

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  
报告送出日期:2017年10月26日

**1 重要提示**

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

**2 基金产品概况**

基金名称	招商招利宝货币
基金代码	000827
基金简称	招利宝货币
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年4月17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	12,914,062,087.62份

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期末(2017年9月30日)	2017年9月30日
1.本期已实现收益	47,907,020.25	34,102,439.07
2.本期利润	47,907,020.25	34,102,439.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0036	0.0028
4.期末基金份额净值	0.9955	0.9954

**3.2 基金净值表现**

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去一个月	1.1322%	0.0044%	0.0044%	0.0000%	0.0000%
过去三个月	1.7899%	0.0044%	0.0044%	0.0000%	0.0000%

**3.3 基金投资组合分析**

资产类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1. 货币资金	3,500,944,387.67	26.37
2. 债券投资	3,530,944,387.67	26.37
3. 其他资产	4,323,309,419.94	31.14
4. 其他负债	6,004,369,164.28	43.15
5. 其他	13,976,221,060.68	100.00

**3.4 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**3.5 基金管理人内部控制**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**3.6 基金管理人内部控制**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**3.7 基金管理人内部控制**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**3.8 基金管理人内部控制**

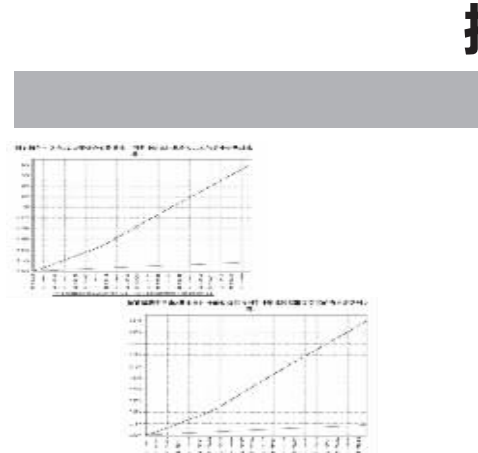
基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资对象选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究或成果向内部所有投资组合开放,在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的情况。

**3.9 基金管理人内部控制**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**3.10 基金管理人内部控制**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。



注:本基金合同于2017年4月17日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。自基金成立日起6个月内为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

**4.1 基金经理(或基金经理小组)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
男,经济学学士,2009年加入招商基金管理有限公司,曾任招商招利宝货币基金经理助理,现任招商招利宝货币基金经理。具有证券投资基金从业资格,持有基金从业资格证书。曾任招商招利宝货币基金经理助理,现任招商招利宝货币基金经理。具有证券投资基金从业资格,持有基金从业资格证书。				

**4.2 基金经理(或基金经理小组)简介**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.3 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.4 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.5 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.6 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.7 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.8 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.9 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.10 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.11 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

**4.12 公平交易专项说明**

基金管理人(以下简称“公司”)已建立较完善的研究报告和投资决策流程,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选择、研究决策流程及投资授权体系,投资组合经理等各投资组合的基金经理均遵守公平交易制度,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。公司的相关研究或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情况。

# 招商招利宝货币市场基金

## 2017年第三季度报告

报告期末货币市场基金净值偏离度的绝对值未发生达到0.5%的情况。

**5.1 投资组合平均剩余期限基本情况**

投资组合	平均剩余期限
招商招利宝货币市场基金	76
招商招利宝货币市场基金(非受限)	111

**5.2 投资组合按行业分类的股票投资组合**

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1. 农林牧渔	22,977	0.17
2. 医药生物	13,217	0.10
3. 食品饮料	43,681	0.33
4. 纺织服装	6,306	0.05
5. 公用事业	22,977	0.17
6. 交通运输	22,977	0.17
7. 信息技术	22,977	0.17
8. 其他	22,977	0.17
合计	139,203	1.04

**5.3 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	400,000	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	40,000	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	40,000	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	40,000	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	40,000	4,400,000.00	3.33
6	130027	招商局港口	40,000	4,400,000.00	3.33
7	130027	招商局港口	40,000	4,400,000.00	3.33
8	130027	招商局港口	40,000	4,400,000.00	3.33
9	130027	招商局港口	40,000	4,400,000.00	3.33
10	130027	招商局港口	40,000	4,400,000.00	3.33

**5.4 报告期内债券投资组合平均剩余期限超过397天债券的情况**

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170004	17国债04	5,800,000	0.04
2	17174396	17广发银行CD1396	4,648,169.616	0.03
3	17171017	17广发银行CD1397	3,300,000	0.02
4	17170708	17广发银行CD1398	3,000,000	0.02
5	17170626	17广发银行CD1391	2,800,000	0.02
6	17170627	17广发银行CD1392	2,800,000	0.02
7	17170628	17广发银行CD1393	2,800,000	0.02
8	17170629	17广发银行CD1394	2,800,000	0.02
9	17170630	17广发银行CD1395	2,800,000	0.02
10	17170631	17广发银行CD1396	2,800,000	0.02

**5.5 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.6 投资组合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**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170004	17国债04	5,800,000	0.04
2	17174396	17广发银行CD1396	4,648,169.616	0.03
3	17171017	17广发银行CD1397	3,300,000	0.02
4	17170708	17广发银行CD1398	3,000,000	0.02
5	17170626	17广发银行CD1391	2,800,000	0.02
6	17170627	17广发银行CD1392	2,800,000	0.02
7	17170628	17广发银行CD1393	2,800,000	0.02
8	17170629	17广发银行CD1394	2,800,000	0.02
9	17170630	17广发银行CD1395	2,800,000	0.02
10	17170631	17广发银行CD1396	2,800,000	0.02

**5.7 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.8 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.9 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.10 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.11 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外资产投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.12 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外资产投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.13 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外资产投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.14 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外资产投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.15 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外资产投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.16 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外资产投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.17 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外资产投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
3	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
4	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33
5	130027	招商局港口	4,400,000.00	3.33

**5.18 投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外资产投资明细**

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000007	招商局港口	44,000,000.00	33.31
2	130027	招商局港口	4,4	