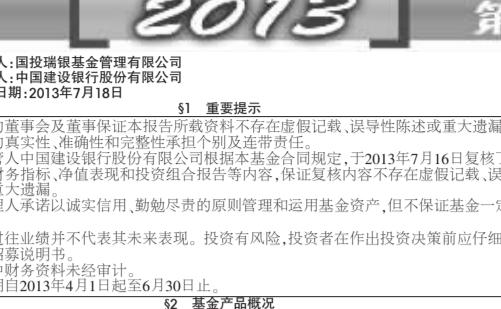


2013年7月18日 星期四

国投瑞银双债增利债券型证券投资基金

2013年6月30日



重要提示

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2013年7月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人：中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年7月16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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

\$2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银双债增利封闭(A场内简称：双债A)

基金主代码 161210

交易代码 161210

契约型，本基金包括A、C两类份额，募集期(仅发售A类基金份额)，该类基金份额在基金合同生效后2年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易，封闭期结束后可以上市开放式基金(LOF)；封闭期结束转为开放式后，本基金包括A、C两类份额。

基金合同生效日 2011年3月29日

报告期末基金份额总额 1,237,619,716.41份

投资目标 在追求基金资产稳定增值、有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

投资策略 本基金采取稳健灵活的投资策略，主要通过对可转债、信用债等固定收益类金融工具的主动管理，并根据对股票市场的趋势研判及新券申购的审慎评估，适度参与一级市场首发新股和增发新股的申购，力求提高基金整体收益。

业绩比较基准 中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%

风险收益特征 本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益低于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

\$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

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 39,980,622.96

2.本期利润 18,864,041.71

3.加权平均基金份额本期利润 0.0152

4.期末基金资产净值 1,273,755,490.36

5.期末基金份额净值 1.029

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.以上所列基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值增长率和基金资产净值

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 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

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化的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.3 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.4 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.5 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.6 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.7 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.8 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.9 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.10 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.11 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.12 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.13 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.14 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.15 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.16 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.17 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%

注：1.本基金以可转债、信用债为主要投资方向，强调基金资产的稳定增值。本基金以中信标普可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数为基础构建业绩比较基准，具体为中信标普可转债指数收益率×45%+中债企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总全价指数收益率×10%，主要是鉴于上述指数的多样性和代表性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

3.2.18 本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.43% 0.21% -1.39% 0.39% 2.82% -0.18%