

金鹰添盈纯债债券型证券投资基金
2024 年第 1 季度报告
2024 年 3 月 31 日

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：二〇二四年四月二十二日

§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 2024 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 2024 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
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	7,688,709,326.19 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	本基金充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性，在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。在资产配置中，本基金以债券为主，通过密切关注债券市场变化，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，在确保资产稳定增值的基础上，通过积极主动的资产配置，力争实现超越业绩基准

	<p>的投资收益。</p> <p>在对宏观经济形势以及微观市场充分研判的基础上，采取积极主动的投资管理策略，积极进行资产组合配置。对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响信用债券投资价值的因素进行评估，主动调整债券组合。</p>	
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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金鹰添盈纯债债券 A	金鹰添盈纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	003384	012623
报告期末下属分级基金的份额总额	2,872,197,296.71 份	4,816,512,029.48 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 (2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日)	
	金鹰添盈纯债债券 A	金鹰添盈纯债债券 C
1.本期已实现收益	22,292,634.85	39,330,312.46

2.本期利润	26,690,552.92	50,091,006.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0123	0.0124
4.期末基金资产净值	3,625,581,157.73	5,878,596,336.01
5.期末基金份额净值	1.2623	1.2205

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；

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、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、金鹰添盈纯债债券 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	0.94%	0.04%	1.16%	0.05%	-0.22%	-0.01%
过去六个月	1.61%	0.03%	1.90%	0.04%	-0.29%	-0.01%
过去一年	139.95%	8.51%	2.82%	0.04%	137.13%	8.47%
过去三年	112.31%	4.92%	5.68%	0.04%	106.63%	4.88%
过去五年	119.55%	3.81%	7.16%	0.05%	112.39%	3.76%
自基金合同生效起至今	147.22%	3.17%	9.40%	0.05%	137.82%	3.12%

2、金鹰添盈纯债债券 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	0.93%	0.04%	1.16%	0.05%	-0.23%	-0.01%

过去六个月	1.61%	0.03%	1.90%	0.04%	-0.29%	-0.01%
过去一年	134.71%	8.55%	2.82%	0.04%	131.89%	8.51%
自基金合同生效起至今	107.33%	5.09%	5.32%	0.04%	102.01%	5.05%

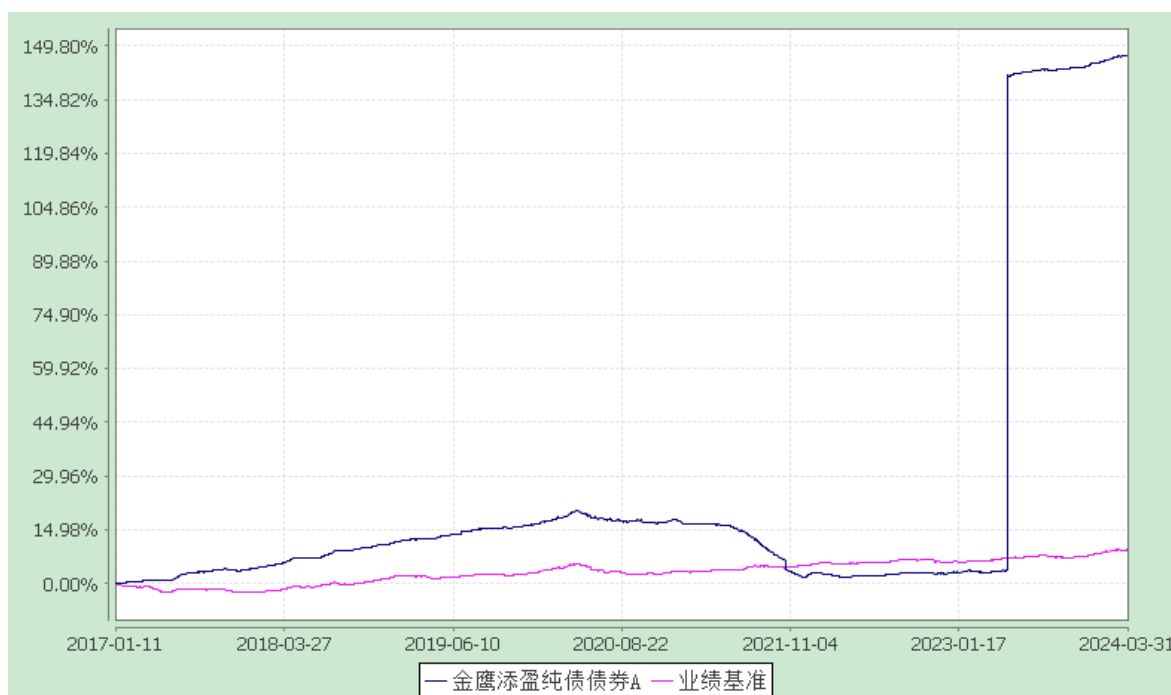
注：本基金自2021年6月8日起增设C类基金份额，C类基金份额首次确认日为2021年6月9日。

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

金鹰添盈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的历史走势对比图

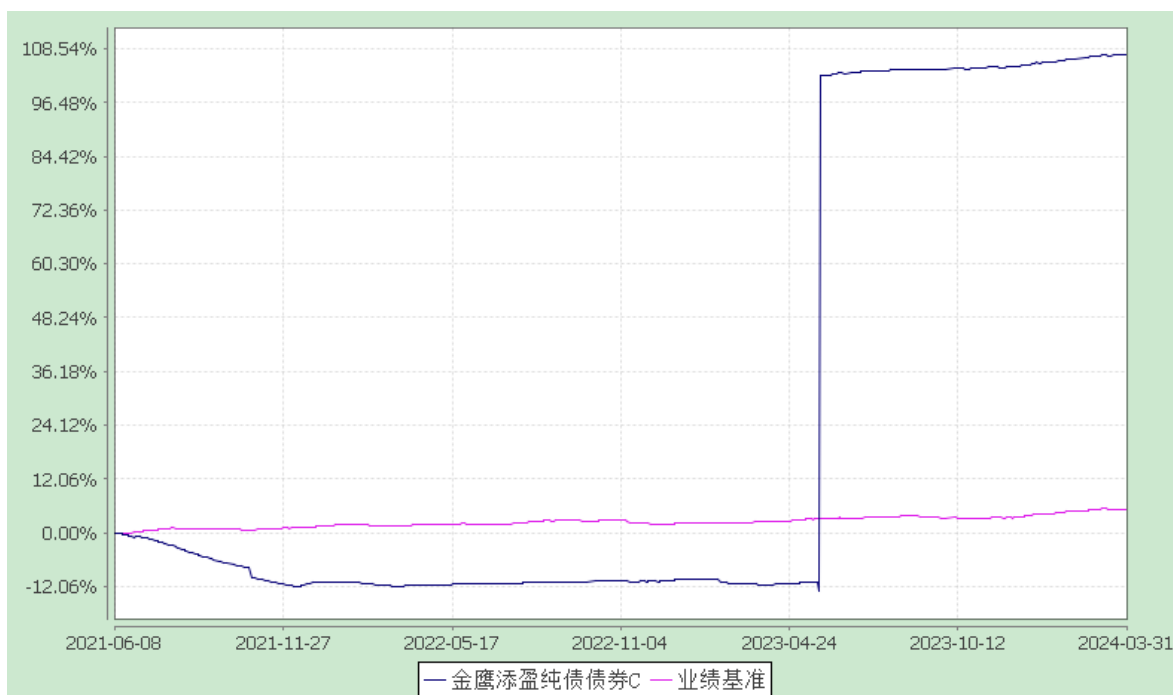
(2017年1月11日至2024年3月31日)

1. 金鹰添盈纯债债券 A:



注：1、本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）*20%。

2. 金鹰添盈纯债债券 C:



注：1、本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年定期存款利率（税后）*20%。

2、本基金自 2021 年 6 月 8 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2021 年 6 月 9 日。

§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		
陈双双	本基金的基金经理	2022-07-27	-	8	陈双双女士，中南财经政法大学数量经济学硕士，2016 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，担任债券交易员职务，现任固定收益部基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及

从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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内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 2024 年一季度，在经济内生动能依然不足、权益市场大幅波动、货币政策宽松和资产荒延续背景下，债券收益率大幅下行，收益率曲线两端表现最佳。具体来看，1 月初，在 12 月 CPI 环比转正、社融同比多增以及 1 月 15 日 MLF 降息预期落空等因素扰动下，债券收益小幅回调震荡；随着年度经济数据披露和

权益市场大跌，30 年期国债备受各类机构和产品青睐，收益率明显下行，曲线牛平；同时 1 月 24 日央行超预期宣布降准 0.5 个百分点，并表态“为包括资本市场在内的金融市场的运行创造良好的货币政策环境”，10 年期国债向下突破 2.5%，短端收益率也迎来一波下行。进入 2 月，随着公布的 1 月 CPI 数据环比上涨、社融数据创新高以及权益市场走势偏强，10 年期国债小幅上行至 2.45% 附近；春节后多家银行陆续下调存款利率叠加地产销售同比延续下降趋势，推动 10 年期国债向下突破 2.4%。3 月初在资金面宽松和央行表态“后续依然有降准空间”，债市情绪继续高涨，10 年期国债向下突破 2.3%，30 年期国债向下突破 2.45%。随着债券资产和银行保险等机构负债成本倒挂、农商行信息和超长期国债供给扰动等，债市开启一轮较大幅度快速调整；在汇率压力、地产信息扰动以及债券供给放量担忧下，长端进入震荡；短端在季末流动性宽松背景下继续下行，利率曲线陡峭化。

本基金在报告期内根据对债市判断以及负债端情况进行配置，合理安排组合的久期和杠杆，在严控风险和保持较好流动性前提下，以相对较低波动和回撤为投资者获得稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.2623 元，本报告期份额净值增长率为 0.94%，同期业绩比较基准增长率为 1.16%；C 类基金份额净值为 1.2205 元，本报告期份额净值增长率为 0.93%，同期业绩比较基准增长率为 1.16%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期无应说明预警事项。

§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	8,932,829,435.57	88.99
	其中：债券	8,932,829,435.57	88.99
	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	1,081,705,135.88	10.78
	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	8,603,014.82	0.09
7	其他各项资产	14,685,675.03	0.15
8	合计	10,037,823,261.30	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、待摊费用。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

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	434,504,957.42	4.57
2	央行票据	-	-

3	金融债券	8,349,847,361.37	87.85
	其中：政策性金融债	3,665,779,973.11	38.57
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	148,477,116.78	1.56
9	其他	-	-
10	合计	8,932,829,435.57	93.99

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	09230412	23 农发清发 12	4,400,000.00	446,284,185. 79	4.70
2	190311	19 进出 11	4,000,000.00	408,638,688. 52	4.30
3	092318003	23 农发清发 03	3,900,000.00	398,300,180. 33	4.19
4	200219	20 国开 19	3,600,000.00	372,623,409. 84	3.92
5	240301	24 进出 01	3,700,000.00	371,859,300. 55	3.91

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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之一的中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局宁波监管局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)

1	存出保证金	33,292.43
2	应收证券清算款	13,239,532.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,412,850.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,685,675.03

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	金鹰添盈纯债债券A	金鹰添盈纯债债券C
本报告期期初基金份额总额	1,659,783,517.14	2,412,888,132.44
报告期期间基金总申购份额	1,507,137,129.85	4,936,775,093.07
减：报告期期间基金总赎回份额	294,723,350.28	2,533,151,196.03
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,872,197,296.71	4,816,512,029.48

§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

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会注册的金鹰添盈纯债债券型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰添盈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。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

10.2 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

10.3 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
二〇二四年四月二十二日