

信息披露

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
 送出日期:2014年8月29日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中,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,完全尽职尽责地履行了基金管理人应尽的义务。

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

报告期内,国投瑞银核心企业股票型证券投资基金管理人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银核心企业股票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、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期间,国投瑞银核心企业股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见

本托管人依据对国投瑞银基金管理有限公司编制的国投瑞银核心企业股票型证券投资基金2014年半年度报告中的财务信息、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。

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银核心企业股票
基金代码	121003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月19日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,014,597,053.69份
基金存续期间	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标

本基金的投资目标是“追求基金资产长期稳定增值”。

投资策略

本基金借鉴UBS Global AM投资管理流程,根据中国市场的特,采取积极的投资策略。

2.3 基金管理人

姓名	魏星
联系电话	400-880-6868
电子邮箱	weixing@ubsic.com
传真	0755-82904468

2.4 信息披露方式

信息披露网址: <http://www.ubsic.com>

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-14,815,194.85
本期利润	-264,575,476.64
本期基金份额净值增长率	-0.0483%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3012
期末基金份额净值	3.904,273,295.08
期末基金资产净值	6988.8

3.2 主要财务指标和净值表现

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。

注:2.期末未供分配利润,采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低值(为期末余额,不是当期发生数)。

注:3.以上所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(例如封闭式基金申购费、开放式基金申购赎回费、基金赎回费等等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.3 基金业绩比较

3.3.1 基金业绩比较基准

3.3.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准变动的比较

阶段	业绩比较基准(①)	业绩比较基准增长率(②)	业绩比较基准收益率(③)	业绩比较基准收益率变动(④)
过去一个月	0.22%	0.50%	0.66%	0.72%
过去三个月	-0.07%	0.57%	0.99%	0.81%
过去六个月	-6.39%	0.80%	-5.78%	0.97%
过去一年	-0.09%	0.95%	0.66%	1.10%
过去三年	-20.35%	1.11%	-25.17%	1.21%

4. 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准变动的比较

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。

5. 投资组合报告

5.1 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
权益投资	2,112,017,440.11	30.27%
固定收益投资	794,289,000.00	11.47%
金融资产投资	3,906,296,440.11	56.74%
其他资产	1,171,246,562.19	17.03%

5.2 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
银行存款	175,076,796.21	2.54%
结算备付金	3,320,905.79	0.05%
交易保证金	1,666,158.11	0.02%
应收申购款	2,906,306,440.11	4.24%
其他应收款	2,112,017,440.11	30.27%

5.3 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
股票	1,750,767,962.21	25.41%
债券	794,289,000.00	11.47%
其他	561,259,477.90	8.15%

5.4 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

5.5 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

5.6 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

5.7 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

5.8 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

5.9 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

国投瑞银核心企业股票型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

本报告期,本基金托管人在对国投瑞银核心企业股票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,完全尽职尽责地履行了基金管理人应尽的义务。

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

报告期内,国投瑞银核心企业股票型证券投资基金管理人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银核心企业股票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、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期间,国投瑞银核心企业股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见

本托管人依据对国投瑞银基金管理有限公司编制的国投瑞银核心企业股票型证券投资基金2014年半年度报告中的财务信息、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。

6.1 资产负债表

项目	期末(2014年6月30日)	上年度末(2013年12月31日)
资产		
银行存款	175,076,796.21	291,047,891.18
结算备付金	3,320,905.79	4,990,471.74
交易保证金	1,666,158.11	1,723,208.21
应收申购款	2,906,306,440.11	3,928,323,497.74
其他应收款	2,112,017,440.11	3,673,043,054.84
基金投资	794,289,000.00	255,279,294.90
其他资产	-	-
负债		
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	-	-
应付托管费	-	-
其他负债	-	-
所有者权益	540,160,245.08	195,000,417.50
实收基金	-	-
未分配利润	540,160,245.08	195,000,417.50

6.2 利润表

项目	本期(2014年1月1日至2014年6月30日)	上年度可比期间(2013年1月1日至2013年6月30日)
营业收入	1,967,624.54	1,556,249.71
公允价值变动收益	129,964,680.51	44,935,603.30
投资收益	1,967,624.54	1,556,249.71
其他收入	4,315,337.58	5,352,194.78
营业支出	719,222.93	893,028.27
销售费用	-	-
管理费用	735,060.54	3,528,421.11
其他费用	-	-
营业利润	3,561,033.70	4,351,501.74
所得税费用	-	-
净利润	3,561,033.70	4,351,501.74

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

项目	本期(2014年1月1日至2014年6月30日)	上年度可比期间(2013年1月1日至2013年6月30日)
期初余额	1,913,323,758.61	1,491,813,427.74
本期新增基金份额	4,101,273,525.08	3,436,514,861.08
本期赎回基金份额	-1,510,323,758.61	-1,491,813,427.74
本期申购基金份额	3,504,273,295.08	4,376,780,811.08
本期基金份额净值	3.904,273,295.08	3.904,273,295.08
期末余额	5,014,597,053.69	5,868,594,238.82

6.4 基金业绩比较

3.3.1 基金业绩比较基准

3.3.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准变动的比较

阶段	业绩比较基准(①)	业绩比较基准增长率(②)	业绩比较基准收益率(③)	业绩比较基准收益率变动(④)
过去一个月	0.22%	0.50%	0.66%	0.72%
过去三个月	-0.07%	0.57%	0.99%	0.81%
过去六个月	-6.39%	0.80%	-5.78%	0.97%
过去一年	-0.09%	0.95%	0.66%	1.10%
过去三年	-20.35%	1.11%	-25.17%	1.21%

6.5 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
权益投资	2,112,017,440.11	30.27%
固定收益投资	794,289,000.00	11.47%
金融资产投资	3,906,296,440.11	56.74%
其他资产	1,171,246,562.19	17.03%

6.6 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
银行存款	175,076,796.21	2.54%
结算备付金	3,320,905.79	0.05%
交易保证金	1,666,158.11	0.02%
应收申购款	2,906,306,440.11	4.24%
其他应收款	2,112,017,440.11	30.27%

6.7 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
股票	1,750,767,962.21	25.41%
债券	794,289,000.00	11.47%
其他	561,259,477.90	8.15%

6.8 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

6.9 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

6.10 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

6.11 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

6.12 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

6.13 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

6.14 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

6.15 基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
公允价值变动收益	129,964,680.51	1.87%
公允价值变动损失	1,967,624.54	0.03%
其他	4,315,337.58	0.06%

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002390	亿纬锂能	287,532,222.42	6.57
2	600276	恒瑞医药	251,414,719.20	5.74
3	000028	国药一致	223,199,703.67	5.10
4	600967	北方钆业	205,078,798.14	4.69
5	000538	云南白药	176,252,162.16	4.03
6	000793	华谊传媒	118,475,571.91	2.71
7	600315	上海家化	109,559,731.13	2.50
8	600566	迪康药业	100,107,595.27	2.29
9	002570	贝因美	100,013,246.69	2.29
10	600985	同仁堂	98,384,238.46	2.25
11	000400	许继电气	94,503,006.99	2.16
12	600019	宝钢股份	89,438,702.88	2.04
13	600955	招商局	88,204,242.25	2.02
14	300026	凯诺斯	88,068,948.22	2.01
15	000468	承德露露	85,877,913.21	1.96
16	300016	北陆药业	82,763,154.27	1.89
17	002019	鑫富药业	82,134,450.84	1.88
18	000876	新希望	79,376,253.20	1.81
19	000411	美尔雅	77,219,277.45	1.76
20	000895	汇友传媒	75,470,720.04	1.72

注:“卖出金额”按买卖成交金额(成交净价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本/溢价及卖出股票的收入总额

买入股票的成本/溢价(元)	卖出股票的收入总额(元)
3,525,611,478.31	4,808,337,073.15

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	期末持有的金融债	769,264,000.00	21.95
4	企业债	25,020,000.00	0.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
合计		794,289,000.00	22.67

7.6 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	占基金资产净值比例(%)
1	140022	14附息国债02	2,500,000	259,925,000.00	7.42
2	140003	14附息国债03	1,400,000	143,864,000.00	4.11
3	140401	14农发01	1,000,000	102,570,000.00	2.93
4	140204	14附息国债04	600,000	60,270,000.00	1.72
5	140201	14附息国债01	500,000	51,310,000.00	1.46

7.7 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明细

本基金本期未持有资产支持证券。

7.8 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明细

本基金本报告期未持有贵金属投资。

7.9 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明细

本基金本报告期未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期未进行股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体经监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资类证券说明

本基金投资的前十名证券中,包括“中国平安”A333,58