

# 国投瑞银双债增利债券型证券投资基金

## 2014 第四季度报告

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司 报告送出日期:2015年01月21日		序号 项目 金额 占基金总资产的比例(%)			
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:2015年01月21日		1 权益投资	15,892,928.74	2.74	
		其中:股票	15,892,928.74	2.74	
		2 基金投资	-	-	
		3 固定收益投资	532,007,441.20	91.78	
		其中:债券	532,007,441.20	91.78	
		4 贵金属投资	-	-	
		5 金融衍生品投资	-	-	
		6 买入返售金融资产	-	-	
		其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
		7 银行存款和结算备付金合计	15,149,966.53	2.61	
8 其他资产	16,609,989.65	2.87			
9 其他负债	579,660,326.12	100.00			
6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合		金额单位:人民币元			
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
A	农林、牧、渔	-	-		
B	采矿业	-	-		
C	制造业	-	-		
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,892,928.74	4.83		
E	建筑业	-	-		
F	交通运输和仓储业	-	-		
G	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-		
H	住宿和餐饮业	-	-		
I	金融业	-	-		
J	房地产业	-	-		
L	租赁和商务服务业	-	-		
M	科学研究和技术服务业	-	-		
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-		
P	教育	-	-		
Q	卫生和社会工作	-	-		
R	文化、体育和娱乐业	-	-		
S	综合	-	-		
合计		15,892,928.74	4.83		
6.3 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		金额单位:人民币元			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600795	国电电力	3,432,598	15,892,928.74	4.83
6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合		金额单位:人民币元			
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
1	国家债券	-	-		
2	央行票据	-	-		
3	金融债券	20,010,000.00	6.08		
其中:政策性金融债		20,010,000.00	6.08		
4	企业债券	431,266,101.90	130.98		
5	企业短期融资券	-	-		
6	中期票据	31,170,000.00	9.47		
7	可转债	49,561,339.30	15.05		
8	其他	-	-		
9	合计	532,007,441.20	161.58		
6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细		金额单位:人民币元			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	124713	14国债13	398,980	42,555,260.80	12.92
2	1180087	11国债07	400,000	40,108,000.00	12.18
3	124742	14国债02	300,000	32,400,000.00	9.84
4	124686	14国债平	300,000	31,600,000.00	9.60
5	124313	13国债零	261,000	26,623,020.00	8.09
6.6 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资产支持证券投资明细		金额单位:人民币元			
本报告期内本基金未持有资产支持证券。					
6.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细		金额单位:人民币元			
本报告期内本基金未持有权证投资。					
6.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	31,985.47			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	16,609,989.65			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	9,561,688.61			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	9,561,688.61			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	9,561,688.61			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	9,561,688.61			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	9,561,688.61			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	9,561,688.61			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	9,561,688.61			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	9,561,688.61			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,034.87			
3	应收股利	-	1,018,026.24		
4	应收利息	-	14,994,478.93		
5	应收申购款	-	565,502.01		
6	其他应收款	-	-		
7	待摊费用	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	9,561,688.61			
6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券投资明细		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	110020	南山转债	24,523,892.60	7.45	
2	110008	国电转债	14,956,182.50	4.54	
3	113001	中冶转债	10,081,240.29	3.06	
6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
本报告期内本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。					
6.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。					
6.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。					
6.11.8 投资组合报告附注					
6.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。					
6.11.3 其他资产构成					
单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	23,304.71			
2	应收证券清算款	48,470,			