

金鹰添裕纯债债券型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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：二〇一九年八月二十三日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同，于2019年8月22日复核了本公司对外的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，内容表述准确无误。

基金管理人承诺以诚信行为、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基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称		金鹰添裕纯债债券型证券投资基金
基金主代码		000741
交易代码		000741
基金运作方式		契约型开放式
上市交易场所		深圳证券交易所
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
基金类型		债券型基金

2.2 基金产品说明

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回报。

投资策略 本基金将基于对宏观经济、政策环境、市场利率、信用环境、流动性、资金面、信用利差、信用评级、信用品种、行业景气度、公司基本面、估值水平、流动性等因素的综合分析，在严格控制风险的前提下，通过久期管理、期限配置、券种选择、杠杆运用、个券选择、信用配置、回购操作等手段，实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）*20%

风险收益特征 本基金为债券型基金，属中低风险品种，预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	金鹰基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
地址	深圳市南山区高新区科技中二路2号深圳软件园二期B座12层	北京市西城区金融街35号交通银行总行大厦
联系人	客户服务部	客户服务部
电话	020-38600000	010-62054000
电子邮箱	cs@jyfund.com	lrb@cboc.com.cn
客户服务电话	4000-880-0000/00001000	010-62054000
传真	020-38600000	010-62054000

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网址 <http://www.jyfund.com>

基金半年度报告摘要的住所地所有地区的通信地址 广东省深圳市南山区高新区科技中二路2号深圳软件园二期B座12层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金額单位：人民币元

项目	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期利息收入	20,096,762.73
本期利润	10,329,400.33
加权平均基金份额本期利润	0.0100
期末基金份额净值	1.0126
本期末基金资产净值	10,000,000.00

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.本期利润期间内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（即为期末余额，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 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	份额净值增长 率(%)	份额净值增长 率标准差(%)	业绩比较基 准收益率 (%)	业绩比较基 准收益率标准差 (%)	①-②	②-④
过去一个月	0.37%	0.01%	0.26%	0.01%	0.12%	-0.05%
过去三月	0.46%	0.01%	-0.11%	0.01%	0.56%	-0.01%
过去六个月	1.62%	0.01%	0.34%	0.01%	1.28%	-0.02%
过去一年	6.03%	0.01%	2.90%	0.01%	3.87%	-0.01%
成立以来	11.14%	0.01%	0.61%	0.01%	10.53%	0.01%

注：本基金业绩比较基准：[中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）]*20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

金鹰添裕纯债债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2016年11月23日至2019年6月30日）



注：截至本报告期末基金总资产净值10,000,000.00元，基金份额总额净值1.0126元。

(2)本报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定。

(3)本基金业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）*20%

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人

经中国证监会证监基字[2002]97号文批准，金鹰基金管理有限公司于2002年12月25日成立，注册资本人民币5.102亿元人民币，2011年12月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013年7月子公司——广州公寓基金管理有限公司成立。

“以人为本、互信合作、创新求变、挑战超越”是金鹰的核心价值观。公司坚持择时投资为导向，着力打造高水准的投研团队，努力为投资者创造丰厚回报。截至目前，公司已拥有6只公募基金，管理规模630.88亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理助理）及基金经理助理的简介

4.1.2.1 资产负债表

会计主体：金鹰添裕纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本报告期末	上年度末
资产：		
银行存款	6,358,350.63	9,520,000.00
结算备付金		
存出保证金		
交易性金融资产	1,030,277,490.00	1,039,210,430.00
其中：股票投资		
基金投资	1,030,277,490.00	1,039,210,430.00
应收利息		
应收股利		
应收申购款		
其他资产		
资产总计	1,036,635,840.63	1,048,729,860.00
负债：		
应付赎回款	1,091,269,434.32	1,112,812,343.15
应付交易费用	207,090.20	204,424.00
应付管理人报酬	81,152.44	81,020.00
应付托管费	39,566.04	20,007.01
应付审计费	16,037.00	16,930.00
应付承销费		
应付信息披露费	207,098.22	201,300.00
负债合计	1,090,412.00	109,409,138.15
负债准备金		
未交增值税	976,800,506.60	977,000,230.00
未交企业所得税	3,903,438.00	76,300,230.00
未交个人所得税	900,704,025.00	1,062,307,101.75
负债总计	1,036,635,840.63	1,112,812,343.15
净资产：		
基金资产净值	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
未分配利润	0.00	0.00
净资产总计	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00

注：截至本报告期末基金总资产净值10,000,000.00元，基金份额总额净值1.0126元。

(2)本报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定。

(3)本基金业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）*20%

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内，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细则，《金鹰添裕纯债债券型证券投资基金基金合同》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，为基金持有人谋取最大利益。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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

报告期内，本公司严格执行证监会《证券投资基金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受平等的机会。公司通过完善交易内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期内，公司连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）对公司管理的不同投资组合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

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，未发现本基金可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2019年上半年，经济基本面延续底部震荡。一季度地产投资和基建共同

支撑经济短暂企稳，3月经济数据表现超预期；但二季度以来地产开发投资增速逐渐回落，带动地产投资下行；制造业投资差强人意，制造业PMI在3月跳升至荣枯线上，又于5月再次回落至荣枯线下方，生产扩张需求放缓；基建难以独自支撑经济持续走好，消费方面总体表现较弱，而5月的数据略显主要归功于端午劳动节长假以及假期效应造成的低基数。出口方面仍面临着贸易摩擦所带来的负面影响。CPI方面，上半年通胀有所上升，2019年5月CPI同比大升至历史新高2.7%，主要归因于农产品价格的持续上涨，黑色系价格和原油价格也有所上升。

受经济基本面的影响，债券市场上呈现先上后下的倒V走势。1月社融数据大幅回升，重返荣枯线上，引起债市剧烈反应；叠加降准预期波动，国债期货跌势加剧，十年国债大幅上涨，调整至15bp左右。4月以来，对于股市的强弱