招商添琪3个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2019年8月26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。本半年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23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。本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	招商添琪3个月定开债发起式	
基金主代码	005648	
交易代码	005648	
基金运作方式	契约型、以定期开放方式运作	
基金合同生效日	2018年3月1日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,210,000,000.00份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	招商添琪3个月定开债发起式A	招商添琪3个月定开债发起式C
下属分级基金的交易代码	005648	005649
报告期末下属分级基金的份额总额	8,210,000,000.00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	本基金以封闭期为固期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 1、封闭期投资策略 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,确定零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。 本基金的具体投资策略包括:资产配置策略、久期策略、期限结构策略、类属配置策略、信用债投资策略、资产支持证券的投资策略、行业配置策略、个券挖掘策略、国债期货投资策略。 2、开放期投资策略 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。
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	贺倩
	联系电话	0755-83196666	010-66060069
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-887-9555	95599
传真		0755-83196475	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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

招商添琪3个月定开债发起式A

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	165,856,214.53
本期利润	161,229,424.79
加权平均基金份额本期利润	0.0196
本期基金份额净值增长率	1.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0470
期末基金资产净值	8,641,962,018.50
期末基金份额净值	1.0526

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。

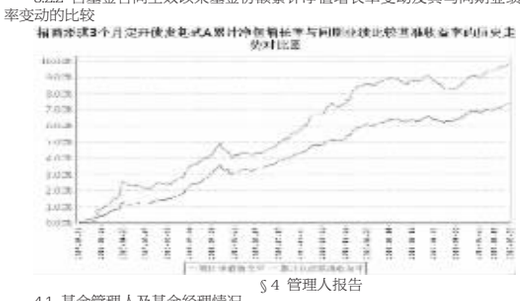
3.2 基金净值表现

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

招商添琪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	0.43%	0.02%	0.57%	0.03%	-0.14%	-0.01%
过去三个月	0.76%	0.04%	0.63%	0.06%	0.13%	-0.02%
过去六个月	1.88%	0.04%	2.07%	0.06%	-0.19%	-0.02%
过去一年	5.23%	0.04%	6.46%	0.06%	-1.23%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.38%	0.04%	9.83%	0.07%	-2.45%	-0.03%

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



§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,公司注册资本金为人民币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(特定客户资产管理计划)资格。

2019年上半年获奖情况如下:

Morningstar晨星(中国)2019年度普通债券型基金奖·招商产业债券·Morningstar晨星一级债五星基金公司·济安金信基金研究中心

五年持续回报普通债券型明星基金·招商安心收益债券·证券时报

五年持续回报普通债券型明星基金·招商产业债券·证券时报

三年持续回报普通债券型明星基金·招商双债增强债券(LOF)·证券时报

金牛奖·固定收益投资金牛基金公司·招商基金管理有限公司·中国证券报

金牛奖·五年期开放式债券型持续优胜金牛基金·招商产业债券·中国证券报

金牛奖·年度开放式债券型金牛基金·招商安心收益债券·中国证券报

金牛奖·最受信赖金牛基金公司·招商基金管理有限公司·中国证券报

金基金·债券投资回报基金管理公司·招商基金管理有限公司·上海证券报

金基金·五年期债券基金·招商产业债券·上海证券报

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		
周欣宇	本基金基金经理	2018年3月1日	-	8	男,硕士。曾任职于松河资本管理公司,从事固定收益市场策略研究工作;2014年加入嘉实基金管理有限公司,任固定收益投资部中级信用研究员;2015年8月加入招商基金管理有限公司,曾任投资经理,招商招庆纯债债券型证券投资基金、招商招元纯债债券型证券投资基金基金经理,现任招商招恒纯债债券型证券投资基金、招商招通纯债债券型证券投资基金、招商招裕纯债债券型证券投资基金、招商招悦纯债债券型证券投资基金、招商添润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招华纯债债券型证券投资基金、招商招惠3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招乾3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招盛纯债债券型证券投资基金、招商招证纯债债券型证券投资基金、招商招怡纯债债券型证券投资基金、招商招琪纯债债券型证券投资基金、招商招玮纯债债券型证券投资基金、招商添琪3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招兴3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商中债1-5年进出口行债券指数证券投资基金、招商中债1-5年农发行债券指数证券投资基金、招商中债3-5年国开行债券指数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遵规守信情况的说明

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、投资总监、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。

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。报告期内,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,在指数型投资组合与主动型投资组合之间发生过两次,原因是指数型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:

2019年上半年,经济增速探底的趋势趋缓,仍面临一些不确定性因素。投资方面,上半年投资呈现前高后低的态势,前三月固定资产投资同比增速保持在6.3%的相对高位,主要来自基建和地产的支撑,四月开始,制造业投资和基建投资增速均大幅下滑,拖累了整体投资的增长。具体来看,前五个月基础设施投资(不含电力、热力、燃气及水生产和供应业)同比增长9.4%,增速较前四个月回落3个百分点。其中,水利管理业投资增长3.9%,增速回落1.9个百分点;公共设施管理业投资增长8.6%,增速回落2.2个百分点;道路运输业投资增长14.8%,增速回落3.4个百分点;铁路运输业投资下降11.4%,降幅扩大2.5个百分点。经过一季度地方债和专项债的发行前移,五月开始基建增速已经难以维持年初的高增速,预计基建增速将继续保持下行的趋势。上半年地产销售端出现回暖迹象,地产投资也维持在相对高位,前五个月房地产投资增速达11.2%,较上年全年提高1.7个百分点,但相较前四个月已经有所回落。消费方面,上半年消费数据持续放弱,1~5月社零增速继续下探至8.1%,创下近年来的新低,汽车消费不振和地产产业链的滞后影响仍然是拖累消费的主要因素。出口方面,上半年出口数据波动较大,整体仍然处于下行通道中,从海外基本面来看,全球主要经济体运行呈现经济放缓的趋势,欧元区各项指标显著下行,美国的领先指标也高位回落,外需恶化持续加剧,叠加尚不明朗的贸易摩擦局势,全年出口形势不容乐观。生产方面,1~5月,规模以上工业增加值同比实际增长6.0%,低于2018全年0.2个百分点,主要源于汽车制造业下滑幅度的扩大。此外,分经济类型看,5月外资企业工业增加值同比下滑0.3%,历史首次负增长。前五个月工业增加值总体小幅下滑,增速创下2016年以来的最低值,表明目前国内经济不确定性风险有所增强。汽车制造业下降幅度进一步扩大,行业前景堪忧。

债券市场回顾:

2019年上半年债券市场收益率随着经济数据和外部冲击的走势宽幅震荡,其中一月延续了上年四季度以来的快牛行情,二月在信贷开门红的催化下收益率开始调整,虽然三月社融一度因为监管严查票据融资和季末央行呵护资金面的原因有所走弱导致收益率重新掉头向下,但四月公布的各项经济数据走强和社融的大超预期以及市场对政策转向的预期引发了年内第一次大幅调整,10年国债调整幅度达到35bps。进入五月以后,贸易摩擦升级和经济金融数据走弱再度引发了债市的做多热情。随后尽管有短期调整,但五月开始债券收益率整体已经有明显的向下趋势。此外,资产荒是贯穿整个上半年信用债市场的重要因素,导致信用债在调整的时候上行幅度更小,而收益率下行时期信用债收益率则下行更多,信用利差持续收窄。同时低等级信用债的等级利差仍然在持续走扩的过程中,等级利差显著走扩,资产荒的结构性影响更加显著。目前债券市场仍处于牛市环境中,但下行的空间可能有限,需要看到经济超预期的下行或货币政策超预期的放松,从当前的市场情况来看配置盘的力量仍然缺乏,使得利率下行节奏可能不够顺畅。在全球货币再宽松的大背景下,不少国家的债券收益率再度跌入负利率区间,中国的无风险利率对外资而言,配置价值显著,可能会吸引境外机构加大对中债的增持力度。

基金操作回顾:

回顾2019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。在债券投资上,根据市场行情的节奏变化及时进行了合理的组合调整。

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1.88%,同期业绩基准增长率为2.07%;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:

展望2019年下半年,预计流动性上会保持平稳,但低等级信用利差由于市场风险偏好的收缩会有所走扩。从央行的近期表态来看,一些宽松政策主要目的还是为了引导资金投向小微、三农领域,而不是转向全面的宽松。预期下半年市场仍将保持震荡格局。

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《招商添琪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2019年4月3日为基准日进行了2019年第一次利润分配,截至2019年4月3日,招商添琪3个月定开债发起式可供分配利润为481,207,824.40元,当次最低应分配金额为96,241,564.88元。利润分配登记日为2019年4月11日,每份基金份额分红0.021元,分红金额为172,410,000.00元。

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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—招商基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害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

本托管人认为,招商基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,招商基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:招商添琪3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末2019年6月30日	上年度末2018年12月31日
资产:		
银行存款	11,338,479.29	1,540,931.77
结算备付金	311,724.20	910,391.03
存出保证金	90,562.01	16,505.32
交易性金融资产	9,791,658,800.00	9,340,323,684.93
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	9,791,658,800.00	9,340,323,684.93
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	173,108,000.59	112,717,268.20
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	9,976,507,566.09	9,455,508,781.25
负债和所有者权益	本期末2019年6月30日	上年度末2018年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,330,448,609.97	797,998,203.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,125,461.35	2,198,550.86
应付托管费	708,487.09	732,850.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	64,295.36	131,064.83
应交税费	760,219.46	696,117.73
应付利息	253,474.36	344,400.83
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	185,000.00	265,000.00
负债合计	1,334,545,547.59	802,366,187.54
所有者权益:		
实收基金	8,210,000,000.00	8,210,000,000.00
未分配利润	431,962,018.50	443,142,593.71
所有者权益合计	8,641,962,018.50	8,653,142,593.71
负债和所有者权益总计	9,976,507,566.09	9,455,508,781.25

注:报告截止日2019年6月30日,招商添琪3个月定开债发起式A份额净值1.0526元,基金份额总额8,210,000,000.00份;总份额合计8,210,000,000.00份。

6.2 利润表

会计主体:招商添琪3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年3月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	183,575,799.36	189,616,640.67
1.利息收入	164,582,271.15	127,513,460.79
其中:存款利息收入	270,371.55	5,883,269.79
债券利息收入	164,311,899.60	121,630,191.00
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	23,620,317.95	17,646,826.21
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,620,317.95	17,646,826.21
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-4,626,789.74	44,456,353.67
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	22,346,374.57	22,044,536.53
1.管理人报酬	12,888,736.34	8,244,860.99
2.托管费	4,296,245.43	2,748,286.99
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	70,574.99	83,900.00
5.利息支出	4,433,883.85	10,655,716.85
其中:卖出回购金融资产支出	4,433,883.85	10,655,716.85
6.税金及附加	500,065.97	192,692.54
7.其他费用	156,867.99	119,079.16
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	161,229,424.79	167,572,104.14
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	161,229,424.79	167,572,104.14

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:招商添琪3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019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)	8,210,000,000.00	443,142,593.71	8,653,142,593.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	161,229,424.79	161,229,424.79
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)	-	-172,410,000.00	-172,410,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	8,210,000,000.00	431,962,018.50	8,641,962,018.50
项目	上年度可比期间2018年3月1日(基金合同生效日)至2018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)	8,210,000,000.00	-	8,210,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	167,572,104.14	167,572,104.14
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	8,210,000,000.00	167,572,104.14	8,377,572,104.14

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:

____金旭___ ____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

招商添琪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》、《招商添琪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]168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8,210,000,000.00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00023号验资报告。基金合同于2018年3月1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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》,截至报告期末最新公告的基金合同及《招商添琪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、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、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为对债券等固定收益工具的投资比例不低于基金资产的80%,但在每个开放期的前10个工作日和后10个工作日以及开放期期间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;前述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关于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。

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2019年6月30日的财务状况以及自2019年1月1日至2019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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

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

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

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股票、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其他增值税应税行为,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。

3)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

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。

6.4.7.2 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
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年3月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,888,736.34	8,244,860.99
其中:支付销售机构的客户维护费	8,595,534.68	5,625,294.35

支付基金管理人招商基金管理有限公司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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年3月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,296,245.43	2,748,286.99

支付基金托管人中国农业银行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:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数

6.4.8.2.3 销售服务费

注:本基金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:

C类日基金销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.20%÷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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	
	招商添琪3个月定开债发起式A	招商添琪3个月定开债发起式C
基金合同生效日(2018年3月1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	0.12%	-

份额单位:份

项目	上年度可比期间2018年3月1日至2018年6月30日	
	招商添琪3个月定开债发起式A	招商添琪3个月定开债发起式C
基金合同生效日(2018年3月1日)持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	0.12%	-

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	招商添琪3个月定开债发起式A			
	本期末2019年6月30日		上年度末2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商银行股份有限公司	8,200,000,000.00	99.8782%	8,200,000,000.00	99.8782%

6.4.8.5 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2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间2018年3月1日(基金合同生效日)至2018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
中国农业银行	11,338,479.29	261,871.04	4,119,188.43	5,883,269.79

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

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019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1,330,448,609.97元,是以如下债券作为质押: