

中银稳健添利债券型发起式证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

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 | 中银添利债券发起 |
| 基金主代码 | 380009 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 2 月 4 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,465,801,744.08 份 |
| 投资目标 | 本基金在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金根据对宏观经济趋势、国家政策方向、行业和企业盈利、信用状况及其变化趋势、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等因素的动态分析，在限定投资范围内，决定债券类资产和权益类资产的配置比例，并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期或不定期对大类资产配置比例进行调整。在充分论证债券市场宏观 |

| | | | |
|-----------------|--|--------------------|------------------|
| | 环境和仔细分析利率走势基础上，依次通过久期配置策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用利差策略和回购放大策略自上而下完成组合构建。 | | |
| 业绩比较基准 | 中国债券综合全价指数。 | | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | | |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 | | |
| 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 | 中银添利债券发起 A | 中银添利债券发起 C | 中银添利债券发起 E |
| 下属分级基金的交易代码 | 380009 | 005852 | 007100 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,904,715,262.93 份 | 1,193,702,057.53 份 | 367,384,423.62 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) | | |
|-----------------|---|------------------|----------------|
| | 中银添利债券发起 A | 中银添利债券发起 C | 中银添利债券发起 E |
| 1. 本期已实现收益 | 37,026,001.99 | 12,551,753.21 | 1,587,235.69 |
| 2. 本期利润 | 51,478,665.00 | 13,863,500.21 | -134,365.74 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0185 | 0.0139 | -0.0008 |
| 4. 期末基金资产 | 3,835,109,341.61 | 1,551,893,908.09 | 479,060,540.98 |

| | | | |
|-----------------|-------|-------|-------|
| 净值 | | | |
| 5. 期末基金份额 净值 | 1.320 | 1.300 | 1.304 |

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所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、中银添利债券发起 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 | 1.40% | 0.08% | 0.83% | 0.06% | 0.57% | 0.02% |
| 过去六个月 | 2.69% | 0.08% | 1.28% | 0.05% | 1.41% | 0.03% |
| 过去一年 | 5.44% | 0.09% | 2.13% | 0.04% | 3.31% | 0.05% |
| 过去三年 | 17.02% | 0.11% | 4.80% | 0.07% | 12.22% | 0.04% |
| 过去五年 | 27.67% | 0.11% | 1.62% | 0.07% | 26.05% | 0.04% |
| 自基金合同 生效日起 | 79.89% | 0.13% | 8.83% | 0.08% | 71.06% | 0.05% |

2、中银添利债券发起 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 | 1.34% | 0.08% | 0.83% | 0.06% | 0.51% | 0.02% |
| 过去六个月 | 2.57% | 0.08% | 1.28% | 0.05% | 1.29% | 0.03% |
| 过去一年 | 5.12% | 0.10% | 2.13% | 0.04% | 2.99% | 0.06% |
| 过去三年 | 15.85% | 0.12% | 4.80% | 0.07% | 11.05% | 0.05% |
| 自基金合同 生效日起 | 18.62% | 0.11% | 6.09% | 0.07% | 12.53% | 0.04% |

3、中银添利债券发起 E：

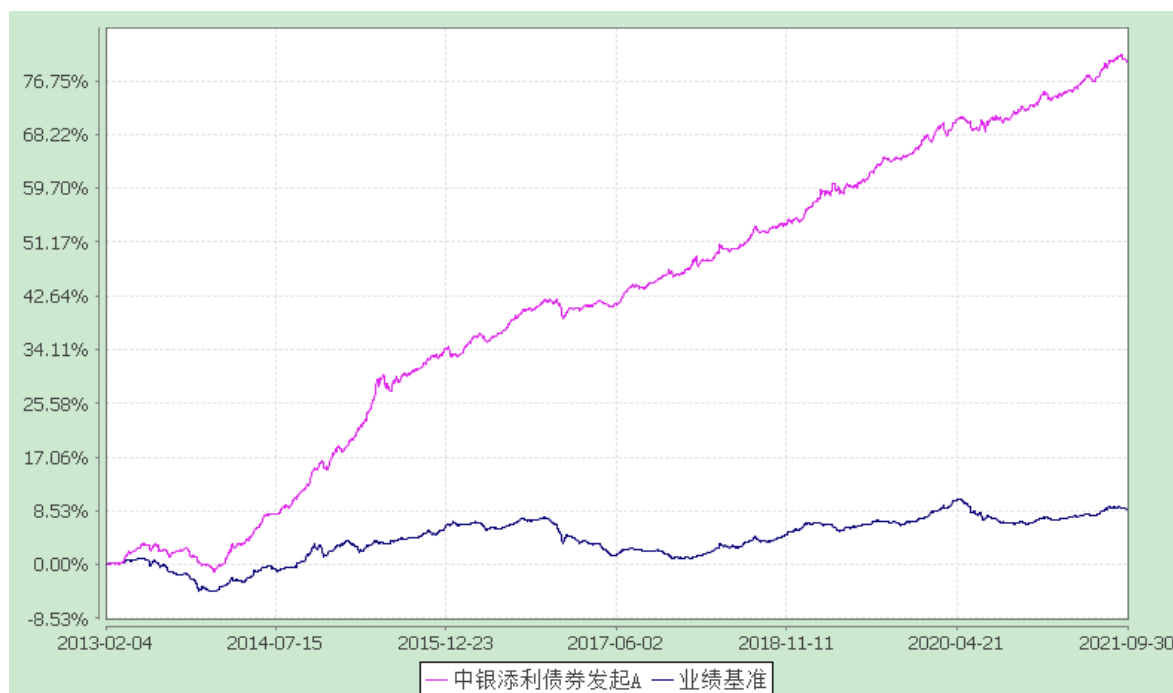
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 1.34% | 0.09% | 0.83% | 0.06% | 0.51% | 0.03% |
| 过去六个月 | 2.56% | 0.08% | 1.28% | 0.05% | 1.28% | 0.03% |

| | | | | | | |
|-----------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去一年 | 5.02% | 0.09% | 2.13% | 0.04% | 2.89% | 0.05% |
| 自基金合同生效日起 | 11.96% | 0.11% | 2.37% | 0.07% | 9.59% | 0.04% |

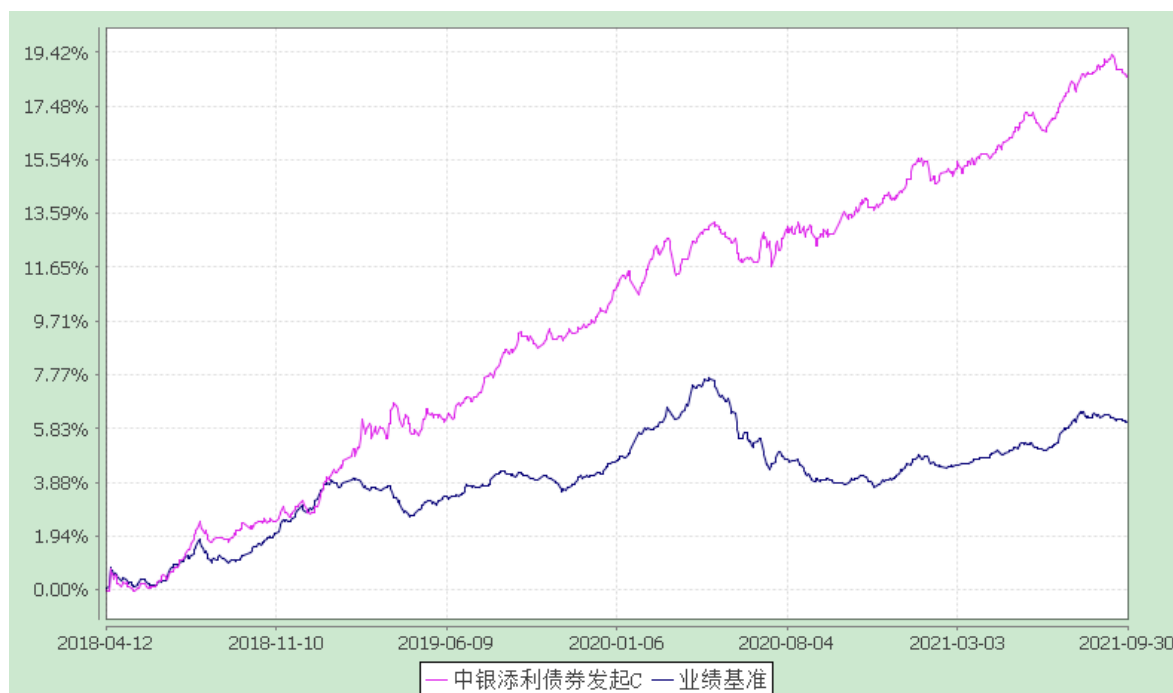
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银稳健添利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的历史走势对比图
 (2013 年 2 月 4 日至 2021 年 9 月 30 日)

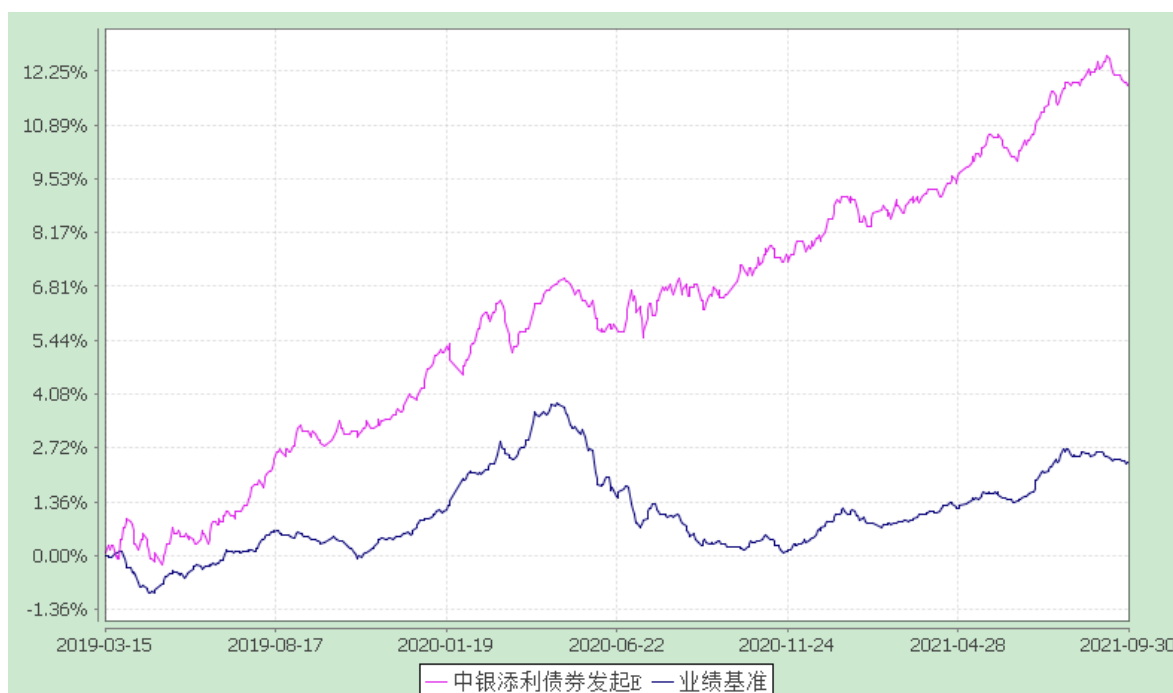
1. 中银添利债券发起 A:



2. 中银添利债券发起 C:



3. 中银添利债券发起 E:



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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 | | |
| 陈玮 | 固定收益投资部副总经理、基金经理 | 2014-12-31 | - | 13 | 中银基金管理有限公司固定收益投资部副总经理、副总裁（VP），应用数学硕士。曾任上海浦东发展银行总行金融市场部高级交易员。2014 年加入中银基金管理有限公司，曾担任固定收益基金经理助理。2014 年 12 月至今任中银纯债基金基金经理，2014 年 12 月至今任中银添利基金基金经理，2014 年 12 月至 2020 年 12 月任中银盛利纯债基金基金经理，2015 年 5 月至 2018 年 2 月任中银新趋势基金基金经理，2015 年 6 月至 2021 年 5 月任中银聚利基金基金经理，2019 年 9 月至今任中银招利基金基金经理，2020 年 10 月至今任中银中高等级债券基金基金经理，2021 年 2 月至今任中银恒优基金基金经理，2021 年 6 月至今任中银通利基金基金经理。具备基金从业资格。 |

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，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。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析

国外经济方面，全球疫情高位回落，疫苗接种速度边际放缓。美国经济修复速度放缓，服务消费持续修复，商品消费增速边际放缓，失业率 8 月值较 6 月值下降 0.7 个百分点至 5.2%，制造业 PMI 9 月值较 6 月值上升 0.5 个百分点至 61.1，服务业 PMI 9 月值较 6 月值上升 1.8 个百分点至 61.9。美联储大概率 11 月宣布 Taper，基建计划规模两党尚未达成一致，债务上限问题被延期至 12 月。欧元区经济复苏边际放缓，失业率 8 月值较 6 月值回落 0.3 个百分点至 7.5%，制造业 PMI 9 月值较 6 月值回落 4.8 个百分点至 58.6，服务业 PMI 9 月值较 6 月值回落 1.9 个百分点至 56.4。欧央行小幅放缓 PEPP 购债规模，但目前对市场影响有限。日本经济恢复缓慢，岸田文雄就任日本第 100 任首相，应对新冠疫情和重振经济成为新政权的重点课题。

国内经济方面，“能耗双控”背景下供需双弱，经济下行压力加大。具体来看，领先指标中采

制造业 PMI 于三季度中枢回落，9 月值回落至 50 以下，较 6 月回落 1.3 个百分点至 49.6，同步指标工业增加值 8 月同比增长 5.3%，较 2021 年 6 月回落 3.0 个百分点。从经济增长动力来看，出口表现相对强劲，消费投资有所回落：8 月美元计价出口增速较 2021 年 6 月回落 6.6 个百分点至 25.6% 左右，仍处于较高位置，8 月消费同比增速大幅回落，较 2021 年 6 月回落 9.6 个百分点至 2.5%，制造业表现好于房地产和基建投资，1-8 月固定资产投资增速较 2021 年二季度末回落 3.7 个百分点至 8.9% 的水平。通胀方面，CPI 震荡回落，8 月同比增速较 2021 年 6 月下降 0.3 个百分点至 0.8%；PPI 继续上行，8 月同比增速较 2021 年 6 月回升 0.7 个百分点至 9.5%。

2. 市场回顾

债券市场方面，三季度债市各品种小幅上涨。其中，三季度中债总全价指数上涨 1.25%，中债银行间国债全价指数上涨 1.54%，中债企业债总全价指数上涨 0.45%。在收益率曲线上，三季度收益率曲线走势平坦化。其中，三季度 10 年期国债收益率从 3.08% 回落 20bp 至 2.88%，10 年期金融债（国开）收益率从 3.49% 回落 29bp 至 3.20%。货币市场方面，7 月央行降准释放 1 万亿流动性，央行公开市场小幅缩量续作，银行间资金面总体平衡，其中，三季度银行间 1 天回购加权平均利率均值在 2.06% 左右，较上季度均值上行 5bp，银行间 7 天回购利率均值在 2.28% 左右，与上季度均值基本持平。

股票市场方面，三季度上证综指下跌 0.64%，代表大盘股表现的沪深 300 指数下跌 6.85%，中小板综合指数下跌 0.10%，创业板综合指数下跌 2.95%。可转债方面，三季度中证转债指数上涨 6.39%。权益市场震荡收跌，转债估值拉升至历史高位。个券方面，百川转债、长城转债、台华转债、国微转债、新春转债等正股强势的品种整体表现相对较好，分别上涨 107.66%、93.87%、91.45%、83.23%、81.58%。

3. 运行分析

三季度权益市场先涨后跌，债券市场各品种小幅上涨。策略上，我们降低权益资产投资比例，重点投资估值合理的各细分行业龙头公司，适当参与高景气行业的投资机会，在可转债估值上升过程中逐步降低风险暴露；债券方面维持适当杠杆比例，显著提升组合久期，重点配置利率债和高等级信用债，积极参与波段投资机会，借此提升基金的业绩表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 1.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 1.34%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%。

报告期内，本基金 E 类份额净值增长率为 1.34%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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 | 168,209,450.70 | 2.55 |
| | 其中：股票 | 168,209,450.70 | 2.55 |
| 2 | 固定收益投资 | 6,237,484,670.98 | 94.40 |
| | 其中：债券 | 6,006,473,870.98 | 90.90 |
| | 资产支持证券 | 231,010,800.00 | 3.50 |
| 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 | 40,943,150.33 | 0.62 |
| 7 | 其他各项资产 | 161,114,886.62 | 2.44 |
| 8 | 合计 | 6,607,752,158.63 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务，本基金报告期末未投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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**

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值 |
|----|------|---------|---------|
|----|------|---------|---------|

| | | | 比例 (%) |
|---|------------------|----------------|--------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 109,597,644.70 | 1.87 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 40,038,010.00 | 0.68 |
| K | 房地产业 | 18,573,796.00 | 0.32 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 168,209,450.70 | 2.87 |

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

| 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(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 000001 | 平安银行 | 1,568,200 | 28,117,826.00 | 0.48 |
| 2 | 600438 | 通威股份 | 481,600 | 24,532,704.00 | 0.42 |
| 3 | 000002 | 万科A | 871,600 | 18,573,796.00 | 0.32 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 391,700 | 14,767,090.00 | 0.25 |
| 5 | 601012 | 隆基股份 | 176,073 | 14,522,501.04 | 0.25 |
| 6 | 601688 | 华泰证券 | 701,600 | 11,920,184.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 7 | 002466 | 天齐锂业 | 96,300 | 9,782,154.00 | 0.17 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 238,689 | 9,738,511.20 | 0.17 |
| 9 | 000513 | 丽珠集团 | 243,600 | 9,454,116.00 | 0.16 |
| 10 | 002756 | 永兴材料 | 91,800 | 8,636,544.00 | 0.15 |

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 | 327,632,000.00 | 5.59 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,196,090,000.00 | 20.39 |
| | 其中：政策性金融债 | 781,770,000.00 | 13.33 |
| 4 | 企业债券 | 2,388,639,000.00 | 40.72 |
| 5 | 企业短期融资券 | 60,102,000.00 | 1.02 |
| 6 | 中期票据 | 848,040,000.00 | 14.46 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 196,399,870.98 | 3.35 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 989,571,000.00 | 16.87 |
| 10 | 合计 | 6,006,473,870.98 | 102.39 |

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 | 170210 | 17 国开 10 | 4,600,000 | 480,056,000.00 | 8.18 |
| 2 | 210005 | 21 付息国债 05 | 2,700,000 | 285,120,000.00 | 4.86 |
| 3 | 163584 | 20 中证 09 | 1,200,000 | 119,496,000.00 | 2.04 |
| 4 | 188762 | 21 光证 G8 | 1,100,000 | 109,637,000.00 | 1.87 |

| | | | | | |
|---|-----------|------------------|-----------|--------------------|------|
| 5 | 101901600 | 19 陕煤化 MTN006 | 1,000,000 | 102,260,000.0 0 | 1.74 |
|---|-----------|------------------|-----------|--------------------|------|

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 | 165523 | G 国电 2 优 | 300,000 | 30,324,000.00 | 0.52 |
| 2 | 137419 | 恒煦 03A1 | 300,000 | 30,222,000.00 | 0.52 |
| 3 | 136427 | 云庐 5 优 | 300,000 | 29,985,000.00 | 0.51 |
| 4 | 189761 | 龙控 09 优 | 300,000 | 29,979,000.00 | 0.51 |
| 5 | 2189305 | 21 惠益 M4A2 | 280,000 | 27,879,600.00 | 0.48 |
| 6 | 138623 | 时联 03 优 | 250,000 | 25,100,000.00 | 0.43 |
| 7 | 137364 | 20 阳光优 | 200,000 | 20,194,000.00 | 0.34 |
| 8 | 137413 | 万科 16 优 | 160,000 | 16,060,800.00 | 0.27 |
| 9 | 165728 | 20 首置优 | 300,000 | 13,260,000.00 | 0.23 |
| 10 | 189219 | 威新 08 优 | 80,000 | 8,006,400.00 | 0.14 |

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

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参与股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2020 年 12 月 24 日，中国证监会对中信证券股份有限公司采取警示函监管措施的决定，2021 年 1 月 23 日，中国证券监督管理委员会深圳证监局对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定。基金管理人通过对该发行人进一步了解分析后，认为该处分不会对 20 中证 09（163584）的投资价值构成实质性影响，因此未披露处罚事宜。

2021 年 3 月 24 日，海通证券股份有限公司公告收到通知，中国证券监督管理委员会上海监管局对海通证券股份有限公司及其子公司采取责令增加内部合规检查的次数并提交合规检查报告、责令暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务 12 个月的监督管理措施。基金管理人通过对该发行人进一步了解分析后，认为该处分不会对 20 海通 01（163148）的投资价值构成实质性影响，因此未披露处罚事宜。

2021 年 7 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会对上海浦东发展银行股份有限公司进行行政处罚，上海浦东发展银行股份有限公司被处 6920 万元的罚款，共涉及 31 项主要违法违规事实。基金管理人通过对该发行人进一步了解分析后，认为该处分不会对浦发转债（110059）的投资价值构成实质性影响，因此未披露处罚事宜。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有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 | 199,300.93 |
| 2 | 应收证券清算款 | 72,925,098.62 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 81,902,298.88 |
| 5 | 应收申购款 | 6,088,188.19 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|----------------|
| 9 | 合计 | 161,114,886.62 |
|---|----|----------------|

5.11.4 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 | 110059 | 浦发转债 | 84,195,155.70 | 1.44 |
| 2 | 132011 | 17 浙报 EB | 42,608,685.00 | 0.73 |
| 3 | 123049 | 维尔转债 | 31,793,671.60 | 0.54 |
| 4 | 113017 | 吉视转债 | 17,446,888.20 | 0.30 |
| 5 | 123085 | 万顺转 2 | 5,353,857.08 | 0.09 |
| 6 | 127030 | 盛虹转债 | 5,221,000.00 | 0.09 |
| 7 | 110074 | 精达转债 | 3,560,517.10 | 0.06 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票中无流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告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 | 中银添利债券发起A | 中银添利债券发起C | 中银添利债券发起E |
|---------------|------------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,534,487,655.19 | 592,372,382.00 | 39,118,651.56 |
| 本报告期基金总申购份额 | 597,724,890.28 | 662,008,444.73 | 415,816,844.52 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 227,497,282.54 | 60,678,769.20 | 87,551,072.46 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------------|------------------|----------------|
| 本报告期末基金份 额总额 | 2,904,715,262.93 | 1,193,702,057.53 | 367,384,423.62 |
|-----------------|------------------|------------------|----------------|

§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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

截至本报告期末，本基金已成立超过三年，无发起资金持有份额情况。

§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 | 2021-07-01 至 2021-08-05 | 758,67 1,732. 97 | 31,587 ,392.3 6 | 0.00 | 790,259,125 .33 | 17.6958% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；（4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。 | | | | | | | |

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银稳健添利债券型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《中银稳健添利债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 www.bocim.com。

10.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人网站 www.bocim.com 查阅。

中银基金管理有限公司
二〇二一年十月二十六日