金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

(上接 B483 版)

本基金本报告期内无分部报告。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内无需说明的重要会计政策变更。

6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内无会计估计变更。

6.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.2.4.6 税项

1、印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84 号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》的规定，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 1‰调整为 3‰。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

经国务院批准，根据财政部、国家税务总局《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》的规定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，证券(股票)交易印花税调整为单边征税，由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》，自 2016 年 5 月 1 日起，证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《财政部、税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入，债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》以及财政部、国家税务总局、证监会财税字[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

6.2.4.7 关联方关系

6.2.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经本基金管理人 2016 年第三次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准(证监许可[2017]2135)，本基金管理人原股东美的集团股份有限公司、东亚联丰投资管理有限公司分别将其持有的本基金管理人 20%和 11%股权转让给东旭集团有限公司。本次股权转让后，本基金管理人股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州证券股份有限公司 9.80%。本基金管理人已完成股权变更事项的工商变更登记。

6.2.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人

6.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行股票交易。

6.2.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行权证交易。

6.2.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行债券交易。

6.2.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.2.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和使用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.2.4.8.2 关联方报酬

6.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 27 日	上年度可比期间 2017年 2 月 16 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	149,099.95	232,666.59
其中：支付销售机构的客户维护费	50,274.44	77,551.82

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E× 0.30%÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值；

2、基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 27 日	上年度可比期间 2017年 2 月 16 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	49,699.99	77,555.51

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E× 0.10%÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.2.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均没有应支付关联方的销售费。

6.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.2.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.2.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 27 日		上年度可比期间 2017年 2 月 16 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	1,802,144.01	10,005.34	3,976,346.03	90,602.52

注：本基金本报告期末的清算备付金余额 53,333.33 元，结算备付金利息收入 206.47 元。上年度可比期间期末结算备付金期末余额为 0，结算备付金利息收入 0。

6.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.2.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.2.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项的说明。

6.2.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期未投资基金。

6.2.4.9 期末(2018 年 3 月 27 日)本基金持有的流通受限证券

6.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无认购/新发股票或债券流通受限情况。

6.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

6.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2018 年 3 月 27 日，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2018 年 3 月 27 日，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.2.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，相关债券的公允价值属第二层次。

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金

(报告期：2018 年 3 月 28 日 -2018 年 6 月 30 日)

7.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,466,191,000.00	97.31
	其中：债券	1,466,191,000.00	97.31
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,000,000.00	0.13
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,600,631.88	0.17
8	其他各项资产	35,906,729.28	2.38
9	合计	1,506,698,361.16	100.00

注：其他各项资产包括：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、买入返售证券。

7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1 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进行股票投资。

7.1.2.2 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。

7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	-
卖出股票的收入(成交)总额	-

7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,373,000.00	23.92
6	中期票据	79,598,000.00	37.80
7	可转债(可交换债)	-	-
8	其他	-	-
9	合计	198,431,000.00	94.24

7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	101759003	17康得新 MTN001	800,000.00	77,784,000.00	5.17
2	101761029	17徐州经开 MTN005	800,000.00	77,160,000.00	5.12
3	180404	18农发 04	700,000.00	70,210,000.00	4.66
4	101661033	16衡阳水投 MTN001	700,000.00	66,360,000.00	4.41
5	101800322	18岱胜电子 MTN001	500,000.00	51,715,000.00	3.43

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

7.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.10.1 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。

7.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.1.11.2 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持有国债期货。

7.1.12 本报告期投资基金情况

7.1.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期内未投资基金。

7.1.13 投资组合报告附注

7.1.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

7.1.13.2 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。

7.1.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,481.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,898,247.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,906,729.28

7.1.13.4 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。

7.1.13.5 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。

7.1.13.6 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。

7.2 金鹰添润纯债债券型证券投资基金

(报告期：2018 年 1 月 1 日 -2018 年 3 月 27 日)

7.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	198,431,000.00	94.04
	其中：债券	198,431,000.00	94.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	4,500,000.00	2.13
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,855,477.34	0.88
8	其他各项资产	6,214,399.99	2.95
9	合计	211,000,877.33	100.00

注：其他各项资产包括：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、买入返售证券。

7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1 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进行股票投资。

7.2.2.2 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。

7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期内未进行股票投资。7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.2.4.2 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	-
卖出股票的收入(成交)总额	-

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,996,000.00	4.75
	其中：政策性金融债	9,996,000.00	4.75
4	企业债券	58,464,000.00	27.77
5	企业短期融资券	50,373,000.00	23.92
6	中期票据	79,598,000.00	37.80
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	198,431,000.00	94.24

7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	101479002	14茂名港 MTN002	200,000.00	20,518,000.00	9.74
2	101760030	17中通客车 MTN001	200,000.00	20,290,000.00	9.64
3	041760026	17遂宁开达 CP001	200,000.00	20,212,000.00	9.60
4	041762023	17海王生物 CP001	200,000.00	20,092,000.00	9.54
5	1480124	14鸠江建投债	200,000.00	16,808,000.00	7.98

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

7.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资资产贵金属。

7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.10.1 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。

7.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.2.11.2 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持有国债期货。

7.2.12 本报告期投资基金情况

7.2.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期内未投资基金。

7.2.13 投资组合报告附注

7.2.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

7.2.13.2 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。

7.2.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,214,300.07
5	应收申购款	99.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,214,399.99

7.2.13.4 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。

7.2.13.5 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。

7.2.13.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金

(报告期：2018 年 3 月 28 日 -2018 年 6 月 30 日)

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
219	6,903,264.31	1,511,785,812.27	100.00%	29,071.36	0.00%

8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	247.61	0.00%

8.1.3 发起式基金发起资金持有份额情况

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
基金管理人固有资金	9,937,388.19	0.66%	9,937,388.19	1.22%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,937,388.19	0.66%	9,937,388.19	1.22%	不少于 3 年

注：发起份额占基金总份额比例中的“基金总份额”为本基金申购确认日的总份额。

8.2 金鹰添润纯债债券型证券投资基金

(报告期：2018 年 1 月 1 日 -2018 年 3 月 27 日)

8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
225	933,458.26	209,999,000.00	99.99%	29,109.33	0.01%

8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	247.61	0.00%

8.2.3 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 开放式基金份额变动

9.1 金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金

(报告期：2018 年 3 月 28 日 -2018 年 6 月 30 日)

单位：份

基金合同生效日(2018 年 3 月 28 日)基金份额总额	210,028,109.33
本报告期基金总申购份额	1,301,786,816.98
减：本报告期基金总赎回份额	42.68
本报告期基金份额分拎份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,511,814,883.63

9.2 金鹰添润纯债债券型证券投资基金

(报告期：2018 年 1 月 1 日 -2018 年 3 月 27 日)

单位：份

本报告期期初基金份额总额	210,015,952.15
本报告期基金总申购份额	14,876.78
减：本报告期基金总赎回份额	2,719.60
本报告期基金拎分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	210,028,109.33

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

金鹰添润纯债债券型证券投资基金的基金份额持有人大会于 2018 年 2 月 26 日至 2018 年 3 月 20 日 12:00 以通讯方式召开，会议审议通过了《关于金鹰添润纯债债券型证券投资基金转型相关事项的议案》。金鹰添润纯债债券型证券投资基金于 2018 年 3 月 27 日转型为金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金，自 2018 年 3 月 28 日起，金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效。相关事项详情请查阅本基金管理人相关公告。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经本基金管理人第六届董事会第八次会议审议通过，报中国证券监督管理委员会广东监管局备案，并于 2018 年 1 月 18 日在证监会指定媒体披露，李兆廷先生自 2018 年 1 月 15 日起担任本基金管理人的董事长。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金

(报告期：2018 年 3 月 28 日 -2018 年 6 月 30 日)

10.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

10.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
民生证券	113,072,945.21	100.00%	66,500,000.00	100.00%	-	-

10.7.2 金鹰添润纯债债券型证券投资基金

(报告期：2018 年 1 月 1 日 -2018 年 3 月 27 日)

10.7.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	2	-	-	-	-	-

本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

2、金鹰基金管理有限公司托管于交通银行的所有理财产品共用交易席位。

10.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财通证券	-	-	31,000,000.00	100.00%	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金

11.1.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 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	2018年 3 月 28 日至 2018 年 6 月 30 日	209,999,000.00	1,291,849,424.08	-	1,501,848,424.08	99.34%

产品特有风险

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：

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；

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；

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；

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，可能导致本基金规模过小。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。

6)份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险；当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

11.2 金鹰添润纯债债券型证券投资基金

11.2.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 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	2018年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 27 日	209,999,000.00	-	-	209,999,000.00	99.99%

产品特有风险

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：

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；

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；

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；

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，可能导致本基金规模过小。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。

6)份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险；当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

11.3 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决