金鹰科技创新股票型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰科技创新股票
基金主代码	001167
交易代码	001167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月30日
报告期末基金份额总额	1,128,507,556.32份
投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下,重点投资于以科技和创新为动力和支撑,具有核心科技或创新优势的优质上市公司,把握相关领域科技发展与创新所带来的投资机会,力争获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将结合对包括宏观经济形势、政策走势、证券市场环境等在内的因素的分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置策略,合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例,最大限度地降低投资组合的风险,提高收益。 通过"自上而下"及"自下而上"相结合的方法挖掘优质的上市公司,构建股票投资组合:1)自上而下地分析行业的增长潜在空间、竞争结构、增长节奏,潜在风险等方面,把握投资机会;2)自下而上地评判企业的核心科技和创新优势、管理层、治理结构以及其提供的产品和服务是否契合科技创新的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质个股。并秉承稳健优先的原则,在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场,力图获得良好的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2018年10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-32,945,064.83
2.本期利润	-115,465,663.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1021
4.期末基金资产净值	555,777,648.58
5.期末基金份额净值	0.492

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。

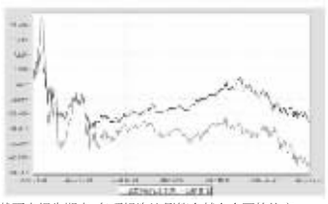
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-17.17%	1.93%	-9.45%	1.31%	-7.72%	0.62%

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

金鹰科技创新股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年4月30日至2018年12月31日)



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)业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

§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		
黄艳芳	基金经理	2017-09-19	-	11	黄艳芳女士,清华大学硕士研究生。历任天相投资顾问有限公司分析师,中航证券资产管理分公司投资主办,量化投资负责人,广州证券股份有限公司资产管理部投资主办。2015年5月加入金鹰基金管理有限公司。任指数及量化投资部数量策略研究员,现任金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)、金鹰科技创新股票型证券投资基金基金经理。

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颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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,公司严格执行证监会《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。

公司通过规范的投资交易流程、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同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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

四季度市场在各种利空打压下再度下跌,强势股跌幅更大,我们维持的高仓位令组合损失较大,报告期内我们减持了一些基本面形势发生重大变化的医药公司,增持了养殖板块。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,基金份额净值为0.492元,本报告期份额净值增长率为-17.17%,同期业绩比较基准增长率为-9.45%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,我们判断单纯依赖控制仓位获取超额收益的阶段已经结束,未来捕捉结构性机会将是重中之重。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§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	514,914,560.47	92.38
	其中:股票	514,914,560.47	92.38
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	42,275,813.81	7.58
7	其他各项资产	186,584.79	0.03
8	合计	557,376,959.07	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。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	13,091,361.36	2.36
B	采矿业	-	-
C	制造业	331,230,979.88	59.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	60,727.90	0.01
F	批发和零售业	13,764,627.90	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,269,202.57	17.86
J	金融业	50,145.80	0.01
K	房地产业	16,674,000.00	3.00
L	租赁和商务服务业	15,653,745.80	2.82
M	科学研究和技术服务业	377,369.26	0.07
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	24,742,400.00	4.45
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	514,914,560.47	92.68

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

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

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	603899	晨光文具	800,054	24,201,633.50	4.35
2	601799	星宇股份	480,000	22,800,000.00	4.10
3	300357	我武生物	590,060	21,826,319.40	3.93
4	002563	森马服饰	2,400,009	21,408,080.28	3.85
5	002493	荣盛石化	2,100,009	21,189,090.81	3.81
6	002821	凯莱英	310,015	21,034,517.75	3.78
7	300253	卫宁健康	1,650,000	20,559,000.00	3.70
8	300047	天源迪科	1,800,091	19,999,011.01	3.60
9	000661	长春高新	108,011	18,901,925.00	3.40
10	002410	广联达	850,000	17,688,500.00	3.18

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未投资债券。

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

本基金本报告期内未投资债券。

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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

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

本基金本报告期内未投资贵金属。

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

本基金本报告期内未投资权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

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报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	166,951.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,736.37
5	应收申购款	10,897.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	186,584.79

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期内未投资可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限证券。

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

本报告期期初基金份额总额	1,135,646,583.95
报告期基金总申购份额	6,880,956.48
减:报告期基金总赎回份额	14,019,984.11
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,128,507,556.32

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去刘岩先生总经理、满黎先生副总经理职务,聘请刘志刚先生担任公司副总经理。自2018年12月5日起,公司董事长李兆廷先生代行总经理职务。上述事项已在证监会指定媒体披露。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准金鹰科技创新股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰科技创新股票型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰科技创新股票型证券投资基金托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、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。

9.2 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

9.3 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:4006-135-888或020-83936180。

金鹰基金管理有限公司
二〇一九年一月二十一日

金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日

§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规定,于2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰添瑞中短债	
基金主代码	005010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年9月15日	
报告期末基金份额总额	8,552,636,002.54份	
投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下,重点投资中短债主题证券,力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金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,通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素,把握投资机会;2)自下而上地评判企业的核心科技和创新优势、管理层、治理结构以及其提供的产品和服务是否契合科技创新的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质个股。并秉承稳健优先的原则,在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场,力图获得良好的收益。	
业绩比较基准	中债总财富(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	本基金为债券型证券投资基金,属于证券投资基金中预期较低风险、较低收益的品种,其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
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	金鹰添瑞中短债A	金鹰添瑞中短债C
下属分级基金的交易代码	005010	005011
报告期末下属分级基金的份额总额	3,876,704,319.16份	4,675,931,683.38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(2018年10月1日-2018年12月31日)	
	金鹰添瑞中短债A	金鹰添瑞中短债C
1.本期已实现收益	47,608,930.48	60,342,186.10
2.本期利润	45,651,050.76	56,889,127.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0098	0.0086
4.期末基金资产净值	3,995,530,282.93	4,799,040,577.89
5.期末基金份额净值	1.0307	1.0263

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1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

1、金鹰添瑞中短债A:

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	0.96%	0.02%	1.36%	0.03%	-0.40%	-0.01%

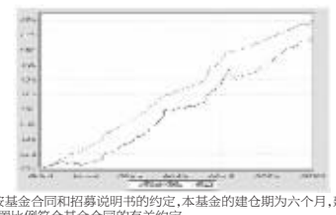
2、金鹰添瑞中短债C:

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	0.85%	0.02%	1.36%	0.03%	-0.51%	-0.01%

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

金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年9月15日至2018年12月31日)

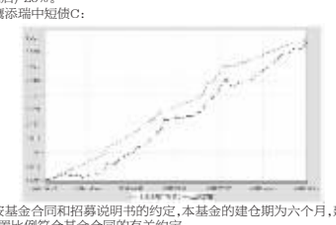
1. 金鹰添瑞中短债A:



注:1、按基金合同和招募说明书的约定,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;

2、本基金的业绩比较基准是:中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。

2. 金鹰添瑞中短债C:



注:1、按基金合同和招募说明书的约定,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;

2、本基金的业绩比较基准是:中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。

§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		
戴骏	基金经理	2017-09-15	-	7	戴骏先生,美国密歇根大学金融工程硕士研究生,历任国泰基金管理有限公司基金经理助理、东兴证券股份有限公司债券交易员等职务,2016年7月加入金鹰基金管理有限公司。现任金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金基金经理。
龙悦芳	基金经理	2017-09-21	-	8	龙悦芳女士,曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易员、投资经理等职务。2017年5月加入金鹰基金管理有限公司,现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金、金鹰添祥中短债债券型证券投资基金、金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,公司严格执行证监会《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。

公司通过规范的投资交易流程、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,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同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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年四季度,金融数据环比较大幅度下滑,预示着实体主动融资需求出现收缩,原油价格大幅下跌,CPI数据符合预期。

四季度,"资产荒"情绪在市场蔓延,进一步强化了9月底由于定向降准所带来的利率下行行情,同时,银行理财规模并未如期收缩,利率定制化产品增多,导致广义基金的配置力量也较为强劲,债券市场的做多行情加速演绎,同时,市场也出现了一波拥挤交易的迹象。虽然年底在资金面紧张的情况下,市场出现了一定调整,但仍由于资金面最终出现缓和,市场对2019年的经济基本面悲观情绪不改,信用及利率债收益均在最后一周出现了明显下行。10年国开债收益率从9月底的4.20下行56bp至3.61,10年国债收益率从3.61下行49bp至3.12。

本基金坚持货币增强的定位,主体仓位依然以中短久期利率债、中高评级信用债、存单、存款及逆回购为主,以赚取票息收益为主。在保持净值稳定的同时,收益率超越货币基金。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,A类基金份额净值为1.0307元,本报告期份额净值增长率为0.96%,同期业绩比较基准增长率为1.36%;C类基金份额净值为1.0263元,本报告份额期净值增长率0.85%,同期业绩比较基准增长率为1.36%。

4.5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年一季度,经济仍然面临下行压力。2019年1月初,央行决定于2019年1月15日和25日分别下调金融机构存款准备金率0.5个百分点,这将释放资金约1.5万亿,同时宣布2019年Q1到期的MLF不再续做,叠加即将开展的TMLF操作和普惠金融定向降准动态考核,则净释放长期资金余额8000亿。货币政策进一步宽松的指向已越来越清晰。全面降准的大门开启后,后续仍将有继续降准操作的可能性。央行全面降准,本质上仍是基本面下行背景下的逆周期调控行为。)经济基本面仍处于下行通道。2)当前货币政策的核心关注点则正在从"防风险"向"稳增长"切换。后续来看,随着央行资金面维稳政策进一步强化,同时汇率风险降低对于政策层面的制约减少,短端利率松动的概率增加,并且随着经济进一步回落,长短利率下行的空间也将进一步释放,债券牛市的思维仍将延续,只不过在短期利好预期过度体现的情况下,仍需要注意长端利率债估值波动的风险。高等级信用债的carry空间依然充足,评级利差也较为充分。在政策层面不断修复融资环境的过程中,中低等级的信用债价值也将逐步提升,只不过融资渠道改善,资金传导机制修复依然是个长期的过程,现在仍不是投资中低评级信用债的最好时机。

基于以上判断,本基金在一季度将适当哑铃型配置,短端依然以票息策略为主,精选信用标的,长端适度拉长久期以提高组合整体久期水平,维持中性杠杆操作。持仓依然以中短久期利率债、高评级信用债、同业存单、存款及逆回购为主。在确保组合良好流动性和安全性的前提下,结合货币市场流动性情况,适时调整组合各类资产比例和久期,竭力为持有人服务。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§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	固定收益投资	10,593,285,000.00	93.50
	其中:债券	10,373,416,000.00	91.56
	资产支持证券	219,869,000.00	1.94
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	129,600,000.00	1.14
	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	400,644,466.27	3.54
7	其他各项资产	206,014,893.33	1.82
8	合计	11,329,544,359.60	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。

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

本基金本报告期内未投资股票。

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

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

本基金本报告期内未投资股票。

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	1,443,234,000.00	16.41
	其中:政策性金融债	650,982,000.00	7.40
4	企业债券	216,218,000.00	2.46
5	企业短期融资券	4,987,861,000.00	56.72
6	中期票据	2,394,813,000.00	27.23
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	1,331,290,000.00	15.14
9	其他	-	-
10	合计	10,373,416,000.00	117.95

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	120224	12国开24	2,200,000.00	219,604,000.00	2.50
2	160215	16国开15	2,200,000.00	219,472,000.00	2.50
3	1820012	18渤海银行01	2,000,000.00	205,140,000.00	2.33
4	011801033	18青投SCP002	2,000,000.00	201,580,000.00	2.29
5	011801440	18首发SCP001	2,000,000.00	200,540,000.00	2.28

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比(%)
1	1889124	18永动1A	1,500,000.00	150,885,000.00	1.72
2	139303	万科30A1	300,000.00	30,000,000.00	0.34
3	139302	链融01A1	200,000.00	19,984,000.00	0.23
4	139317	中交1优A	190,000.00	19,000,000.00	0.22

注:本基金本报告期未仅持有四只资产支持证券。

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

本基金本报告期内未投资贵金属。

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

本基金本报告期内未投权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

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报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,731.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	152,139,163.10
5	应收申购款	53,849,999.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	206,014,893.33

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

本基金本报告期内未投资股票。

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

项目	金鹰添瑞中短债A	金鹰添瑞中短债C
本报告期期初基金份额总额	5,321,070,988.60	7,298,288,127.90
报告期基金总申购份额	1,079,982,080.89	2,596,791,667.13
减:报告期基金总赎回份额	2,524,348,750.33	5,209,148,111.65
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,876,704,319.16	4,675,931,683.38

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去刘岩先生总经理、满黎先生副总经理职务,聘请刘志刚先生担任公司副总经理。自2018年12月5日起,公司董事长李兆廷先生代行总经理职务。上述事项已在证监会指定媒体披露。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会注册的金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰添瑞中短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。

9.2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

9.3查阅方式

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:4006-135-888或020-83936180。

金鹰基金管理有限公司
二〇一九年一月二十一日

金鹰添享纯债债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日

§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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰添享纯债债券
基金主代码	003852
交易代码	003852
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年2月28日
报告期末基金份额总额	542,461.50份
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,通过分析经济周期变化、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,挖掘价值被低估的标的券种,力争实现超越业绩基准的投资收益。 (一)资产配置策略 本基金在综合判断宏观经济形势以及微观市场的基础上,分析不同类别资产的收益率水平、流动性特征和风险水平特征,确定大类金融资产配置和债券类属配置,同时,根据市场的变化,动态调整大类资产和债券资产的投资比例,以规避市场风险,提高投资收益。 (二)债券投资策略 债券投资策略主要包含类属配置策略、久期配置策略、收益率曲线策略、杠杆策略、相对价值投资策略、信用利差曲线策略。
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	浙商银行股份有限公司

§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(2018年10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-5,361.35
2.本期利润	-5,278.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0073
4.期末基金资产净值	544,925.40
5.期末基金份额净值	1.0045

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