

# 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

基金管理人的董事会及基金经理保证基金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。  
本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2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
基金管理人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
本基金投资组合报告所载数据截至2015年12月31日。

§ 2 基金产品概况

注:本基金报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

5.2 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(%)
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采矿业	-	-
3	制造业	1,193,462,464.07	62.64
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,127,290.00	0.48
5	建筑业	-	-
6	批发和零售业	89,611,166.41	4.70
7	交通运输、仓储和邮政业	-	-
8	信息传输、软件和信息技术服务业	146,259,700.04	7.62
9	金融业	226,499,040.00	11.68
10	房地产业	34,677,747.44	1.82
11	租赁和商务服务业	-	-
12	科学研究、技术服务及地质勘查业	-	-
13	水利、环境和公共设施管理业	-	-
14	居民服务、修理和其他服务业	-	-
15	教育	-	-
16	文化、体育和娱乐业	39,377,000.00	2.07
17	综合	-	-
18	合计	1,737,954,263.00	91.22

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

5.4 报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.5 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.6 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资明细

5.7 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资明细

5.8 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资明细

5.9 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资明细

5.10 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.11 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.12 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.13 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.14 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.15 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.16 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.17 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.18 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.19 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.20 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.21 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.22 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.23 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.24 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.25 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.26 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.27 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.28 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.29 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.30 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.31 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.32 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.33 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.34 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.35 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.36 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.37 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.38 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.39 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.40 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.41 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.42 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.43 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.44 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.45 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.46 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.47 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.48 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.49 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.50 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.51 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.52 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.53 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.54 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.55 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.56 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.57 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.58 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.59 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.60 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.61 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.62 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.63 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.64 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.65 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.66 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.67 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.68 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.69 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.70 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.71 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.72 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.73 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.74 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.75 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.76 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.77 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.78 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.79 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.80 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.81 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.82 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.83 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.84 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.85 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.86 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.87 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.88 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.89 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.90 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.91 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.92 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.93 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.94 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.95 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.96 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资组合

5.97 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证及金融衍生品投资组合

5.98 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资组合

5.99 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名保险及组合类金融产品投资组合

5.100 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资组合

5.101 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资组合

5.102 报告期按公