

目录-全部展开 目录-全部收缩
重要提示
基金产品概况
基金基本情况
主要财务指标和基金净值表现
基金净值表现
基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
其他指标
管理人报告
投资组合报告
投资业绩评价

重要提示
基金管理人承诺基金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。
基金托管人平安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
项目 数值
基金简称 金鹰添荣纯债债券
场内简称 添荣纯债
基金代码 400033
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2017-03-07
报告期末基金份额总额 200,188,178.67
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 本基金主要投资于固定收益类金融工具，在充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性及严格控制风险的前提下，通过分析宏观经济变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖掘价值被低估的券种，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
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、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 平安银行股份有限公司

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)
本期已实现收益 1,984,055.51
本期利润 2,235,854.51
加权平均基金份额本期利润 0.0110
期末基金资产净值 211,621,168.21
期末基金份额净值 1.0571

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与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
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 ①-③ ②-④
过去三个月 1.05% 0.04% 0.45% 0.04% 0.60% 0.00%



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
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(2019-03-31)

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 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硕士，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。

注：1、任职日期和离任日期为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基金合同的约定，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。

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，各投资组合按照投资管理流程和流程独立决策，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。
公司通过规范的投交流程、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。
报告期内，公司对连续四个季度期间内、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间同日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。

报告期内基金的投资策略和运作分析
回顾2019年一季度债券市场行情，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利率中进中退，地方债提前发行、债市估值修复、中美贸易摩擦等多重因素驱动下步入震荡行情，整个一季度十年国债收益率小幅下行2bp，一年国债收益率下行10bp，收益率曲线陡峭化。在信用债收益率整体下行、一季度信用利差在流动性变化和信用政策的呵护下小幅下行。流动性层面，央行1月再次降准1个百分点，加上MLF和普惠金融定向降准动态考核所释放的资金，对冲了1月缴税和春节前现金需求对资金面带来的冲击，市场流动性整体较宽松，货币市场利率维持在相对低位，DR007较长期国债处于市场低位，回购利率在2.5%以下。受国际宏观因素影响，季末银行减少非银机构的融资，DR007和DR007利率拉大，流动性分层显现，但回购利率整体仍维持在低位。一季度操作方面，我们仍然保持谨慎配置，获得较高的票息收入，把握流动性宽松利率的下行机会。

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；基建在产地产地政府稳增长和财政收支平衡压力下托底力度有限；房地产投资在政策高压和销售放缓背景下回落压力较大，企业盈利增速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。
流动性层面，二季度末到期量高达11855亿元，4月3日是缴税大月，流动性缺口较大，在经济下行压力加大、信用债利率在推进中的背景下，预计央行将继续呵护市场资金面，保持流动性合理充裕但波动可能加大，降准仍可期。美联储3月议息会议表态年内可能暂持加息和通胀，国内货币政策面临的外部约束有所弱化。
基于以上判断，我们认为在经济下行压力仍大及扰动因素下，二季度长端利率或将维持震荡态势，短端利率在合理充裕的流动性环境及公开市场逆回购利率约束下，维持平稳。我们将继续保持债券部分的长期利率资产配置，力争有效控制并防范风险，竭力为持有人服务。

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 - -
其中：股票 - -
2 固定收益投资 198,911,700.00 93.77
其中：债券 198,911,700.00 93.77
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 7,216,541.11 3.40
7 其他资产 5,998,554.09 2.83
8 合计 212,126,795.20 100.00

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。

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 - -
C 制造业 - -
D 电力、热力、燃气及生产和供应业 - -
E 建筑业 - -
F 批发和零售业 - -
G 交通运输、仓储和邮政业 - -
H 住宿和餐饮业 - -
I 信息技术、软件和信息技术服务业 - -
J 金融业 - -
K 房地产业 - -
L 租赁和商务服务业 - -
M 科学研究和技术服务业 - -
N 水利、环境和公共设施管理业 - -
O 居民服务、修理和其他服务业 - -
P 教育 - -
Q 卫生和社会工作 - -
R 文化、体育和娱乐业 - -
S 综合 - -
合计 - -

注：本基金本报告期末无股票投资。

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：本基金本报告期末无股票投资。

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 140,615,900.00 66.45
其中：政策性金融债 60,474,000.00 28.58
4 企业债券 - -
5 企业短期融资券 - -
6 中期票据 58,296,800.00 27.55
7 可转债(可交换债) - -
8 同业存单 - -
9 其他 - -
10 合计 198,911,700.00 93.99

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 170210 17国债10 400,000.00 40,460,000.00 19.12
2 172001 17南京银行绿色金融01 200,000.00 20,136,000.00 9.69
3 172010 17南京银行二债 200,000.00 20,288,000.00 9.59
4 152102 15南海农商二债 200,000.00 20,216,000.00 9.57
5 130209 13国债09 200,000.00 20,014,000.00 9.46

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：本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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(%)
注：本基金本报告期末无贵金属投资。

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
公允价值变动总额合计(元) - -
股指期货投资本期收益(元) - -
股指期货投资本期公允价值变动(元) - -
注：本基金本报告期末无股指期货投资。

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
本期国债期货投资政策
无。

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) - -
国债期货投资本期公允价值变动(元) - -
注：本基金本报告期末无国债期货投资。

本期国债期货投资评价

投资报告附注
受到调查以及处罚情况
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有受到监管部门立案调查，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。

其他资产构成
单位：人民币元
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 -
6 其他应收款 5,998,554.09
7 其他 -
8 其他 -
9 合计 5,998,554.09

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
单位：份
项目 数值
报告期期初基金份额总额 203,895,536.56
报告期期末基金份额总额 200,188,178.67
减少：报告期期间基金赎回份额 1,296,239.72
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) 5,005,597.55
报告期期末基金份额总额 200,188,178.67

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
项目 基金份额
报告期初管理人持有的本基金份额 -
报告期期间买入/申购总份额 -
报告期期间卖出/赎回总份额 -
报告期期末管理人持有的本基金份额 -
报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例(%) -
注：无。

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
合计

注：无。

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
基金管理人自有资金 -% -% -% -% -
基金管理人高级管理人员 -% -% -% -% -
基金管理人其他人员 -% -% -% -% -
基金管理人股东 -% -% -% -% -
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
投资者类别 报告期内持有基金份额变化情况 报告期末持有基金情况
序号 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 期初份额 申购份额 赎回份额 持有份额 持有份额占基金总额比例
机构 1 2019年1月1日至2019年3月31日 199,999,000.00 - 199,999,000.00 199,999,000.00 99.91%
个人 - - - - - - - - -
注：本基金本报告期末无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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阅。本基金管理人网址：http://www.gefund.com.cn。
投资者对本报告如有任何疑问，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020-33951860。