

信息披露 Disclosure

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况声明
 本报告期内，本基金托管人在对国家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托管人应尽的义务。

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
 本报告期内，国投瑞银核心企业股票型证券投资基金的托管人——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、基金份额净值的数据复核、基金费用开支等方面运作上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，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的真实、准确和完整发表意见
 本托管人依法对国家投瑞银基金管理有限公司编制和披露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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银核心企业股票型证券投资基金
 报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注	本期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币资产			
银行存款		175,076,796.21	291,047,891.18
结算备付金		3,250,905.79	4,990,774.11
存出保证金		1,666,158.11	1,732,204.21
应收金融资产		2,906,306,446.11	3,928,322,349.74
其中：股票投资		2,112,017,446.11	3,673,043,054.84
基金投资		—	—
债券投资		794,289,000.00	255,279,294.90
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
买入返售金融资产		540,160,245.08	195,000,417.50
应收证券清算款		—	11,721,546.56
其他应收款		17,213,463.00	2,175,840.86
应收股利		—	—
应收利息		9,494.38	24,377.58
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		3,643,683,502.68	4,435,015,401.24
负债和所有者权益			
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
应付短期融资款		—	—
应付基金赎回款		129,964,680.51	44,935,603.39
应付证券清算款		1,967,624.94	1,536,249.71
应付管理人报酬		4,315,337.58	5,352,194.78
应付托管费		719,222.93	802,042.47
应付销售服务费		—	—
应付交易费		738,064.54	3,328,421.11
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付股利		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		1,708,281.50	1,970,089.20
负债合计		139,410,207.60	58,234,590.66
所有者权益			
实收基金		5,014,597,053.69	5,868,594,238.82
未分配利润		-1,510,323,758.61	-1,491,813,427.74
所有者权益合计		3,504,273,295.08	4,376,780,810.08
负债和所有者权益总计		3,643,683,502.68	4,435,015,401.24

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值人民币0.6988元，基金资产总额5,014,597,053.69元。

6.2 利润表

会计主体：国投瑞银核心企业股票型证券投资基金
 本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注	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
一、收入		-216,922,893.13	-137,332,213.50
利息收入		18,292,253.39	6,454,975.83
其中：存款利息收入		1,975,737.47	1,461,212.88
债券利息收入		13,634,631.11	3,072,770.54
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		2,681,884.81	1,920,992.41
利息收入总额		—	—
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		14,057,719.79	245,527,464.31
其中：股票投资收益		17,247,128.06	271,254,211.80
基金投资收益		-4,918,230.87	1,540,249.76
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益		—	—
投资收益		36,223,078.56	26,522,690.69
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-249,760,281.79	-389,324,820.33
4.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)		487,476.40	10,378.90
二、费用		47,632,637.51	50,297,236.83
1.管理人报酬		29,227,646.24	31,130,094.53
2.托管费		4,871,274.34	5,189,834.09
3.销售服务费		—	—
4.交易费用		13,320,240.86	13,737,100.09
5.利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6.其他费用		233,476.64	231,797.82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-264,575,476.64	-187,629,950.03
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-264,575,476.64	-187,629,950.03

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
 会计主体：国投瑞银核心企业股票型证券投资基金
 本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注	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
一、期初所有者权益(基金净值)		5,868,594,238.82	4,376,780,810.08
二、本期损益		-264,575,476.64	-187,629,950.03
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回/转换/转入/转出)		-853,997,185.13	-407,532,039.36
其中：1.基金申购款		8,472,593.71	3,281,846.36
2.基金赎回款		-862,469,778.84	-248,446,992.04
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(利润分配/转分配)		5,014,597,053.69	5,868,594,238.82
五、期末所有者权益(基金净值)		5,014,597,053.69	5,868,594,238.82

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值人民币0.6988元，基金资产总额5,014,597,053.69元。

项目	附注	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
一、收入		-216,922,893.13	-137,332,213.50
利息收入		18,292,253.39	6,454,975.83
其中：存款利息收入		1,975,737.47	1,461,212.88
债券利息收入		13,634,631.11	3,072,770.54
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		2,681,884.81	1,920,992.41
利息收入总额		—	—
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		14,057,719.79	245,527,464.31
其中：股票投资收益		17,247,128.06	271,254,211.80
基金投资收益		-4,918,230.87	1,540,249.76
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益		—	—
投资收益		36,223,078.56	26,522,690.69
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-249,760,281.79	-389,324,820.33
4.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)		487,476.40	10,378.90
二、费用		47,632,637.51	50,297,236.83
1.管理人报酬		29,227,646.24	31,130,094.53
2.托管费		4,871,274.34	5,189,834.09
3.销售服务费		—	—
4.交易费用		13,320,240.86	13,737,100.09
5.利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6.其他费用		233,476.64	231,797.82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-264,575,476.64	-187,629,950.03
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-264,575,476.64	-187,629,950.03

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
 会计主体：国投瑞银核心企业股票型证券投资基金
 本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注	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
一、期初所有者权益(基金净值)		5,868,594,238.82	4,376,780,810.08
二、本期损益		-264,575,476.64	-187,629,950.03
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购/赎回/转换/转入/转出)		-853,997,185.13	-407,532,039.36
其中：1.基金申购款		8,472,593.71	3,281,846.36
2.基金赎回款		-862,469,778.84	-248,446,992.04
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(利润分配/转分配)		5,014,597,053.69	5,868,594,238.82
五、期末所有者权益(基金净值)		5,014,597,053.69	5,868,594,238.82

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值人民币0.6988元，基金资产总额5,014,597,053.69元。

本报告附注为财务报表的组成部分。
 本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

国投瑞银	国投瑞银	国投瑞银
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注
 6.4.1 基金基本情况
 国投瑞银核心企业股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2013年12月18日《关于同意国投瑞银核心企业股票型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2014年6月19日正式生效，首次设立募集规模为2,659,682,699.78份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，注册地为上海，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
 金额单位：人民币元

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,062,250	278,600,255.00	7.95
2	000002	万科A	33,468,662	276,758,834.74	7.90
3	601318	中国平安	4,353,358	171,261,033.72	4.89
4	600030	中信证券	13,527,781	155,028,370.26	4.42
5	600048	保利地产	28,817,365	142,934,120.48	4.08
6	602290	信创医药	5,485,219	116,676,989.13	3.33
7	600509	中国南车	5,552,485	116,442,740.29	3.32
8	600035	银禧新材	5,492,197	82,108,345.15	2.34
9	000848	承德露露	3,781,538	75,135,583.46	2.14
10	600887	伊府股份	1,962,943	65,012,672.14	1.86

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
 金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	343,385,010.48	7.85
2	000002	万科A	264,368,966.74	6.04
3	002290	信创医药	222,613,612.07	5.09
4	600035	银禧新材	204,141,066.33	4.66
5	000848	承德露露	161,397,397.20	3.70
6	600048	保利地产	135,079,153.23	3.09
7	600032	白云山	127,986,663.78	2.92
8	002570	贝因美	125,460,979.74	2.87
9	600015	上海家化	115,773,779.90	2.65
10	600026	招商局	97,528,764.46	2.23
11	600036	中信证券	104,958,065.54	2.40
12	601318	中国平安	102,507,568.95	2.34
14	300326	中信银行	89,051,488.28	2.03
15	002043	以岭药业	70,992,443.41	1.62
16	300238	冠昊生物	68,346,968.21	1.57
17	000661	长春高新	67,449,306.86	1.54
18	300058	蓝思科技	66,666,882.19	1.51
19	000538	华鲁制药	61,962,753.44	1.42
20	300020	银信股份	57,528,764.46	1.31

7.4.2 股票投资组合的重大变动
 6.4.2 会计报表的编制基础
 本财务报表按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于具体会计准则和信息披露方面，参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》，中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号—年度报告和半年度报告》及其他中国证监会颁布的相关规定。

7.4.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
 金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	343,385,010.48	7.85
2	000002	万科A	264,368,966.74	6.04
3	002290	信创医药	222,613,612.07	5.09
4	600035	银禧新材	204,141,066.33	4.66
5	000848	承德露露	161,397,397.20	3.70
6	600048	保利地产	135,079,153.23	3.09
7	600032	白云山	127,986,663.78	2.92
8	002570	贝因美	125,460,979.74	2.87
9	600015	上海家化	115,773,779.90	2.65
10	600026	招商局	97,528,764.46	2.23
11	600036	中信证券	104,958,065.54	2.40
12	601318	中国平安	102,507,568.95	2.34
14	300326	中信银行	89,051,488.28	2.03
15	002043	以岭药业	70,992,443.41	1.62
16	300238	冠昊生物	68,346,968.21	1.57
17	000661	长春高新	67,449,306.86	1.54
18	300058	蓝思科技	66,666,882.19	1.51
19	000538	华鲁制药	61,962,753.44	1.42
20	300020	银信股份	57,528,764.46	1.31

注：投资者若想了解本报告期内基金投资的所有股票明细，应阅读刊载于国投瑞银基金管理有限公司网站(<http://www.uibscid.com>)的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
 金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	343,385,010.48	7.85
2	000002	万科A	264,368,966.74	6.04
3	002290	信创医药	222,613,612.07	5.09
4	600035	银禧新材	204,141,066.33	4.66
5	000848	承德露露	161,397,397.20	3.70
6	600048	保利地产	135,079,153.23	3.09
7	600032	白云山	127,986,663.78	2.92
8	002570	贝因美	125,460,979.74	2.87
9	600015	上海家化	115,773,779.90	2.65
10	600026	招商局	97,528,764.46	2.23
11	600036	中信证券	104,958,065.54	2.40
12	601318	中国平安	102,507,568.95	2.34
14	300326	中信银行	89,051,488.28	2.03
15	002043	以岭药业	70,992,443.41	1.62