

# 金鹰添悦 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

### 2024 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

## §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 10 月 24 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 金鹰添悦 60 天滚动持有短债  |
| 基金主代码      | 016088   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022 年 12 月 20 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 193,727,124.06 份   |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险、保持较高流动性的前提下，重点投资于短期债券资产，力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。                  |
| 投资策略       | 本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行和金融市场运行趋势，在保证投资低风险的基础上谨慎投资，力争实现组合的稳健增值。本基金以长期利率趋势分析为基 |

|                 |   |                   |
|-----------------|---|-------------------|
|                 | 础，结合经济变化趋势、货币政策、不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，综合运用久期配置、类属配置、期限结构配置以及个券选择等多种积极管理策略，深入挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。 |                   |
| 业绩比较基准          | 中证短债指数收益率*85%+一年期定期存款利率（税后）*15%   |                   |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。  |                   |
| 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     | 金鹰添悦 60 天滚动持有短债 A   | 金鹰添悦 60 天滚动持有短债 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 016088  | 016089            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 95,160,135.25 份   | 98,566,988.81 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<br>(2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日) |                   |
|-----------|---|-------------------|
|           | 金鹰添悦 60 天滚动持有短债 A                       | 金鹰添悦 60 天滚动持有短债 C |
| 1.本期已实现收益 | 321,164.27                              | 506,450.40        |
| 2.本期利润    | -969,004.10                             | -202,008.10       |

|                |               |                |
|----------------|---------------|----------------|
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0113       | -0.0016        |
| 4.期末基金资产净值     | 98,196,621.00 | 101,201,646.54 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0319        | 1.0267         |

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、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、金鹰添悦 60 天滚动持有短债 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      | -0.14% | 0.07%     | 0.43%      | 0.01%         | -0.57% | 0.06% |
| 过去六个月      | 0.78%  | 0.06%     | 1.02%      | 0.01%         | -0.24% | 0.05% |
| 过去一年       | 2.94%  | 0.06%     | 2.31%      | 0.01%         | 0.63%  | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.20%  | 0.05%     | 4.30%      | 0.01%         | -0.10% | 0.04% |

#### 2、金鹰添悦 60 天滚动持有短债 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 | -0.18% | 0.07%     | 0.43%      | 0.01%         | -0.61% | 0.06% |
| 过去六个月 | 0.51%  | 0.06%     | 1.02%      | 0.01%         | -0.51% | 0.05% |
| 过去一年  | 2.56%  | 0.06%     | 2.31%      | 0.01%         | 0.25%  | 0.05% |
| 自基金合  | 3.68%  | 0.05%     | 4.30%      | 0.01%         | -0.62% | 0.04% |

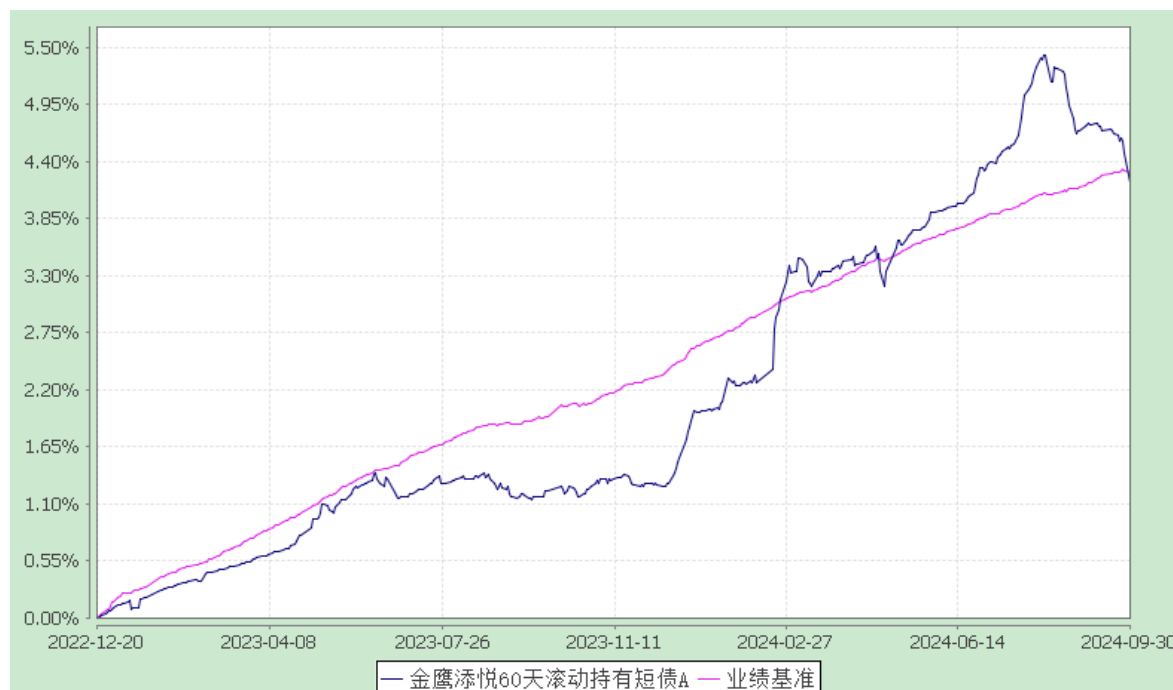
|            |  |  |  |  |  |  |
|------------|--|--|--|--|--|--|
| 同生效起<br>至今 |  |  |  |  |  |  |
|------------|--|--|--|--|--|--|

### 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

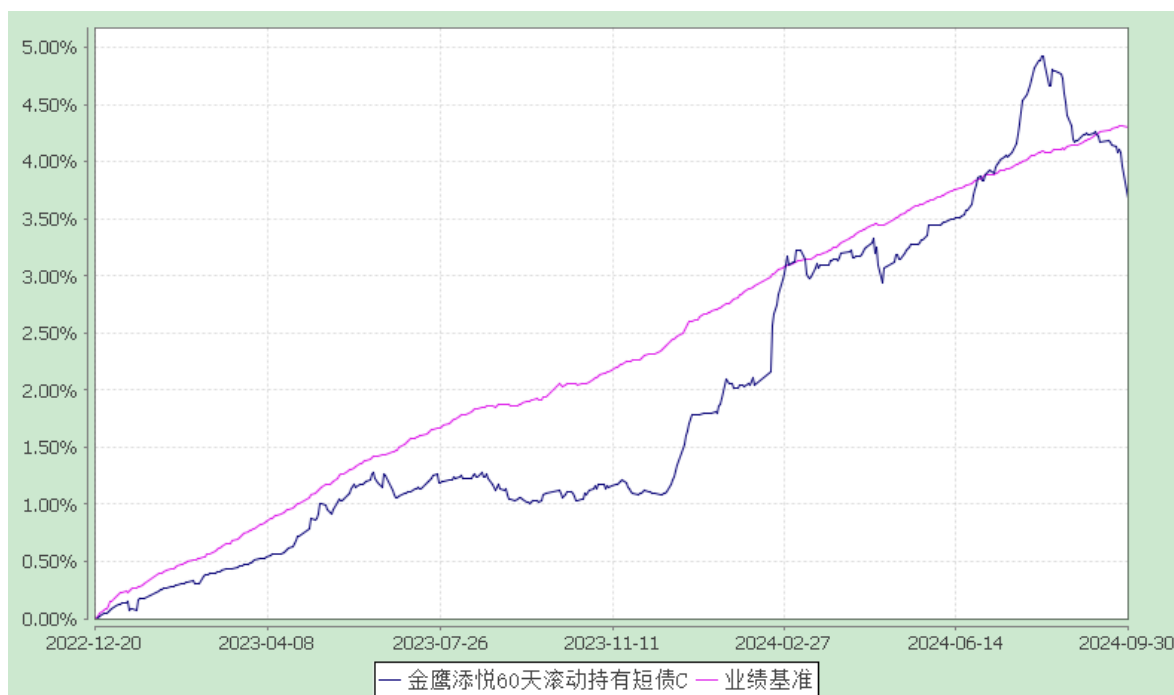
金鹰添悦 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022 年 12 月 20 日至 2024 年 9 月 30 日)

#### 1. 金鹰添悦 60 天滚动持有短债 A:



#### 2. 金鹰添悦 60 天滚动持有短债 C:



注：1、本基金业绩比较基准为：中证短债指数收益率\*85%+一年期定期存款利率（税后）\*15%。

## §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 |        |  |
| 邹卫 | 本基金的基金经理，公司固定收益研究部总经理 | 2024-01-12  | -    | 13     | 邹卫先生，历任中信证券华南股份有限公司研究员，广州广证恒生市场研究有限公司研究员，中信证券华南股份有限公司资产管理部投资经理，金鹰基金管理有限公司风险管理部副总监，广州金鹰资产管理有限公司总经理助理。2017年12月加入金鹰基金管理有限公司，历任固定收益研究部总经理、特定资产投资管理部总经理、投资经理，现任固定收益研究部总经理、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

回顾三季度，债券市场经历了较大幅度波动调整。24 年 7 月，央行公告货币市场临时操作工具，以及借券卖出等相关公告，抬高 7 月中上旬长端利率；7 月下旬 OMO 预期外调降，利率中枢下行；8 月以来政府债发行加速，资金扰动因素较多，同时大行卖券、强监管信号持续释放，长短端利率均向上调整；8 月下旬资金情况好转，债市修复性下行；9 月美联储降息 50BP，国内降准降息预期抬升，利率整体大幅下行。但到 9 月底，货币政策、地产、消费等政策频出，市场风险偏好大幅转向，权益市场快速升温，理财和基金均面临大幅赎回，债券利率快速上行。

展望四季度，从基本面看，当下国内经济环境仍待改善，从宽财政到宽信用传导时间不确定性高，同时央行在季末降准降息，将大幅缓解银行端负债压力并降低成本，债券资产性价比在提升，利率继续大幅上行空间受到制约。在短期的赎回冲击后，市场走势仍会回到基本面逻辑，在流动性宽松的环境下，债券市场有望得到修复。由于本基金是中短期纯债基金，在符合流动性和安全性要求的前提下，我们会重点配置高性价比的短期利率债和信用债，并适当搭配各久期券种，在获得稳定的票息收益的同时获取一定的资本利得。

#### 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 1.0319 元，本报告期份额净值增长率为-0.14%，同期业绩比较基准增长率为 0.43%；C 类基金份额净值为 1.0267 元，本报告期份额净值增长率为-0.18%，同期业绩比较基准增长率为 0.43%。

#### 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            | 236,040,159.19 | 96.46  |
|   | 其中：债券             | 236,040,159.19 | 96.46  |
|   | 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          | -              | -      |
|   | 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      | 6,653,644.04   | 2.72   |
| 7 | 其他各项资产            | 1,997,584.52   | 0.82   |
| 8 | 合计                | 244,691,387.75 | 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。

## 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 | 8,371,043.51 | 4.20         |
| 2  | 央行票据 | -            | -            |

|    |           |                |        |
|----|-----------|----------------|--------|
| 3  | 金融债券      | 151,219,918.98 | 75.84  |
|    | 其中：政策性金融债 | 15,162,780.82  | 7.60   |
| 4  | 企业债券      | -              | -      |
| 5  | 企业短期融资券   | 10,040,945.21  | 5.04   |
| 6  | 中期票据      | 66,408,251.49  | 33.30  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -      |
| 8  | 同业存单      | -              | -      |
| 9  | 其他        | -              | -      |
| 10 | 合计        | 236,040,159.19 | 118.38 |

#### 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<br>(元)   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|----------|------------|---------------|----------------------|
| 1  | 148206 | 23 长城 01 | 200,000.00 | 20,359,377.53 | 10.21                |
| 2  | 115489 | 23 平证 10 | 200,000.00 | 20,234,923.84 | 10.15                |
| 3  | 149900 | 22 国元 01 | 170,000.00 | 17,267,350.85 | 8.66                 |
| 4  | 185269 | 22 兴业 01 | 160,000.00 | 16,260,361.64 | 8.15                 |
| 5  | 115346 | 23 华泰 G8 | 150,000.00 | 15,220,505.75 | 7.63                 |

#### 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华泰证券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江苏省分行的处罚。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   | 11,392.48    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,982,993.60 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 3,198.44     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 1,997,584.52 |
|---|----|--------------|

#### 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             | 金鹰添悦60天滚动<br>持有短债A | 金鹰添悦60天滚动<br>持有短债C |
|----------------|--------------------|--------------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 14,688,417.51      | 101,430,845.92     |
| 报告期期间基金总申购份额   | 129,940,274.00     | 97,003,307.93      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 49,468,556.26      | 99,867,165.04      |
| 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   | 95,160,135.25      | 98,566,988.81      |

### §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

无交易。

## §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、中国证监会批准发行及募集的文件。
- 2、《金鹰添悦 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰添悦 60 天滚动持有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

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  
二〇二四年十月二十五日