招商理财7天债券型证券投资基金

【2013】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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014年3月28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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月26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2013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2013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	招商理财7天债券	
基金主代码	217025	
交易代码	217025	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月7日	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	787,271,941.98份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	招商理财7天债券A	招商理财7天债券B
下属分级基金的交易代码:	217025	217026
报告期末下属分级基金的份额总额	502,851,660.86份	284,420,281.12份

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金安全,保持资产流动性的基础上,通过积极主动的管理,力争为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在127天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	中国人民银行公告的金融机构人民币七天通知存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型证券投资基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	欧志明	赵会军
	联系电话	0755-83196666	010-66105799
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-887-9555	95588
传真		0755-83196475	010-66105798

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
基金年度报告报告备置地点	(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)中国工商银行股份有限公司 地址:中国北京市西城区复兴门内大街55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

3.1.1 期间数据和指标	2013年		2012年12月7日(基金合同生效日)-2012年12月31日	
	招商理财7天债券A	招商理财7天债券B	招商理财7天债券A	招商理财7天债券B
本期已实现收益	41,722,259.05	16,194,865.22	6,632,342.34	3,606,191.13
本期利润	41,722,259.05	16,194,865.22	6,632,342.34	3,606,191.13
本期净值收益率	4.3787%	4.6829%	0.2622%	0.2819%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末	
期末基金资产净值	502,851,660.86	284,420,281.12	1,728,582,510.94	951,065,641.20
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2013年末		2012年末	
累计净值收益率	4.6524%	4.9780%	0.2622%	0.2819%

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2012年12月7日生效,至2012年12月31日未满1年,故2012年的数据和指标为非完整会计年度数据。

3.2 基金表现

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

招商理财7天债券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	1.1737%	0.0018%	0.3450%	0.0000%	0.8287%	0.0018%
过去六个月	2.3785%	0.0016%	0.6900%	0.0000%	1.6885%	0.0016%
过去一年	4.3787%	0.0066%	1.3687%	0.0000%	3.0100%	0.0066%
自基金合同生效起至今	4.6524%	0.0064%	1.4625%	0.0000%	3.1899%	0.0064%

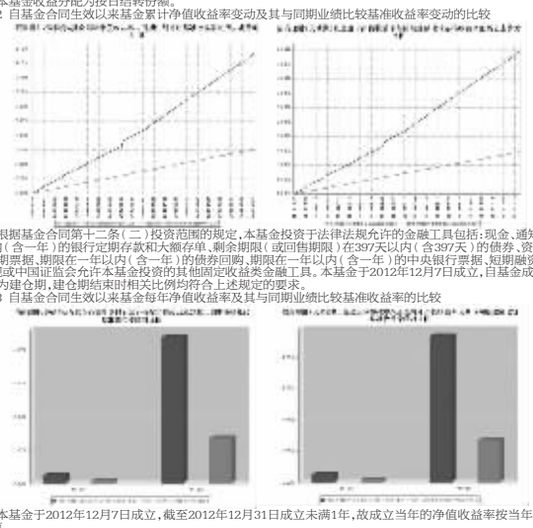
注:本基金收益分配为按日结转份额。

招商理财7天债券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	1.2482%	0.0018%	0.3450%	0.0000%	0.9032%	0.0018%
过去六个月	2.5285%	0.0016%	0.6900%	0.0000%	1.8385%	0.0016%
过去一年	4.6829%	0.0066%	1.3687%	0.0000%	3.3142%	0.0066%
自基金合同生效起至今	4.9780%	0.0064%	1.4625%	0.0000%	3.5155%	0.0064%

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



注:根据基金合同第十三条(二)投资范围的规定,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、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券、及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金于2012年12月7日成立,自基金成立日起6个月内为建仓期,建仓期结束时相关比例均符合上述规定的要求。

3.2.3 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比较

注:本基金于2012年12月7日成立,截至2012年12月31日成立未满1年,故成立当年的净值收益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、招商理财7天债券A

单位:人民币元

招商理财7天债券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
2013	41,722,259.05	-	-	41,722,259.05	
2012年12月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日	6,632,342.34	-	-	6,632,342.34	
合计	48,354,601.39	-	-	48,354,601.39	

2、招商理财7天债券B

单位:人民币元

招商理财7天债券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
2013	16,194,865.22	-	-	16,194,865.22	
2012年12月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日	3,606,191.13	-	-	3,606,191.13	
合计	19,801,056.35	-	-	19,801,056.35	

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2012年12月7日生效,至2012年12月31日未满1年,故2012年的利润分配数据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,是中国第一家中外合资基金管理公司。公司的经营范围包括发起设立基金、基金管理业务和中国证监会批准的其它业务。

经招商基金管理有限公司(以下简称"本公司")股东会审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1074号文批复同意,本公司原股东荷兰投资公司(ING Asset Management B.V.)将其持有的本公司21.6%股权转让给招商银行股份有限公司,11.7%股权转让给招商证券股份有限公司,截止2013年10月份,本次股权转让的相关工商变更登记手续已办理完毕。

目前,本公司的股东股权结构为: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%。公司注册资本金为2.1亿元人民币。招商基金拥有两家全资子公司,分别为招商财富资产管理有限公司和招商资产管理(香港)有限公司。

截至2013年12月31日,本基金管理人共管理三十五只共同基金,具体如下:从2003年4月28日起管理招商安泰系列开放式证券投资基金(含招商安泰股票证券投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金、招商安泰债券投资基金);从2004年1月14日起管理招商现金增值开放式证券投资基金;从2004年6月1日起开始管理招商先锋证券投资基金;从2005年11月17日起开始管理招商优质成长股票型证券投资基金(LOF);从2006年7月11日起开始管理招商安本增利债券型证券投资基金;从2007年3月30日起开始管理招商核心价值混合型证券投资基金;从2008年6月19日起开始管理招商大盘蓝筹股票型证券投资基金;从2009年10月22日起开始管理招商安心收益债券型证券投资基金;从2009年6月19日起开始管理招商行业领先股票型证券投资基金;从2009年12月25日起开始管理招商中小盘精选股票型证券投资基金;从2010年3月25日起开始管理招商全球资源股票型证券投资基金(QDII);从2010年6月22日起开始管理招商深证100指数证券投资基金;从2010年6月25日起开始管理招商信用添利债券型证券投资基金;从2010年12月8日开始管理上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金;从2011年2月11日起开始管理招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF);从2011年3月17日起开始管理招商安瑞进取债券型证券投资基金;从2011年6月27日开始管理深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金及招商深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金联接基金;从2011年9月1日起开始管理招商安达保本混合型证券投资基金;从2012年2月1日起开始管理招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金;从2012年3月21日起开始管理招商产业债券型证券投资基金;从2012年6月28日起开始管理招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金;从2012年7月20日起开始管理招商信用增强债券型证券投资基金;从2012年8月20日起开始管理招商安盈保本混合型证券投资基金;从2012年12月7日起开始管理招商理财7天债券型证券投资基金;从2013年2月5日起开始管理招商典视财经50指数证券投资基金;从2013年3月1日起开始管理招商双债增强分级债券型证券投资基金;从2013年4月19日起开始管理招商安润保本混合型证券投资基金;从2013年5月17日起开始管理招商保证金快线货币市场基金;从2013年8月1日起开始管理招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金;从2013年11月6日起开始管理招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金;从2013年12月11日起开始管理招商标普高收益红利贵族指数增强型证券投资基金。

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		
孙海波	本基金的基金经理	2012年12月7日	-	14	孙海波,男,中国国籍,经济学硕士,曾任职于南开大学计算中心及泰康人寿保险股份有限公司;1999年加入光大证券股份有限公司,曾任职于投行部、债券投资部及自营部;2004年起先后任职于万家基金管理有限公司(原天同基金)及中信基金管理有限公司(现华夏基金)的投资管理部,均从事证券投资相关工作;2007年加入中国中投证券有限责任公司,担任证券投资部副总经理,全面负责公司证券投资业务;2012年加入招商基金管理有限公司固定收益投资部,现任副总监兼招商安心收益债券型证券投资基金、招商安盈保本混合型证券投资基金、招商理财7天债券型证券投资基金及招商安达保本混合型证券投资基金基金经理。
向霈	本基金的基金经理	2013年12月27日	-	7	向霈,女,中国国籍,管理学士,2006年加入招商基金管理有限公司,曾任职于市场部、股票投资部、交易部,现任固定收益投资部研究员,从事固定收益类证券研究相关工作,现任招商现金增值开放式证券投资基金及招商理财7天债券型证券投资基金基金经理。

注:1、报告截止日至批准送出日期间,于2014年3月11日孙海波先生离任本基金的基金经理;
2、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;
3、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 管理人对投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》、《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《招商理财7天债券型证券投资基金基金合同》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(以下简称"公司")根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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

基金管理人(以下简称"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。公司交易部在报告期内,对所有组合的各条指令,均在中央交易员的统一分派下,本着持有人利益最大化的原则执行了公平交易。

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,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在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。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

2013年银行间流动性经历了剧烈的变化,从上半年的宽松转化为下半年的紧张,全年既经历了3-5月份的流动性异常宽松,也经历了6月和12月底两次异常紧张,7月份之后资金面一直偏紧,7天回购利率的月均水平不断上行。1-5月份流动性宽松的主要原因是外汇占款大幅增长,央行虽采取公开市场回笼来应对,但仍未能改变流动性宽松的局面,资金利率中枢低位波动。进入5月份之后,外汇占款增量大幅下降,财政存款增量连续多增为资金面的持续收紧埋下了隐患,与此同时央行的货币政策进一步收紧,先后祭出3年央票续发、上调逆回购发行利率等紧缩手段,资金利率台阶式上行。此外,线上利率还受到央行的指导,利率有一定低估,更为市场化的线下存款利率上行幅度更大。上半年,市场资金面宽松,我们于年中市场资金面转紧时提高了定期存款的配置比例;下半年货币市场利率波动加剧,资金利率中枢不断抬升,我们维持了定期存款的较高配置比例,在基金规模快速增长的同时为投资者创造了较好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年招商理财7天债券A的份额净值收益率为4.3787%,同期业绩比较基准收益率为1.3687%,基金份额净值收益率优于业绩比较基准收益率3.0100%;招商理财7天债券B的份额净值收益率为4.6829%,同期业绩比较基准收益率为1.3687%,基金份额净值收益率优于业绩比较基准收益率3.3142%。

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2014年,央行可能会在某个时点放松货币政策,我们认为央行可能放松主要源于以下两个原因:(1)银行间利率水平的上升逐渐传导至实体利率,为偏弱的经济带来更多下行压力,经济增速可能跌出政府的心理下限。上半年的通胀增速大概率也会出现下降。(2)2014年公开市场到期量非常少,外汇占款的波动又很大,银行超储缺乏稳定的增量,而高准备金率造成每年上缴的准备金就达到2万亿以上,银行的超储将不断消耗。央行需要通过降准或者大量逆回购来维持的合理超储水平,否则银行间市场将逐渐干涸。以央行放松为转折点,全年回购利率可能先窄幅震荡后小幅下行。

4.6 管理人对投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,公司设立由股票投资部、专户资产投资部、固定收益投资部、研究部、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。

股票投资部、专户资产投资部、固定收益投资部、研究部和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;股票投资部、专户资产投资部和固定收益投资部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,招商理财7天债券A共分配利润人民币41,722,259.05元,招商理财7天债券B共分配利润人民币16,194,865.22元,不存在应分配但尚未实施分配的情况。

§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

2013年,本基金托管人在对招商理财7天债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全履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

2013年,招商理财7天债券型证券投资基金的管理人——招商基金管理有限公司在招商理财7天债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,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

本托管人依法对招商基金管理有限公司编制和披露的招商理财7天债券型证券投资基金2013年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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)审计了招商理财7天债券型证券投资基金的财务报表,包括2013年12月31日和2012年12月31日的资产负债表、2013年度和2012年12月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的利润表、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:招商理财7天债券型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	388,853,099.67	1,456,355,331.30
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	347,983,669.69	806,561,980.18
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	347,983,669.69	806,561,980.18
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	40,000,180.00	600,001,100.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	5,964,930.00	13,196,139.28
应收股利	-	-
应收申购款	5,079,800.00	6,580,000.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	787,881,679.36	2,882,694,550.76
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	-	201,599,779.20
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	185,475.12	691,772.50
应付托管费	54,955.61	204,969.64
应付销售服务费	159,497.73	518,379.66
应付交易费用	10,808.92	10,067.30
应交税费	-	-
应付利息	-	21,430.32
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	199,000.00	-
负债合计	609,737.38	203,046,398.62
所有者权益:		
实收基金	787,271,941.98	2,679,648,152.14
未分配利润	-	-
所有者权益合计	787,271,941.98	2,679,648,152.14
负债和所有者权益总计	787,881,679.36	2,882,694,550.76

注:1、报告截止日2013年12月31日,招商理财7天债券A基金份额净值1.0000元,基金份额总额502,851,660.86份;招商理财7天债券B基金份额净值1.0000元,基金份额总额284,420,281.12份;总份额总额787,271,941.98份(2012年12月31日,招商理财7天债券A基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,728,582,510.94份;招商理财7天债券B基金份额净值1.0000元,基金份额总额951,065,641.20份;总份额总额2,679,648,152.14份);
2、本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年12月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:招商理财7天债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年12月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	68,395,559.36	11,780,703.57
1.利息收入	65,308,367.07	11,505,445.18
其中:存款利息收入	38,463,041.12	9,686,908.21
债券利息收入	16,061,093.66	1,477,059.17
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	10,784,232.29	341,477.80
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,087,192.29	275,253.63
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,087,192.29	275,253.63
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)	-	4.76
减:二、费用	10,478,435.09	1,542,170.10
1.管理人报酬	3,754,624.13	691,772.50
2.托管费	1,112,481.20	204,969.64
3.销售服务费	3,075,411.47	518,379.66
4.交易费用	-	-
5.利息支出	2,017,007.59	119,259.45
其中:卖出回购金融资产支出	2,017,007.59	119,259.45
6.其他费用	518,910.70	7,788.85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	57,917,124.27	10,238,533.47
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	57,917,124.27	10,238,533.47

注:本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年12月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:招商理财7天债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	2,679,648,152.14	-	2,679,648,152.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	57,917,124.27	57,917,124.27
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)	-1,892,376,210.16	-	-1,892,376,210.16
其中:1.基金申购款	7,694,044,504.78	-	7,694,044,504.78
2.基金赎回款	-9,586,420,714.94	-	-9,586,420,714.94
四、本期向基金分红股转入人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-57,917,124.27	-57,917,124.27
五、期末所有者权益(基金净值)	787,271,941.98	-	787,271,941.98

项目	上年度可比期间 2012年12月7日(基金合同生效日)至2012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)	5,094,441,669.78	-	5,094,441,669.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,238,533.47	10,238,533.47
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)	-2,414,793,517.64	-	-2,414,793,517.64
其中:1.基金申购款	1,634,785,910.40	-	1,634,785,910.40
2.基金赎回款	-4,049,579,428.04	-	-4,049,579,428.04
四、本期向基金分红股转入人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-10,238,533.47	-10,238,533.47
五、期末所有者权益(基金净值)	2,679,648,152.14	-	2,679,648,152.14

注:本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年12月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

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:

许小松 赵生章 李扬
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

招商理财7天债券型证券投资基金(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")《关于核准招商理财7天债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]1472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《招商理财7天债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2012年12月7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5,094,441,669.78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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")。

本基金于2012年12月3日至2012年12月5日募集,募集期间冲认购资金人民币5,094,291,590.90元,认购资金在募集期间产生的利息人民币150,078.88元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计5,094,441,669.78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1200019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、《招商理财7天债券型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《招商理财7天债券型证券投资基金招募说明书》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、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券、及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。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:中国人民银行公告的金融机构人民币七天通知存款基准利率(税后)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年12月31日和2012年12月31日的财务状况以及2013年度和2012年12月7日(基金合同生效日)至2012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。本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年12月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的债券投资划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产;其他金融资产划分为应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于支付价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,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以公允价值计量,公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益;应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权人几乎所有的风险和报酬转移时,本基金终止确认该金融资产。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

(a) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产-债券投资

本基金债券投资的估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余期限内摊销,每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价对债券投资进行估值。

(b) 应收款项及其他金融负债

本基金的应收款项及其他金融负债在初始确认后,采用实际利率法按摊余成本进行估值,直线法与实际利率法确定的余额差异较少的可采用直线法。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值(即公平交易中,熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额)的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值,另外对金融资产的特殊情况处理如下