行股份有限公司处以行政处罚。2025年9月30日，国家金融监督管理总局对中国邮政储蓄银行股份有限公司处以行政处罚。

基金管理人对上述主体发行的相关证券进行了深入了解和分析，执行了内部严格的投资决策流程，符合相关法律法规及基金合同的要求。除此以外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资范围不包括股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	846,508.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	846,508.99

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

	东财鑫享30天滚动持有中短债A	东财鑫享30天滚动持有中短债C
报告期期初基金份额总额	1,360,747,158.13	1,296,912,741.99
报告期期间基金总申购份额	1,178,330,263.70	69,903,357.41
减：报告期期间基金总赎回份额	1,103,966,576.24	168,598,273.55
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	1,435,110,845.59	1,198,217,825.85

§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

本报告期内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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

一、中国证监会准予东证融汇鑫享30天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更注册的文件

二、《东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》

三、《东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金托管协议》

四、法律意见书

五、基金管理人业务资格批件、营业执照

六、基金托管人业务资格批件、营业执照

七、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

东财基金管理有限公司

2026年10月27日