

金鹰元祺信用债债券型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

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：2019-04-20

目录
重要提示
基金管理人承诺
基金概况
主要财务指标和基金净值变动

基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称、住所、办公地址、邮政编码、电话、传真、互联网网址
基金托管人：交通银行股份有限公司

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

基金基本情况
基金名称：金鹰元祺债券
场内简称：元祺
基金代码：002490
基金运作方式：契约开放式
基金合同生效日：2017-11-08
报告期末基金份额总额：175,754,644.49

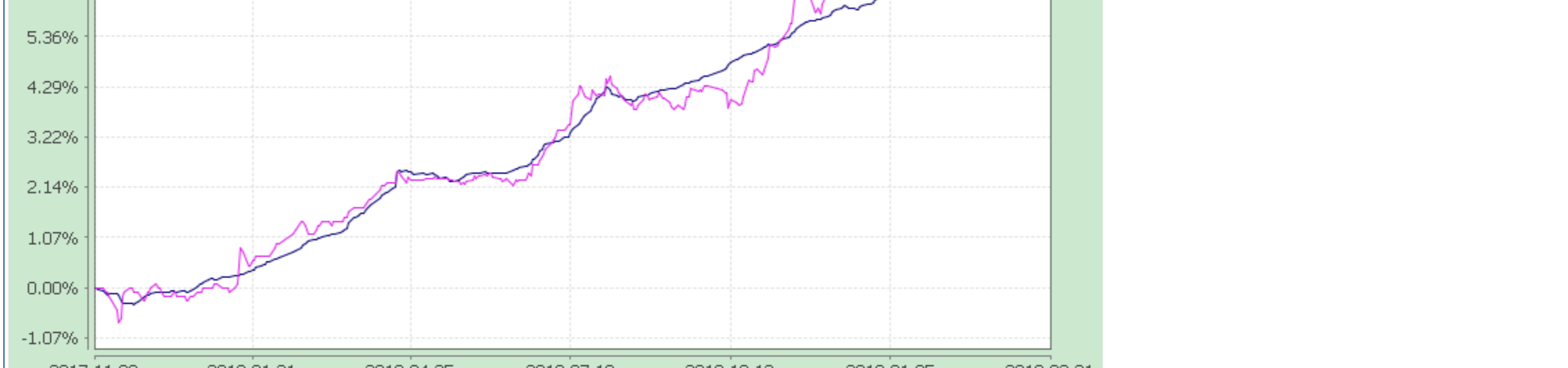
投资目标：本基金在严格控制风险的前提下，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略：本基金充分考量债券资产的安全性、收益性及流动性，在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。

主要财务指标
主要财务指标：本期已实现收益 725,515.34
本期利润 881,913.81
加权平均基金份额本期利润 0.0050
期末基金份额净值 203,478,280.65
期末基金资产净值 1,155,555.55

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. 本基金资产净值本期实现收益或亏损中包含公允价值变动收益部分

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：过去三个月
净值增长率①：2.71%
净值增长率标准差②：0.16%



注：1. 本基金由金鹰元祺保本混合型证券投资基金于2017年11月8日转型而来；
2. 本基金合同和投资目标的约定，本基金的投资目标为6个月、建仓期和建仓后各资产仓位比例符合基金合同的约定；
3. 本基金的投资比较基准是：中债国债总财富(总值)指数收益率*40%+一年定期存款利率(税后)*60%

其他指标

其他指标：本报告期 (2019-01-01至2019-03-31) 报告期末 (2019-03-31)

基金经理(或基金经理小组)简介

姓名：汪伟
职务：本基金的基金经理
任职日期：2018-01-24
离任日期：-
证券从业年限：6
说明：汪伟先生，2013年7月至2014年9月曾任广州证券股份有限公司交易员、投资经理等职务。

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，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。

公平交易专项说明

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，各投资组合投资决策流程和独立决策，并在获取投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

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多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

去年四季度我们提示了“资产荒”的逻辑，今年一季度市场如期迎来了风险资产的狂欢。债券资产整体呈现“量缩价升”的格局，转债和可转债市场表现尤为突出。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，基金份额净值为1.1555元，本报告期份额净值增长率为7.1%，同期业绩比较基准增长率为4.28%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当下，再去争论谁半的牛熊或反转意义不大，应对政策力度变化，往后看半年，宏观层面的变化对于投资的指导可能比较复杂，甚至混乱。

报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金资产净值已连续超过90个工作日低于5000万元的预警，本基金管理人已按法律法规要求向证监会报告并寻求解决方案。

投资组合报告

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细
序号：1 股票代码：000527 股票名称：汇川技术 数量：1,131,811.00 公允价值：11,941,000.00

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10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：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、应收中款项。

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 - -

注：本基金本报告期末未投资股票。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10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 011801388 18苏州高新SCP009 200,000.00 20,120,000.00 9.91

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5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 011801388 18苏州高新SCP009 200,000.00 20,120,000.00 9.91

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未投资资产支持证券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未投资贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证投资明细

注：本基金本报告期末未投资权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

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

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

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

本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

投资组合报告附注

受处罚情况：本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生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。

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：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。

其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 8,307.54

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 110013 汇川转债 658,900.00 0.32

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末未投资股票。

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。

开放式基金份额变动

项目 单位：份
报告期期初基金份额总额 23,848,071.35
报告期期间基金总申购份额 153,872,728.64

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基金份额变动情况
项目 基金份额
报告期末前10名持有本基金基金份额

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 - - - - -

报告期末发起式基金发起资金持有基金份额情况

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

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 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 份额占比
机构 1 2019年1月1日至2019年3月12日 5,445,221.02 - - 5,445,221.02 3.10

注：本基金在报告期内，存在报告期末单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，可能存在以下风险：
1) 基金估值大幅波动的风险：当持有基金份额比例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，可能导致证券价格波动，导致基金收益或水平发生波动。

影响投资者决策的其他重要信息：广东省工商银行深圳分行核准，本基金管理人代表人已于2019年3月27日变更为刘志刚先生。

备查文件目录

- 1. 中国证监会批准发行及募集的文件。
2. 《金鹰元祺信用债债券型证券投资基金合同》。
3. 《金鹰元祺信用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文件、营业执照、公司章程。
5. 基金托管人交通银行股份有限公司执照和营业执照。

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25层

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询，本基金管理人网址：http://www.gffund.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：4006-155-888或020-83980180。