

金鹰添荣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：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2019-04-20

重要提示

基金管理人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。
基金管理人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，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。

基金基本情况
项目 数值
基金简称 金鹰添荣纯债债券
基金代码 004033

主要财务指标

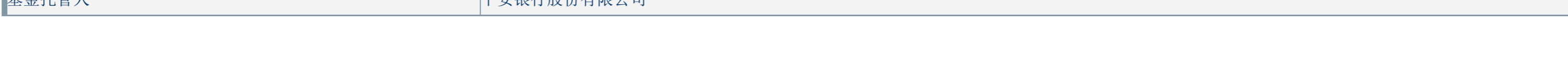
主要财务指标
项目 报告期(2019-01-01至2019-03-31) 单位：人民币元
本期已实现收益 1,994,055.51
本期利润 2,235,854.09

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;

基金净值表现

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 业绩比较基准收益标准差④
过去三个月 1.05% 0.04% 0.45% 0.04%



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)本基金的业绩比较基准为：中债综合(全价)指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%。

其他指标

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

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
任职日期 离任日期 证券从业年限 说明
刘丽娟 本基金的基金经理，公司固定收益部总监 2017-03-07 - 12 刘丽娟女士，中南财经政法大学工商管理学士，历任华泰证券股份有限公司交易员、投资经理，广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监。2014年12月加入金鹰基金管理有限公司，任固定收益部总监。现任固定收益部基金经理。

管理人对报告期内本基金的运作遵规守信情况的说明

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以及各项基金合同的规定，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。报告期内，基金运作合规，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。

公平交易专项说明

报告期内，公司严格执行《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，各投资组合按照投资管理流程和制度决策，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。

异常交易行为的专项说明

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。
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

回顾2019年一季度债券市场环境，市场收益率整体下行。在市场流动性较为宽松的背景下，短端收益率下行至低位，而长端收益率在信用债扩容+社融企稳，地方债提前发行、估值修复、中美贸易摩擦等多重因素驱动下步入震荡行情。整个一季度十年国开收益率小幅下行2bp，一年期国债收益率下行10bp，收益率曲线陡峭化。在信用违约常态化背景下，一季度信用利差在流动性收紧和信用政策的呵护下小幅下行。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，基金份额净值1.0571元，本报告期份额净值增长1.05%，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，从基本面来看，经济下行压力加大，出口在外围经济放缓以及贸易战的长期影响下预计将继续回落;消费在个税减免及消费刺激政策下，预计维持平稳;基建在产地产地政策及PPP新项目和财政收支平衡压力下托底力度有限;房地产行业在政策高压和销售放缓背景下回调压力较大，企业盈利持续回落以及对经济前景的悲观预期下制造业投资预计回落。关注社融增速企稳回升、基期上行带来的通胀隐忧、风险偏好回升、经济悲观预期有所修复等因素。

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

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益类投资 - -
2 固定收益投资 198,911,700.00 93.77

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 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 - -

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 178210 17国开10 400,000.00 40,460,000.00 19.12

报告期末按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 - -

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 178210 17国开10 400,000.00 40,460,000.00 19.12

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

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(%)

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：本基金本报告期末无权证投资。

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的股指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) 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货投资政策

无。

报告期末本基金的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元) -
股指期货投资本期收益(元) -
国债期货投资本期公允价值变动(元) -

报告期末本基金的国债期货投资政策

无。

报告期末本基金的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元) -
国债期货投资本期收益(元) -
股指期货投资本期公允价值变动(元) -

报告期末本基金的国债期货投资政策

无。

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 -

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末无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：本基金本报告期末无受限投资。

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。

开放式基金份额变动

项目 数值
报告期初基金份额总额 203,188,178.67
报告期间基金申购份额 1,298,239.72

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目 基金份额
报告期末管理人持有的基金份额 -
报告期间买入/申购基金份额 -

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号 交易方式 交易日期 交易份额(份) 交易金额(元) 适用费率

报告期末发起式基金发起持有份额情况

项目 持有份额总数 持有份额占基金份额总额 发起份额总数 发起份额占基金份额总额 发起份额承诺持有期限

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

投资者类别 序号 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 期末基金份额 申购份额 赎回份额 持有份额 持有份额占基金份额总额 99.91%

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、中国证监会注册的金鹰添荣纯债债券型证券投资基金发行及募集的文件;
2、《金鹰添荣纯债债券型证券投资基金基金合同》;
3、《金鹰添荣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授权、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询，本基金管理人网址：http://www.gefund.com.cn。