

# 金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金

## 2021 年第 3 季度报告

### 2021 年 9 月 30 日

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：二〇二一年十月二十六日

## §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 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 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	1,242,456,232.07 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	1,047,457,448.88 份	194,998,783.19 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 (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 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	7,232,943.37	1,583,231.40
2.本期利润	7,873,810.56	1,847,980.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.0088
4.期末基金资产净值	1,088,612,347.65	199,450,458.88
5.期末基金份额净值	1.0393	1.0228

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%	0.92%	0.03%	0.04%	-0.01%
过去六个月	1.89%	0.02%	1.86%	0.02%	0.03%	0.00%
过去一年	3.64%	0.02%	3.41%	0.03%	0.23%	-0.01%
过去三年	10.79%	0.03%	9.91%	0.04%	0.88%	-0.01%
自基金合同生效起至今	17.15%	0.03%	14.94%	0.04%	2.21%	-0.01%

#### 2、金鹰添瑞中短债 C:

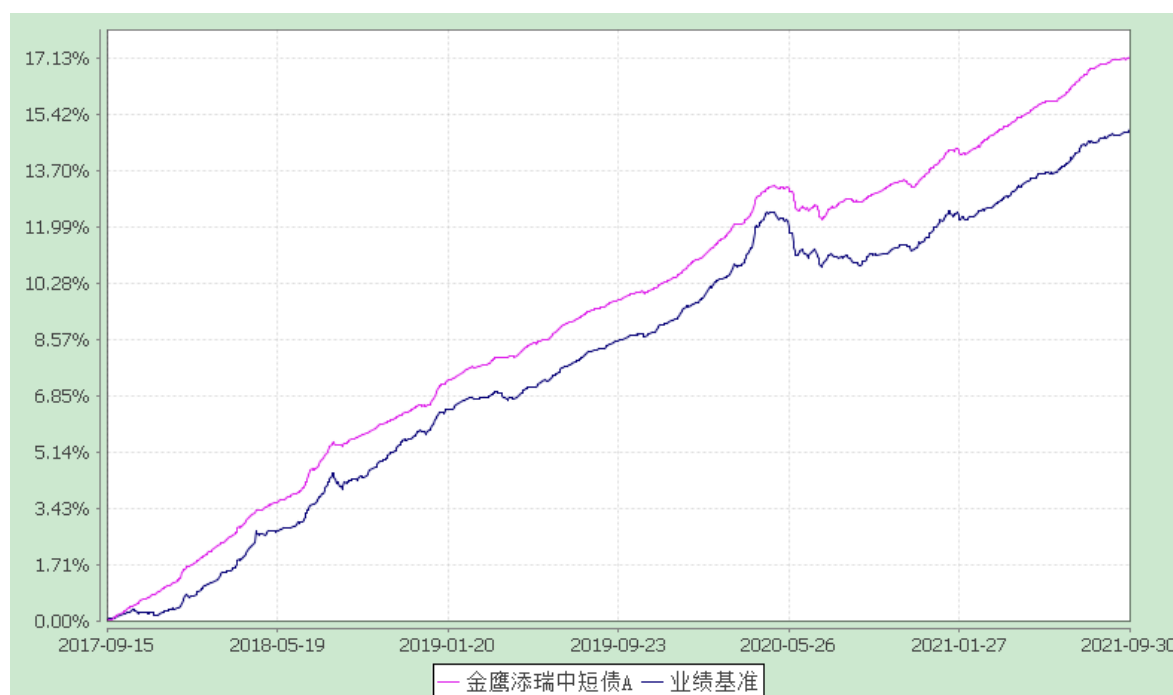
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.85%	0.02%	0.92%	0.03%	-0.07%	-0.01%
过去六个月	1.68%	0.02%	1.86%	0.02%	-0.18%	0.00%
过去一年	3.22%	0.02%	3.41%	0.03%	-0.19%	-0.01%
过去三年	9.47%	0.03%	9.91%	0.04%	-0.44%	-0.01%
自基金合同生效起	15.28%	0.03%	14.94%	0.04%	0.34%	-0.01%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

### 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 2021 年 9 月 30 日)

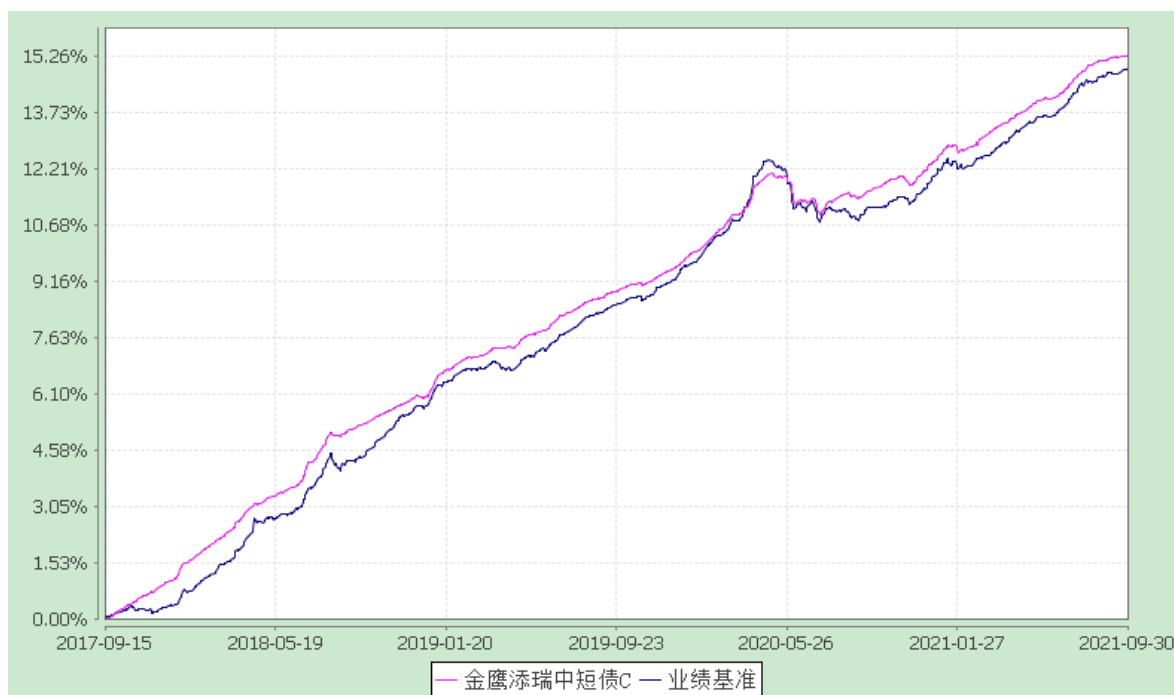
#### 1. 金鹰添瑞中短债 A:



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，公司混合投资部总监	2017-09-15	-	10	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，现任混合投资部基金经理。
龙悦芳	本基金的	2017-09-21	-	11	龙悦芳女士，曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易

	基金 经理， 公司 固定 收益 部副 总监				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

回顾三季度，季初央行超预期降准，加上国内多地疫情反复，债券收益率快速下行，10 年期国债收益率最低触碰 2.799%。随后因为供给回升，降息落空，资金价格有所抬升，债市步入震荡调整。且因监管要求银行理财净值化改造提速，季末存款压力下，银行理财赎回加大，部分信用债、存单抛压重引发收益率明显抬升。截至三季度末，10 年期国债下行 20BP 至 2.88%，期限利差小幅收窄，信用利差略有走阔。

流动性层面，尽管三季度央行降准，但地方债供给增加，央行公开市场投放节制，银行超储率维持低位，银行间市场资金价格并未下降，反而略有上升。特别是临近季末，跨季资金价格明显上升，央行季末在公开市场持续投放，加上月底财政投放，季末最后一天资金价格才得以回落。

三季度，本基金维持中短端吃票息的策略，精选收益率相对较高、资质较好的 ABS 和信用债进行配置。季初我们适当地增加了杠杆和久期，在降准收益率大幅下行后，我们又变现了部分资产降低了杠杆水平，且将部分低性价比的信用债进行了替换。在 9 月中下旬债市调整后，适当地增加了相对性价比较高的短久期资产的配置。在严控投资标的信用风险和流动性风险，保持组合流动性和安全性的前提下，保持净值稳步增长，实现季度收益率超越货币基金 50-100BP 的目标。

### 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 1.0393 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 0.92%；C 类基金份额净值为 1.0228 元，本报告期份额净值增长率 0.85%，同期业绩比较基准增长率为 0.92%。

## 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	1,418,199,440.00	93.66
	其中：债券	1,259,397,600.00	83.17
	资产支持证券	158,801,840.00	10.49
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	29,400,164.10	1.94
	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	1,254,708.07	0.08
7	其他各项资产	65,370,459.90	4.32
8	合计	1,514,224,772.07	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、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

本基金本报告期内未投资于股票。

#### 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 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

本基金本报告期内未投资于股票。

#### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系

### 统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌的股票。

### 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	653,930,000.00	50.77
	其中：政策性金融债	191,021,000.00	14.83
4	企业债券	50,565,000.00	3.93
5	企业短期融资券	279,310,600.00	21.68
6	中期票据	81,072,000.00	6.29
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	194,520,000.00	15.10
9	其他	-	-
10	合计	1,259,397,600.00	97.77

### 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	112111120	21 平安银行 CD120	1,000,000.00	97,240,000.00	7.55
2	155559	19 渤海 02	800,000.00	80,328,000.00	6.24
3	190403	19 农发 03	700,000.00	70,259,000.00	5.45
4	160207	16 国开 07	600,000.00	60,516,000.00	4.70
5	163241	20 宁证 01	600,000.00	60,024,000.00	4.66

### 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	168202	睿安 2A3	300,000.00	27,177,000.00	2.11
2	168091	安润 2A3	300,000.00	24,984,000.00	1.94
3	179565	光耀 05A	230,000.00	23,006,900.00	1.79
4	136351	东曦 1A2	124,000.00	12,370,240.00	0.96
5	138526	惠安 2A3	300,000.00	10,746,000.00	0.83
6	169881	光耀 03A	100,000.00	10,005,000.00	0.78
7	169692	光耀 02A	100,000.00	9,998,000.00	0.78
8	136473	东曦 4A2	100,000.00	9,981,000.00	0.77
9	189914	烨熠 1A2	100,000.00	9,968,000.00	0.77
10	165129	万安 2A3	100,000.00	5,990,000.00	0.47

**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于贵金属。

**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于权证。

**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之一的平安银行股份有限公司因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款等未依法履行其他职责行为，于 2021 年 6 月 8 日被中国银行保险监督管理委员会云南监管局公开处罚，罚款人民币 210 万元；因贷款资金用途管控不到位等未依法履行其他职责等行为，于 2020 年 10 月 27 日被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局公开处罚，罚款人民币 100 万元。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国家开发银行因为违规的政府购买服务项目提供融资等未依法履行其他职责的行为，于 2021 年 1 月 8 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 4880 万元。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厦门国际银行股份有限公司因违规开展同业业务，于 2021 年 3 月 12 日被中国银行保险监督管理委员会厦门监管局公开处罚，处以七百八十万元罚款；因部分房地产开发贷款发放不合规，经营性物业抵押贷款发放不审慎，于 2021 年 1 月 19 日被中国银行保险监督管理委员会厦门监管局公开处罚，处以罚款八十万元。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中国农业银行股份有限公司因发生重要信息系统突发事件未报告等未依法履行其他职责等行为，于 2021 年 1 月 29 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 420 万元；因收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费），于 2020 年 12 月 7 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

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	14,774.42

2	应收证券清算款	45,834,950.12
3	应收股利	-
4	应收利息	18,862,849.12
5	应收申购款	657,886.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,370,459.90

#### 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	754,323,867.43	214,900,216.37
报告期期间基金总申购份额	357,850,592.65	29,572,700.45
减：报告期期间基金总赎回份额	64,717,011.20	49,474,133.63
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	1,047,457,448.88	194,998,783.19

### §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。

### 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

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  
二〇二一年十月二十六日