

# 招商添德 3 个月定期开放债券型发起 式证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| §1 重要提示及目录.....                              | 1  |
| 1.1 重要提示.....                                | 1  |
| 1.2 目录.....                                  | 2  |
| §2 基金简介.....                                 | 4  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 4  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 4  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 5  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 5  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                        | 5  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 5  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 6  |
| §4 管理人报告.....                                | 7  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 7  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 8  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 8  |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 9  |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 11 |
| 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....               | 12 |
| §5 托管人报告.....                                | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                      | 12 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13 |
| 6.2 利润表.....                                 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 16 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| §7 投资组合报告.....                               | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 33 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 33 |
| 7.3 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.....       | 33 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 33 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 34 |
| 7.6 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.....      | 34 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 34 |
| 7.8 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贵金属投资明细.....   | 34 |
| 7.9 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.....      | 34 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 35 |

|   |    |
|---|----|
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 35 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                      | 35 |
| §8 基金份额持有人信息.....                       | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 37 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 37 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 38 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                | 38 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 38 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 39 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 39 |
| 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.....   | 39 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 39 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 39 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 39 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 39 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 40 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 40 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 42 |
| 11.1 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..... | 42 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 42 |
| §12 备查文件目录.....                         | 42 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 42 |
| 12.2 存放地点.....                          | 43 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 43 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                           |                   |
|-----------------|---------------------------|-------------------|
| 基金名称            | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |                   |
| 基金简称            | 招商添德 3 个月定开债发起式           |                   |
| 基金主代码           | 006393                    |                   |
| 交易代码            | 006393                    |                   |
| 基金运作方式          | 契约型定期开放式                  |                   |
| 基金合同生效日         | 2018 年 9 月 12 日           |                   |
| 基金管理人           | 招商基金管理有限公司                |                   |
| 基金托管人           | 兴业银行股份有限公司                |                   |
| 报告期末基金份额总额      | 2,694,108,736.55 份        |                   |
| 基金合同存续期         | 不定期                       |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 招商添德 3 个月定开债发起式 A         | 招商添德 3 个月定开债发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 006393                    | 006394            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,694,108,736.55 份        | -                 |

注：由于本基金 C 类份额从成立至报告期末未有份额，报告中披露的内容均为本基金 A 类份额的情况。

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，力争基金资产长期稳健增值，为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略 | <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配的基础上，基金管理人将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境确定债券投资组合管理策略，确定部分债券采取持有到期策略，部分债券将采取积极的投资策略，以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>本基金的具体投资策略包括：</p> <p>（1）资产配置策略；（2）久期策略；（3）期限结构策略；（4）类属配置策略；（5）信用债投资策略；（6）杠杆投资策略；（7）资产支持证券的投资策略；（8）行业配置策略；（9）个券挖掘策略；（10）中小企业私募债券投资策略；（11）国债期货投资策略。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p> |

|        |   |
|--------|---|
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率                                   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人                 | 基金托管人                |
|---------|-----------------------|----------------------|
| 名称      | 招商基金管理有限公司            | 兴业银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名                    | 潘西里                  |
|         | 联系电话                  | 0755-83196666        |
|         | 电子邮箱                  | cmf@cmfchina.com     |
| 客户服务电话  | 400-887-9555          | 95561                |
| 传真      | 0755-83196475         | 021-62159217         |
| 注册地址    | 深圳市福田区深南大道 7088 号     | 福州市湖东路 154 号         |
| 办公地址    | 中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 | 上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼 |
| 邮政编码    | 518040                | 200120               |
| 法定代表人   | 王小青                   | 吕家进                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                  |
|--------|------------|-----------------------|
| 注册登记机构 | 招商基金管理有限公司 | 中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

招商添德 3 个月定开债发起式 A

|               |                                       |
|---------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 40,945,219.66                         |
| 本期利润          | 54,861,458.18                         |

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0185           |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.82%            |
| 本期基金份额净值增长率   | 11.10%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 期末可供分配利润      | 238,958,167.41   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0887           |
| 期末基金资产净值      | 3,013,522,732.95 |
| 期末基金份额净值      | 1.1186           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率   | 20.91%           |

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

2、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；

3、期末可供分配利润，采用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。

## 3.2 基金净值表现

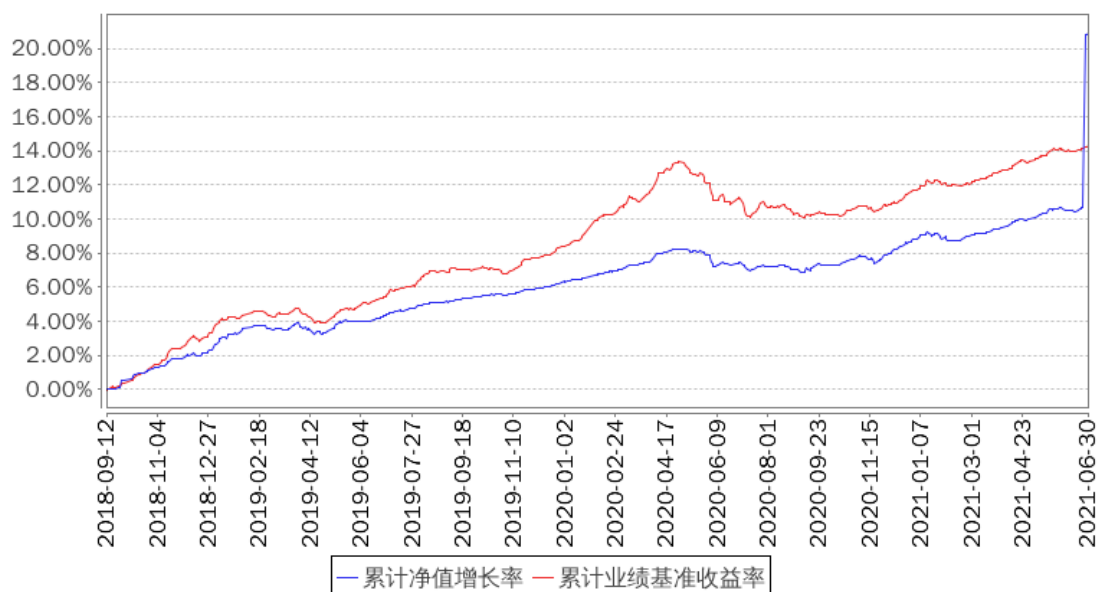
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商添德 3 个月定开债发起式 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 9.30%    | 1.99%       | 0.18%      | 0.04%         | 9.12% | 1.95% |
| 过去三个月      | 10.47%   | 1.18%       | 1.32%      | 0.04%         | 9.15% | 1.14% |
| 过去六个月      | 11.10%   | 0.84%       | 2.31%      | 0.04%         | 8.79% | 0.80% |
| 过去一年       | 12.57%   | 0.59%       | 2.84%      | 0.06%         | 9.73% | 0.53% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.91%   | 0.35%       | 14.30%     | 0.07%         | 6.61% | 0.28% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

招商添德3个月定开债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司首批获得企业年金基金投资管理人资格、基本养老保险基金投资管理资格；2004 年获得全国社保基金投资管理人资格；同时拥有 QDII (合格境内机构投资者) 资格、专户理财(特定客户资产管理业务)资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---------|-----------------|------|--------|---|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 滕越 | 本基金基金经理 | 2018 年 9 月 12 日 | -    | 11     | 女，硕士。2009 年 7 月加入民生证券股份有限公司，曾任分析师；2014 年 9 月加入华创证券有限责任公司，曾任高级分析师；2016 年 3 月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，从事固定收益类产品研究及投资组合辅助管理相关 |



|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 工作，曾任招商安达灵活配置混合型证券投资基金、招商稳盛定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商稳乾定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商稳泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商稳祥定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任招商安本增利债券型证券投资基金、招商信用增强债券型证券投资基金、招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商民安增益债券型证券投资基金、招商添浩纯债债券型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|---|

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也

对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司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% 的情形共发生过七次，原因是指数量化投资组合为满足投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

## 4. 4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济回顾：

2021 年上半年，国内经济仍在复苏区间，但复苏动能有所减缓。投资方面，最新的 6 月固定资产投资完成额累计同比增长 12.6%，较一季度末 25.6% 的累计同比有所下降，以 2019 年同期为基数来看，上半年固定资产投资两年平均增速为 4.5%，投资端略有回升。其中地产在政策管控力度加大、限制政策频出的背景下投资韧性依然较强，主要是下游销售较好带动所致，6 月房地产开发投资累计同比为 15%，两年平均增速为 8.5%，为固定资产投资提供较强支撑；制造业投资恢复依然低于平均水平，受近期上游原材料价格上涨影响，制造业企业整体资本支出意愿不强，6 月制造业投资累计同比为 19.2%，两年平均增速 2.6%，绝对增速位于低位，但较一季度环比有所回升；基建投资在今年严控地方政府债务的背景下增长空间不大，6 月基建投资累计同比为 7.15%，两年平均增速 3.5%。消费方面，6 月社会消费品零售总额累计同比为 23%，两年平均增速为 5.8%，消费虽有恢复但边际放缓，较疫情前 8% 左右同比增速仍有一定差距，这可能与疫情常态化下居民消费方式尚未完全恢复以及普遍认为未来收入不确定性较大有关。对外贸易方面，受海外疫苗接种进度提速以及经济复苏影响，国内出口依然强劲，6 月出口金额累计同比为 38.6%，两年平均增速为 16%，但考虑到海外供给逐渐恢复，出口增速未来变动方向不确定性较大。生产方面，疫情后国内供给和消费端复苏均较好，叠加外需强劲，生产数据持续保持高位，6 月工业增加值累计同比为 15.9%，两年平均增速 7.3%，高于疫情前平均水平，其中高技术产业和装备制造业表现较好。6 月 PMI 指数为 50.9%，二季度以来呈环比下行趋势，但供给端仍相对充裕，

目前 PMI 指数已连续 16 个月保持在荣枯线以上，其中 6 月生产指数和新订单指数分别为 51.9%和 51.5%。预计 2021 年下半年经济增长依然保持韧性。

债券市场回顾：

2021 年以来，债券市场走出了先调整后上涨的趋势。资金面是 2021 年上半年债市走势的核心矛盾。上半年债市走势可分为两个阶段：

阶段一：1 月 1 日-2 月 10 日（春节前）：1 月初，资金面宽松余威仍在，债市收益率小幅下行。1 月中旬后，央行进行连续净回笼，资金利率大幅抬升。同时，A 股、商品、海外市场美股均大涨，美债调整，多重压力下，中债开启一波调整，10 年国开调整达 25bp；

阶段二：2 月 18 日-6 月 30 日（春节后至年中）：这一阶段，债市经历春节前的调整后，重回上涨的轨道，10 年国开收益率下行约 30bp，与 1 月初水平相似，但各期限各等级信用利差较年初压窄，这一过程较为波折，债市多空因素交织，收益率下行较为曲折。市场的担忧有：资金面虽然平稳，但市场预期央行亦不会进一步宽松；二三季度是利率债的供给高峰期；物价上涨持续超预期；外围环境上各主要发达国家伴随疫苗接种经济逐步恢复，美联储展现鹰派态度，美债调整。但最终，利率债供给高峰在二季度没有迎来，社融持续回落显示融资需求走弱，政策限制下房地产和基建需求偏弱形成阶段性的资产荒，这使得债市收益率最终在震荡中逐步回落。

基金操作回顾：

回顾 2021 年上半年的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。债券投资方面，上半年本组合在市场收益率波动过程中积极调整仓位，顺应市场趋势，优化资产配置结构，提高组合收益。

#### 4.4.2 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 11.10%，同期业绩基准增长率为 2.31%，本报告期内，基金持有人未实际持有本基金 C 类份额。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场展望：

基本面方面，5 月经济数据尤其是复合增速与 4 月相比，工业增加值和投资并没有延续上行，可能原因在于 2021 年 3、4 月的改善较快，更主要的是基数效应。制造业投资和消费作为反应较慢的经济变量，依然出现了缓慢上行的趋势。调查失业率与 2018-2019 年阶段水平几无差距，但存在结构性矛盾，就业加消费的持续好转，将成为货币政策进一步回归中性的有力支持。总之，5 月诸多数据复合增速的回落，并不能完全说明经济增速的见顶，仍然需要更进一步的观察。展望下半年，我们认为，疫苗接种带动服务业和地产销售景气上行，叠加仍有余地的财政政策，会进一步支持下半年经济发展。

资金面方面，1-6 月资金利率中枢整体呈现先升后降趋势，临近年中资金利率呈现季节性上涨，与央行“不急转弯”的表态一致，跨月、跨季和跨半年资金面的紧张程度不高，也带来了较好的杠杆息差。预计下半年伴随经济进一步好转，央行可能将资金利率中枢小幅上移。

政策面方面，宏观政策、财政政策和货币政策努力的方向没有太大改变，仍然是支持小微、科创、绿色发展、制造业和消费。下半年值得关注的政策重点是地方政府隐性债务的处理以及金融防风险会否有新的监管政策。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计师事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》及最新的招募说明书约定“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每

次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配”。

本基金以2021年4月12日为收益分配基准日进行了2021年第一次利润分配，截至2021年4月12日，招商添德3个月定开债发起式A期末可供分配利润为46,699,054.96元，当次最低应分配金额为9,339,811.00元。利润分配登记日为2021年4月19日，每份基金份额分红0.0070元，分红金额为20,911,472.98元，均符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金未发生连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产        | 附注号     | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 资产：       |         |                     |                       |
| 银行存款      | 6.4.7.1 | 167,485,841.44      | 11,598,808.35         |
| 结算备付金     |         | -                   | -                     |
| 存出保证金     |         | -                   | -                     |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 2,987,657,000.00    | 2,597,610,000.00      |
| 其中：股票投资   |         | -                   | -                     |
| 基金投资      |         | -                   | -                     |
| 债券投资      |         | 2,987,657,000.00    | 2,597,610,000.00      |
| 资产支持证券投资  |         | -                   | -                     |
| 贵金属投资     |         | -                   | -                     |
| 衍生金融资产    | 6.4.7.3 | -                   | -                     |
| 买入返售金融资产  | 6.4.7.4 | -                   | 368,706,193.06        |
| 应收证券清算款   |         | -                   | 10,198,241.10         |
| 应收利息      | 6.4.7.5 | 49,510,771.38       | 41,689,691.33         |
| 应收股利      |         | -                   | -                     |
| 应收申购款     |         | -                   | -                     |
| 递延所得税资产   |         | -                   | -                     |
| 其他资产      | 6.4.7.6 | -                   | -                     |
| 资产总计      |         | 3,204,653,612.82    | 3,029,802,933.84      |
| 负债和所有者权益  | 附注号     | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债：       |         |                     |                       |
| 短期借款      |         | -                   | -                     |
| 交易性金融负债   |         | -                   | -                     |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3 | -                   | -                     |
| 卖出回购金融资产款 |         | 189,999,785.00      | -                     |
| 应付证券清算款   |         | -                   | -                     |

|            |          |                  |                  |
|------------|----------|------------------|------------------|
| 应付赎回款      |          | -                | -                |
| 应付管理人报酬    |          | 728,081.74       | 695,164.71       |
| 应付托管费      |          | 242,693.91       | 231,721.55       |
| 应付销售服务费    |          | -                | -                |
| 应付交易费用     | 6.4.7.7  | 23,295.13        | 25,602.46        |
| 应交税费       |          | -                | -                |
| 应付利息       |          | 28,845.14        | -                |
| 应付利润       |          | -                | -                |
| 递延所得税负债    |          | -                | -                |
| 其他负债       | 6.4.7.8  | 108,178.95       | 200,000.00       |
| 负债合计       |          | 191,130,879.87   | 1,152,488.72     |
| 所有者权益：     |          |                  |                  |
| 实收基金       | 6.4.7.9  | 2,694,108,736.55 | 2,987,351,696.29 |
| 未分配利润      | 6.4.7.10 | 319,413,996.40   | 41,298,748.83    |
| 所有者权益合计    |          | 3,013,522,732.95 | 3,028,650,445.12 |
| 负债和所有者权益总计 |          | 3,204,653,612.82 | 3,029,802,933.84 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，招商添德 3 个月定开债发起式 A 份额净值 1.1186 元，基金份额总额 2,694,108,736.55 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目         | 附注号      | 本期 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年<br>1 月 1 日至 2020 年 6 月<br>30 日 |
|------------|----------|---------------------------------------|---|
| 一、收入       |          | 61,769,807.66                         | 12,215,342.62                                 |
| 1. 利息收入    |          | 45,381,351.61                         | 18,096,939.71                                 |
| 其中：存款利息收入  | 6.4.7.11 | 70,176.89                             | 67,388.04                                     |
| 债券利息收入     |          | 43,889,552.80                         | 16,628,090.91                                 |
| 资产支持证券利息收入 |          | -                                     | -   |
| 买入返售金融资产   |          | 1,421,621.92                          | 1,401,460.76                                  |

|                        |            |               |               |
|------------------------|------------|---------------|---------------|
| 收入                     |            |               |               |
| 其他利息收入                 |            | -             | -             |
| 证券出借利息收入               |            | -             | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 2,472,217.53  | 95,994.85     |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | -             | -             |
| 基金投资收益                 |            | -             | -             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 2,472,217.53  | 95,994.85     |
| 资产支持证券投资<br>收益         | 6.4.7.14   | -             | -             |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.15   | -             | -             |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.16   | -             | -             |
| 股利收益                   | 6.4.7.17   | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18   | 13,916,238.52 | -5,977,591.94 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.19   | -             | -             |
| 减：二、费用                 |            | 6,908,349.48  | 2,031,602.04  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 4,500,566.29  | 1,395,609.14  |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,500,188.81  | 465,203.08    |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -             | -             |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.20   | 25,775.00     | 5,362.50      |
| 5. 利息支出                |            | 743,875.62    | 46,746.85     |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出      |            | 743,875.62    | 46,746.85     |
| 6. 税金及附加               |            | -             | -             |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.21   | 137,943.76    | 118,680.47    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 54,861,458.18 | 10,183,740.58 |
| 减：所得税费用                |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以             |            | 54,861,458.18 | 10,183,740.58 |



|         |  |  |  |
|---------|--|--|--|
| “-”号填列) |  |  |  |
|---------|--|--|--|

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                |                   |
|--|---|----------------|-------------------|
|  | 实收基金                                    | 未分配利润          | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 2,987,351,696.29                        | 41,298,748.83  | 3,028,650,445.12  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                       | 54,861,458.18  | 54,861,458.18     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -293,242,959.74                         | 244,165,262.37 | -49,077,697.37    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 2,684,108,736.55                        | 315,919,438.25 | 3,000,028,174.80  |
| 2. 基金赎回款                               | -2,977,351,696.29                       | -71,754,175.88 | -3,049,105,872.17 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                       | -20,911,472.98 | -20,911,472.98    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,694,108,736.55                        | 319,413,996.40 | 3,013,522,732.95  |
| 项目                                     | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                   |
|  | 实收基金                                    | 未分配利润          | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 907,999,588.00                          | 26,295,309.17  | 934,294,897.17    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                       | 10,183,740.58  | 10,183,740.58     |

|  |                |                |                |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“—”号填列）      | -              | -              | -              |
| 其中：1. 基金申购款                            | -              | -              | -              |
| 2. 基金赎回款                               | -              | -              | -              |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“—”号填列） | -              | -27,693,987.43 | -27,693,987.43 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 907,999,588.00 | 8,785,062.32   | 916,784,650.32 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_王小青\_\_\_\_                      \_\_\_\_欧志明\_\_\_\_                      \_\_\_\_何剑萍\_\_\_\_  
基金管理人负责人              主管会计工作负责人              会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1373 号文批准公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 809,999,000.00 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00030 号验资报告。基金合同于 2018 年 9 月 12 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同

业存单、国债期货等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合为：对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，不受前述投资组合比例的限制。在开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；在封闭期，本基金每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《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》、财税

[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------|
| 活期存款           | 167,485,841.44      |
| 定期存款           | -                   |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                   |
| 存款期限 1-3 个月    | -                   |
| 存款期限 3 个月以上    | -                   |
| 其他存款           | -                   |
| 合计             | 167,485,841.44      |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |                  |                  |               |
|---------------|---------------------|------------------|------------------|---------------|
|               | 成本                  | 公允价值             | 公允价值变动           |               |
| 股票            | -                   | -                | -                |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -                | -                |               |
| 债券            | 交易所市场               | -                | -                |               |
|               | 银行间市场               | 2,958,686,247.57 | 2,987,657,000.00 | 28,970,752.43 |
|               | 合计                  | 2,958,686,247.57 | 2,987,657,000.00 | 28,970,752.43 |
| 资产支持证券        | -                   | -                | -                |               |
| 基金            | -                   | -                | -                |               |
| 其他            | -                   | -                | -                |               |
| 合计            | 2,958,686,247.57    | 2,987,657,000.00 | 28,970,752.43    |               |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 11,451.96           |
| 应收定期存款利息   | -                   |
| 应收其他存款利息   | -                   |
| 应收结算备付金利息  | -                   |
| 应收债券利息     | 49,499,319.42       |
| 应收资产支持证券利息 | -                   |
| 应收买入返售证券利息 | -                   |
| 应收申购款利息    | -                   |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                   |
| 应收出借证券利息   | -                   |
| 其他         | -                   |
| 合计         | 49,510,771.38       |

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                   |
| 银行间市场应付交易费用 | 23,295.13           |
| 合计          | 23,295.13           |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                   |
| 应付赎回费       | -                   |
| 应付证券出借违约金   | -                   |
| 预提费用        | 108,178.95          |
| 合计          | 108,178.95          |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 招商添德 3 个月定开债发起式 A |                                    |                   |
|-------------------|------------------------------------|-------------------|
| 项目                | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                   |
|                   | 基金份额（份）                            | 账面金额              |
| 上年度末              | 2,987,351,696.29                   | 2,987,351,696.29  |
| 本期申购              | 2,684,108,736.55                   | 2,684,108,736.55  |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -2,977,351,696.29                  | -2,977,351,696.29 |
| 基金份额折算变动份额        | -                                  | -                 |
| 本期末               | 2,694,108,736.55                   | 2,694,108,736.55  |

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 招商添德 3 个月定开债发起式 A |                |                |                |
|-------------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目                | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末              | 25,242,029.35  | 16,056,719.48  | 41,298,748.83  |
| 本期利润              | 40,945,219.66  | 13,916,238.52  | 54,861,458.18  |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | 193,682,391.38 | 50,482,870.99  | 244,165,262.37 |
| 其中：基金申购款          | 237,553,835.29 | 78,365,602.96  | 315,919,438.25 |
| 基金赎回款             | -43,871,443.91 | -27,882,731.97 | -71,754,175.88 |
| 本期已分配利润           | -20,911,472.98 | -              | -20,911,472.98 |
| 本期末               | 238,958,167.41 | 80,455,828.99  | 319,413,996.40 |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 67,665.82                          |
| 定期存款利息收入  | -                                  |
| 其他存款利息收入  | -                                  |
| 结算备付金利息收入 | 2,511.07                           |
| 其他        | -                                  |
| 合计        | 70,176.89                          |

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

**6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

**6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

**6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------------------------|------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,472,217.53                       |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                                  |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                                  |
| 合计                            | 2,472,217.53                       |

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------------------|------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,635,156,343.96                   |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,606,201,548.38                   |
| 减：应收利息总额                | 26,482,578.05                      |
| 买卖债券差价收入                | 2,472,217.53                       |

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

**6.4.7.14 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.15 贵金属投资收益****6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.17 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 13,916,238.52                      |
| ——股票投资                 | -                                  |
| ——债券投资                 | 13,916,238.52                      |
| ——资产支持证券投资             | -                                  |
| ——贵金属投资                | -                                  |
| ——其他                   | -                                  |
| 2.衍生工具                 | -                                  |
| ——权证投资                 | -                                  |
| 3.其他                   | -                                  |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                  |
| 合计                     | 13,916,238.52                      |

**6.4.7.19 其他收入**

本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------------------|
|----|------------------------------------|



|           |           |
|-----------|-----------|
| 交易所市场交易费用 | -         |
| 银行间市场交易费用 | 25,775.00 |
| 合计        | 25,775.00 |

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 审计费用    | 39,671.58                          |
| 信息披露费   | 59,507.37                          |
| 证券出借违约金 | -                                  |
| 银行费用    | 11,164.81                          |
| 其他      | 27,600.00                          |
| 合计      | 137,943.76                         |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 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  |
|------------------------|----------|
| 招商基金管理有限公司             | 基金管理人    |
| 兴业银行股份有限公司             | 基金托管人    |
| 招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”) | 基金管理人的股东 |

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,500,566.29                       | 1,395,609.14                            |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 0.00                               | 0.00                                    |

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,500,188.81                       | 465,203.08                              |

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{C 类日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

由于本基金 C 类份额从基金成立至今无份额进入，因此本基金本报告期内及上年度可比期间无销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------------------------|---------------------------------|-------------------|
|                                 | 招商添德 3 个月定开债发起式 A               | 招商添德 3 个月定开债发起式 C |
| 基金合同生效日（2018 年 9 月 12 日）持有的基金份额 | -                               | -                 |
| 报告期初持有的基金份额                     | 10,000,000.00                   | -                 |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -                               | -                 |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                               | -                 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | -                               | -                 |
| 报告期末持有的基金份额                     | 10,000,000.00                   | -                 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 0.37%                           | -                 |

| 项目                              | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------------------------|---------------------------------|-------------------|
|                                 | 招商添德 3 个月定开债发起式 A               | 招商添德 3 个月定开债发起式 C |
| 基金合同生效日（2018 年 9 月 12 日）持有的基金份额 | -                               | -                 |
| 报告期初持有的基金份额                     | 10,000,000.00                   | -                 |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -                               | -                 |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                               | -                 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | -                               | -                 |

|                     |               |   |
|---------------------|---------------|---|
| 报告期末持有的基金份额         | 10,000,000.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.10%         | - |

#### 6.4.10.5.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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  | 167,485,841.44                     | 67,665.82 | 2,570,180.05                            | 67,388.04 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

招商添德 3 个月定开债发起式 A

| 序号 | 权益登记日           | 场内除息日 | 场外除息日           | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计      | 备注 |
|----|-----------------|-------|-----------------|---------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 1  | 2021 年 4 月 19 日 | -     | 2021 年 4 月 19 日 | 0.0700        | 20,911,472.92 | 0.06      | 20,911,472.98 | -  |
| 合计 | -               | -     | -               | 0.0700        | 20,911,472.92 | 0.06      | 20,911,472.98 | -  |

#### 6.4.12 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 189,999,785.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日             | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|--------|----------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| 190409 | 19 农发 09 | 2021 年 7 月<br>1 日 | 100.49 | 2,000,000 | 200,980,000.00 |
| 合计     | -        | -                 | -      | 2,000,000 | 200,980,000.00 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括债券投资、资产支持证券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人以全面、独立、互相制约为基本原则，建立了全面的合规及风险管理组织架构，包括：董事会及下设专门委员会、监事会、督察长、法律合规部、监察审计部及风险管理部等。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了于本报告期末本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| AAA    | 1,659,918,000.00    | 1,243,193,000.00      |
| AAA 以下 | -                   | -                     |
| 未评级    | -                   | -                     |
| 合计     | 1,659,918,000.00    | 1,243,193,000.00      |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| AAA    | 29,151,000.00       | -                     |
| AAA 以下 | -                   | -                     |

|     |               |   |
|-----|---------------|---|
| 未评级 | -             | - |
| 合计  | 29,151,000.00 | - |

注：同业存单投资评级以其主体评级进行列示。

### 6.4.13.3 流动性风险

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易市场和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款及债券投资。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计             |
|---------------------|----------------|-------|-------|-----|----------------|
| 资产                  |                |       |       |     |                |
| 银行存款                | 167,485,841.44 | -     | -     | -   | 167,485,841.44 |
| 结算备付金               | -              | -     | -     | -   | -              |

|                       |                |                  |                |               |                  |
|-----------------------|----------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 存出保证金                 | -              | -                | -              | -             | -                |
| 交易性金融资产               | 39,183,000.00  | 2,857,033,000.00 | 91,441,000.00  | -             | 2,987,657,000.00 |
| 买入返售金融资产              | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应收利息                  | -              | -                | -              | 49,510,771.38 | 49,510,771.38    |
| 应收股利                  | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应收申购款                 | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应收证券清算款               | -              | -                | -              | -             | -                |
| 其他资产                  | -              | -                | -              | -             | -                |
| 资产总计                  | 206,668,841.44 | 2,857,033,000.00 | 91,441,000.00  | 49,510,771.38 | 3,204,653,612.82 |
| 负债                    |                |                  |                |               |                  |
| 应付赎回款                 | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付管理人报酬               | -              | -                | -              | 728,081.74    | 728,081.74       |
| 应付托管费                 | -              | -                | -              | 242,693.91    | 242,693.91       |
| 应付证券清算款               | -              | -                | -              | -             | -                |
| 卖出回购金融资产款             | 189,999,785.00 | -                | -              | -             | 189,999,785.00   |
| 应付销售服务费               | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付交易费用                | -              | -                | -              | 23,295.13     | 23,295.13        |
| 应付利息                  | -              | -                | -              | 28,845.14     | 28,845.14        |
| 应付利润                  | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应交税费                  | -              | -                | -              | -             | -                |
| 其他负债                  | -              | -                | -              | 108,178.95    | 108,178.95       |
| 负债总计                  | 189,999,785.00 | -                | -              | 1,131,094.87  | 191,130,879.87   |
| 利率敏感度缺口               | 16,669,056.44  | 2,857,033,000.00 | 91,441,000.00  | 48,379,676.51 | 3,013,522,732.95 |
| 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年            | 5 年以上          | 不计息           | 合计               |
| 资产                    |                |                  |                |               |                  |
| 银行存款                  | 11,598,808.35  | -                | -              | -             | 11,598,808.35    |
| 结算备付金                 | -              | -                | -              | -             | -                |
| 存出保证金                 | -              | -                | -              | -             | -                |
| 交易性金融资产               | 50,005,000.00  | 2,413,379,000.00 | 134,226,000.00 | -             | 2,597,610,000.00 |
| 买入返售金融资产              | 368,706,193.06 | -                | -              | -             | 368,706,193.06   |
| 应收利息                  | -              | -                | -              | 41,689,691.33 | 41,689,691.33    |
| 应收股利                  | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应收申购款                 | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应收证券清算款               | -              | -                | -              | 10,198,241.10 | 10,198,241.10    |
| 其他资产                  | -              | -                | -              | -             | -                |
| 资产总计                  | 430,310,001.41 | 2,413,379,000.00 | 134,226,000.00 | 51,887,932.43 | 3,029,802,933.84 |
| 负债                    |                |                  |                |               |                  |
| 应付赎回款                 | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付管理人报酬               | -              | -                | -              | 695,164.71    | 695,164.71       |



|           |                |                  |                |               |                  |
|-----------|----------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 应付托管费     | -              | -                | -              | 231,721.55    | 231,721.55       |
| 应付证券清算款   | -              | -                | -              | -             | -                |
| 卖出回购金融资产款 | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付销售服务费   | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付交易费用    | -              | -                | -              | 25,602.46     | 25,602.46        |
| 应付利息      | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付利润      | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应交税费      | -              | -                | -              | -             | -                |
| 其他负债      | -              | -                | -              | 200,000.00    | 200,000.00       |
| 负债总计      | -              | -                | -              | 1,152,488.72  | 1,152,488.72     |
| 利率敏感度缺口   | 430,310,001.41 | 2,413,379,000.00 | 134,226,000.00 | 50,735,443.71 | 3,028,650,445.12 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|                    |                       |                             |                        |
|--------------------|-----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设                 | 1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点 |                             |                        |
|                    | 2.其他市场变量保持不变          |                             |                        |
|                    | 3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响 |                             |                        |
| 分析                 | 相关风险变量的变动             | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|                    |                       | 本期末（2021 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|                    | 1. 市场利率平行上升 50 个基点    | -43,716,685.69              | -40,850,143.29         |
| 2. 市场利率平行下降 50 个基点 | 44,967,132.22         | 41,989,509.48               |                        |

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险敞口。

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险的敏感性分析。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 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            | 2,987,657,000.00 | 93.23        |
|    | 其中：债券             | 2,987,657,000.00 | 93.23        |
|    | 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          | -                | -            |
|    | 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      | 167,485,841.44   | 5.23         |
| 8  | 其他资产              | 49,510,771.38    | 1.54         |
| 9  | 合计                | 3,204,653,612.82 | 100.00       |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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。

#### 7.2.2 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。

### 7.3 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

#### 7.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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

本基金报告期内无买入股票。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期内无卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内无买卖股票。

### 7.5 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（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 61,052,000.00    | 2.03         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,887,422,000.00 | 95.82        |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,227,504,000.00 | 40.73        |
| 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      | 29,151,000.00    | 0.97         |
| 9  | 其他        | 10,032,000.00    | 0.33         |
| 10 | 合计        | 2,987,657,000.00 | 99.14        |

### 7.6 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

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（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 190409    | 19 农发 09    | 2,600,000 | 261,274,000.00 | 8.67         |
| 2  | 092000010 | 20 东方债 02BC | 2,000,000 | 200,920,000.00 | 6.67         |
| 3  | 190404    | 19 农发 04    | 1,900,000 | 192,508,000.00 | 6.39         |
| 4  | 2028012   | 20 浦发银行 01  | 1,700,000 | 167,127,000.00 | 5.55         |
| 5  | 190305    | 19 进出 05    | 1,600,000 | 161,088,000.00 | 5.35         |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除 19 进出 05（证券代码 190305）、19 农发 04（证券代码 190404）、19 农发 09（证券代码 190409）、20 北京银行小微债 03（证券代码 2020045）、20 东方债 02BC（证券代码 092000010）、20 国开 12（证券代码 200212）、20 华夏银行小微债 01（证券代码 2028028）、20 交通银行 01（证券代码 2028029）、20 浦发银行 01（证券代码 2028012）、21 北京银行小微债 01（证券代码 2120005）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 1、19 进出 05（证券代码 190305）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 2、19 农发 04（证券代码 190404）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、违规提供担保及财务资助、信息披露虚假或严重误导性陈述等原因，多次受到监管机构的处罚。

## 3、19 农发 09（证券代码 190409）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、违规提供担保及财务资助、信息披露虚假或严重误导性陈述等原因，多次受到监管机构的处罚。

## 4、20 北京银行小微债 03（证券代码 2020045）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

## 5、20 东方债 02BC（证券代码 092000010）

根据 2021 年 2 月 5 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被浙江银保监局处以罚款。

## 6、20 国开 12（证券代码 200212）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

## 7、20 华夏银行小微债 01（证券代码 2028028）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、内部制度不完善、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

## 8、20 交通银行 01（证券代码 2028029）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、信息披露虚假或严重误导性陈述等原因，多次受到监管机构的处罚。

## 9、20 浦发银行 01（证券代码 2028012）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因，多次受到监管机构的处罚。

## 10、21 北京银行小微债 01（证券代码 2120005）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、违反反洗钱法、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.12.2

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额（元） |
|----|---------|-------|
| 1  | 存出保证金   | -     |
| 2  | 应收证券清算款 | -     |
| 3  | 应收股利    | -     |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 4 | 应收利息  | 49,510,771.38 |
| 5 | 应收申购款 | -             |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 49,510,771.38 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别                 | 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 |
| 招商添德 3 个月定期开放债券发起式 A | 212      | 12,708,060.08 | 2,694,082,490.82 | 100.00% | 26,245.73 | 0.00%  |
| 招商添德 3 个月定期开放债券发起式 C | -        | -             | -                | -       | -         | -      |
| 合计                   | 212      | 12,708,060.08 | 2,694,082,490.82 | 100.00% | 26,245.73 | 0.00%  |

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别                 | 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 | 招商添德 3 个月定期开放债券发起式 A | 15,132.17 | 0.0006%  |

|  |                        |           |         |
|--|------------------------|-----------|---------|
|  | 招商添德 3 个月定期开<br>债发起式 C | -         | -       |
|  | 合计                     | 15,132.17 | 0.0006% |

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                 | 份额级别               | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|--------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 招商添德 3 个月定期开债发起式 A | 0                 |
|                                    | 招商添德 3 个月定期开债发起式 C | 0                 |
|                                    | 合计                 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 招商添德 3 个月定期开债发起式 A | 0                 |
|                                    | 招商添德 3 个月定期开债发起式 C | 0                 |
|                                    | 合计                 | 0                 |

### 8.4 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   | 10,000,000.00 | 0.37            | 10,000,000.00 | 0.37            | 3 年        |
| 基金管理人高级管理人员 | 0.00          | 0.00            | 0.00          | 0.00            | -          |
| 基金经理等人员     | 0.00          | 0.00            | 0.00          | 0.00            | -          |
| 基金管理人股东     | 0.00          | 0.00            | 0.00          | 0.00            | -          |
| 其他          | 0.00          | 0.00            | 0.00          | 0.00            | -          |
| 合计          | 10,000,000.00 | 0.37            | 10,000,000.00 | 0.37            | -          |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 招商添德 3 个月定期开债发起式 A | 招商添德 3 个月定期开债发起式 C |
|--------------------------------|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效日(2018 年 9 月 12 日)基金份额总额 | 809,999,000.00     | -                  |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 2,987,351,696.29   | -                  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 2,684,108,736.55   | -                  |
| 减: 报告期基金总赎回份额                  | 2,977,351,696.29   | -                  |
| 本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)    | -                  | -                  |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 2,694,108,736.55   | -                  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 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

根据本基金管理人 2021 年 3 月 6 日的公告, 经招商基金管理有限公司第六届董事会 2021 年第二次会议审议通过, 同意沙骏先生离任副总经理。

根据本基金管理人 2021 年 6 月 5 日的公告, 经招商基金管理有限公司第六届董事会 2021 年第六次会议审议通过, 同意选举王小青先生担任公司董事长, 刘辉女士不再担任公司董事长。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况



本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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 |    |
| 长江证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

### 10.7.2 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 |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券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 |
| 长江证券 | -    | -            | 270,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 方正证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                     | 法定披露日期     |
|----|--|----------------------------|------------|
| 1  | 招商基金管理有限公司关于基金直销账户信息变更的公告                        | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-13 |
| 2  | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同（2021 年 1 月 19 日修订） | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-19 |
| 3  | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议（2021 年 1 月 19 日修订） | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-19 |

|    |   |                            |            |
|----|---|----------------------------|------------|
| 4  | 招商基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告                   | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-19 |
| 5  | 招商基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告              | 证券时报及基金管理人网站               | 2021-01-21 |
| 6  | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告        | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-21 |
| 7  | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金更新的招募说明书(二零二一年第一号)     | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-22 |
| 8  | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新    | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-22 |
| 9  | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新    | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-22 |
| 10 | 招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                         | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-06 |
| 11 | 关于招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金第九个开放期开放申购赎回及转换业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-12 |
| 12 | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年年度报告            | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-30 |
| 13 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告                  | 证券时报及基金管理人网站               | 2021-03-30 |
| 14 | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年度第一次分红公告        | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-15 |
| 15 | 招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告        | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-21 |
| 16 | 招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告              | 证券时报及基金管理人网站               | 2021-04-21 |
| 17 | 招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告                  | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-07 |
| 18 | 招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                         | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-05 |
| 19 | 关于招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金第十个开放期开放申购赎回及转换      | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会         | 2021-06-23 |

|       |          |
|-------|----------|
| 业务的公告 | 基金电子披露网站 |
|-------|----------|

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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              | 20210628-20210628                    | 10,000,000.00    | -                | -                | 10,000,000.00    | 0.37%  |
| 机构    | 2              | 20210101-20210627, 20210629-20210630 | 2,977,351,696.29 | 2,684,082,490.82 | 2,977,351,696.29 | 2,684,082,490.82 | 99.63% |

#### 产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

由于本基金 C 类份额从成立至报告期末未有资金进入，报告中披露的内容均为本基金 A 类份额的情况。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商添德 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

## 12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日