

国投瑞银双债增利债券型证券投资基金

[2015] 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2016年01月20日

§ 1 重要提示

基金管理人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：中国建设银行股份有限公司，于2016年01月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等内容，保证复核结果与基金管理人计算的数据一致。

基金销售机构：基金管理人和代销机构，但不包括基金管理人直销中心。

基金销售机构不以其自身名义，投资风险和收益由投资者自负，投资者应仔细阅读基金的招募说明书、本报告中的申购赎回费用表。

报告送出日期：2016年01月20日

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2016年，国家继续推进经济结构调整，货币政策维持宽松平稳，财政政策将成为平稳经济的主要引擎。预计2016年资金供应量相比去年大幅增加，同时资金价格宽松幅度可能不及市场预期，债券方面预计基金可能维持持较稳的组合久期，严控信用风险。同时，随着转债供给的增加以及股市的大幅回调，2016年基金将更加注重转债市场投资机会的把握。

§ 5 投资组合报告

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	股权投资	-	-
2	其中：股票	-	-
3	固定收益投资	640,196,362.33	64.93%
4	其中：债券	640,196,362.33	64.93%
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他	-	-
9	合计	998,992,159.87	100.00%

注：本基金报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

5.2 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

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：2016年01月20日

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2015年10月01日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	国投瑞银双债债券A	国投瑞银双债债券C
2.期初现金差额	8,340,293.90	2,394,392.18
3.报告期利润	7,021,407.25	1,073,191.16
4.期末现金及现金等价物余额	10,020.07	6,006.04
5.期末基金份额总额	332,627,689.36	646,537,298.09
6.期末基金份额净值	1.066	1.067
7.报告期末下属分级基金的份额总额	161,216	161,221
8.报告期末下属分级基金的份额净值	315,068,669.45	606,016,871.36

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要低于所列示数据。

3.2.1 基金净值表现

3.2.2 本报告期基金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	净值增长率为基准的收益率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去三个月	2.01%	2.98%	0.67%	-0.84%
过去六个月	-	-	-	-

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	150416	15农发16	900,000	90,207,000.00	9.22
2	150201	15附息国债101	600,000	61,488,000.00	6.29
3	150210	15附息国债101	500,000	54,180,000.00	5.64
4	150419	15农发19	600,000	60,096,000.00	6.12
5	150102	11农发行2	600,000	56,015,000.00	5.11

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

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	300595	300595	300,000,000.00	31.28	-
2	410200	企业债	166,950,273.00	16.04	-
3	401200	企业债	40,126,000.00	4.10	-
4	401200	企业债	20,790,000.00	2.13	-
5	401200	企业债	11,433,089.23	1.19	-
6	401200	企业债	10,000,000.00	1.00	-
7	401200	企业债	6,000,000.00	0.60	-
8	401200	企业债	5,000,000.00	0.50	-
9	401200	企业债	4,000,000.00	0.40	-
10	401200	企业债	4,000,000.00	0.40	-

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

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	150419	15农发16	900,000	90,207,000.00	9.22
2	150201	15附息国债101	600,000	61,488,000.00	6.29
3	150210	15附息国债101	500,000	54,180,000.00	5.64
4	150419	15农发19	600,000	60,096,000.00	6.12
5	150102	11农发行2	600,000	56,015,000.00	5.11

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重股投资明细

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	000001	平安银行	1,000,000	1,000,000.00	1.00
2	000002	招商银行	1,000,000	1,000,000.00	1.00
3	000003	中国银行	1,000,000	1,000,000.00	1.00
4	000004	农业银行	1,000,000	1,000,000.00	1.00
5	000005	工商银行	1,000,000	1,000,000.00	1.00

5.9 报告期内基金的证券投资情况说明

5.10 报告期内基金的国债回购交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.13 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.14 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.15 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.16 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.17 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.18 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.19 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.20 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.21 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.22 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.23 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.24 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.25 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.26 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.27 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.28 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.29 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.30 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.31 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.32 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.33 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.34 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.35 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.36 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.37 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.38 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明

5.39 公司管理人对本基金进行持续监督并定期评估的说明