

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:2012年03月29日

## § 1 重要提示及目录

基金管理人的董事、监事、高级管理人员、基金经理、基金托管人、基金代销机构、基金销售机构的从业人员在报告期间内没有发生损害基金持有人利益的行为,并对其内容的完整性、准确性、及时性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月26日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等,内容,复核报告不存在虚假记载、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及其更新。

本年度报告将摘要自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

报告期自2011年3月29日起至2012年3月31日止。

## § 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 国投瑞银双债增利债券型证券投资基金

基金代码 161216

交易代码 161216

契约型,本基金包括A、C两类份额。募集期间仅发售A类基金份额,该类基金份额在基金合同生效后3年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,封闭期届满后转为上市开放式基金(LOF);封闭期届满后转为开放式后,本基金包括A、C两类份额。

基金合同生效日 2011年03月29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

报告期基金净值总额 1,237,619,716.41份

基金合同存续期 不定期

基金上市交易的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2011年05月20日

2.2 基金产品说明

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。

本基金将根据宏观经济的政策、利率变化情况、信用环境等

固定收益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;并根据对市场的趋势研判及

新股申购的评估情况,适时参与一级市场新股的增发新股的

申购,力求提高基金总体收益。

本基金将根据债券型基金的最低风险品种,风险收益特征

与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露义务人 中国建设银行股份有限公司

联系人 陈丽

联系电话 400-880-6868

电子邮箱 service@ubssdc.com

客户服务电话 400-880-6868

传真 0755-82904048

2.4 信息披露方式

管理人互联网网址 <http://www.ubssdc.com>

基金管理人报告备置地点 深圳市福田区金田路4028号深业经贸中心46层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标

2011年03月29日-2011年12月31日

本期已实现收益 28,449,284.51

本期利润 -5,101,252.54

加权平均基金份额本期利润 -0.0041

本期基金份额净值增长率 2011年末

期末可供分配基金份额利润 1,232,518,463.87

基金份额净值 0.996

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扣除非经常性损益后的余额。

2.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表未分配利润与本期利润中已实现部分的较低数

为期末余额,不考虑期间费用。

3.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),计算费用后实际利润水平将低于所列数字。

4.本基金合同生效日在2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

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

注:1.本基金以信用债券、信用债券为投资方向,强调基金资产的稳定增值。本基金以中债总指数

指数、中债企业债总指数和中债企业债指数为基础构建业绩比较基准,具体为中债总指数可转债指

数收益率×45%+中债企业债总指数收益率×45%+中债国债指数收益率×10%。主要是鉴于上述指

数的公允性和权威性,以及本基金的投资策略的一致性。

2.本基金在报告期未采用单一的业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金以信用债券、信用债券为投资方向,强调基金资产的稳定增值。本基金以中债总指数

指数、中债企业债总指数和中债企业债指数为基础构建业绩比较基准,具体为中债总指数可转债指

数收益率×45%+中债企业债总指数收益率×45%+中债国债指数收益率×10%。主要是鉴于上述指

数的公允性和权威性,以及本基金的投资策略的一致性。

2.本基金在报告期未采用单一的业绩比较基准。

3.2.3 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.4 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.5 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.6 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.7 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.8 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.9 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.10 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.11 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.12 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2.截至报告期末本基金各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例0.34%,权证投资占基

金净值比例100%,债券投资占基金净值比例136.39%,可转债、信用债券合计投资占固定收益类资产比例

100%,符合基金合同的相关规定。

3.2.13 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同生效日为2011年3月29日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。根据合同约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起3个月内对基金的投资组合比例符合基金

合同的有关约定。本基金在建仓期间将各项资产配置比例符合基金合同的约定。