

2015年06月30日
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
送出日期:2015年08月28日

\$ 1 重要提示及目录

基金管理人的董事会、董事保证本报告所披露的信息不存在虚假记载、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的法律责任。本基金年度报告在三分之一以上扉页上盖章并签署，由董事长签发。

基金管理人和基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
基金投资运作过程中可能面临其未表现出来，投资者欲了解详细情况，请阅读半年度报告全文。
本报告期财务资料未经审计。
本基金报告期自2015年1月1日起至2015年08月30日止。

\$ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银双债债券	
基金代码	161216	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年03月01日	
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	
报告期末基金份额总额	307,446,256.47	
基金合同存续期间	不定期	
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2011-05-20	
下属两级基金的基金简称	国投瑞银双债债券A (场内简称:双债A)	国投瑞银双债债券C (场内简称:双债C)
下属两级基金的交易代码	161216	161221
报告期末两级基金的份额总额	217,467,690.57	90,378,601.90

2.2 基金产品说明

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稳定回报。

投资策略 本基金采取“双债”投资策略,即在实现固定收益类资产投资的同时,通过股票等其他资产的配置,力争在控制风险的前提下,提高基金的收益率。

业绩比较基准 中债企业债指数收益率×45%+中债国债指数收益率×45%+中债企业债指数收益率×10%

2.3 基金管理人员和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国投瑞银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
姓名	刘凯	田青
信息披露负责人	400-380-6988	010-67960606
联系电话	400-380-6988	010-67960606
电子邮箱	service@utrcfund.com	tianqing12@cbt.com
客户服务电话	400-380-6988	010-67960606
传真	0755-26290408	010-66275883

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网址:<http://www.utbcidc.com>
基金半年度报告置地地点:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心40层

2.5 其他相关资料

项目 名称 办公地址

注册登记机构 中国登记结算登记有限公司 北京市西城区平安大街17号

3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

3.1 本期间数据和指标		报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)	
本期已实现收益	27,087,023.36	6,597,798.15	
本期利润	16,731,556.06	4,313,372.04	
加权平均基金份额本期利润	0.0673	0.0696	
本期基金份额净值增长率为	6.47%	6.31%	

3.2 月末数据和指标

2015年6月30日(2015年6月30日)

0.0103 0.0075

94,882,962.85

1,060

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.对期末未分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生额)。
3.以上所述基金绩效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),计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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:百分比

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去一个月	-0.11%	0.43%	-12.39%	2.40%	-12.28%
过去三个月	3.16%	0.28%	-3.15%	1.71%	-6.21%
过去六个月	6.47%	0.24%	-3.34%	9.78%	-1.13%
过去一年	28.43%	0.36%	-17.68%	1.07%	-10.75%
过去二年	43.64%	0.26%	-19.78%	0.65%	-23.98%
自基金合同生效日起至今	54.69%	0.23%	-17.98%	0.66%	-36.71%

注:1.本基金可从银行、证券公司、基金销售机构、基金管理人以及基金代销机构等处购买基金,也可通过基金管理人网站直接购买。
2.对期末未分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生额)。
3.以上所述基金绩效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),计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2.2 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

项目	本期	本报告期	本报告期
本期已实现收益	27,087,023.36	6,597,798.15	
本期利润	16,731,556.06	4,313,372.04	
加权平均基金份额本期利润	0.0673	0.0696	
本期基金份额净值增长率为	6.47%	6.31%	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.对期末未分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生额)。
3.以上所述基金绩效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),计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.3.1 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

项目	本期	本报告期	本报告期
本期已实现收益	27,087,023.36	6,597,798.15	
本期利润	16,731,556.06	4,313,372.04	
加权平均基金份额本期利润	0.0673	0.0696	
本期基金份额净值增长率为	6.47%	6.31%	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.对期末未分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生额)。
3.以上所述基金绩效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),计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2.4 基金净值表现

3.2.4.1 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

项目	本期	本报告期	本报告期
本期已实现收益	27,087,023.36	6,597,798.15	
本期利润	16,731,556.06	4,313,372.04	
加权平均基金份额本期利润	0.0673	0.0696	
本期基金份额净值增长率为	6.47%	6.31%	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.对期末未分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生额)。
3.以上所述基金绩效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),计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2.5 基金净值表现

3.2.5.1 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

项目	本期	本报告期	本报告期
本期已实现收益	27,087,023.36	6,597,798.15	
本期利润	16,731,556.06	4,313,372.04	
加权平均基金份额本期利润	0.0673	0.0696	
本期基金份额净值增长率为	6.47%	6.31%	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.对期末未分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生额)。
3.以上所述基金绩效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),计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2.6 基金净值表现

3.2.6.1 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

项目	本期	本报告期	本报告期
本期已实现收益	27,087,023.36	6,597,798.15	
本期利润	16,73		