

# 金鹰添盛定期开放债券型发起式证券投资基金

## 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：浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商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       | 金鹰添盛定期开放债券   |
| 基金主代码      | 005752   |
| 交易代码       | 005752   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2018 年 9 月 26 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 808,140,156.24 份   |
| 投资目标       | 本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。  |
| 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  | 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<br>(2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益      | 6,840,325.64                            |
| 2.本期利润         | 12,386,095.80                           |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0153                                  |
| 4.期末基金资产净值     | 823,641,313.14                          |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0192                                  |

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。

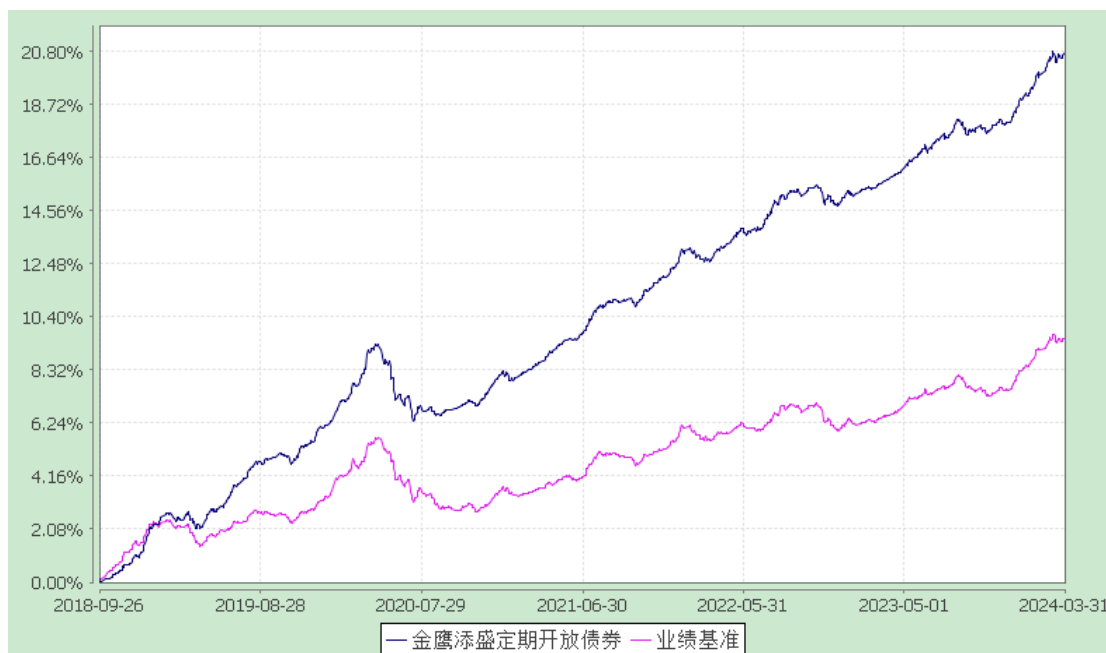
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

| 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      | 1.51%  | 0.08%     | 1.15%      | 0.05%         | 0.36%  | 0.03% |
| 过去六个月      | 2.50%  | 0.06%     | 1.90%      | 0.04%         | 0.60%  | 0.02% |
| 过去一年       | 4.23%  | 0.05%     | 2.82%      | 0.04%         | 1.41%  | 0.01% |
| 过去三年       | 11.19% | 0.05%     | 5.67%      | 0.04%         | 5.52%  | 0.01% |
| 过去五年       | 17.53% | 0.06%     | 7.13%      | 0.05%         | 10.40% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.75% | 0.06%     | 9.56%      | 0.05%         | 11.19% | 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

金鹰添盛定期开放债券型发起式证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018 年 9 月 26 日至 2024 年 3 月 31 日)



注：1.1 本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率×80%+1年期银行定期存款利率（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<br>年限 | 说明   |
|----|------------------------|-------------|------|------------|--|
|    |                        | 任职日期        | 离任日期 |            |  |
| 林暉 | 本基金的基金经理，公司绝对收益投资部副总经理 | 2019-07-12  | -    | 14         | 林暉先生，2010 年 4 月至 2012 年 12 月曾任兴业证券股份有限公司交易员，2012 年 12 月至 2015 年 4 月曾任中海基金管理有限公司基金经理助理，2015 年 4 月至 2016 年 8 月曾任兴业证券股份有限公司投资经理，2016 年 8 月至 2018 年 6 月曾任国泰君安证券资产管理有限公司投资经理。2018 年 6 月加入金鹰基金管理有限公司，担任投资经理。现任绝对收益投资部基金经理。 |

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 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

回顾一季度的债券市场，收益率在开年便开始快速下行，3 月初到达阶段低点，随后震荡。十年期国开债共下行 27BP，30 年期国开债下行 36 BP，1 年期国开债下行 35 BP。

主要影响因素为大背景机构高配时间叠加利率债供给偏慢带来资产荒放大，节奏推动因素如 12 月中央经济工作会议和政治局会议释放政策预期稳定；12 月新一轮存款利率调降带来降息预期升温；2 月 5 年 LPR 调降 25 BP 大幅超预期；利率因此呈现稳步下行趋势直至交易结构相对脆弱，以及两会公布将发行 1 万亿超长期特别国债加大市场对供给放量担忧，十债利率快速回调 8 BP 左右，随后开启区间震荡走势，波动有所放大，等待新的影响因素触发。目前看供给端较需求端更强，通胀较低，房地产销量仍在下行，经济活力有待进一步提升的背景下，利率整体风险相对可控。

同时从定价上看，当前实际利率仍旧处于历史高位，要想改变现状的话必须得是链条上的某个环节先出现松动和变化，或许要么是产业格局上出现较大变化，内需或是外需抬升改变当前各个行业产能过剩的局面，带动通胀的上行；要么是

进一步密集的宽松货币政策带动名义利率下行，来再次激发全社会动物精神的释放。从一季度情况来看，两个维度的变化都不大，外需仍旧是支撑一季度经济增速企稳的主体，调研的微观体感也是如此，而对于内需各家预期都较为被动和看不清楚，不过也许这正是新旧经济模式切换的常态，如果还是依赖于旧药方，那各家反而会觉得工具尚多，空间较大。

一季度组合债券部分仍旧维持较高的久期配置，3 月份利率低位顺势降低了 30 年期国债等超长端利率的仓位，替换为 10 年期国债，但基本保持组合久期未出现较大变化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.0192 元，本报告期份额净值增长率为 1.51%，同期业绩比较基准增长率为 1.15%。

#### 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            | 981,559,828.28 | 97.29        |
|    | 其中：债券             | 981,559,828.28 | 97.29        |
|    | 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          | 19,007,330.10  | 1.88         |
|    | 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 | 8,272,837.83     | 0.82   |
| 7 | 其他各项资产       | 47,585.93        | 0.00   |
| 8 | 合计           | 1,008,887,582.14 | 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      | 245,903,567.62 | 29.86        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 735,656,260.66 | 89.32        |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,951,598.36  | 3.76         |
| 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        | 981,559,828.28 | 119.17       |

### 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 | 019721  | 23 国债 18      | 1,350,000.00 | 136,919,219.18 | 16.62   |
| 2 | 2128015 | 21 农业银行小微债    | 700,000.00   | 72,299,740.98  | 8.78    |
| 3 | 2128020 | 21 招商银行小微债 02 | 700,000.00   | 71,951,806.56  | 8.74    |
| 4 | 2120071 | 21 上海银行       | 700,000.00   | 71,533,114.75  | 8.68    |
| 5 | 019730  | 23 国债 27      | 560,000.00   | 56,791,303.02  | 6.90    |

### 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、中国银行保险监督管理委员会随州监管分局的处罚。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招商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深圳监管局的处罚。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上海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上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。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广发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中信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徽商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合肥中心支行的处罚。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   | 47,585.93 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | -         |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |

|   |    |           |
|---|----|-----------|
| 9 | 合计 | 47,585.93 |
|---|----|-----------|

#### 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

|                |                |
|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 808,140,193.84 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 0.83           |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 38.43          |
| 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   | 808,140,156.24 |

### §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         | 10,000,000.00 |
| 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         | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 1.24          |

#### 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

| 项目              | 持有份<br>额总数        | 持有份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份<br>额总数        | 发起份额占<br>基金总份<br>额比例 | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-----------------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金       | 10,000,0<br>00.00 | 1.24%                | 10,000,0<br>00.00 | 1.24%                | 不少于 3 年        |
| 基金管理人高级管理<br>人员 | -                 | -                    | -                 | -                    | -              |
| 基金经理等人员         | -                 | -                    | -                 | -                    | -              |
| 基金管理人股东         | -                 | -                    | -                 | -                    | -              |
| 其他              | -                 | -                    | -                 | -                    | -              |
| 合计              | 10,000,0<br>00.00 | 1.24%                | 10,000,0<br>00.00 | 1.24%                | 不少于 3 年        |

注：本基金的管理人发起资金持有期限已经届满3年。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

## 9.1 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<br>别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                |                    |      |      | 报告期末持有基金<br>情况     |                  |
|--|----------------|--------------------------------|--------------------|------|------|--------------------|------------------|
|  | 序号             | 持有基金份额比<br>例达到或者超过<br>20%的时间区间 | 期初份额               | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额               | 份<br>额<br>占<br>比 |
| 机构   | 1              | 20240101-2024033<br>1          | 798,139,3<br>11.48 | 0.00 | 0.00 | 798,139,311<br>.48 | 98.76<br>%       |
| 产品特有风险   |                |                                |                    |      |      |                    |                  |
| <p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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</p> |                |                                |                    |      |      |                    |                  |

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。

## 9.2 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、中国证监会批准基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰添盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰添盛定期开放债券型发起式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  
二〇二四年四月二十二日