

国投瑞银双债增利债券型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:2015年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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、完整性和及时性承担个别法律责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年6月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，复核结果表明不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人承诺不从事违反基金合同规定的投资活动。
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。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 国投瑞银双债债券

基金主代码 161216

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011年03月01日

报告期末基金份额总额 307,446,298.47份

投资目标 在追求基金资产一定增值，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回报收益。

投资策略 本基金采用稳健的投资策略，在严格控制风险的前提下，获得基金资产的稳定增值。
本基金将通过深入研究宏观经济、行业政策、市场环境、资金供求、利率水平、信用利差等影响债券价格的因素，精选具有投资价值的债券品种，力争在有效控制风险的前提下，获得高于业绩比较基准的回报收益。

业绩比较基准 中证国债指数收益率×40%+中债企业债指数收益率×40%+银行存款利率(税后)×20%

风险收益特征 本基金为债券型基金，风险低于股票型基金，高于货币市场基金，属于债券基金中的低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于债券基金的股票型基金。

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

下属两级基金的基金简称 国投瑞银双债债券A 国投瑞银双债债券C

下属两级基金的基金代码 161216 161221

报告期末下属两级基金的份额总额 217,067,496.57份 90,379,601.90份

§ 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(2015年04月01日-2015年06月30日)

国投瑞银双债债券A 国投瑞银双债债券C

1.本期已实现收益 6,707,902.06 2,063,100.71

2.本期利润 8,275,601.08 2,644,323.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.0331 0.0309

4.期末基金份额净值 226,871,620.15 94,882,962.05

5.期末可供分配基金份额净值 1.046 1.060

注:1.本基金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.以上所示基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用(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 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银双债债券A

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ 比较基准收益率③-④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.16% -3.10% 1.71% 6.31% -1.43%

国投瑞银双债债券C

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ 比较基准收益率③-④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.06% -3.16% 1.71% 6.20% -1.43%

注:1.本基金以银行存款、信用债券、货币市场基金等为标的构建投资组合，具体为中债信证可转债指数收益率×40%+中债企业债指数收益率×40%+银行存款利率(税后)×10%，主要是鉴于上述指数的公允性和权威性，以及上述指数与本基金的资产配置的一致性。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银双债债券A

5.4 报告期末按照行业分类的债券投资组合

(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 600016 民生银行 18,860,941.00 5.26

2 603993 浦发银行 9,941,760.00 3.09

3 200702 吉林银行 433,200.00 0.00

4 000088 深圳发展 2,064.24 0.00

5 合计 36,354,696.10 10.09

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

(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 600016 民生银行 1,897,400 18,860,941.00 5.26

2 603993 浦发银行 904,350 9,941,760.00 3.09

3 200702 吉林银行 433,200 0.00

4 000088 深圳发展 183 2,064.24 0.00

5 合计 36,354,696.10 10.09

5.6 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

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期内未持有权证投资。

5.9 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股指期货投资明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金的国债期货投资情况说明

10.1.1 本基金的国债期货投资情况说明

10.1.2 本基金的国债期货投资决策程序

10.1.3 本基金的国债期货投资对基金资产的影响分析

10.1.4 本基金的国债期货交易对基金投资业绩的影响

10.1.5 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.6 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.7 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.8 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.9 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.10 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.11 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.12 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.13 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.14 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.15 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.16 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.17 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.18 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.19 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.20 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.21 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.22 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.23 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.24 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.25 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.26 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.27 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.28 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.29 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.30 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.31 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.32 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.33 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.34 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.35 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.36 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.37 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.38 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.39 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.40 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.41 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.42 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.43 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.44 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.45 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.46 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.47 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.48 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.49 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.50 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.51 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.52 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.53 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.54 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.55 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.56 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.57 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.58 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.59 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.60 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.61 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.62 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.63 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.64 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.65 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.66 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.67 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.68 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.69 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.70 本基金的国债期货投资对基金净值的影响

10.1.71 本基金的国债期货投资对基金资产的影响

10.1.72 本基金的国债期货投资对基金投资业绩的影响

10.1.73 本基金的国债期货投资内部控制制度

10.1.74 本基金的国债期货投资对基金净值的影响