

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:2014年1月22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。
基金托管人中行建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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、基金合同及基金销售机构提供的材料。
本基金报告期财务数据未经审计。

报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银双债增利债券(A) (A类) (场内简称:国投A)

基金代码 162316

交易代码 162316

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2001年1月20日

报告期末基金份额总额 1,237,976,14.60

基金净值 1.00

基金份额净值 1.00

基金份额净值增长率 -0.0266%

基金份额净值增长率标准差 0.0265%

风险收益特征 本基金为债券型基金，属证券投资基金中较低风险品种，风险收益水平低于股票型基金。

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

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 6,401,837.40

2.本期利润 -32,934,065.17

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0266

4.期末基金资产净值 1,210,998,106.17

5.期末基金份额净值 0.978

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水平将低于所列数字。
3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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变动的比较

阶段 净值增长 纯值增长 业绩比较 基准收益 纯值标准差 ①-③ ②-④

过去三个月 -2.69% 0.1% -3.74% 0.22% 1.05% -0.11%

注:1.本基金可以可转债、信用债为主要投资方向,强调基金资产的稳定增值。本基金以中债可转债指数、中债企业债总全价指数和中债国债指数为基准构建业绩比较基准,具体为中债可转债指数收益率*45%+中债企业债总全价指数收益率*45%+中债国债指数收益率*10%。
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 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银双债增利债券型证券投资基金

2013 第四季度报告

报告期内基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号 项目 金额 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 - -

2 衍生工具 - -

3 固定收益投资 1,453,596,104.42 93.50

其中:债券 - 1,453,596,104.42 93.50

资产支持证券 - -

4 货币市场工具 - -

5 其他 - -

6 衍生工具及套期保值准备金合计 63,122,409.74 4.06

7 其他各项资产 37,914,727.66 2.44

8 合计 1,554,633,241.82 100.00

5.0.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位: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 110011 歌华转债 62,639,751.30 5.17

2 110018 国电转债 26,032,997.00 2.15

3 110015 石化转债 23,585,388.80 1.95

4 110012 海运转债 11,810,662.90 0.98

5 110022 国仁转债 4,741,473.00 0.39

5.0.5 报告期末持有的股票投资

金额单位: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 110011 歌华转债 62,639,751.30 5.17

2 110018 国电转债 26,032,997.00 2.15

3 110015 石化转债 23,585,388.80 1.95

4 110012 海运转债 11,810,662.90 0.98

5 110022 国仁转债 4,741,473.00 0.39

5.0.6 报告期末持有的股票投资明细

金额单位: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 110011 歌华转债 62,639,751.30 5.17

2 110018 国电转债 26,032,997.00 2.15

3 110015 石化转债 23,585,388.80 1.95

4 110012 海运转债 11,810,662.90 0.98

5 110022 国仁转债 4,741,473.00 0.39

5.0.7 基金管理人运用资金投资的基本情况

5.0.8 影响投资者决策的其他重要信息

1.报告期内基金管理人对本人进行了二次分红,指定期报告时间为2013年10月11日。

2.报告期内基金管理人自2013年10月29日起对个人投资者通过公司网上直销系统以转账汇款方式购买本公司旗下基金实行买入申购、申购费率优惠,指定账户公告时间为2013年10月29日。

3.2.2 报告期内基金管理人对本公司旗下基金实行买入申购、申购费率优惠,指定账户公告时间为2013年10月29日。

4.基金管理人对本公司旗下基金实行买入申购、申购费率优惠,指定账户公告时间为2013年10月29日。

5.0.9 备查文件目录

《关于国投瑞银双债增利债券型证券投资基金基金募集的批复》(证监许可[2011]127号)

《关于国投瑞银双债增利债券型证券投资基金基金合同确认的函》(基金部函[2011]187号)

《国投瑞银双债增利债券型证券投资基金托管协议》

《国投瑞银双债增利债券型证券投资基金招募说明书》

《国投瑞银双债增利债券型证券投资基金托管协议》

《国投瑞银双债增利债券型证券投资基金托管协议》