金鹰添益纯债债券型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

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：2019-04-18

一、重要提示

基金管理人的董事会及董事会成员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法律责任。

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03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，但不能保证一定盈利。

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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期2019年01月01日至03月31日止。

二、基金产品概况

基金基本情况

项目	内容
基金简称	金鹰添益纯债债券
场内简称	-
基金主代码	003594
交易代码	003594
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017-01-11
报告期末基金份额总额	1,608,958,181.22
投资目标	在严格控制风险的前提下，为参与机构投资者提供收益稳定的投资品种。
投资策略	本基金在分析宏观经济形势、货币政策、财政政策、产业政策、证券市场资金供求状况等基础上，对各类资产的收益率、风险状况进行预期，并结合产品定位、投资期限、流动性要求等因素，对资产配置比例、久期、信用等风险因素进行管理，在控制风险的前提下，为参与机构投资者提供收益稳定的投资品种。
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，属于较低预期风险的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金、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

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-01-01 至 2019-03-31）
本期已实现利益	8,392,986.20
期末可供出售金融资产变动额	12,882,417.32
期末持有的基金份额风险收益	0.00
期末基金资产净值	1,621,308,874.28
期末基金份额净值	1.0078

注：1、本期已实现风险收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不包括公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额。

2、本期末风险收益=期末已实现风险收益/期末基金份额变动的比例。

3、期末可供出售金融资产变动额、期末期末可供出售证券未实现利润与未实现利润在已实现部分的调整数（当期未实现、不是当期发生数）。

4、上述期末基金份额变动的比例为扣除当期申购、赎回份额后的份额变动比例。

5、期末可供出售金融资产变动额、期末风险收益为负数，以“-”号填列。

三、基金管理人管理报告

基金投资策略

本报告期基金投资策略没有发生变化。

业绩表现

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

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	1.29 %	0.04 %	0.46 %	0.06 %	0.83 %	-0.02 %

自基金合同生效日起至基金份额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）根据本基金合同，本基金建仓期为6个月。

2）本基金的投资组合比例为：债券类资产投资比例为80%—95（不含）%，现金类资产投资比例为5%—20%。

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-01-01至2019-03-31）
其他指标	报告期（2019-01-31）

四、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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号—定期报告》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第1号—定期报告》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第2号—招募说明书（正文）》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第3号—基金合同》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第4号—托管协议》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第5号—基金份额发售公告》等有关法律法规及中国证监会、交易所、登记机构、基金业协会等监管机构的有关规定，本报告期内，本基金管理人在法律法规允许的范围内，为了保护基金份额持有人的利益，在不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金管理人对本报告期内基金的投资运作进行了监督和检查，本报告期内，本基金管理人在投资运作方面基本遵守了有关法律法规的规定。

五、投资组合报告

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	985,153,208.00	61.28
	其中：债券	985,153,208.00	61.28
	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	1,108,849.38	0.31
7	其他资产	28,398,909.81	1.80
8	合计	1,014,660,967.19	100.00

注：1）报告期末本基金没有通过沪港通投资。

2）报告期末本基金没有参与转融通证券出借业务。

报告期末按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金没有投资股票。

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资产类别投资明细

序号	资产类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	固定收益类证券	985,153,208.00	61.28
2	权证投资	-	-
3	股票投资	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,108,849.38	0.31
8	其他资产	28,398,909.81	1.80
9	合计	1,014,660,967.19	100.00

注：其他资产为应收、交易保证金、应收利息、应收股息、其他应收款、应收申购款。

报告期末按照行业分类的投资组合情况

报告期末按照行业分类的投资组合情况

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

注：本基金本报告期末未投资股票。

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

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（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未投资股票。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

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

序号	权证代码	权证名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未投资权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资股指期货的交易情况说明

序号	投资品种	交易方式（买）	交易方式（卖）	市场风险认定方式
1	股指期货	多头	-	市场风险
2	股指期货	空头	-	市场风险
3	股指期货	-	空头	市场风险
4	股指期货	-	多头	市场风险
5	股指期货	多头	空头	市场风险
6	股指期货	空头	多头	市场风险
7	股指期货	多头	多头	市场风险
8	股指期货	空头	空头	市场风险
9	股指期货	-	-	市场风险
10	股指期货	-	-	市场风险
11	股指期货	-	-	市场风险