金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:二〇一九年四月二十日

§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2019年1月1日起至3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	5,243,130,047.67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,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。	
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	2,701,807,701.44份	2,541,322,346.23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(2019年1月1日-2019年3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	43,254,532.77	41,880,384.62
2.本期利润	41,767,688.06	41,089,404.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0123	0.0116
4.期末基金资产净值	2,784,348,992.33	2,606,212,478.27
5.期末基金份额净值	1.0306	1.0251

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	1.16%	0.02%	0.92%	0.03%	0.24%	-0.01%

2、金鹰添瑞中短债C:

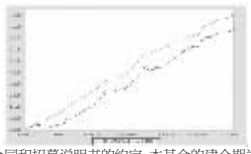
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.06%	0.02%	0.92%	0.03%	0.14%	-0.01%

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2019年3月31日)

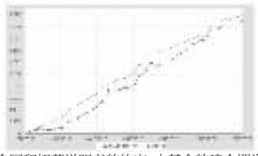
1. 金鹰添瑞中短债A:



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	本基金的基金经理、公司固定收益部副总监	2017-09-15	-	8	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,现任固定收益部基金经理。
龙悦芳	本基金的基金经理、公司固定收益部副总监	2017-09-21	-	9	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,现任固定收益部基金经理。

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

本报告期内,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

一季度,社融企稳回升,宽信用政策初现成效。市场对经济悲观预期得到修复,市场风险偏好提升,股市大幅上涨。债市整体呈震荡行情,10年期国债在3.05-3.2%区间震荡,短端利率继续维持低位运行。无风险利率维持低位,资金外溢风险资产,信用利差进一步收敛,行情继续向中等评级迁移。但违约事件不断,市场对于低评级债券仍偏谨慎。

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。同时根据对市场及流动性的判断,适时调整组合久期和杠杆比例,在保持净值稳定,组合流动性和安全性的同时,获取了一定的超额收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,A类基金份额净值为1.0306元,本报告期份额净值增长率为1.16%,同期业绩比较基准增长率为0.92%;C类基金份额净值为1.0251元,本报告份额期净值增长率1.06%,同期业绩比较基准增长率为0.92%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,经济下行压力仍在,全球经济放缓,美联储暂停加息和缩表,国内货币政策面临的外部约束弱化。支撑债市的基本面因素仍在。但宽信用及减税降费等稳经济政策的推出,有利于延缓经济下行趋势,短期经济或保持韧性。猪周期上行及油价上涨带来通胀隐忧,加上宽信用政策渐出成效,货币政策进一步宽松的必要性下降,货币政策或维持相对中性,保持流动性合理宽裕,后续托底经济主要靠财政政策。因此我们认为短期长端利率或因市场对经济悲观预期的修复面临一定的调整压力,短端利率受益于理财新规下短端资产的需求支撑,有望继续维持平稳,收益率曲线将陡峭化,牛平需待通胀预期消退及基本面下行进一步确认。

基于以上判断,本基金在二季度将利用市场调整的机会适当地增配高收益率资产,结合市场情况适时调整组合各类资产比例和久期,在保证组合流动性和安全性的同时,为持有人创造稳定的收益。

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	5,589,337,700.00	92.54
	其中:债券	5,358,103,000.00	88.72
	资产支持证券	231,234,700.00	3.83
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	202,906,944.36	3.36
	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	100,529,419.97	1.66
7	其他各项资产	146,874,646.61	2.43
8	合计	6,039,648,710.94	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	1,266,335,000.00	23.50
	其中:政策性金融债	422,918,000.00	7.85
4	企业债券	156,754,000.00	2.91
5	企业短期融资券	2,051,070,000.00	38.06
6	中期票据	1,641,114,000.00	30.45
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	242,830,000.00	4.51
9	其他	-	-
10	合计	5,358,103,000.00	99.42

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	160215	16国开15	2,200,000.00	220,198,000.00	4.09
2	1820012	18渤海银行01	2,000,000.00	203,900,000.00	3.78
3	1828017	18兴业绿色金融02	2,000,000.00	202,540,000.00	3.76
4	101801354	18中远海控MTN001	2,000,000.00	202,160,000.00	3.75
5	011802318	18铁建房产SCP001	2,000,000.00	201,020,000.00	3.73

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	101,325,000.00	1.88
2	139407	万科34A1	600,000.00	60,408,000.00	1.12
3	139303	万科30A1	300,000.00	30,219,000.00	0.56
4	139302	链融01A1	200,000.00	20,144,000.00	0.37
5	139317	中交1优A	190,000.00	19,138,700.00	0.36

注:本基金本报告期末仅持有五只资产支持证券。

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	6,044.96
2	应收证券清算款	51,446,904.11
3	应收股利	-
4	应收利息	88,191,818.16
5	应收申购款	7,229,879.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	146,874,646.61

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

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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	3,876,704,319.16	4,675,931,683.38
报告期基金总申购份额	1,602,929,453.96	606,818,194.11
减:报告期基金总赎回份额	2,777,826,071.68	2,741,427,531.26
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,701,807,701.44	2,541,322,346.23

§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

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。

§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
二〇一九年四月二十日

金鹰添享纯债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:二〇一九年四月二十日

§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2019年1月1日起至3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	517,896.14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	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(2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-6,479.80
2.本期利润	-5,272.35
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0106
4.期末基金资产净值	514,759.05
5.期末基金份额净值	0.9939

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	-1.06%	0.02%	0.45%	0.04%	-1.51%	-0.02%

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

金鹰添享纯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历史走势对比图

(2017年2月28日至2019年3月31日)

注:(1)基金合同生效日期为2017年2月28日。

(2)截至本报告期末,各项投资比例符合基金合同的约定。

(3)本基金业绩比较基准是:中债综合(全价)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		
刘丽娟	本基金的基金经理、公司固定收益部总监	2017-02-28	-	12	刘丽娟女士,中南财经政法大学工商管理硕士,历任恒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 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,无损害基金份额持有人利益的行为。

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

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,而长端收益率在宽信用推进中社融企稳、地方债提前发行、股市估值修复、中美贸易战缓和等多重因素影响下步入震荡行情。整个一季度十年国开债收益率小幅下行2bp,一年国开债收益率下行约10bp,收益率曲线陡峭化。在信用违约常态化的背景下,一季度信用利差在流动性宽松和宽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%并置换一季度到期的MLF,加上TMLF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走款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较长时间处于公开市场逆回购招标利率2.55%以下。受MPA考核因素影响,季末银行减少对非银机构的融出,DR007和R007利差拉大,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,债券部分继续以短久期利率债为主要配置品种,把握流动性宽松短端利率的下行机会。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,基金份额净值0.9939元,本报告期份额净值增长-1.06%,同期业绩比较基准增长率为0.45%。

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2019年二季度,从基本面来看,经济下行压力仍大,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;基建在严控地方政府隐性债务新增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将回落。关注社融增速企稳回升、猪周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。

流动性层面上,二季度MLF到期量高达11855亿元,4月5月也是缴税大月,流动性缺口较大。在经济下行压力仍大、宽信用仍在推进中的背景下,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停加息和缩表,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,二季度长端利率将维持震荡走势,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短久期利率债配置,力争有效控制并防范风险,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

报告期内,本基金资产净值已发生连续超过60个工作日低于5000万元的情形,本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

§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	439,643.00	63.41
	其中:债券	439,643.00	63.41
	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	244,085.45	35.20
7	其他各项资产	9,618.04	1.39
8	合计	693,346.49	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	289,040.00	56.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	150,603.00	29.26
	其中:政策性金融债	150,603.00	29.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	439,643.00	85.41

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	019537	16国债09	2,090.00	209,000.00	40.60
2	108603	国开1804	1,200.00	120,600.00	23.43
3	019544	16国债16	800.00	80,040.00	15.55
4	018005	国开1701	300.00	30,003.00	5.83

注:本基金本报告期末仅持有4只债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	82.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,535.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,618.04

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

本报告期期初基金份额总额	542,461.50
报告期基金总申购份额	30,703.21
减:报告期基金总赎回份额	55,268.57
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	517,896.14

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	489,431.70
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	489,431.70
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	94.50

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 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者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
	1	2019年1月1日至2019年3月31日	489,431.70	-	-	489,431.70	94.50%

产品特有风险
本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,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,导致本基金的收益水平发生波动,同时,因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因,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,基金份额持有人将可能无法及时赎回所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,可能导致本基金的流动性风险; 4)基金提前终止、转型或与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。基金可能会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申购申请被拒绝的风险: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提出的申购及转换转入申请。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转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入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%,该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

8.2 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。

§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享纯债债券型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰添享纯债债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰添享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成立批件、营业执照、公司章程。

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
二〇一九年四月二十日

金鹰添盈纯债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:二〇一九年四月二十日

§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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰添盈纯债债券
基金主代码	003384
交易代码	003384
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月11日
报告期末基金份额总额	1,008,928,193.57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	本基金在充分考虑基