

国投瑞银景气行业证券投资基金

2017年度报告摘要

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：光大银行股份有限公司
报告送达日期：二〇一八年三月二十七日

重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事局、董事会或类似决策机构、高级管理人员、基金经理人、基金托管人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法律责任。本基金的托管人已对本报告的内容进行复核，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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财产，但不保证基金一定盈利。

基金过往表现不代表其未来表现。投资人应在作出投资决策前仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书及其摘要、基金产品资料概要、基金定期报告和最新的定期报告。

本年度报告将自年度报告正式发布之日起十个工作日内报中国证监会备案。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 国投瑞银景气行业混合

基金代码 121002

交易方式 121002(前端) 129002(后端)

基金运作方式 封闭式

基金合同生效日 2004年4月29日

基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人 中国光大银行股份有限公司

报告期末基金总资产 577,383,360,179元

基金份额净值 1.00元

不适用

2.2 基金产品说明

本基金的回报目标是“获取收益、追求绝对风险收益”，即股票投资组合的

股票投资组合的预期收益水平为每年7%、

风险控制指标为每年最大回撤率为-20%~20%(-7%~7%)。

2.3 投资策略

在有效控制市场风险的基础上，通过行业配置、行业轮动、个股精选等方法实

现对不同行业、不同风格的股票的配置。

2.4 管理费、托管费

采取固定管理费策略，通过定期扣款、收益到账等方式实现。

2.5 风险收益特征

本基金为股票型基金，其风险收益特征与股票型基金相类

似，属于较高风险、较高收益的基金品种。

2.6 业绩比较基准

业绩比较基准：中证全债指数×70%+沪深300指数×30%

2.7 风险揭示

本基金的风险揭示包括但不限于以下方面：

（1）市场风险：指因整体市场波动而使基金资产价值下降的风险。

（2）信用风险：指由债券发行人经营情况恶化而无法支付本金和利息的风

险。

（3）流动性风险：指由于投资品种的流动性较差，导致变现困难而给基金

带来损失的风险。

（4）管理风险：指基金管理人在基金管理过程中可能因管理不善、操作不

当、技术落后、人员匮乏等原因而影响基金资产的保值增值。

（5）操作风险：指因基金管理人在投资运作过程中违反相关法律法规、

规章、规范性文件、合同、契约、基金合同、基金招募说明书、基金产品

资料概要、基金定期报告、基金净值公告、基金销售机构的销售行为、基

金销售行为、基金宣传推介材料、基金销售机构的销售行为、基金销售

机构的销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金

销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售

行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售行为、

基金销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金

销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售

行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售行为、基金销售行为、