

国投瑞银核心企业混合型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

2018年6月30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
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

1.重要提示

基金管理人的声明:本基金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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由基金托管人复核。

基金托管人:中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年6月23日复核了本报告,并同意将此报告予以公告。

基金报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

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,并认真阅读本报告,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

基金报告期未发生诉讼。

报告期利润2018年1月1日起至6月30日止。

2.基金简介

2.1基金基本情况

基金简称 国投瑞银核心企业混合型证券投资基金
基金主代码 121003
基金次代码 121003
基金运作方式 约期开放式
基金合同生效日 2006年4月19日
基金托管人 国投瑞银基金管理有限公司
中国工商银行股份有限公司
基金持有人数 1,573,816,382.54户
基金合同存续期 不定期

2.2基金产品说明

投资目标 本基金将通过UBSAM投资管理经验,根据中国市场的特点,采取积极的投资策略。

投资策略 (一)投资管理方法 本基金将借鉴UBSAM投资管理流程和方法,并加以本土化,我们所借鉴的投资管理工具主要包括GEVS等股基估值方法和GERS股基风险管理方法。

(二)投资资产配置 本基金将根据资产配置比例,将资产配置比例分为:自上而下的研究,即,两者投资决策是互反的,即行和行将要具备自下而上的公司基本面分析,而公司分析的两个前提条件又基于自上而下的研究结果。

(三)投资管理 本基金将通过UBSAM固投收益组合的管理方法,采取“自上而下”的债券分析方法,确定投资品种和组合比例。

业绩比较基准 5%*金融行业平均收益+95%*标普中国A股300指数。

风险收益特征 本基金为混合型基金,较低风险和较低收益与债券基金,低于股票基金。

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 国投瑞银基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

信息披露义务人 刘晓洁 陈明

联系人 400-880-6868 service@ubsec.com

电子邮箱 400-880-6868 95588

客户服务电话 0755-8204048 010-66105799

传真 0755-8204048 010-66105799

2.4信息披露方式

信息披露单半年报和报告的管理人互联网网址 http://www.ubsec.com

基金半年度报告发布地点 深圳市福田区金田路4026号深业经贸中心46层

3.基金净值信息和基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

基金报告期2018年1月1日至2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

基金报告期的利润增长率 -6.29%

3.2基金期初净值和本期净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.3基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.4基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.5基金净值表现

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.6基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.7基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.8基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.9基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.10基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.11基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.12基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.13基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.14基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.15基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.16基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.17基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.18基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.19基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.20基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.21基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.22基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.23基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.24基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.25基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.26基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.27基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,585.82

加权平均基金利润 -0.0447

3.28基金资产净值

报告期2018年6月30日

报告期可分配基金利润 -0.3470

基金报告期利润 -69,595,