# 工银瑞信国家战略主题股票型证券投资基金 2017年年度报告摘要

2017年12月31日
基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
送出日期：二〇一八年三月二十七日

## §1重要提示及目录

**1.1**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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于**2018**年**3**月**20**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。

本年度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。

本报告期自**2017**年**01**月**01**日起至**12**月**31**日止。

**1.2**

## §2基金简介

**2.1**基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 工银瑞信国家战略主题股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 工银国家战略股票 |
| 基金主代码 | 001719 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年1月29日 |
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 65,295,236.65份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

**2.2**基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 把握国家战略主题相关上市公司的稳步成长，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将在投资研究团队及时跟踪宏观环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，把握市场机会，公司价值创造和变化特征，综合评价各类资产的风险收益水平，在安全的前提下，为投资者获取稳定的长期回报。本基金将采用自上而下的资产配置方法，在宏观经济、证券市场发展趋势、国家战略主题相关行业发展趋势、上市公司基本面状况、估值水平等因素的综合分析基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金资产的长期稳定增值。从长期看，随着国家战略主题相关行业的发展，上市公司盈利能力的提升，本基金所定的与国家战略主题相关的行业是指在国家战略方针指导下的相关行业和经济领域，具体包括区域发展战略的相关行业和经济领域、环境发展战略的相关行业和经济领域和民生改善战略的相关行业和经济领域，经济改革战略的相关行业和经济领域和其他符合国家战略导向的行业和经济领域。本基金在行业配置的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方法，选择具有核心竞争优势和持续增长潜力，估值水平相对合理的国家战略主题相关优质上市公司获得进行重点投资。 |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深300指数收益率+20%×中债综合财富指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |

**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 | | 工银瑞信基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 朱碧艳 | 贺婧 |
| | 联系电话 | 400-811-9999 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | customerservice@icbccs.com.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-811-9999 | 95599 |
| 传真 | | 010-66583158 | 010-68121816 |

**2.4**信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露媒体名称 | 中国证券报、证券时报、上海证券报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.icbccs.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

## §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

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2017年 | 2016年1月29日(基金合同生效日)-2016年12月31日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 1,864,962.29 | 7,688,808.77 |
| 本期利润 | 10,875,670.44 | 3,020,775.70 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1607 | 0.0298 |
| 本期加权平均净值利润率 | 16.03% | 2.94% |
| 本期基金份额净值增长率 | 17.90% | -8.40% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **2017年末** | **2016年末** |
| 期末可供分配利润 | 5,231,629.19 | -6,035,795.07 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0801 | -0.0839 |
| 期末基金资产净值 | 70,526,865.84 | 65,866,639.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.080 | 0.916 |
| **3.1.3 累计期末指标** | **2017年末** | **2016年末** |
| 基金份额累计净值增长率 | 8.00% | -8.40% |

注：**1.**上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

**2.**本期已实现收益是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。

**3.**所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

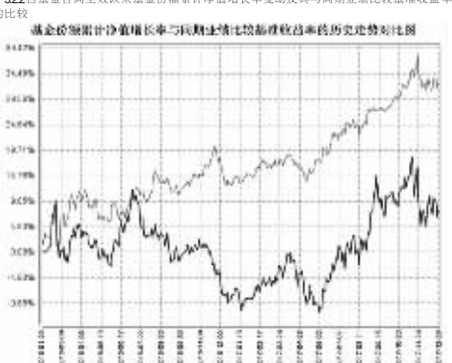
**4.**本基金基金合同生效日为**2016**年**1**月**29**日。

**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

| 阶段 | 份额净值增长率①1 | 份额净值增长率标准差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 | -2.09% | 1.58% | 3.98% | 0.64% | -6.07% | 0.94% |
| 过去六个月 | 9.98% | 1.47% | 8.00% | 0.56% | 1.98% | 0.91% |
| 过去一年 | 17.90% | 1.28% | 17.22% | 0.51% | 0.68% | 0.75% |
| 自基金合同生效以来 | 8.00% | 1.17% | 32.73% | 0.70% | -24.73% | 0.47% |

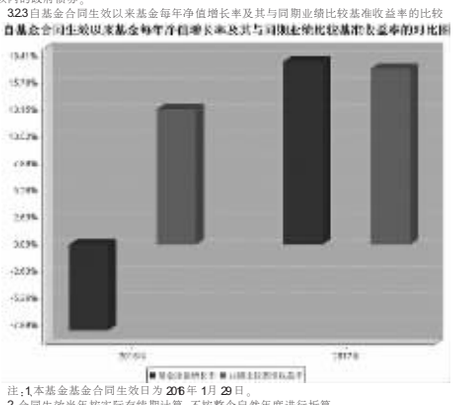
**3.2.2**自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较




注：**1.**本基金基金合同于**2016**年**1**月**29**日生效。

**2.**按基金合同规定，本基金建仓期为**6**个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票资产占基金资产的比例为**80%-95%**，其中，投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于**80%**。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的**5%**的现金或到期日在一年以内的政府债券。

**3.2.3**自基金合同生效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




注：**1.**本基金基金合同生效日为**2016**年**1**月**29**日。

**2.**合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

**3.3**过去三年基金的利润分配情况

无。

## §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

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于**2005**年**6**月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

公司（含子公司）拥有公募基金、特定资产管理、企业年金基金投资管理、全国社会保障基金境内外投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、保险资产管理、企业年金养老金产品投资管理、QDII、CFII、RQFII等多项业务资格。

截至**2017**年**12**月**31**日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深**300**指数证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金、工银瑞信**60**天理财债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）等**18**只公募基金。

公司始终坚持"以稳健的投资管理，为客户提供长期稳健的理财服务"为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持"稳健投资、价值投资、长期投资"，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

**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 | | |
| 袁安乐 | 权益投资总监，本基金的基金经理 | 2016年1月29日 | - | 14 | 生后在天相投资顾问有限公司担任研究员，国信证券经济研究所任投资分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理，研究员，2010年加入工银瑞信，历任权益投资总监。2011年11月23日至今，担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理，2013年9月23日至今，担任工银瑞信精选平衡混合基金基金经理，2014年10月22日至2017年10月9日，担任工银瑞信精选行业股票型基金基金经理，2015年4月28日至今，担任工银新材料新能源行业股票型基金基金经理，2016年1月29日至今，担任工银瑞信国家战略主题股票型基金基金经理，2017年4月21日至今，担任工银瑞信互联网加股票型证券投资基金基金经理。 |

注：**1.**任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

**2.**证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.2**管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

**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

**1.**公平交易原则

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为公平对待不同基金份额持有人，公平对待基金持有人和其他资产委托人，在投资管理活动中公平对待公司所管理的不同基金财产和客户资产，不得直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

**2.**适用范围

本制度适用于本公司所管理的不同投资组合，包括封闭式基金、开放式基金，以及社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等其他受托资产。基金经理，指管理公募基金基金经理，如封闭式基金、开放式基金。投资经理，指管理其他受托资产的投资经理，如企业年金、特定客户资产管理等专项受托资产。

**3.**公平交易的具体措施

**3.1.1**在研究和投资决策环节：

**3.1.1.1**在公司股票池的基础上，研究部根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，参考公司《股票池管理办法》，建立股票池，各基金基金经理、其他受托资产投资经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

**3.1.2.2**各基金基金经理、其他受托资产投资经理投资决策参照《投资授权管理办法》执行，在授权的范围内，独立、自主、审慎决策。

**3.1.3.3**基金经理不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。

**3.1.4.4**对于涉及到关联交易的投资行为，参考公司《关联交易管理制度》执行。

**3.2.2.2**在交易执行环节：

**3.2.2.1.1**交易人员、投资交易系统权限的适当分离。在必要的情况下，对于社保基金或其他专项受托资产组合配备专门的交易员，未经授权，其他交易员不得参与社保基金或其他专项受托资产组合的日常交易，并进行交易系统权限的屏蔽。

**3.2.2.2.1.2.2**公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施，保证交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。

**3.2.3.3.1.3.3.1.3.3.1