

国投瑞银双债增利债券型证券投资基金

[2013] 第三季度报告

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月31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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的约定，于2013年10月21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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银双债增利债券型证券投资基金

基金主代码 161216

交易代码 161216

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成立后2年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易，到期闭合后转为上市开放式基金(LOF)。封闭期结束后转为开放式后，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

基金运作方式 契约型开放式

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，力求取得高于业绩比较基准的收益。

投资策略 本基金将采取稳健均衡的投资策略，主要通过对可转换信用债券、信用债券类金融工具的主动管理，力求在有效控制风险的基础上，获得基金资产的稳定增值，并根据对市场的动态研判及新券申购的收益率预测，适度参与一级市场首次公开发行股票和增发新股的申购，提高基金整体收益水平。

业绩比较基准 中证综合可转换债券指数收益率×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%，主要是鉴于该指数的充分性和权威性，以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

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

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 9,881,164.05

2.本期利润 -6,308,593.59

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0051

4.期末基金份额净值 1,247,645,017.42

5.期末基金份额总额 1,008

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.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，计入费用后实际收益将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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

单位:人民币元

阶段 净值增长 率① (%) 净值增长 率② (%) 业绩比较 基准收益 率③ (%) 基准收益 率④ (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.49% 0.12% -0.11% 0.25% -0.38% -0.13%

注:1.本基金可以可转换信用债券型基金为投资目标，强调基金资产的稳定性。本基金以中债信标普可转债指数、中债企业债全价指数和中债国债全价指数为基本构建业绩比较基准，具体以中债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%，主要是鉴于该指数的充分性和权威性，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累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 59,734.24

2 应收证券清算款

3 应收股利

4 应收利息 34,177,587.71

5 应收申购款

6 其他应收款

7 待摊费用

8 其他

9 合计 34,237,321.95

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位:人民币元

序号 债券代码 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 122070 11海航01 961,250 95,500,187.50 7.65

2 128111 11深物业MTN1 900,000 90,351,000.00 7.24

3 1100087 11华旗债 800,000 80,168,000.00 6.43

4 110011 歌华华债 656,670 66,133,235.70 5.30

5 126018 08中行债 692,530 61,531,290.50 4.93

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.9 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.10 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.11 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名保险投资明细

本基金本报告期末未持有保险投资。

5.12 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.13 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.14 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.15 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.16 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名保险投资组合

本基金本报告期末未持有保险投资。

5.17 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名基金投资组合

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.18 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.19 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.20 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.21 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名保险投资组合

本基金本报告期末未持有保险投资。

5.22 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名基金投资组合

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.23 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.24 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.25 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.26 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名保险投资组合

本基金本报告期末未持有保险投资。

5.27 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名基金投资组合

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.28 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.29 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.30 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.31 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名保险投资组合

本基金本报告期末未持有保险投资。

5.32 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名基金投资组合

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.33 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.34 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.35 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.36 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名保险投资组合

本基金本报告期末未持有保险投资。

5.37 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名基金投资组合

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.38 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.39 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.40 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.41 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名保险投资组合

本基金本报告期末未持有保险投资。

5.42 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名基金投资组合

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.43 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.44 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.45 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.46 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名保险投资组合

本基金本报告期末未持有保险投资。

5.47 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名基金投资组合

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.48 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.49 报告期末按市值占总资产比例大小排序的前十名债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。