

招商睿逸稳健配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30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
报告送出日期:2017年10月26日

1 重要提示
基金管理人及董事会对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。
本报告中财务资料未经审计。
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 | 招商睿逸混合 |
| 基金代码 | 002317 |
| 交易代码 | 002317 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日期 | 2016年4月13日 |
| 报告期内基金申购总额 | 411,784,668.92份 |
| 报告期内基金赎回总额 | 1,114,784,668.92份 |
| 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 |

3 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -1,041,376.33
2.本期利润 270,871.70
3.加权平均基金份额本期利润 0.0006
4.期末基金资产净值 411,986,507.52

3.1 主要财务指标和基金净值表现
1. 招商睿逸混合基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%
2. 招商睿逸混合基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%
3. 招商睿逸混合基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|------------|------|--------|---|
| 何文刚 | 本基金基金经理 | 2016年4月13日 | - | 9 | 男,硕士。2007年7月加入招商基金管理有限公司,历任研究员、研究员助理、投资经理、基金经理等职务。2015年9月加入招商基金管理有限公司,担任睿逸混合基金基金经理。2016年4月13日起担任招商睿逸混合基金基金经理。2017年7月加入招商基金管理有限公司,担任睿逸混合基金基金经理。2017年7月加入招商基金管理有限公司,担任睿逸混合基金基金经理。 |

4.2 投资组合报告
4.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
4.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合
4.2.3 报告期末按行业分类的债券投资组合
4.2.4 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

4.3 基金管理人及基金托管人
4.3.1 基金管理人
4.3.2 基金托管人

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,股票市场有所上涨,总体看,大盘指数涨幅较小,其中沪深300指数上涨4.63%,上证50指数上涨4.80%,创业板指上涨2.69%。行业上,受到5G、新能源汽车等主题影响,通信、汽车等行业表现活跃。策略上,优选行业内的龙头股票为,保持价值投资,保持分散配置,10年内看一直3.6%左右波动,下行7天回补大部分回至3%到4%之间震荡,买入时尽量选择科技、医药、消费、周期、基建、以短久期、高等级债券为主。
4.5 报告期内基金的投资表现和净值变动情况
报告期内,本基金份额净值增长率为0.10%,同期业绩比较基准增长率为2.60%。
4.6 报告期内基金持有人数量或基金资产净值预警情况说明
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 投资组合报告

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|----------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 72,737,681.15 | 16.34 |
| 2 | 其中:股票 | 72,737,681.15 | 16.34 |
| 3 | 固定收益投资 | 321,762,674.00 | 72.27 |
| 4 | 其中:债券 | 321,762,674.00 | 72.27 |
| 5 | 资产支持证券 | - | - |
| 6 | 贵金属投资 | - | - |
| 7 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 8 | 买入返售金融资产 | 11,970,137.96 | 2.69 |
| 9 | 其他资产 | 6,884,640.97 | 1.55 |
| 10 | 合计 | 445,237,555.54 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------------|---------------|--------------|
| A | 农林、牧渔 | 4,155,547.00 | 1.01 |
| B | 医药生物 | 39,763.00 | 0.01 |
| C | 制造业 | 45,039,050.20 | 10.95 |
| D | 电力、热力、燃气及生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储和邮政业 | 28,365.45 | 0.01 |
| G | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 25,519.11 | 0.01 |
| H | 批发和零售业 | - | - |
| I | 房地产业 | - | - |
| J | 金融业 | 23,306,033.00 | 5.66 |
| K | 其他行业 | - | - |
| L | 国防军工 | - | - |
| M | 科学、技术和创新服务业 | - | - |
| N | 其他 | - | - |
| O | 其他 | - | - |
| P | 其他 | - | - |
| Q | 其他 | - | - |
| R | 其他 | - | - |
| S | 其他 | - | - |
| T | 其他 | - | - |
| 合计 | - | 72,737,681.15 | 17.89 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.4 报告期末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 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.5 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.6 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.7 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.8 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.9 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.10 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.11 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.12 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

| 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 | 001318 | 中国平安 | 194,200 | 9,976,272.00 | 2.43 |
| 2 | 002466 | 天齐锂业 | 96,900 | 6,993,550.00 | 1.70 |
| 3 | 002382 | 蓝帆医疗 | 438,700 | 5,347,753.00 | 1.30 |
| 4 | 003238 | 振钢电子 | 318,500 | 5,124,660.00 | 1.25 |
| 5 | 601601 | 中信证券 | 132,200 | 4,919,070.00 | 1.20 |
| 6 | 002460 | 赣锋锂业 | 53,200 | 4,565,790.00 | 1.11 |
| 7 | 000823 | 超讯通信 | 281,000 | 4,321,618.00 | 1.05 |
| 8 | 002714 | 亿联网络 | 112,100 | 4,155,547.00 | 1.01 |
| 9 | 601009 | 招商证券 | 481,800 | 3,811,030.00 | 0.93 |
| 10 | 600703 | 中航光电 | 142,100 | 3,284,190.00 | 0.80 |

5.13 其他资产

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 164,054.14 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,720,598.63 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,884,640.97 |

5.14 报告期末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

| 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 | 002242 | 蓝帆医疗 | 5,347,753.00 | 1.30 | 最大申购 |

5.15 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.16 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.17 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.18 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.19 报告期末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

| 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 | 11179532 | 17*招商证券 | 700,000 | 66,862,000.00 | 16.27 |
| 2 | 127292 | 15招商公路 | 400,000 | 39,536,000.00 | 9.61 |
| 3 | 136133 | 16招商港口 | 400,000 | 39,256,000.00 | 9.55 |
| 4 | 170203 | 17招商积余 | 300,000 | 29,967,000.00 | 7.29 |
| 5 | 128449 | 16招商地产 | 300,000 | 29,286,000.00 | 7.12 |

5.20 报告期末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

| 序号 | 股票代码 |
|----|------|
|----|------|