

# 招商保证金快线货币市场基金 2021 年 年度报告

2021 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 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 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	17
§5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	18
§6 审计报告.....	18
6.1 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告.....	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 债券回购融资情况.....	45
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	46
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.....	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	47

8.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	47
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	48
8.9	投资组合报告附注	48
§9	基金份额持有人信息	49
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
9.2	期末上市基金前十名持有人	50
9.3	期末货币市场基金前十名份额持有人情况	50
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
9.5	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	51
§10	开放式基金份额变动	51
§11	重大事件揭示	52
11.1	基金份额持有人大会决议	52
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	52
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
11.4	基金投资策略的改变	52
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	53
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	53
11.9	其他重大事件	53
§12	影响投资者决策的其他重要信息	57
12.1	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	57
§13	备查文件目录	57
13.1	备查文件目录	57
13.2	存放地点	57
13.3	查阅方式	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商保证金快线货币市场基金		
基金简称	招商保证金快线		
场内简称	招商快线 ETF		
基金主代码	159003		
交易代码	159003		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 5 月 17 日		
基金管理人	招商基金管理有限公司		
基金托管人	平安银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	6,094,706,728.11 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2014 年 10 月 20 日		
下属分级基金的基金简称	招商保证金快线 A	招商保证金快线 B	招商保证金快线 D
下属分级基金的场内简称	招商快线	招商快线	-
下属分级基金的交易代码	159003	159004	011258
报告期末下属分级基金的份额总额	2,493,954.00 份	3,811,433.00 份	6,088,401,341.11 份

注：1、本基金 A 和 B 级份额净值为 100 元，本基金 D 级份额净值为 1 元；

2、本基金从 2021 年 3 月 8 日起新增 D 类份额，D 类份额自 2021 年 3 月 10 日起存续；

3、本基金自 2021 年 8 月 23 日起新增扩位证券简称，扩位证券简称为“招商快线 ETF”。

### 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	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。
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，属于证券市场中的低风险品种，本基金的风险

	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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	李帅帅
	联系电话	0755-83196666	0755-25878287
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95511-3
传真		0755-83196475	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码		518040	518001
法定代表人		王小青	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼
注册登记机构	招商保证金快线 A、B：中国证券登记结算有限责任公司 招商保证金快线 D：招商基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 深圳市福田区深南大道 7088 号

## § 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

单位：人民币元

#### 1、招商保证金快线 A

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	6,014,973.33	3,235,717.96	4,526,844.98

本期利润	6,014,973.33	3,235,717.96	4,526,844.98
本期净值收益率	2.1387%	1.7772%	2.1103%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末基金资产净值	249,395,400.00	180,438,400.00	133,696,100.00
期末基金份额净值	100.00	100.00	100.00
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
累计净值收益率	25.3875%	23.2488%	21.4716%

## 2、招商保证金快线 B

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	16,281,237.11	2,464,117.93	2,038,793.17
本期利润	16,281,237.11	2,464,117.93	2,038,793.17
本期净值收益率	2.3786%	2.0171%	2.3506%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末基金资产净值	381,143,300.00	524,410,200.00	6,390,000.00
期末基金份额净值	100.00	100.00	100.00
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
累计净值收益率	27.9768%	25.5982%	23.5810%

## 3、招商保证金快线 D

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 3 月 10 日-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	18,060,859.62
本期利润	18,060,859.62
本期净值收益率	1.8776%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末基金资产净值	6,088,401,341.11
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
累计净值收益率	1.8776%

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，由于货币市场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（申）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、本基金从 2021 年 3 月 8 日起新增 D 类份额，D 类份额自 2021 年 3 月 10 日起存续，截至本报告期末存续未满一年，本报告期为非完整会计年度。

## 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

招商保证金快线 A

阶段	净值收益率①	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	0.5430%	0.0012%	0.0894%	0.0000%	0.4536%	0.0012%
过去六个月	1.0630%	0.0014%	0.1789%	0.0000%	0.8841%	0.0014%
过去一年	2.1387%	0.0011%	0.3549%	0.0000%	1.7838%	0.0011%
过去三年	6.0263%	0.0013%	1.0656%	0.0000%	4.9607%	0.0013%
过去五年	12.8615%	0.0025%	1.7753%	0.0000%	11.0862%	0.0025%
自基金合同生效起至今	25.3875%	0.0053%	3.0635%	0.0000%	22.3240%	0.0053%

招商保证金快线 B

阶段	净值收益率①	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	0.6036%	0.0012%	0.0894%	0.0000%	0.5142%	0.0012%
过去六个月	1.1840%	0.0014%	0.1789%	0.0000%	1.0051%	0.0014%
过去一年	2.3786%	0.0011%	0.3549%	0.0000%	2.0237%	0.0011%
过去三年	6.7463%	0.0013%	1.0656%	0.0000%	5.6807%	0.0013%
过去五年	14.0635%	0.0025%	1.7753%	0.0000%	12.2882%	0.0025%
自基金合同生效起至今	27.9768%	0.0054%	3.0635%	0.0000%	24.9133%	0.0054%

招商保证金快线 D

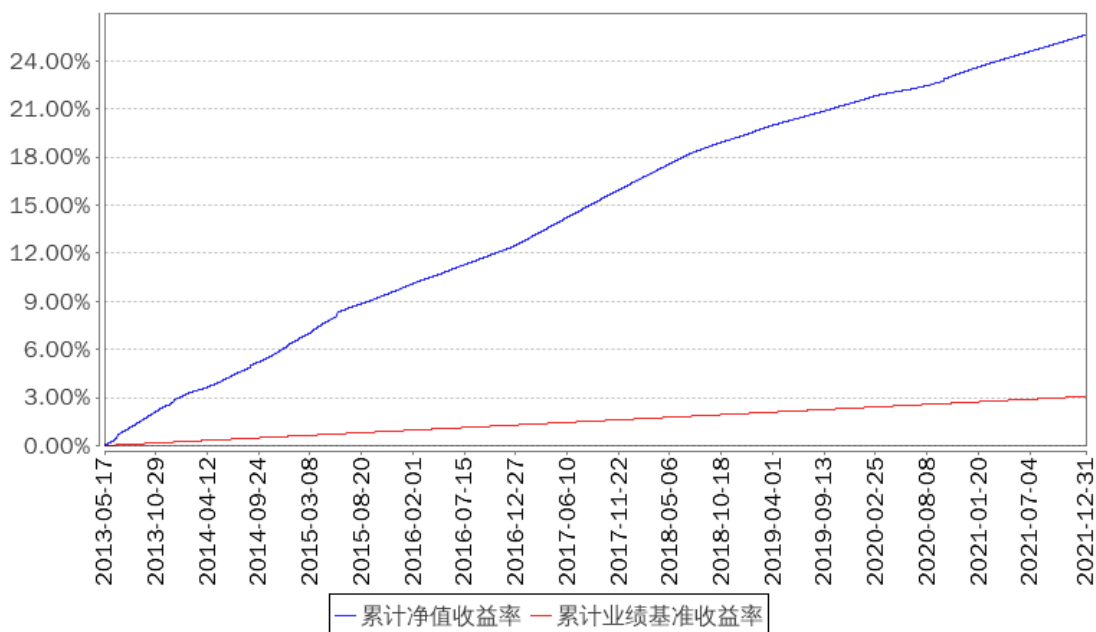
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6036%	0.0012%	0.0894%	0.0000%	0.5142%	0.0012%
过去六个月	1.1840%	0.0014%	0.1789%	0.0000%	1.0051%	0.0014%
自基金合同生效起至今	1.8776%	0.0012%	0.2887%	0.0000%	1.5889%	0.0012%

注：本基金收益分配为“每日分配、按月支付”的现金分红。

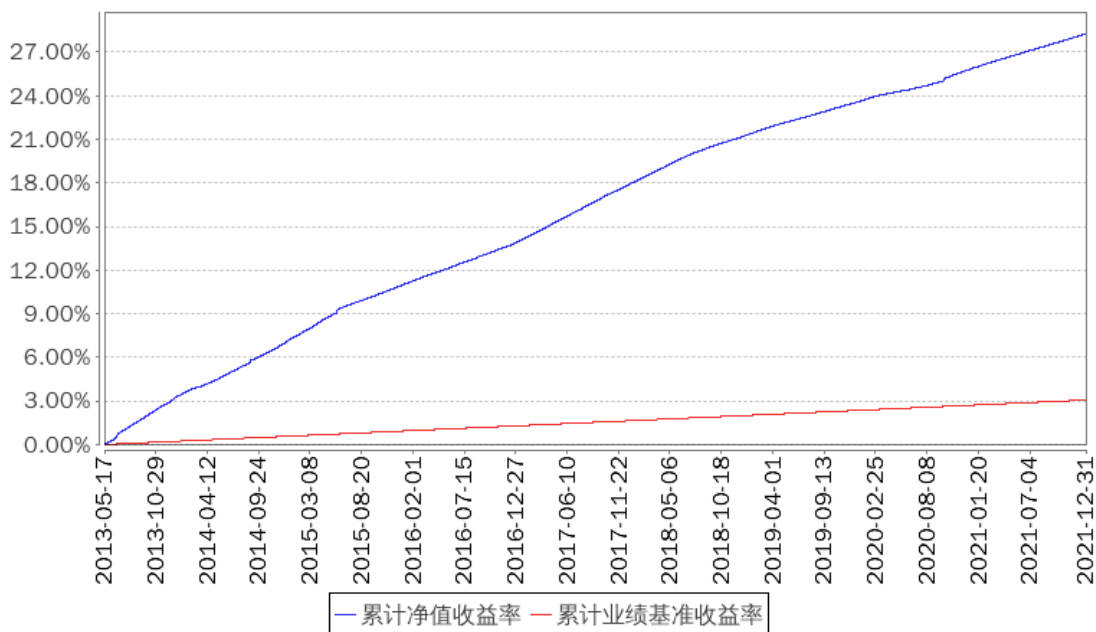
### 3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



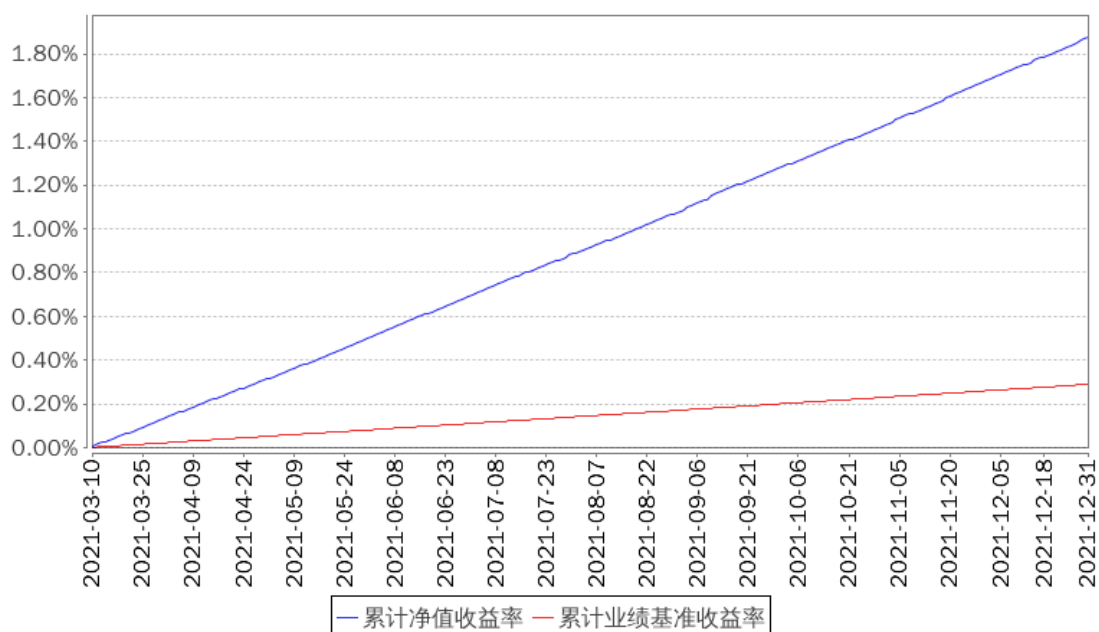
招商保证金快线A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商保证金快线B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



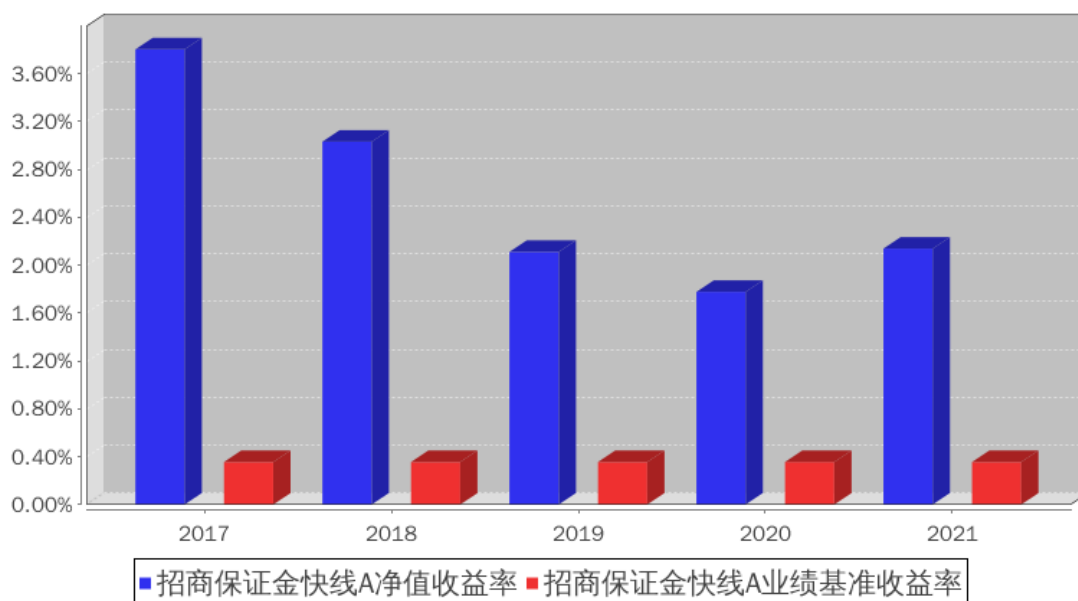
招商保证金快线D累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



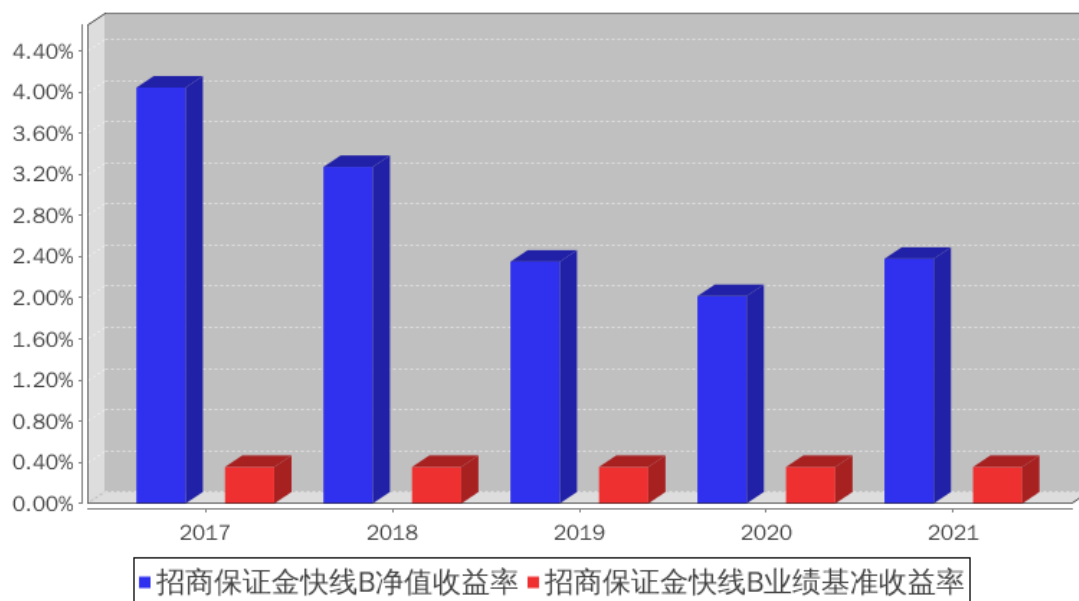
注：本基金从 2021 年 3 月 8 日起新增 D 类份额，D 类份额自 2021 年 3 月 10 日起存续。

### 3.2.3 过去五年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

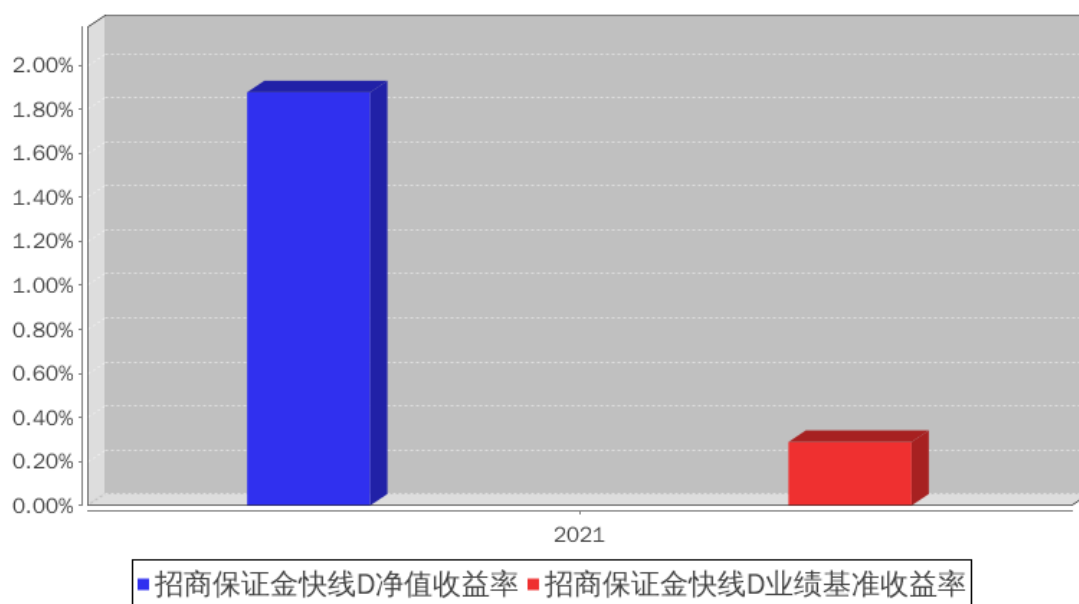
招商保证金快线A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



招商保证金快线B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



招商保证金快线D基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金从 2021 年 3 月 8 日起新增 D 类份额，D 类份额自 2021 年 3 月 10 日起存续，截至本报告期末基金存续未满 1 年，故存续起始当年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

招商保证金快线 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

2021 年	-	5,924,223.32	90,750.01	6,014,973.33	-
2020 年	-	3,198,770.68	36,947.28	3,235,717.96	-
2019 年	-	4,602,472.53	-75,627.55	4,526,844.98	-
合计	-	13,725,466.53	52,069.74	13,777,536.27	-

招商保证金快线 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
2021 年	-	16,393,175.87	-111,938.76	16,281,237.11	-
2020 年	-	1,955,336.54	508,781.39	2,464,117.93	-
2019 年	-	2,272,106.03	-233,312.86	2,038,793.17	-
合计	-	20,620,618.44	163,529.77	20,784,148.21	-

招商保证金快线 D

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
2021 年	10,899,824.16	1,761,797.87	5,399,237.59	18,060,859.62	-
合计	10,899,824.16	1,761,797.87	5,399,237.59	18,060,859.62	-

## § 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、公募基金投顾业务资格，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		
曹晋文	本基金基金经理	2021 年 11 月 4 日	-	7	男，硕士。曾任中国人寿资产管理有限公司账户助理、信诚人寿保险有限公司投资经

	理				理、民生加银基金管理有限公司固定收益部基金经理、格林基金管理有限公司固定收益部基金经理、部门副总监。2020 年 1 月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，现任招商保证金快线货币市场基金、招商理财 7 天债券型证券投资基金、招商招福宝货币市场基金、招商招禧宝货币市场基金基金经理。
许强	本基金基金经理（已离任）	2016 年 2 月 6 日	2021 年 11 月 4 日	11	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，招商保证金快线货币市场基金、招商理财 7 天债券型证券投资基金、招商招恒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、招商招丰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、招商招琪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、招商招华纯债债券型证券投资基金、招商招弘纯债债券型证券投资基金、招商招益宝货币市场基金、招商招景纯债债券型证券投资基金、招商招享纯债债券型证券投资基金、招商招禧宝货币市场基金、招商招轩纯债债券型证券投资基金基金经理，现任招商招金宝货币市场基金、招商财富宝交易型货币市场基金、招商招信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招利宝货币市场基金、招商招诚半年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商定期宝六个月期理财债券型证券投资基金、招商现金增值开放式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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《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，基金管理人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

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。

### 4.3.3 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，国内经济在疫情后呈现复苏态势，全年 GDP 同比增长 8.1%，增速较上年提高 5.9 个百分点。分季度看，由于 2020 年基数前低后高和下半年以来地产拖累、基建乏力等问题，2021 年经济增速呈现前高后低态势，四个季度 GDP 增速分别为 18.3%、7.9%、4.9% 和 4.0%，下半年以来 GDP 增速跌破 5%。投资方面，12 月固定资产投资完成额累计同比增长 4.9%，两年平均增速为 3.9%，投资端表现一般。其中房地产投资自 6 月以来持续下滑，且下滑幅度较大，12 月房地产开发投资累计同比增长 4.4%，两年平均增速为 5.7%，主要是房企在融资端受限政策频出以及地产销售超预期下滑背景下拿地和新开工意愿下滑所致；基建投资在今年严控地方债务的背景下增长空间较小，虽然财政要求专项债发行尽快形成实物工作量，但落实到具体投资层面尚需一定时间，且 2021 年稳增长压力不大的背景下政府用基建托底经济的意愿不强，12 月基建投资累计同比增长 0.2%，两年平均增速为 1.8%，基建投资增速持续放缓，不过后续在财政前置、专项债发行提速的预期下有望抬升；地产和基建走弱带动固定资产投资整体下行，而制造业投资表现较好，对整体固定资产投资形成支撑，12 月制造业投资累计同比增长 13.5%，两年平均增速为 5.4%，这可能与出口持续高景气拉动制造业投资有关。消费方面，12 月社会消费品零售总额累计同比增长 12.5%，两年平均增速为 4.0%，其中餐饮消费两年平均增速为 -0.5%，消费数据在疫情反复和居民收入高不确定性的情况下依然偏弱。对外贸易方面，受海外主要国家经济高景气度影响，国内出口依然强劲，12 月出口金额累计同比增长 29.9%，两年平均增速为 16.0%，但在海外加息预期抬升、经济复苏态势趋缓以及高基数效应影响下，未来出口增速有较大下行压力。生产方面，国内供给端下半年以来持续走弱，12 月工业增加值累计同比增长 9.6%，两年平均增速为 6.1%。12 月 PMI 指数为 50.3%，11 月以来 PMI 已连续两月回复至荣枯线以上，其中 12 月生产指数和新订单指数分别为 51.4% 和 49.7%，反映经济在边际上呈现弱复苏态势。

货币市场回顾：

资金面在 2021 年一季度内经历了先上后下的波动走势，春节前受走款因素和央行投放流动性力度略小影响，隔夜上行与 7 天利率连续多日倒挂，短端带动长端上行。春节后受财政存款支出超预期及现金回流的影响，资金利率快速下行。二季度央行操作平稳，短端资金和存单、存款利率下行到历史极低分位数水平，6 月份受季末影响，资金面利率明显抬升。三季度受经济下行压力影响央行宣布降准 25bp，置换部分 MLF，存款存单利率下行，资金面利率更加平稳，在 2.2% 以下位置波动。四季度 11 月初受房企债务违约影响，央行积极投放资金，市场降准预期浓厚。11 月末受各机构杠杆高企影响，资金面趋紧，跨月困难。12 月央行宣布降准 25bp，同时置换部分 MLF，资金面受跨年因素扰动，短端及长端利率不断上行，逆回购配置价值上升。年末最后一天，受大行及非银融出增多，资金面重回平稳宽松。年前 1 年存单从 2.75% 下行到 2.6%。

总结来看，2021 年较好配置时点为一季度春节前和四季度。二三季度资金面表现平稳，略有波动。操作中坚持“早买早收益”和注重组合交易的灵活性会体现较好的收益水平。

基金操作回顾：

本基金在报告期内，在满足法律法规及流动性需求的情况下，积极寻找利率曲线上的高收益资产，尽可能拉长久期和提高杠杆，以增厚组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值收益率为 2.1387%，同期业绩基准收益率为 0.3549%，B 类份额净值收益率为 2.3786%，同期业绩基准收益率为 0.3549%，D 类份额净值收益率为 1.8776%，同期业绩基准收益率为 0.2887%。

#### 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：

2022 年经济政策重心转为稳增长，央行为配合经济政策，预计会继续维持稳中偏松的货币政策。市场对央行在上半年继续降准降息的预期很浓烈，导致目前利率水平处在历史分位数较低的水平。需要注意降准降息的兑现情况，或带来市场的反转。整体来看，我们预计资金面短期内会处于较为宽松的水平，长期受美国加息节奏加快的影响，或一定程度上制约央行货币政策继续宽松。组合操作上，会继续坚持早配置早收益的配置思路，寻找利率曲线上价值较高的资产，努力提高持有人收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责、合法经营和保障基金持有人利益的原则，经营管理和业务运作稳健、合规，基金的投资、交易、后台等运作规范有序。基



金管理人的风险管理及合规控制部门依据独立、客观、公正的原则，主要从以下几个方面进一步加强了公司内部控制和基金投资风险管理工作：

1、公司实施了员工全面培训和形式多样的专题培训，包括不定期推送监管动态和风险案例，持续整理风险点录入系统定期推送，定期或不定期组织法规考试，不定期开展各类合规主题培训等，丰富培训形式，不断提升员工合规与风控意识；

2、公司合规风控部门通过事中合规控制系统、事后投资风险管理系统、风险管理模型等对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理；

3、定期稽核方面，除了每季度会对各业务领域进行一次全面的稽核，公司合规审计部门还根据监察稽核计划，对公司的关键业务部门及业务流程进行了专项稽核和检查；

4、根据法律法规的更新及业务的发展变化情况，公司各业务部门对相关内部控制制度提出修改意见和建议，并关注内部控制制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度体系，更好的防范法律风险和合规风险。

报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定，未发现重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损基金投资者利益的情形。报告期内，本基金若曾因市场波动、申购赎回等原因出现了相关投资比例限制被动突破的情形，均在法规规定的时间内完成了调整，符合法律法规和基金合同的规定和要求。报告期内，本基金未出现因权证未行权、可转债未及时卖出或转股等有损基金份额持有人利益的投资失误行为。本基金管理人承诺将一如既往本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在规范经营、控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付。本报告期内，招商保证金快线 A 共分配利润人民币 6,014,973.33 元，招商保证金快线 B 共分配利润人民币 16,281,237.11 元，招商保证金快线 D 共分配利润人民币 18,060,859.62 元，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	招商保证金快线货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的招商保证金快线货币市场基金(以下简称“招商保证金快线基金”)财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了招商保证金快线基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于招商保证金快线基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>招商保证金快线基金管理人招商基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括招商保证金快线基金 2021 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,</p>

	<p>我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>招商保证金快线基金管理人招商基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，招商保证金快线基金管理人招商基金管理有限公司管理层负责评估招商保证金快线基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非招商保证金快线基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>招商保证金快线基金管理人招商基金管理有限公司治理层负责监督招商保证金快线基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价招商保证金快线基金管理人招商基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对招商保证金快线基金管理人招商基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对招商保证金快线基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致招商保证金快线基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与招商保证金快线基金管理人招商基金管理有限公司治理层</p>

	就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴钟鸣	刘西茜
会计师事务所的地址	中国北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：招商保证金快线货币市场基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,444,120,861.61	114,756,283.18
结算备付金		-	175,238.10
存出保证金		278,870.66	-
交易性金融资产	7.4.7.2	3,434,661,476.91	418,203,301.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,434,661,476.91	418,203,301.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,519,562,939.35	276,133,133.66
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	7,721,389.64	1,778,267.83
应收股利		-	-
应收申购款		4,992,015.67	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		7,411,337,553.84	811,046,223.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		684,998,372.50	51,409,774.29

应付证券清算款		-	53,707,078.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		674,316.84	120,424.18
应付托管费		269,726.73	48,169.69
应付销售服务费		92,883.12	48,382.05
应付交易费用	7.4.7.7	83,811.67	18,250.56
应交税费		2,176.74	-
应付利息		44,941.13	2,310.02
应付利润		6,042,284.00	664,235.16
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,000.00	179,000.00
负债合计		692,397,512.73	106,197,623.97
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	6,718,940,041.11	704,848,600.00
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		6,718,940,041.11	704,848,600.00
负债和所有者权益总计		7,411,337,553.84	811,046,223.97

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，招商保证金快线 A 份额净值 100.0000 元，基金份额总额 2,493,954.00 份；招商保证金快线 B 份额净值 100.0000 元，基金份额总额 3,811,433.00 份；招商保证金快线 D 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,088,401,341.11 份；总份额合计 6,094,706,728.11 份。

## 7.2 利润表

会计主体：招商保证金快线货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		48,611,504.56	7,220,866.25
1.利息收入		47,527,243.73	7,220,866.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,128,155.14	1,870,466.92
债券利息收入		24,020,021.76	2,936,631.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,379,066.83	2,413,767.48
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,084,260.83	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.12	1,084,260.83	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12.5	-	-
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）	7.4.7.13	-	-
减：二、费用		8,254,434.50	1,521,030.36
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	3,409,424.35	587,985.30
2.托管费	7.4.10.2.2	1,363,769.83	235,194.10
3.销售服务费	7.4.10.2.3	847,672.06	461,302.36
4.交易费用	7.4.7.14	-	-
5.利息支出		2,409,562.03	28,909.48
其中：卖出回购金融资产支出		2,409,562.03	28,909.48
6.税金及附加		6,776.20	393.95
7.其他费用	7.4.7.15	217,230.03	207,245.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,357,070.06	5,699,835.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,357,070.06	5,699,835.89

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商保证金快线货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	704,848,600.00	-	704,848,600.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,357,070.06	40,357,070.06
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）	6,014,091,441.11	-	6,014,091,441.11
其中：1.基金申购款	21,667,511,910.30	-	21,667,511,910.30
2.基金赎回款	-15,653,420,469.19	-	-15,653,420,469.19

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）	-	-40,357,070.06	-40,357,070.06
五、期末所有者权益（基金净值）	6,718,940,041.11	-	6,718,940,041.11
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	140,086,100.00	-	140,086,100.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,699,835.89	5,699,835.89
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）	564,762,500.00	-	564,762,500.00
其中：1.基金申购款	10,348,007,900.00	-	10,348,007,900.00
2.基金赎回款	-9,783,245,400.00	-	-9,783,245,400.00
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）	-	-5,699,835.89	-5,699,835.89
五、期末所有者权益（基金净值）	704,848,600.00	-	704,848,600.00

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：

\_\_\_\_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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

招商保证金快线货币市场基金(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”)《关于核准招商保证金快线货币市场基金募集的批复》(证监许可[2013]65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《招商保证金快线货币市场基金基金合同》发售,基金合同于2013年5月17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3,387,812,874.00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,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。



本基金于 2013 年 5 月 13 日开始募集，并于当日募集完毕，募集期间净认购资金人民币 3,387,718,000.00 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 94,874.00 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 3,387,812,874.00 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 1300025 号验资报告。

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”),对已经存续的开放式证券投资基金且基金合同内容不符合《流动性风险管理规定》要求的,应当在《流动性风险管理规定》施行之日起 6 个月内予以调整。根据《流动性风险管理规定》等法律法规,经与基金托管人协商一致,招商基金管理有限公司对本基金合同相关条款进行修订,修订后的合同自 2018 年 3 月 22 日生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《招商保证金快线货币市场基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商保证金快线货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金为货币市场基金,主要投资于以下金融工具,包括:现金;期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,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)。

招商保证金快线 A 基金份额、B 基金份额于 2014 年 10 月 20 日开始在深圳证券交易所上市交易。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。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<年度和中期报告>》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 12 月 31 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格（即相关金融工具的公允价值），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所

引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按卖出成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权。基金收益分配采用现金分红方式。“每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为基金份额持有人每日计算当日收益并全部分配，每月集中支付。本基金收益每月集中支付一次，每月累计收益支付方式采用现金分红方式。若基金份额持有人赎回全部基金份额时，其累计未付收益将一并结算。当日申购的基金份额自下一工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起不享有基金的分配权益。

#### 7.4.4.11 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。

### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

(b) 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。

2018 年 1 月 1 日(含)以后, 资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 以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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税; 对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税; 同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

(d) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税, 分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率, 计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	14,120,861.61	54,756,283.18
定期存款	1,430,000,000.00	60,000,000.00
其中: 存款期限 1 个月以内	100,000,000.00	-
存款期限 1-3 个月	730,000,000.00	15,000,000.00
存款期限 3 个月以上	600,000,000.00	45,000,000.00
其他存款	-	-
合计	1,444,120,861.61	114,756,283.18

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	3,434,661,476.91	3,436,192,000.00	1,530,523.09	0.0228
	合计	3,434,661,476.91	3,436,192,000.00	1,530,523.09	0.0228
资产支持证券		-	-	-	-
合计		3,434,661,476.91	3,436,192,000.00	1,530,523.09	0.0228
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	418,203,301.20	418,412,300.00	208,998.80	0.0297
	合计	418,203,301.20	418,412,300.00	208,998.80	0.0297
资产支持证券		-	-	-	-
合计		418,203,301.20	418,412,300.00	208,998.80	0.0297

注：于 12 月 31 日，本基金交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,519,562,939.35	-
合计	2,519,562,939.35	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	53,700,000.00	-
银行间市场	222,433,133.66	-
合计	276,133,133.66	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,875.39	4,722.26
应收定期存款利息	4,521,224.35	191,500.32
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	78.90
应收债券利息	1,411,536.99	1,490,815.42
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	1,785,627.41	91,150.93
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	125.50	-
合计	7,721,389.64	1,778,267.83

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	83,811.67	18,250.56
合计	83,811.67	18,250.56

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	189,000.00	179,000.00
合计	189,000.00	179,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

招商保证金快线 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,804,384.00	180,438,400.00
本期申购	102,419,047.00	10,241,904,700.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-101,729,477.00	-10,172,947,700.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	2,493,954.00	249,395,400.00

招商保证金快线 B		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,244,102.00	524,410,200.00
本期申购	29,919,325.00	2,991,932,500.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-31,351,994.00	-3,135,199,400.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	3,811,433.00	381,143,300.00

招商保证金快线 D		
项目	本期 2021 年 3 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-



本期申购	8,433,674,710.30	8,433,674,710.30
本期赎回（以“-”号填列）	-2,345,273,369.19	-2,345,273,369.19
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	6,088,401,341.11	6,088,401,341.11

注：本期申购赎回含“强增强减”份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

招商保证金快线 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	6,014,973.33	-	6,014,973.33
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-6,014,973.33	-	-6,014,973.33
本期末	-	-	-

招商保证金快线 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	16,281,237.11	-	16,281,237.11
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-16,281,237.11	-	-16,281,237.11
本期末	-	-	-

招商保证金快线 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	18,060,859.62	-	18,060,859.62
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-18,060,859.62	-	-18,060,859.62
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	94,475.70	849,957.82
定期存款利息收入	11,018,287.94	1,019,208.42
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	14,622.23	1,300.68
其他	769.27	-
合计	11,128,155.14	1,870,466.92

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	1,084,260.83	-
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	1,084,260.83	-

##### 7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,167,765,089.64	1,143,957,314.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,150,839,066.63	1,143,000,000.00
减：应收利息总额	15,841,762.18	957,314.75
买卖债券差价收入	1,084,260.83	-

##### 7.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

##### 7.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

##### 7.4.7.12.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.14 交易费用

本基金本报告期内及上年度可比期间无交易费用。

#### 7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	37,230.03	37,245.17
合计	217,230.03	207,245.17

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 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
平安银行股份有限公司	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：1、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。

2、基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,409,424.35	587,985.30
其中：支付销售机构的客户维护费	184,485.22	-
支付投资顾问的投资顾问费	-	-

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×0.20%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,363,769.83	235,194.10

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.08%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

#### 7.4.10.2.3 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	招商保证金快线 A	招商保证金快线 B	招商保证金快线 D	合计
平安银行	-	-	23,898.47	23,898.47
招商基金管理有限公司	162.47	29.03	42,774.41	42,965.91

招商证券	10,244.56	6,731.09	-	16,975.65
合计	10,407.03	6,760.12	66,672.88	83,840.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	招商保证金快线 A	招商保证金快线 B	招商保证金快线 D	合计
招商证券	9,610.31	1,384.69	-	10,995.00
平安银行	-	-	-	-
招商基金管理有 限公司	-	-	-	-
合计	9,610.31	1,384.69	-	10,995.00

注：1、本基金的 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，D 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

A 类份额日销售服务费=前一日 A 类基金资产净值×0.25%÷当年天数

B 类份额日销售服务费=前一日 B 类基金资产净值×0.01%÷当年天数

D 类份额日销售服务费=前一日 D 类基金资产净值×0.25%÷当年天数

2、根据《招商基金管理有限公司关于招商保证金快线货币市场基金 D 类基金份额销售服务费优惠活动的公告》，自 2021 年 5 月 10 日起，本基金的 D 类基金份额销售服务费由“按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提”调整为本基金的基金销售服务费“按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提”。

#### 7.4.10.3 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
平安银行	20,257,182.79	-	-	-	190,000,000.00	11,490.41

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
-	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	招商保证金快线 A	招商保证金快线 B	招商保证金快线 D
基金合同生效日（2013 年 5 月 17 日）持有的	-	-	-

基金份额			
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	180,524,595.71
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	90,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-	90,524,595.71
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	1.49%

项目	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	招商保证金快线 A	招商保证金快线 B	招商保证金快线 D
基金合同生效日（2013 年 5 月 17 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

#### 7.4.10.4.2 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	招商保证金快线 D			
	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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
平安银行股份有限公司	1,103,488,535.66	18.12%	-	-
招商财富资产管理有限公司	100,000,000.00	1.64%	-	-
招商证券股份有限公司	350,020,823.66	5.75%	-	-

#### 7.4.10.5 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
平安银行-活期	14,120,861.61	94,475.70	54,756,283.18	849,957.82
平安银行-定期	100,000,000.00	294,777.78	-	-

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

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

招商保证金快线 A

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	本期利润分配合计	备注
-	5,924,223.32	90,750.01	6,014,973.33	-

招商保证金快线 B

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	本期利润分配合计	备注
-	16,393,175.87	-111,938.76	16,281,237.11	-

招商保证金快线 D

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	本期利润分配合计	备注
10,899,824.16	1,761,797.87	5,399,237.59	18,060,859.62	-

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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 684,998,372.50 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
112103027	21 农业银行 CD027	2022 年 1 月 4 日	99.52	500,000	49,759,532.74
112103047	21 农业银行 CD047	2022 年 1 月 4 日	99.17	1,000,000	99,174,277.20
112106111	21 交通银行 CD111	2022 年 1 月 4 日	99.33	500,000	49,662,594.91
112110274	21 兴业银行 CD274	2022 年 1 月 4 日	98.59	174,000	17,154,326.66
112113213	21 浙商银行	2022 年 1 月 4 日	99.15	1,000,000	99,149,488.42

	CD213				
112114050	21 江苏银行 CD050	2022 年 1 月 4 日	99.22	1,000,000	99,222,731.99
112114086	21 江苏银行 CD086	2022 年 1 月 4 日	98.48	707,000	69,622,542.03
210201	21 国开 01	2022 年 1 月 4 日	100.01	99,000	9,901,226.41
219949	21 贴现国债 49	2022 年 1 月 4 日	99.90	500,000	49,951,971.47
219961	21 贴现国债 61	2022 年 1 月 4 日	99.55	1,900,000	189,137,761.33
合计	-	-	-	7,380,000	732,736,453.16

#### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括债券投资、银行存款与买入返售金融资产。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。

##### 7.4.13.1 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建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

##### 7.4.13.2 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、债券投资及其他金融资产。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，定期存款分别存放于信用良好的股份制商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。



本基金在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并采用券款对付交割方式，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 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6 列示了于本报告期末及上年度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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,000,053.16	-
合计	10,000,053.16	-

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。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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。

#### 7.4.13.2.4 按长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长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 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。

#### 7.4.13.2.6 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	3,046,132,181.56	359,199,976.05
AAA 以下	29,656,114.61	-
未评级	-	-
合计	3,075,788,296.17	359,199,976.05

注：同业存单投资评级以其主体评级进行列示。

#### 7.4.13.3 流动性风险

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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在银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 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。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金投资组合的平均剩余期限，在每个交易日均不得超过 120 天。现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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、债券投资；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。基于本基金产品性质，生息资产占基金资产的比重较大，但资产期限配置比较短，因此本基金利率风险适中。本基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线、久期管理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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	1,444,120,861.61	-	-	-	1,444,120,861.61
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	278,870.66	-	-	-	278,870.66
交易性金融资产	3,434,661,476.91	-	-	-	3,434,661,476.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,519,562,939.35	-	-	-	2,519,562,939.35
应收利息	-	-	-	7,721,389.64	7,721,389.64
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,992,015.67	4,992,015.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,398,624,148.53	-	-	12,713,405.31	7,411,337,553.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	674,316.84	674,316.84
应付托管费	-	-	-	269,726.73	269,726.73
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	684,998,372.50	-	-	-	684,998,372.50
应付销售服务费	-	-	-	92,883.12	92,883.12
应付交易费用	-	-	-	83,811.67	83,811.67
应付利息	-	-	-	44,941.13	44,941.13
应付利润	-	-	-	6,042,284.00	6,042,284.00
应交税费	-	-	-	2,176.74	2,176.74
其他负债	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	684,998,372.50	-	-	7,399,140.23	692,397,512.73
利率敏感度缺口	6,713,625,776.03	-	-	5,314,265.08	6,718,940,041.11
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	114,756,283.18	-	-	-	114,756,283.18
结算备付金	175,238.10	-	-	-	175,238.10
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	418,203,301.20	-	-	-	418,203,301.20
买入返售金融资产	276,133,133.66	-	-	-	276,133,133.66
应收利息	-	-	-	1,778,267.83	1,778,267.83
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	809,267,956.14	-	-	1,778,267.83	811,046,223.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	120,424.18	120,424.18
应付托管费	-	-	-	48,169.69	48,169.69
应付证券清算款	-	-	-	53,707,078.02	53,707,078.02
卖出回购金融资产款	51,409,774.29	-	-	-	51,409,774.29
应付销售服务费	-	-	-	48,382.05	48,382.05
应付交易费用	-	-	-	18,250.56	18,250.56
应付利息	-	-	-	2,310.02	2,310.02
应付利润	-	-	-	664,235.16	664,235.16
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	51,409,774.29	-	-	54,787,849.68	106,197,623.97
利率敏感度缺口	757,858,181.85	-	-	-53,009,581.85	704,848,600.00

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-4,922,755.34	-173,164.47
2. 市场利率平行下降 50 个基点	4,939,918.37	174,116.47	

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具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组合相关。对本基金而言，其他价格风险表现在当投资组合的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动导致与其摊余成本发生重大差异时对损益的影响。本基金管理人通过对加强投资组合管理、优化品种配置、每日跟踪偏离程度等方法对其他价格风险进行管理。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金投资组合的摊余成本与可参考公允价值的偏离程度绝对值为 0.0228% (2020 年 12 月 31 日该值为 0.0297%)。本基金管理人将视情况调整组合以控制风险，规避出现投资组合的摊余成本与可参考公允价值产生重大偏差的可能。

**7.4.13.4.2.1 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。

**7.4.13.4.2.2 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。

**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债**

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(2021 年 12 月 31 日)			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产	3,434,661,476.91	-	3,434,661,476.91	-
-股票投资	-	-	-	-
-债券投资	3,434,661,476.91	-	3,434,661,476.91	-
-基金投资	-	-	-	-
-资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的资产总额	3,434,661,476.91	-	3,434,661,476.91	-

单位：人民币元

持续的公允价值计量资产	上年度末(2020 年 12 月 31 日)			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产	418,203,301.20	-	418,203,301.20	-
-股票投资	-	-	-	-
-债券投资	418,203,301.20	-	418,203,301.20	-
-基金投资	-	-	-	-

资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的资产总额	418,203,301.20	-	418,203,301.20	-

## (a) 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）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

## (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于**错误!未找到引用源。**12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(**错误!未找到引用源。**12月31日：无)。

## 7.4.14.2 其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,434,661,476.91	46.34
	其中：债券	3,434,661,476.91	46.34
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,519,562,939.35	34.00
	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	1,444,120,861.61	19.49
4	其他资产	12,992,275.97	0.18
5	合计	7,411,337,553.84	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	5.56
	其中：买断式回购融资	-

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	684,998,372.50	10.20
	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资产净值比例的简单平均值。

### 8.2.1 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

### 8.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 8.3.3 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的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	40.99	10.20
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）-60 天	1.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）-90 天	35.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）-120 天	12.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）-397 天（含）	19.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	110.12	10.20

## 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未超过 240 天。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	298,858,237.29	4.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,014,890.29	0.74
	其中：政策性金融债	50,014,890.29	0.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,000,053.16	0.15
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,075,788,296.17	45.78
8	其他	-	-
9	合计	3,434,661,476.91	51.12
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名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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	219961	21 贴现国债 61	1,900,000	189,137,761.33	2.81
2	112108083	21 中信银行 CD083	1,500,000	148,896,124.34	2.22
3	112176599	21 宁波银行 CD344	1,000,000	99,491,255.55	1.48
4	112182396	21 宁波银行 CD153	1,000,000	99,487,265.52	1.48
5	112114177	21 江苏银行 CD177	1,000,000	99,486,340.37	1.48
6	112176757	21 宁波银行 CD345	1,000,000	99,484,282.65	1.48
7	112189839	21 广州农村商业银行 CD110	1,000,000	99,426,615.10	1.48
8	112109142	21 浦发银行 CD142	1,000,000	99,321,531.85	1.48
9	112114050	21 江苏银行 CD050	1,000,000	99,222,731.99	1.48
10	112103047	21 农业银行 CD047	1,000,000	99,174,277.20	1.48

## 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	0.0529%
报告期内偏离度的最低值	-0.0284%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0222%

## 8.7.1 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。



## 8.7.2 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 基金计价方法说明

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。

报告期内基金投资的前十名证券除 21 广州农村商业银行 CD110(证券代码 112189839)、21 江苏银行 CD050 (证券代码 112114050)、21 江苏银行 CD177 (证券代码 112114177)、21 宁波银行 CD153 (证券代码 112182396)、21 宁波银行 CD344 (证券代码 112176599)、21 宁波银行 CD345 (证券代码 112176757)、21 农业银行 CD047 (证券代码 112103047)、21 浦发银行 CD142 (证券代码 112109142)、21 中信银行 CD083 (证券代码 112108083) 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、21 广州农村商业银行 CD110 (证券代码 112189839)

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。

#### 2、21 江苏银行 CD050 (证券代码 112114050)

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 3、21 江苏银行 CD177 (证券代码 112114177)

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

#### 4、21 宁波银行 CD153 (证券代码 112182396)

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、涉嫌违反法律法规，多次受到监管机构的处罚。

#### 5、21 宁波银行 CD344 (证券代码 112176599)

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、涉嫌违反法律法规，多次受到监管机构的处罚。

#### 6、21 宁波银行 CD345 (证券代码 112176757)

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、涉嫌违反法律法规，多次受到监管机构的处罚。

7、21 农业银行 CD047（证券代码 112103047）

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、未依法履行职责等原因，多次受到监管机构的处罚。

8、21 浦发银行 CD142（证券代码 112109142）

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。

9、21 中信银行 CD083（证券代码 112108083）

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。

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。

### 8.9.2 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	278,870.66
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	7,721,389.64
4	应收申购款	4,992,015.67
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	12,992,275.97

## § 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
招商保证金快线 A	2,249	1,108.92	168,958.00	6.77%	2,324,996.00	93.23%
招商保证金快线 B	39	97,729.05	3,179,037.00	83.41%	632,396.00	16.59%
招商保证	86	70,795,364.43	6,088,135,340.32	100.00%	266,000.79	0.00%

金快线 D						
合计	2,374	2,567,273.26	6,091,483,335.32	99.95%	3,223,392.79	0.05%

注：1、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）。2、本基金 A、B 级份额净值均为 100 元，本基金 D 级份额净值为 1 元。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华泰证券资管-兴业银行-华泰恒安进取集合资产管理计划	289,910.00	4.60%
2	陈晓	216,020.00	3.43%
3	招商基金-农业银行-招商基金-锐益 AD 期集合资产管理计划	208,500.00	3.31%
4	光大期货-光大银行-光大期货创新优选 5 号集合资产管理计划	201,800.00	3.20%
5	陕西省国际信托股份有限公司-陕国投·东山精密第二期员工持股集合资金信托计划	200,000.00	3.17%
6	华泰证券资管-兴业银行-华泰恒赢创新集合资产管理计划	184,500.00	2.93%
7	华泰证券资管-兴业银行-华泰聚盈增长集合资产管理计划	170,000.00	2.70%
8	光大保德信基金-上海银行-光大保德信致远集合资产管理计划	160,000.00	2.54%
9	光大保德信基金-上海银行-光大保德信慧宇集合资产管理计划	160,000.00	2.54%
10	招商基金-农业银行-招商基金-锐益 AF 期集合资产管理计划	156,415.00	2.48%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供，持有人为场内持有人。其中占上市总份额比例为持有份额除以 A、B 级总份额。

## 9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	1,103,488,535.66	18.11%
2	券商类机构	350,020,823.66	5.74%
3	银行类机构	350,000,000.00	5.74%
4	银行类机构	301,853,660.59	4.95%
5	银行类机构	300,000,000.00	4.92%
6	银行类机构	300,000,000.00	4.92%
7	银行类机构	300,000,000.00	4.92%
8	银行类机构	300,000,000.00	4.92%

9	信托类机构	300,000,000.00	4.92%
10	银行类机构	250,000,000.00	4.10%

#### 9.4 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	招商保证金快线 A	-	-
	招商保证金快线 B	-	-
	招商保证金快线 D	1,375.95	0.0000%
	合计	1,375.95	0.0000%

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）。

#### 9.5 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商保证金快线 A	0
	招商保证金快线 B	0
	招商保证金快线 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商保证金快线 A	0
	招商保证金快线 B	0
	招商保证金快线 D	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商保证金快线 A	招商保证金快线 B	招商保证金快线 D
基金合同生效日 (2013年5月17日) 基金份额总额	1,445,572,335.00	1,942,240,539.00	-
本报告期期初基金份额总额	1,804,384.00	5,244,102.00	-
本报告期期间基金总申购份额	102,419,047.00	29,919,325.00	8,433,674,710.30
减:本报告期基金总赎回份额	101,729,477.00	31,351,994.00	2,345,273,369.19
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-

"-"填列)			
本报告期末基金份额总额	2,493,954.00	3,811,433.00	6,088,401,341.11

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开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

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。

根据本基金管理人 2021 年 9 月 25 日的公告，经招商基金管理有限公司第六届董事会 2021 年第七次会议审议通过，王小青先生离任公司总经理职务、代为履行公司总经理职务。

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

### 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、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 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 9 年，本报告期应支付给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	
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	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。

### 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

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
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	2,181,200,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 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。

## 11.9 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	上海证券报、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	上海证券报及基金管理人网站	2021-01-21
3	招商保证金快线货币市场基金 2020 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-21
4	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-06
5	招商保证金快线货币市场基金托管协议（2021 年 3 月 8 日修订）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
6	招商保证金快线货币市场基金基金合同（2021 年 3 月 8 日修订）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
7	关于招商保证金快线货币市场基金增加基金份额类别并修改基金合同和托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
8	招商保证金快线货币市场基金更新的招募说明书（二零二一年第一号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-12
9	招商保证金快线货币市场基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-12
10	招商保证金快线货币市场基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-12
11	招商保证金快线货币市场基金（D 类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、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	招商保证金快线货币市场基金 2020 年年度报告	上海证券报、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	上海证券报及基金管理人网站	2021-03-30
14	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	上海证券报及基金管理人网站	2021-04-21
15	招商保证金快线货币市场基金 2021 年第 1 季度报告	上海证券报、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关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监	2021-05-07

		会基金电子披露网站	
17	招商基金管理有限公司关于招商保证金快线货币市场基金D类基金份额销售服务费优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-08
18	招商保证金快线货币市场基金更新的招募说明书（二零二一年第二号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-14
19	招商保证金快线货币市场基金（A类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-14
20	招商保证金快线货币市场基金（B类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-14
21	招商保证金快线货币市场基金（D类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-14
22	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-05
23	关于招商保证金快线货币市场基金(D类份额)增加平安银行股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-24
24	关于招商保证金快线货币市场基金(D类份额)增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-28
25	关于暂停招商保证金快线货币市场基金D类份额大额申购（含定期定额投资）业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-02
26	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-07-20
27	招商保证金快线货币市场基金 2021 年第 2 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-20
28	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-12
29	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加国信证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-16
30	招商基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-21
31	招商保证金快线货币市场基金（A类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会	2021-08-26



		会基金电子披露网站	
32	招商保证金快线货币市场基金（B类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-26
33	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-08-30
34	招商保证金快线货币市场基金 2021 年中期报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-30
35	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-25
36	关于开放招商保证金快线货币市场基金 D 类份额转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-10-09
37	招商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2021-10-26
38	招商保证金快线货币市场基金 2021 年第 3 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-10-26
39	关于招商保证金快线货币市场基金基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-04
40	招商保证金快线货币市场基金更新的招募说明书（二零二一年第三号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-09
41	招商保证金快线货币市场基金（A类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-09
42	招商保证金快线货币市场基金（B类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-09
43	招商保证金快线货币市场基金（D类份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-09
44	招商基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-16
45	关于警惕冒用招商基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-07
46	招商基金管理有限公司关于基金美元直销账户信息变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20211015-20211111, 20211201-20211201	-	301,853,660.59	-	301,853,660.59	4.95%
机构	2	20210630-20210706, 20210719-20210914, 20210924-20210928, 20211011-20211021	-	851,463,102.79	501,463,102.79	350,000,000.00	5.74%
机构	3	20210628-20210928, 20211011-20211111, 20211129-20211216, 20211220-20211228	-	1,103,488,535.66	-	1,103,488,535.66	18.11%

#### 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：1、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；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资、买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出、卖出等业务减少的份额。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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保证金快线货币市场基金设立的文件；
- 3、《招商保证金快线货币市场基金基金合同》；
- 4、《招商保证金快线货币市场基金托管协议》；
- 5、《招商保证金快线货币市场基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 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

### 13.3 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

2022 年 3 月 30 日