

2012年7月20日 星期五

国投瑞银核心企业股票型证券投资基金

[2012] 第二季度报告

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

报告送出日期:2012年7月20日

\$1 重要提示

基金管理人的董事会及监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、准确性完整性承担个别及连带责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据《基金合同》规定,于2012年7月10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,保证复核结果不存在虚假记载、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。

基金管理人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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

\$2 基金产品概况

基金简称: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

基金份额总额:5,896,478,161.61份

投资目标:

本基金主要投资于具有良好成长性的核心企业股票,并辅以其他金融工具,构建合理的资产配置,力争在有效控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。

基金经理:王伟,具有基金从业资格,现任国投瑞银基金管理有限公司基金经理。

基金评价:晨星(中国)评级为4星,银河证券评价为4星,海通证券评价为4星,鹏华AM基金额评分为4星。

投资策略:本基金将坚持价值投资理念,通过深入研究上市公司的基本面,分析其内在价值,精选出具有持续增长潜力的上市公司,进行重点配置,同时辅以其他金融工具,构建合理的资产配置,力争在有效控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。

风险特征:本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于债券型基金,低于混合型基金,属于高风险、高收益的基金品种。

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

\$3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

1.本期已实现收益 -49,511,041.26

2.本期利润 165,666,941.02

3.期末平均基金份额本期利润 0.0279

4.期末基金资产净值 4,352,612,931.78

5.期末基金份额净值 0.7382

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长 增长比率 基准收益 基准收益 率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 3.88% 1.02% 0.37% 1.04% 3.51% -0.02%

注:1.本基金业绩比较基准为5%的金融机构存款利率+45%的中信标普300指数收益率,其中,同业存款利率为中国人民银行规定的金融机构存款利率;中信标普300指数由中信证券股份有限公司和标准普尔(Standard & Poor's)共同开发的中国A股指数,由深证证券交易所上市的公司组成,其样本股覆盖了经济金融行业中的大部分股票,能比较全面地描述A股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

3.2.1 本报告期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 净值增长① 净值增长