

重要提示

基金管理人承诺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规定，于2019年4月19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。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金简称 (金鹰添盈纯债债券), 场内简称, 基金代码 (002384), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2017-01-11), 报告期末基金资产总额 (1,008,928,193.57), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 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).

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期 (2019-01-01至2019-03-31). Includes 本期已实现收益 (8,762,006.22), 本期利润 (13,062,617.33), 加权平均基金份额本期利润 (0.0120), 期末基金资产净值 (1,021,968,876.28), 期末基金份额净值 (1.0129).

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、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；
4、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。

基金净值表现

Table with 5 columns: 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. Includes data for 过去三个月 (1.28%, 0.03%, 0.45%, 0.04%, 0.83%, -0.01%).



注：（1）截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定；
（2）本基金的投资业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率+80%一年定期存款利率（税后）*20%。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 and 报告期 (2019-01-01至2019-03-31). Includes 基金管理人 (金鹰基金管理有限公司) and 基金托管人 (交通银行股份有限公司).

基金管理人（或基金经理）简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes 黄倩倩 (基金经理) with 2018-07-07 start date and 7 years experience.

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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，未发现基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明

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。公司通过严格的投资交易流程、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，不断强化事中监控分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期，公司对连续四个季度内、不同时间留下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合间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。

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，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过当日成交量的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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度以来，经济基本面短期有所企稳，总体地产投资不强，叠加基建发力，企业有被动去库存进入主动补库存阶段，经济下行压力有所缓和。3月，官方制造业PMI大幅回升1.3个百分点至50.5%，在连续三个月低于临界点之后重返扩张区间。受益于去年年中宽松的货币政策，效果逐渐显现，年初以来社融信贷表现超预期，市场对于社融增速逐步企稳形成共识。通胀方面，受春节因素影响，CPI二月份有所回升，但三月份通胀和物价的持续上涨打乱了CPI季节性回落的规律；PPI受油价持续上涨影响，环比有所修复，通胀有所上行。
货币政策方面，央行继续维持中性宽松的货币政策，资金面保持合理充裕，幅度适中。债券市场方面，整体收益率呈现震荡上行态势，十年国债回到300左右，一月短债利率大幅超预期，市场走强，债市开始回调模式。债市大幅波动，3月，官方制造业PMI大幅回升，重返扩张区间，引起债市剧烈反应；叠加降准预期流动，国债期货大跌，十年国债大幅上行，调整约150个左右。
一季度我们维持之前的配置，获得稳定的票息收入，在保证流动性安全的基础上，尽量把握确定性机会，兼顾交易机会带来的超额收益。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，基金份额净值1.0129元，本报告期份额净值增长1.28%，同期业绩比较基准增长率为0.45%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年二季度，投资反弹基础尚不牢固，仍处在震荡筑底，一是终端需求依然分化，地产一二线城市回暖但三四线城市，商用车批发企稳但零售仍回落；二是社融企稳态势初现，从融资到实体的改善仍有待时；三是去年春节开工晚、环保约束趋紧，令生产集中释放，意味着今年4、5月生产面临高基数。随着一系列的减税等积极财政政策的实施，发力效果将在一段时间后有所显现，消费将对经济构成一定支撑，综合来看，整体经济基本面短期有所企稳，但持续性仍有待进一步观察。
资金面方面，预计二季度资金面水平仍将维持中性宽松的格局，美联储3月议息会议决定加息，央行的货币操作有了更多的空间，但政府工作报告提出避免大水漫灌，资金利率水平进一步下行的空间也有所限，预计资金利率水平仍会在目前的区间内震荡，同时国际上有所收紧，年初以来权益市场的大幅上涨带动整体市场风险偏好的上升，对债券市场构成一定负面影响，预计债市在二季度延续震荡态势，经济数据和通胀数据进一步支持。此外，若信用违约事件继续发酵，资质较差的国企和民企融资困难局面恐将再次恶化，信用利差或将进一步走阔。
投资方面，我们将密切关注事件冲击带来的交易性和配置性机会，在确保组合良好流动性和安全性的前提下，力争有效控制并防范风险，努力为持有人带来更大的回报。

报告期内基金持有人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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Includes 权益类投资 (0.00%), 固定收益投资 (997,138,200.00), 贵金属投资 (0.00%), 金融衍生品投资 (0.00%), 买入返售金融资产 (0.00%), 银行存款和结算备付金合计 (1,166,849.38), 其他资产 (26,599,969.61), 合计 (1,021,968,876.28).

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、应收中购款。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 农、林、牧、渔业, 采矿业, 制造业, 电力、热力、燃气及水生产和供应业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输、仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息传输、软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利、环境和公共设施管理业, 居民服务、修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作, 文化、体育和娱乐业, 综合, 合计.

注：本基金本报告期内未投资股票。

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

Table with 5 columns: 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 (%). Includes 0 rows as no stocks were held.

注：本基金本报告期内未投资股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 国家债券, 央行票据, 金融债券 (60,102,000.00), 企业债券 (280,791,000.00), 企业短期融资券 (382,531,200.00), 中期票据 (273,734,000.00), 可转债 (可交换债), 同业存单, 其他, 合计 (997,138,200.00).

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

Table with 5 columns: 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 (%). Includes 143025, 19国债01, 19南京高科CP001, 19CJ307, 19鹏普气CP003, 16晋能02.

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

注：本基金本报告期内未持有资产支持证券。

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量 (份), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 0 rows as no precious metals were held.

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

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

注：本基金本报告期内未投资权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险说明. Includes 0 rows as no derivatives were held.

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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

注：本基金本报告期内未投资权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期内未进行股指期货交易。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险说明. Includes 0 rows as no derivatives were held.

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

本期国债期货投资评价

无。

投资报告附注

受到调查及处罚情况
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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
本基金报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额 (元). Includes 存出保证金 (2,041.76), 应收证券清算款, 应收股利, 应收利息 (26,593,745.16), 应收中购款 (4,122.69), 其他应收款, 待摊费用, 其他, 合计 (26,599,969.61).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期内未投资股票。

投资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。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 数值. Includes 报告期初基金份额总额 (1,008,951,566.32), 报告期间基金份额净申购 (1,710,859.48), 减：报告期间基金份额净赎回 (1,737,232.23), 报告期间基金份额净变动 (份额减少以“-”填列), 报告期末基金份额总额 (1,008,928,193.57).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况
单位：份

Table with 2 columns: 项目, 基金份额. Includes 报告期初管理人持有的基金份额, 报告期间买入/申购总份额, 报告期间卖出/赎回总份额, 报告期末管理人持有的基金份额, 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%) (0.00%).

注：无。

Table with 5 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Includes 0 rows as no transactions were made.

注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 5 columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限. Includes 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人高级管理人员, 其他, 合计.

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

Table with 3 columns: 投资者类别, 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间, 期初份额, 中购份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比. Includes 机构 (2019年1月1日至2019年3月31日) with 984,719,518.91 shares.

本基金报告期内，存在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，可能会存在以下风险：
1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的投资水平发生波动。同时，因巨额赎回，份额净值小数点后位数及方式、管理费及托管费等费用计提等问题，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；
2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将无法及时赎回其持有的全部基金份额；
3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金的流动性风险；
4) 基金提前终止、转型或其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
5) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小，基金可能面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形；
6) 份额占比较高的投资者中期中请赎回的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额赎回的申请及赎回款项的支付。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及赎回申请被赎回的风险。如果投资者某笔申购或赎回申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或赎回申请中赎回部分可能被确认失败。

影响投资者决策的其他重要信息

经广东省工商行政管理局核准，本基金管理人法定代表人已于2019年3月27日变更为刘志刚先生。

备查文件目录

- 1. 中国证监会核准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或成立批件、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。

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

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：4006-135-8888或020-83961880。