

招商招金宝货币市场基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 30 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2016 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	招商招金宝货币	
基金主代码	000644	
交易代码	000644	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 6 月 18 日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,473,826,338.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	招商招金宝货币 A	招商招金宝货币 B
下属分级基金的交易代码:	000644	000651
报告期末下属分级基金的份额总额	440,738,900.47 份	7,033,087,437.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在兼顾基金资产的安全性和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对短期金融工具的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。</p> <p>(1) 根据宏观经济指标、货币政策的研究，确定组合平均剩余到期期限；</p> <p>(2) 根据各期限各品种的流动性、收益性以及信用水平来确定组合资产配置；</p> <p>(3) 根据市场资金供给情况对组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整；</p> <p>(4) 在保证组合流动性的前提下，利用现代金融分析方法和工具，寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会。</p> <p>(5) 合理有效分配基金的现金流，保持本基金的流动性。</p>
业绩比较基准	人民币活期存款基准利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	王永民
	联系电话	0755-83196666	010-66594896
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-887-9555	95566

传真	0755-83196475	010-66594942
----	---------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfcchina.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年		2015 年		2014 年 6 月 18 日(基金合同生效日)- 2014 年 12 月 31 日	
	招商招金宝货币 A	招商招金宝货币 B	招商招金宝货币 A	招商招金宝货币 B	招商招金宝货币 A	招商招金宝货币 B
本期已实现收益	5,654,534.52	114,902,345.17	10,148,277.44	34,760,158.51	8,811,442.72	6,767,793.40
本期利润	5,654,534.52	114,902,345.17	10,148,277.44	34,760,158.51	8,811,442.72	6,767,793.40
本期净值收益率	2.5625%	2.8084%	3.2584%	3.5077%	2.1705%	2.3027%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期末基金资产净值	440,738,900.47	7,033,087,437.77	154,283,754.79	1,245,761,192.64	512,996,367.00	308,067,543.25
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用；

3、本基金收益分配为按日结转份额；

4、本基金合同于 2014 年 6 月 18 日生效，至 2014 年 12 月 31 日未满 1 年，故 2014 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商招金宝货币 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7283%	0.0023%	0.0894%	0.0000%	0.6389%	0.0023%
过去六个月	1.3542%	0.0021%	0.1789%	0.0000%	1.1753%	0.0021%
过去一年	2.5625%	0.0020%	0.3558%	0.0000%	2.2067%	0.0020%
自基金合同 生效起至今	8.2030%	0.0033%	0.9022%	0.0000%	7.3008%	0.0033%

注：本基金收益分配为按日结转份额。

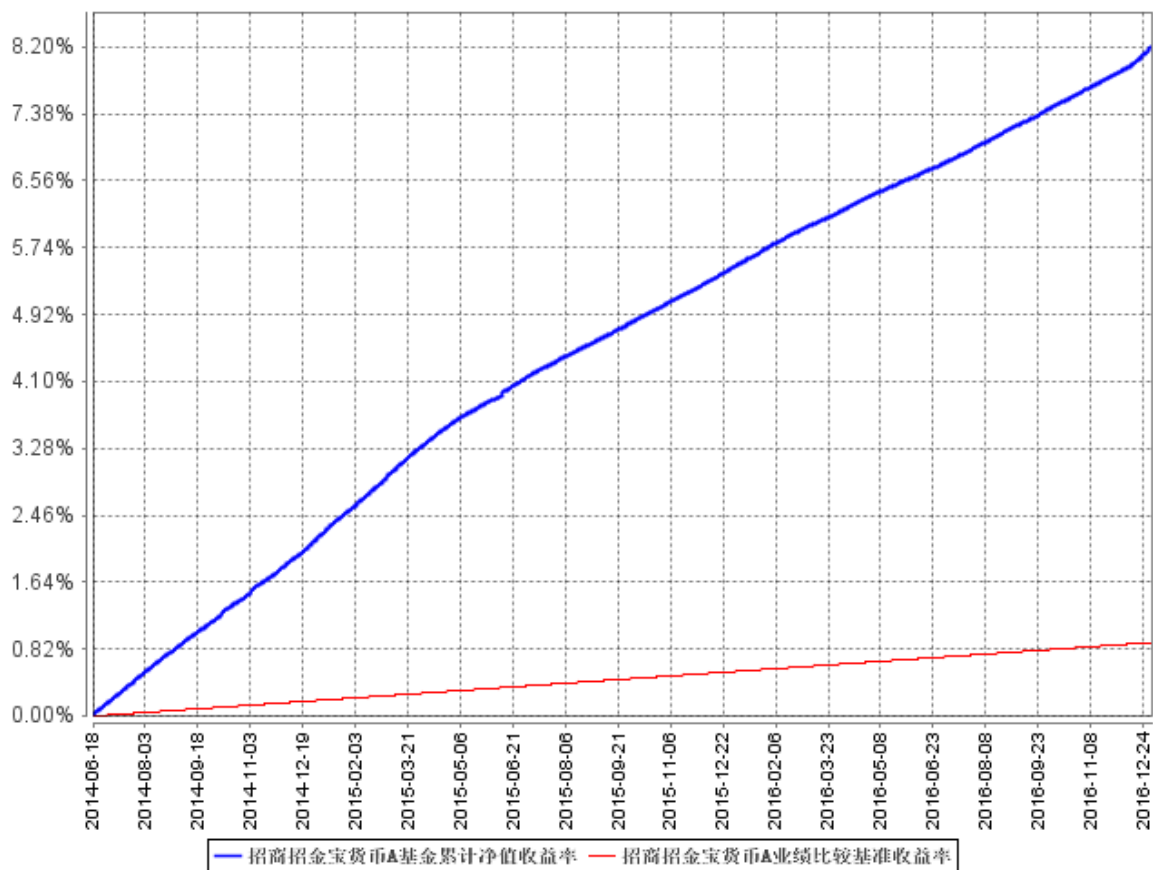
招商招金宝货币 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7888%	0.0023%	0.0894%	0.0000%	0.6994%	0.0023%
过去六个月	1.4760%	0.0021%	0.1789%	0.0000%	1.2971%	0.0021%
过去一年	2.8084%	0.0020%	0.3558%	0.0000%	2.4526%	0.0020%
自基金合同 生效起至今	8.8650%	0.0033%	0.9022%	0.0000%	7.9628%	0.0033%

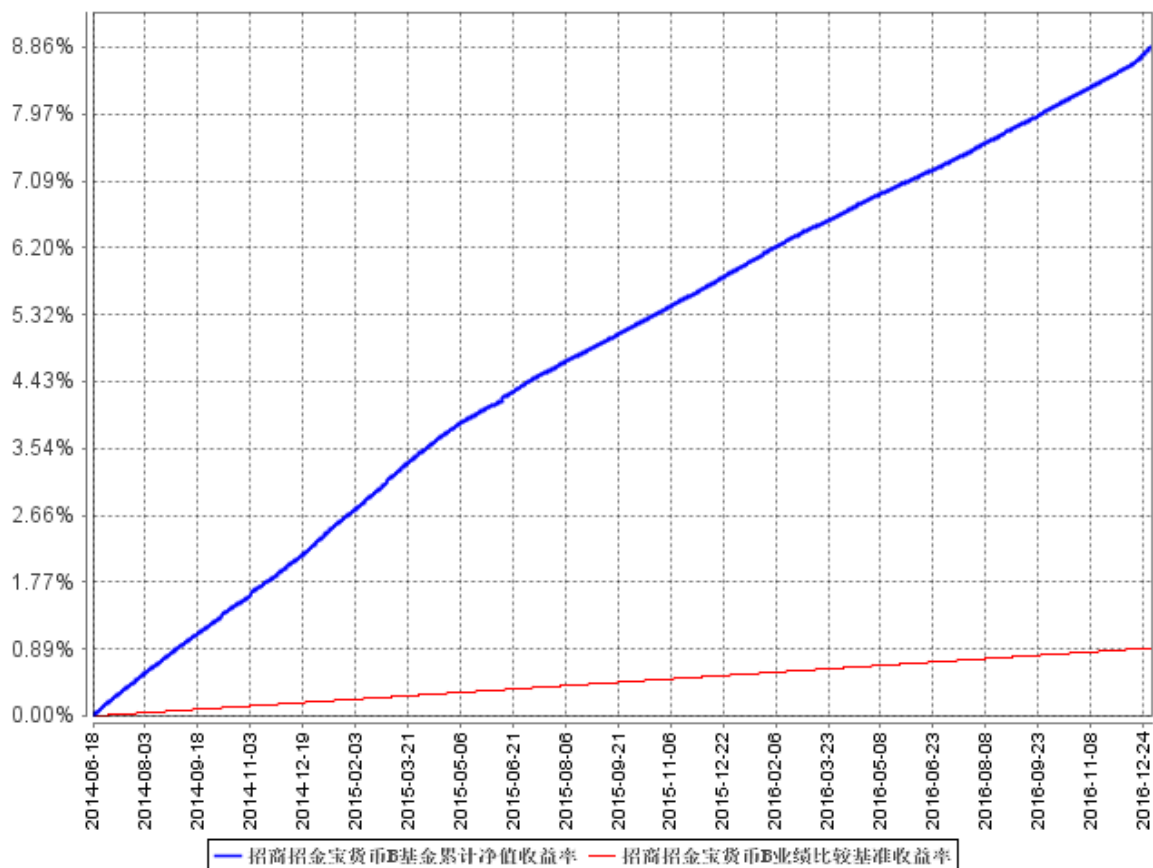
注：本基金收益分配为按日结转份额。

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

招商招金宝货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

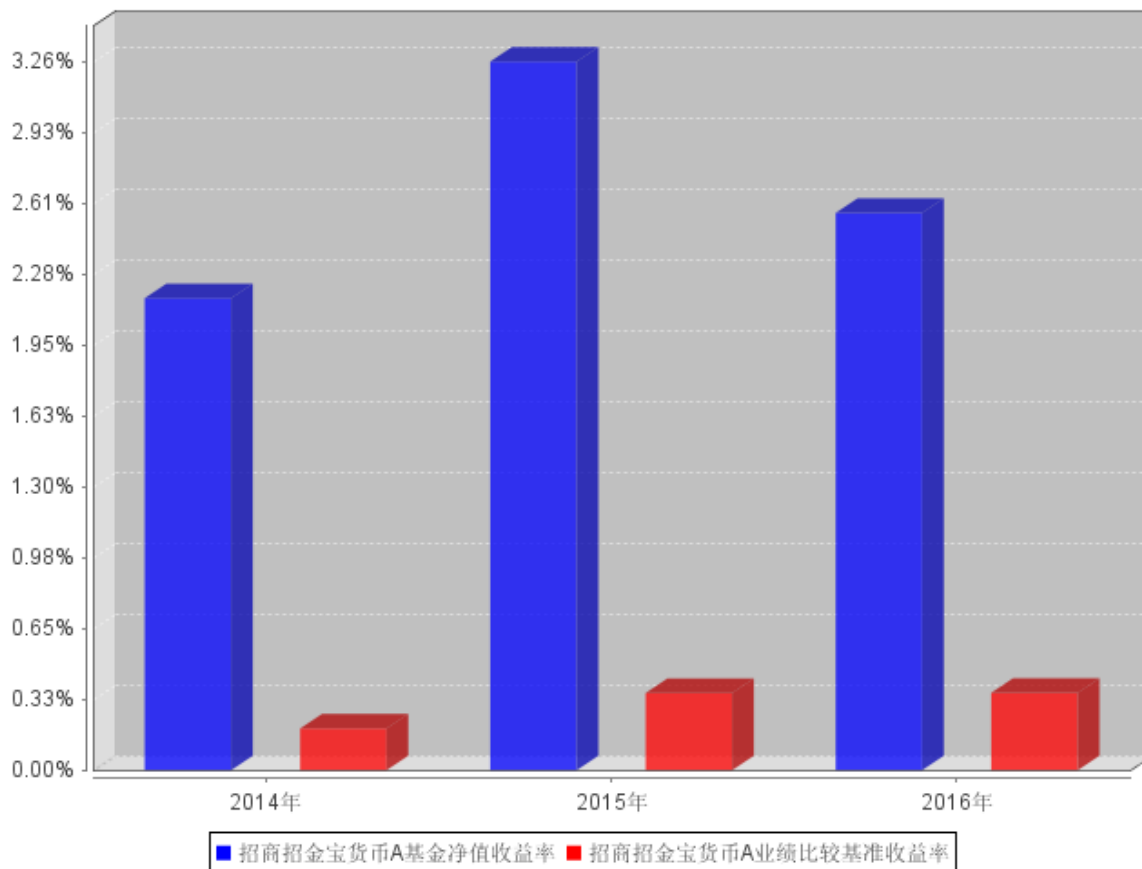


招商招金宝货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

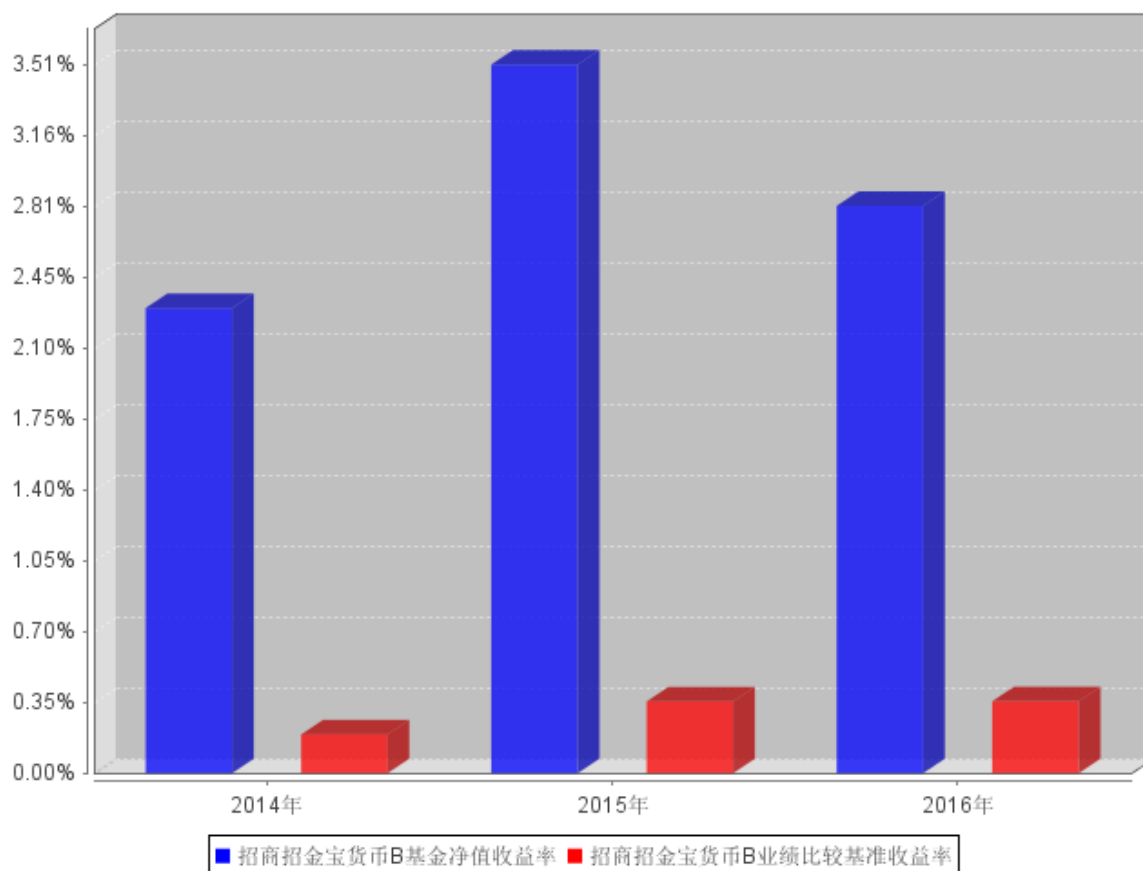


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商招金宝货币A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



招商招金宝货币B自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2014 年 6 月 18 日成立，截至 2014 年 12 月 31 日成立未满 1 年，故报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、招商招金宝货币 A

单位：人民币元

招商招金宝货币 A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014	8,811,442.72	-	-	8,811,442.72	-
2015	10,148,277.44	-	-	10,148,277.44	-
2016	5,654,534.52	-	-	5,654,534.52	-
合计	24,614,254.68	-	-	24,614,254.68	-

2、招商招金宝货币 B

单位：人民币元

招商招金宝货币 B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014	6,767,793.40	-	-	6,767,793.40	-
2015	34,760,158.51	-	-	34,760,158.51	-

2016	114,902,345.17	-	-	114,902,345.17	-
合计	156,430,297.08	-	-	156,430,297.08	-

注：1、本基金采取的收益分配方式是：每日计算投资人账户当日所产生的收益，运作期末将投资人账户累计的收益结转为其基金份额，计入该投资人账户的本基金份额中；

2、本基金合同于 2014 年 6 月 18 日生效，至 2014 年 12 月 31 日未满 1 年，故 2014 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

§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 2.1 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。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 116 只基金，公募基金管理规模快速增长。截至 2016 年底，公募基金管理规模为 3455 亿元，行业排名第 9，非货币基金管理规模行业排名第 7。

2016 年度获奖情况如下：

金贝奖·2016 中国最佳基金公司 《21 世纪经济报道》

金帆奖·综合实力十强基金公司 《21 世纪经济报道》

金帆奖·基金公司最佳风控能力奖 《21 世纪经济报道》

华量奖·公募量化先锋奖 《每日经济新闻》

波特菲勒·最佳债券型基金产品奖（招商双债增强） 《新浪网》

金鼎奖·最具创新力公司 《每日经济新闻》

金鼎奖·最佳对冲型产品（复合策略） 《每日经济新闻》

观察家金融峰会·年度卓越竞争力基金公司 《经济观察报》

2016 年度北京金融业十大卓越品牌·品牌推广卓越奖 北京品牌协会、《北京商报》

2016 年度中国互联网金融金桔奖·最具竞争力互联网基金公司 《时代周报》

2016 东方财富风云榜·2016 年度最佳基金公司 《东方财富网》

2016 东方财富风云榜·2016 年度最受欢迎基金组合（招商超越组合） 《东方财富网》

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		
许强	本基金的基金经理	2016 年 2 月 6 日	-	6	男，管理学学士。2008 年 9 月加入毕马威华振会计师事务所，从事审计工作；2010 年 9 月加入招商基金管理有限公司，曾任基金核算部基金会计，固定收益投资部研究员，现任招商理财 7 天债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、招商招金宝货币市场基金、招商招恒纯债债券型证券投资基金、招商财富宝交易型货币市场基金、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、招商招元纯债债券型证券投资基金、招商招庆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、招商招盛纯债债券型证券投资基金、招商招旺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、招商招惠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、招商招丰纯债债券型证券投资基金、招商招顺纯债债券型证券投资基金、招商招祥纯债债券型证券投资基金、招商招旭纯债债券型证券投资基金及招商招华纯债债券型证券投资基金基金经理。
向霏	本基金的基金经理	2014 年 6 月 18 日	2016 年 2 月 6 日	10	女，工商管理硕士。2006 年加入招商基金管理有限公司，先后曾任职于市场部、股票投资部、交易部，2011 年起任固定收益投资部研究员，曾任招商现金增值开放式证券投资基金、招商理财 7 天债券型证券投资基金、招商招金宝货币市场基金及招商保证金快线货币市场基金基金经理，现任招商招钱宝货币市场基金、招商信用添利债券型证券投资基金（LOF）、招商招利 1 个月期理财债券型证券投资基金、招商招盈 18 个月定开债券型证券投资基金、招商财富宝交易型货币市场基金、招商中国信用机会定期开放债券型证券投资基金（QDII）、招商招轩债券型证券投资基金及招商招泰 6 个月定期开放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《招商招金宝货币市场基金基金合同》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、投资比例及投资组合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 公平交易制度和控制方法

基金管理人（以下简称“公司”）根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）的规定，制定了《招商基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司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。公司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。公司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。公司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。

报告期内，公司按照法规要求，连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、

5 日内) 对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, 相关基金经理也对分析中发现的溢价率超过正常范围的情况进行了合理性解释。根据分析结果, 公司旗下组合的同向交易情况基本正常, 没有发现有明显异常并且无合理理由的同向交易异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司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, 公司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, 在某指数型投资组合与某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指数复制比例要求的投资策略需要。报告期内未发现其他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

2016 年经济基本平稳, 房地产销售和投资阶段性回暖, 基建投资增速稳定, 制造业投资持续下滑。年内受低库存、需求不差和供给收缩驱动, 工业品价格上涨, 产能去化行业盈利能力改善。国际方面, 美国总统大选特朗普获胜, 减税、增支、贸易保护的组合政策引发市场对 2017 年全球通胀和联储持续加息的担忧。CPI 全年低位震荡, PPI 三季度走出通缩区间, 四季度快速上行。CPI 方面, 服务类和居住类价格对 CPI 拉动较大, 食品价格表现弱势; PPI 方面, 供给侧改革收缩供给, 叠加地产需求超预期、基建和 PPP 项目持续落地, 钢铁、煤炭等部分工业品价格出现暴涨。

2016 年上半年货币政策整体以稳健中性为主, 受制于人民币兑美元贬值预期, 全年仅 1 次降准, 央行整体以 MLF/OMO/PSL 等工具维持货币政策的灵活性; 下半年央行通过拉长投放资金久期、抬升资金成本、季末年末谨慎投放等手段提升了资金成本, 主动引导金融去杠杆, 银行间回购利率平均大幅上行, 债券市场出现明显调整。

招商招金宝货币在运作期严格按照基金合同要求进行投资运作, 2016 年一季度适当拉长久期增加同业存款配置, 三季度根据宏观政策变化缩短久期并减少存单配置, 合理控制久期和债券仓位, 在保证组合流动性的前提下提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年招商招金宝货币 A 的份额净值收益率为 2.5625%，同期业绩比较基准收益率为 0.3558%，基金份额净值收益率优于业绩比较基准收益率 2.2067%；招商招金宝 B 的份额净值收益率为 2.8084%，同期业绩比较基准收益率为 0.3558%，基金份额净值收益率优于业绩比较基准收益率 2.4526%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年，多空因素继续博弈，市场面临。一方面，政策调控房地产市场，财政赤字扩大空间有限，实体投资回报率低迷，经济仍有下行压力，中期来看基本面对债券市场仍有支撑。另一方面，中央去杠杆、防控金融风险的政策方针、通胀隐忧、联储持续加息预期、人民币贬值压力制约货币政策宽松空间，都对市场构成压力。整体来看，去杠杆、防风险在相当长的一段时间仍然是宏观政策调控的出发点，央行主要通过灵活调整公开市场投放规模和投放利率，同时辅以规范银行同业业务、细化市场管理等手段，以达到去化金融杠杆的目的。预计市场资金面将维持紧平衡状态，季末等部分时点受MPA考核等因素影响可能出现资金面波动，资金利率整体将较2016年明显上行，需重点关注美国加息进程、国内经济走势、及国内监管政策的实施节奏。

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验。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未与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据法律法规及《基金合同》的约定，本基金每日计算投资人账户当日所产生的收益，运作期末将投资人账户累计的收益结转为其基金份额，计入该投资人账户的本基金份额中。本报告期内，招商招金宝货币 A 共分配利润人民币 5,654,534.52 元，招商招金宝货币 B 共分配利润人民币 114,902,345.17 元，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求，基金合同生效后，连续二十个工作日出现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情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现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 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在招商招金宝货币市场基金基金合同（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计了招商招金宝货币市场基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注，并出具了无保留意见的审计报告。

投资者欲了解详细内容，可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：招商招金宝货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	2,638,537,835.64	511,111,542.34
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,185,324,048.39	748,556,290.89
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,185,324,048.39	748,556,290.89
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	4,076,411,514.61	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	17,658,618.73	17,476,388.29
应收股利	-	-
应收申购款	79,619,123.71	123,883,620.00
递延所得税资产	-	-

其他资产	-	-
资产总计	7,997,551,141.08	1,401,027,841.52
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015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	515,758,826.36	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	5,777,404.33	-
应付管理人报酬	1,174,696.33	412,096.23
应付托管费	355,968.60	124,877.64
应付销售服务费	89,593.07	43,766.11
应付交易费用	206,202.17	33,154.11
应交税费	-	-
应付利息	93,111.98	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	269,000.00	369,000.00
负债合计	523,724,802.84	982,894.09
所有者权益:		
实收基金	7,473,826,338.24	1,400,044,947.43
未分配利润	-	-
所有者权益合计	7,473,826,338.24	1,400,044,947.43
负债和所有者权益总计	7,997,551,141.08	1,401,027,841.52

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，招商招金宝货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 440,738,900.47 份；招商招金宝货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 7,033,087,437.77 份；总份额合计 7,473,826,338.24 份。

7.2 利润表

会计主体：招商招金宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入	144,150,051.81	53,269,284.05
1.利息收入	144,463,914.03	53,263,119.66
其中：存款利息收入	28,730,333.83	21,608,089.43
债券利息收入	52,042,219.76	15,861,155.77

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	63,691,360.44	15,793,874.46
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-313,862.22	6,164.39
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-313,862.22	6,164.39
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.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	23,593,172.12	8,360,848.10
1. 管理人报酬	14,668,361.44	4,881,402.85
2. 托管费	4,444,957.95	1,479,212.92
3. 销售服务费	971,699.06	860,286.53
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	3,027,550.70	669,507.47
其中：卖出回购金融资产支出	3,027,550.70	669,507.47
6. 其他费用	480,602.97	470,438.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	120,556,879.69	44,908,435.95
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	120,556,879.69	44,908,435.95

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商招金宝货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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）	1,400,044,947.43	-	1,400,044,947.43

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	120,556,879.69	120,556,879.69
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）	6,073,781,390.81	-	6,073,781,390.81
其中：1. 基金申购款	33,432,261,222.50	-	33,432,261,222.50
2. 基金赎回款	-27,358,479,831.69	-	-27,358,479,831.69
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）	-	-120,556,879.69	-120,556,879.69
五、期末所有者权益（基金净值）	7,473,826,338.24	-	7,473,826,338.24
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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）	821,063,910.25	-	821,063,910.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,908,435.95	44,908,435.95
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）	578,981,037.18	-	578,981,037.18
其中：1. 基金申购款	10,583,472,406.38	-	10,583,472,406.38
2. 基金赎回款	-10,004,491,369.20	-	-10,004,491,369.20
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）	-	-44,908,435.95	-44,908,435.95
五、期末所有者权益（基金净值）	1,400,044,947.43	-	1,400,044,947.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

金旭
基金管理人负责人

欧志明
主管会计工作负责人

何剑萍
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

招商招金宝货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准招商招金宝货币市场基金募集的批复》（证监许可[2014]471号文）批准，由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》及其配套规则和《招商招金宝货币市场基金基金合同》发售，基金合同于2014年6月18日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为1,271,562,184.15份基金份额。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金于2014年6月3日至2014年6月16日募集，募集期间净认购资金人民币1,271,340,585.71元，认购资金在募集期间产生的利息人民币221,598.44元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计1,271,562,184.15份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第1400434号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商招金宝货币市场基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商招金宝货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在1年以内（含1年）的债券回购、中央银行票据，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、中期票据，及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。法律法规或监管机构允许基金投资其他基金的，且允许货币市场基金投资其他货币市场基金的，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下，本基金可参与其他货币市场基金的投资，不需召开持有人大会。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款基准利率（税后）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年

12 月 31 日的财务状况、2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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的说明

报告期所采用的会计政策、会计估计与 2015 年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008]1 号文《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 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金及同类型基金适用的主要税项列示如下：

(a) 2016 年 4 月 30 日（含）前以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入，暂免征收企业所得税，4 月 30 日（含）前免征营业税。

(c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(d)对基金取得的债券的利息收入，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。

(e)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税，并由内地发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(f)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

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
中国银行	基金托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
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
招商财富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
招商资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,668,361.44	4,881,402.85
其中：支付销售机构的客户维护费	1,295,465.51	946,863.61

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,444,957.95	1,479,212.92

注：支付基金托管人中国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。计算公式为：

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

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商招金宝货币 A	招商招金宝货币 B	合计
招商基金管理有限公司	62,473.89	397,189.60	459,663.49

招商银行	385,273.02	3,776.98	389,050.00
中国银行	59,786.17	409.53	60,195.70
招商证券	-	-	-
合计	507,533.08	401,376.11	908,909.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	招商招金宝货币 A	招商招金宝货币 B	合计
招商基金管理有限公司	32,157.38	102,411.64	134,569.02
招商银行	389,331.71	6,754.48	396,086.19
中国银行	274,227.81	5,647.28	279,875.09
招商证券	-	-	-
合计	695,716.90	114,813.40	810,530.30

注：根据基金合同的规定，招商招金宝货币 A 的销售服务费按基金前一日资产净值×0.25%的年费率来计提，招商招金宝货币 B 的销售服务费按基金前一日资产净值×0.01%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

招商招金宝货币 A 的日销售服务费 = 前一日招商招金宝货币 A 资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数

招商招金宝货币 B 的日销售服务费 = 前一日招商招金宝货币 B 资产净值 × 0.01% ÷ 当年天数

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	2,251,510,000.00	163,331.37
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	727,050,000.00	57,107.72

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未及上年度可比期间运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	158,537,835.64	211,196.53	11,111,542.34	178,501.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未及上年度可比期间在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因为认购新发或增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 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的流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 515,758,826.36 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
130212	13 国开 12	2017 年 1 月 3 日	99.65	300,000	29,895,000.00
140201	14 国开 01	2017 年 1 月 3 日	100.11	1,100,000	110,121,000.00
160414	16 农发 14	2017 年 1 月 3 日	99.85	700,000	69,895,000.00
111610658	16 兴业 CD658	2017 年 1 月 3 日	98.05	2,000,000	196,100,000.00
160304	16 进出 04	2017 年 1 月 3 日	99.85	200,000	19,970,000.00
111682668	16 广州农村商业银行 CD179	2017 年 1 月 3 日	97.91	780,000	76,369,800.00
140434	14 农发 34	2017 年 1 月 3 日	100.60	300,000	30,180,000.00
合计				5,380,000	532,530,800.00

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 以公允价值计量的金融工具

(a) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

持续的公允价值计量资产	本期末 (2016 年 12 月 31 日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	-	-	-	-
债券投资	-	1,185,324,048.39	-	1,185,324,048.39
持续以公允价值计量的资产总额	-	1,185,324,048.39	-	1,185,324,048.39

单位：人民币元

持续的公允价值计量资产	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产				
股票投资	-	-	-	-
债券投资	-	748,556,290.89	-	748,556,290.89
持续以公允价值计量的资产总额	-	748,556,290.89	-	748,556,290.89

2016 年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债的第一层次与第二层次之间没有发生转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

2016 年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息，本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设参见本年度报告正文附注 7.4.4.4 和 7.4.4.5。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2015 年 12 月 31 日：无）。

7.4.10.1.2 其他金融工具的公允价值(非以公允价值计量账面价值)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,185,324,048.39	14.82
	其中：债券	1,185,324,048.39	14.82
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,076,411,514.61	50.97
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,638,537,835.64	32.99
4	其他各项资产	97,277,742.44	1.22
5	合计	7,997,551,141.08	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		3.89
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	515,758,826.36	6.90
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	14

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	54.18	6.90
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	6.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	14.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	29.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.71	6.90

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期没有超过 240 天的情况。

8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	260,441,636.34	3.48
	其中：政策性金融债	260,441,636.34	3.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	89,921,082.14	1.20
6	中期票据	-	-
7	同业存单	834,961,329.91	11.17
8	其他	-	-
9	合计	1,185,324,048.39	15.86
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111610658	16 兴业 CD658	2,000,000	195,553,591.74	2.62
2	111617319	16 光大 CD319	2,000,000	195,477,364.78	2.62
3	140201	14 国开 01	1,100,000	110,125,163.72	1.47
4	111610331	16 兴业 CD331	1,000,000	99,896,887.21	1.34
5	111682668	16 广州农村商业银行 CD179	1,000,000	97,817,765.08	1.31
6	160414	16 农发 14	700,000	70,056,636.88	0.94
7	011698773	16 陕煤化 SCP010	500,000	49,978,788.11	0.67
8	111694704	16 重庆银行 CD027	500,000	49,653,704.37	0.66
9	111611476	16 平安 CD476	500,000	49,487,374.87	0.66
10	111694641	16 西安银行 CD028	500,000	49,256,255.46	0.66

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1025%
报告期内偏离度的最低值	-0.0968%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0354%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.0000 元。

8.9.2 报告期内基金投资的前十名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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	17,658,618.73
4	应收申购款	79,619,123.71
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	97,277,742.44

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
A 级	11,778	37,420.52	45,563,653.74	10.34%	395,175,246.73	89.66%
B 级	103	68,282,402.31	6,835,921,498.91	97.20%	197,165,938.86	2.80%
合计	11,881	68,319,822.83	6,881,485,152.65	92.07%	592,341,185.59	7.93%

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）。

9.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	A 级	2,348,661.69	0.5329%
	B 级	-	-
	合计	2,348,661.69	0.0314%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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）。

9.3 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的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	A 级	10-50
	B 级	0
	合计	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	A 级	0
	B 级	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	招商招金宝货币 A	招商招金宝货币 B
基金合同生效日（2014 年 6 月 18 日）基金 份额总额	840,744,227.14	430,987,274.77
本报告期期初基金份额总额	154,283,754.79	1,245,761,192.64
本报告期基金总申购份额	1,012,628,976.78	32,419,632,245.72
减:本报告期基金总赎回份额	726,173,831.10	26,632,306,000.59
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	440,738,900.47	7,033,087,437.77

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、根据本基金管理人 2016 年 11 月 24 日的公告，经招商基金管理有限公司第五届董事会审议通过，聘任杨渺为公司副总经理。

2、2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年，本报告期应支付毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 60,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中投证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	新增
华泰证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	新增
国泰君安	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	新增
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	新增
东方证券	1	-	-	-	-	新增
中信建投	6	-	-	-	-	新增
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	新增
红塔证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	新增
天风证券	2	-	-	-	-	新增
华创证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	新增

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

招商基金管理有限公司
2017 年 3 月 31 日