

# 国投瑞银核心企业混合型证券投资基金

## 2015 第四季度报告

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:2016年1月20日

**§1 重要提示**

基金管理人及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责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年1月18日披露了本报告期内基金净值、净值表现和投资组合报告等内容,但基金净值可能存在不准确性,导致投资者做出错误决策,基金管理人不承担由此产生的任何责任,投资者须以本基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等文件为准。

基金管理人及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责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年1月18日披露了本报告期内基金净值、净值表现和投资组合报告等内容,但基金净值可能存在不准确性,导致投资者做出错误决策,基金管理人不承担由此产生的任何责任,投资者须以本基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等文件为准。

基金管理人及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责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年1月18日披露了本报告期内基金净值、净值表现和投资组合报告等内容,但基金净值可能存在不准确性,导致投资者做出错误决策,基金管理人不承担由此产生的任何责任,投资者须以本基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等文件为准。

**§2 基金产品概况**

基金名称:国投瑞银核心企业混合型证券投资基金

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

报告期末基金总份额:1,072,706,176.149

报告期末基金份额总额:1,072,706,176.149

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

注:本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的股票。

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	矿业	-	-
C	制造业	1,105,492,044.27	60.64
D	电力、热力、燃气及生产服务业	9,127,266.88	0.48
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	88,612,156.61	4.70
G	信息传输、软件和信息技术服务业	146,289,763.54	7.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	228,408,034.98	12.01
J	房地产业	34,477,747.84	1.82
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	39,377,080.08	2.07
Q	其他	-	-
合计		1,737,048,363.00	91.22

§3 报告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

序号	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	600036	招商银行	3,169,051	62,401,344.27	4.86
2	000038	国药一致	1,286,232	89,611,756.41	4.70
3	000025	长电科技	4,048,212	67,179,597.64	4.08
4	600072	中航电子	2,406,089	66,400,729.07	3.49
5	300397	蓝盾医疗	119,010	60,046,747.20	3.36
6	600308	际华股份	1,859,741	59,409,882.12	3.12
7	601228	光大证券	2,656,076	57,756,845.84	3.08
8	002289	齐创包装	2,706,263	52,369,089.56	2.77
9	300103	达瑞医疗	1,849,087	50,520,143.12	2.65
10	600241	黄金珠宝	1,169,927	50,167,424.33	2.63

§4 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	金融债	-	-
3	企业债	-	-
4	可转债	26,106,000.00	1.32
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	其他	-	-
合计		26,106,000.00	1.32

§5 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111807	11国债(7)	260,000	26,106,000.00	1.32

注:本基金本报告期末未持有以上债券。

§6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

§7 报告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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

§8 报告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

本基金本报告期末未持有权证投资。

§9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

§10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

§11 投资组合报告附注

§11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

§11.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同约定备选股票库之内的股票。

§11.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	967,152.26
2	应收证券清算款	34,111,774.28
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	562,797.89
6	其他资产	65,004.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		36,680,428.64

注:本基金本报告期末未持有以上资产。

§11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§11.5 报告期末前十名股票中存在受违规处罚的情况

本基金本报告期末前十名股票中不存在受违规处罚的情况。

§11.6 报告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

本基金本报告期末未持有权证投资。

§11.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

§11.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

§11.9 投资组合报告附注

§11.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

§11.9.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同约定备选股票库之内的股票。

§11.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	967,152.26
2	应收证券清算款	34,111,774.28
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	562,797.89
6	其他资产	65,004.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		36,680,428.64

注:本基金本报告期末未持有以上资产。

§11.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§11.9.5 报告期末前十名股票中存在受违规处罚的情况

本基金本报告期末前十名股票中不存在受违规处罚的情况。

§11.9.6 报告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

本基金本报告期末未持有权证投资。

§11.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

§11.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

§11.9.9 投资组合报告附注

§11.9.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

§11.9.9.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同约定备选股票库之内的股票。

§11.9.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	967,152.26
2	应收证券清算款	34,111,774.28
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	562,797.89
6	其他资产	65,004.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		36,680,428.64

注:本基金本报告期末未持有以上资产。

§11.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§11.9.9.5 报告期末前十名股票中存在受违规处罚的情况

本基金本报告期末前十名股票中不存在受违规处罚的情况。

§11.9.9.6 报告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

本基金本报告期末未持有权证投资。

§11.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

§11.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

§11.9.9.9 投资组合报告附注

§11.9.9.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

§11.9.9.9.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同约定备选股票库之内的股票。

§11.9.9.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	967,152.26
2	应收证券清算款	34,111,774.28
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	562,797.89
6	其他资产	65,004.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		36,680,428.64

注:本基金本报告期末未持有以上资产。

§11.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§11.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在受违规处罚的情况

本基金本报告期末前十名股票中不存在受违规处罚的情况。

§11.9.9.9.6 报告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

本基金本报告期末未持有权证投资。

§11.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

§11.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

§11.9.9.9.9 投资组合报告附注

§11.9.9.9.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

§11.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同约定备选股票库之内的股票。

§11.9.9.9.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	967,152.26
2	应收证券清算款	34,111,774.28
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	562,797.89
6	其他资产	65,004.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		36,680,428.64

注:本基金本报告期末未持有以上资产。

§11.9.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§11.9.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在受违规处罚的情况

本基金本报告期末前十名股票中不存在受违规处罚的情况。

§11.9.9.9.9.6 报告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

本基金本报告期末未持有权证投资。

§11.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

§11.9.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

§11.9.9.9.9.9 投资组合报告附注

§11.9.9.9.9.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

§11.9.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同约定备选股票库之内的股票。

§11.9.9.9.9.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	967,152.26
2	应收证券清算款	34,111,774.28
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	562,797.89
6	其他资产	65,004.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		36,680,428.64

注:本基金本报告期末未持有以上资产。

§11.9.9.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§11.9.9.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在受违规处罚的情况

本基金本报告期末前十名股票中不存在受违规处罚的情况。

§11.9.9.9.9.9.6 报告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

本基金本报告期末未持有权证投资。

§11.9.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

§11.9.9.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

§11.9.9.9.9.9.9 投资组合报告附注

§11.9.9.9.9.9.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

§11.9.9.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同约定备选股票库之内的股票。

§11.9.9.9.9.9.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	967,152.26
2	应收证券清算款	34,111,774.28
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	562,797.89
6	其他资产	65,004.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		36,680,428.64

注:本基金本报告期末未持有以上资产。

§11.9.9.9.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§11.9.9.9.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在受违规处罚的情况

本基金本报告期末前十名股票中不存在受违规处罚的情况。

§11.9.9.9.9.9.9.6 报告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

本基金本报告期末未持有权证投资。

§11.9.9.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

§11.9.9.9.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

§11.9.9.9.9.9.9.9 投资组合报告附注

§11.9.9.9.9.9.9.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

§11.9.9.9.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同约定备选股票库之内的股票。

§11.9.9.9.9.9.9.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	967,152.26
2	应收证券清算款	34,111,774.28
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	562,797.89
6	其他资产	65,004.06
7	待摊费用	-
8	其他</	