

信息披露 Disclosure

招商现金增值开放式证券投资基金

2010年12月31日

[2010] 年度报告摘要

基金管理人:招商基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2011年3月30日

§1 重要提示

基金管理人招商业务管理有限公司的董事会、监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。本基金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。

基金管理人招商业务管理有限公司根据基金合同的规定，于2011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、会计报告等內容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并以其真实意思表示。

本基金报告中财务数据未经审计，德勤华永会计师事务所为本基金财务出具了2010年度无保留意见的审计报告，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基金合同。

本年度报告摘要披露于年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本基金报告中财务数据已经审计，德勤华永会计师事务所为本基金财务出具了2010年度无保留意见的审计报告，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基金合同。

本基金报告自2010年4月1日起至2012月31日止。

§2 基金简介

基金简称 招商现金增值货币

基金主代码 217004

交易代码 217004

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2004年1月14日

基金管理人 招商基金管理有限公司

基金托管人 招商银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 6,880,751,690.70份

基金合同终止日期 不定期

下属分级基金的基金简称： 招商现金增值货币A 招商现金增值货币B

下属分级基金的交易代码： 217004 217014

报告期末下属分级基金的份额总额 1,423,257,199.55份 5,457,494,491.15份

§2.2 基金产品说明

保持本基金的安全性与资产的流动性，追求稳定的当期收益

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操作，在保持本基金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。

一年期银行定期储蓄存款的税后利率；(1-利息税率)×一年期银行定期储蓄存款利率

本基金流动性好、安全性高、收益稳定

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人 招商基金管理有限公司 基金托管人 招商银行股份有限公司

名称 招商基金管理有限公司 招商银行股份有限公司

信息披露负责人 姓武进 张燕

联系电话 0755-83196666 0755-83199084

电子邮件 ccmf@cmchina.com yan_zhang@cmchina.com

客户服务电话 400-887-9555 95555

传真 0755-83196405 0755-83195201

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.cmfchina.com

(1) 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

(2) 招商银行股份有限公司资产托管部 地址:中国深圳深南大道7088号招商银行大厦

§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

1. 招商现金增值货币A

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2010年 2009年 2008年

本期已实现收益 37,002,887.25 81,431,892.59 214,776,286.67

本期利润 37,002,887.25 81,431,892.59 214,776,286.67

本期净收益率 1.8279% 1.3671% 3.4380%

3.1.2 期末数据和指标 2010年末 2009年末

期末基金份额净值 1,423,257,199.55 2,365,503,333.49 11,052,076,904.28

期末基金份额总额 1,0000 1,0000 1,0000

3.2.1 招商现金增值货币B

2010年 2009年 2008年

自分级日(2009年12月1日)至2010年12月31日

本期已实现收益 44,444,539.71 2,103,296.79

本期利润 44,444,539.71 2,103,296.79

本期净值收益率 2.0731% 0.1357%

3.2.2 期末数据和指标 2010年末 2009年末

期末基金份额净值 5,457,494,491.15 1,492,813,162.45

期末基金份额总额 1,0000 1,0000 1,0000

注:1. 本期已实现的收益指基金利息收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益、利息收入费用化的余额。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加上本期利润的金额相等。

2. 基金净值无折无溢价买入或卖出份额。

3. 本基金收益分配方式为按份转持份额。

3.2.3 各项净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

招商现金增值货币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标准差③ 业绩比较基准收益率差额④

过去三个月 0.5906% 0.0038% 0.6299% 0.0004% -0.0393% 0.0034%

过去六个月 1.1884% 0.0045% 1.2049% 0.0004% -0.0165% 0.0041%

过去一年 1.8279% 0.0037% 2.3361% 0.0003% -0.5082% 0.0034%

过去三年 6.7687% 0.0064% 8.4422% 0.0021% -1.6735% 0.0043%

过去五年 11.5735% 0.0053% 13.1719% 0.0021% -1.5962% 0.0032%

自基金合同生效起至今 16.8511% 0.0046% 16.5885% 0.0021% -0.2626% 0.0025%

招商现金增值货币B

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标准差③ 业绩比较基准收益率差额④

过去三个月 0.5618% 0.0038% 0.6299% 0.0004% 0.0219% 0.0034%

过去六个月 1.3113% 0.0045% 1.2049% 0.0004% 0.1064% 0.0041%

过去一年 2.0731% 0.0037% 2.3361% 0.0003% -0.2630% 0.0034%

过去三年 2.2116% 0.0037% 2.5236% 0.0003% -0.3120% 0.0034%

自基金合同生效起至今 16.8511% 0.0046% 16.5885% 0.0021% -0.2626% 0.0025%

注:根据基金合同第十四条(五)投资限制的规定:本基金投资于债券及相关品种,但不低于基金总资产的80%,本基金于2004年01月14日成立,自基金成立之日起45个工作日内为建仓期,建仓结束时总投资范围符合上述规定的要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 招商现金增值货币A

3.2.4 过去五年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

招商现金增值货币A

3.2.5 过去五年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

招商现金增值货币B

3.2.6 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.7 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.8 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.9 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.10 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.11 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.12 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.13 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.14 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.15 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.16 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.17 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.18 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.19 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.20 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.21 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.22 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.23 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.24 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.25 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.26 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.27 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.28 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.29 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.30 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.31 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.32 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.33 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.34 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.35 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.36 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.37 未来五年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

招商现金增值货币B

3.2.38 未来五年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

招商现金增值货币A

3.2.39 未来五年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