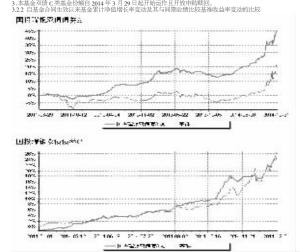
国投瑞银双债增利债券型证券投资基金

| 个别及连带责任。 基金托管人中国建设银行股份有限。 合报告等内容、保证复核内容不存在虚假 基金管理人承诺以诚实信用、勒勉尽 | 责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金- N。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔 | 夏核了本报告中的财务指标、净值表现和投资约 - 定盈利。 | | |
|--|---|---|--|--|
| | § 2 基金产品概况 | | | |
| 基金简称 | 国投瑞银双债债券 | | | |
| 基金主代码 | 161216 | | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | | |
| 基金合同生效日 | 2011年 03 月 29 日 | | | |
| 报告期末基金份额总额 | 281,455,544.30 份 | | | |
| 投资目标 | 得高于业绩比较基准的投资收益。 | 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。 | | |
| 投资策略 | 本基金采取稳健灵活的投资策略,主要 主动管理,力求在有效控制风险的基础 场的趋势研现处新股申购收益率预测, 力求提高基金总体收益率。 | 通过对可转债、信用债等固定收益类金融工具 上,获得基金资产的稳定增值;并根据对股票市 适度参与一级市场首发新股和增发新股的申顺 | | |
| 业绩比较基准 | 中信标普可转债指数收益率×45%+中债数收益率×10% | 企业债总全价指数收益率×45%+中债国债总 | | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属证券投资基金 场基金,低于混合型基金和股票型基金 | 中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币。 | | |
| 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 场内简称 双债 A | ") 国投瑞银双债债券 C | | |
| 下属两级基金的交易代码 | 161216 | 161221 | | |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 222 554 220 57 // | 233 554 330 57 (f) 47 901 213 73 (f) | | |

| 国投瑞银双债债券 A | 国投瑞银双债债券 C |
|---|---|
| 30,411,388.30 | 5,972,226.27 |
| 38,273,473.75 | 5,793,455.00 |
| 0.1444 | 0.1299 |
| 272,570,745.65 | 56,687,487.82 |
| 1.167 | 1.183 |
| 收益、其他收入(不含公允价值变效。 。 易基金的各项费用(例如基金申购) 起开始运作且开放申购赎回。 | |
| | 38,273,473.75 0.1444 272,570,745.65 1.167 收益、其他收入(怀含公允价值变对 。 易基金的各项费用《例如基金申购》 |

| 3.2.1 本报告期基金份额净值 国投瑞银双债债券 A | 增长率及其与同 | 司期业绩比较基 | 准收益率的比 | 较 | | |
|--|----------------------|--------------------|----------------|-----------------------|-----------|----------|
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标 准差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-3 | 2-4 |
| 过去三个月 | 14.49% | 0.60% | 18.13% | 0.89% | -3.64% | -0.29% |
| 国投瑞银双债债券 C | | | | | | |
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标 准差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | 2-4 |
| 过去三个月 | 14.35% | 0.60% | 18.13% | 0.89% | -3.78% | -0.29% |
| 注:1、本基金以可转债、信用信总全价指数和中债国债总指数为基收益率x45%+中债国债总指数收益 致性。 | s础构建业绩比 译×10%,主要: | 较基准,具体为 是鉴于上述指数 | 中信标普可转 | 债指数收益率; | (45%+中债企业 | k.债总全价指数 |



| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈翔凯 | 本基金基金经理、固定收益部总监 | 2012年09月15日 | | 17 | 中国籍。硕士,具有基金从业资格。 曾任职于平安保险资产管理公司。 安树产保险股份有限公司。2008 年 5 月加入国投瑞银。先后任职于基 投资部、专户投资部。现任国投瑞 货币市场基金。国投瑞银取储增利债券基 金、国投瑞银币高等数债券基金、医 技瑞银制资币市场基金基金经理 |
| 刘莎莎 | 本基金基金经理 | 2014年 09 月 02 日 | | 6 | 中国籍,硕士,具有基金从业资格。 曾任职中诚信证券评估公司分析师 即光保险资产管理中心信用研究员 泰康资产管理有限公司信用研究员 2013年7月加入国投瑞银。现任国 投瑞银双债增利基金和国投瑞银岁 增利基金基金经理。 |

的相关规定。 经期内本基金管理处理;信情记说明 与期内、本基金管理人遵守,征券法)、征券投资基金法》及其系列法规和包投增银双值增利债券型证券投资基金 影片有关规定。本部督守遗信,推修勤勉。忠实尽职的原则。为基金的拥持有人的利益管理和运用基金资产。在报告 的投资之本。 近

2014 第四季度 报告 2014年 12月 31日

| 3.1 | 报告期末基金资产组合情况 | | 金額单位:人民币5 |
|-----|-------------------|----------------|----------------|
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 %) |
| 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 |
| | 资产支持证券 | - | |
| 4 | 贵金属投资 | - | |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买人返售金融资产 | - | |
| | 其中:买断式回购的买人返售金融资产 | - | |
| 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 | 合计 | 579,660,326.12 | 100.00 |
| 5.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合 | | 金額单位:人民币元 |
| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 66.) |
| A | 农、林、牧、渔业 | _ | - |
| В | 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 |
| Е | 建筑业 | - | |
| F | 批发和零售业 | _ | |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | _ | |
| Н | 住宿和餐饮业 | _ | |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | _ | - |
| J | 金融业 | _ | |
| K | 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 | _ | _ |
| | | + | |
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | | |

| | | | | | 並除十世:/年代117 |
|-------|----------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(段) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 %) |
| 1 | 600795 | 国电电力 | 3,432,598 | 15,892,92 | 8.74 4.83 |
| 5.4 1 | 设告期末按债券 | 品种分类的债券投资 | 6组合 | | 金额单位:人民币5 |
| 序号 | | 债券品种 | | 公允价值 | 占基金资产净值比例 66) |
| 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 | 抽借 | | 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 |

| 8 | 具他 | | | | - | | - |
|-------|-----------------|-------------|---------|------|----------------|-------|--------------|
| 9 | | 合计 | | | 532,007,441.20 | | 161.58 |
| 5.5 ‡ | 设告期末按公 分 | 心价值占基金资产净值比 | 例大小排序的前 | 五名信 | 责券投资明细 | | 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黔铁投 | 398 | ,980 | 42,555,20 | 06.80 | 12.92 |
| 2 | 1180087 | 11彬煤债 | 400 | ,000 | 40,108,00 | 00.00 | 12.18 |
| 3 | 124742 | 14贵水 02 | 300 | ,000 | 32,400,00 | 00.00 | 9.84 |
| 4 | 124686 | 14昌平债 | 300 | ,000 | 31,608,00 | 00.00 | 9.60 |
| 5 | 124313 | 13苏家屯 | 261 | ,010 | 26,623,02 | 00.00 | 8.09 |
| | | c价值占基金资产净值比 | 例大小排名的前 | 十名第 | 资产支持证券投资明细 | | |

※ 5mm、Kricx 2、10/11111、自急愈深下的值比例大小排名的前十名资产支持证券投金。准备、期末并有资产支持证券投资,指导其收公允价值占基金资产的值比例大小排序的前五名贯金属投资明细金。在提出其未持有贵金融资、经费用未收公允价值占基金资产单值比例大小排序的前五名权证投资明细金之种战事期末,持有我直接。 经期末本基金投资的股份期货交易情况说明上基金合同规定、准备金不参与股指期货交易。 设备资本准备收货的国货销货交易请收记说明上基金合同规定、准备金不参与国债期货交易请议说明上基金合同规定、准备金不参与国债期货交易。 投资组合报告解注:

5.11.1 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的,在报告编制日前一年内未受到公开谴责

| 1 | 1ナロ(水IIC並 | 31,985.47 |
|--------|------------------------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 1,018,026.24 |
| 3 | 应收股利 | = |
| 4 | 应收利息 | 14,994,475.93 |
| 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 |
| 5.11.4 | 4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 | 金額单位:人民币元 |
| | | |

| 1 | 110020 | 南山转债 | 24,523,892.60 | 7.45 |
|-------|-----------------------------|---|--|------------------------------|
| 2 | 110018 | 国电转债 | 14,956,182.50 | 4.54 |
| 3 | 113001 | 中行转债 | 10,081,264.20 | 3.06 |
| 5.11. | 金本报告期末 6 投资组合报 金本期未投资 | 前十名股票不存在流通受 告附注的其他文字描述部 托管行股票、未投资控股股 相关法规或本基金管理公 | 分 股东主承销的证券,未从二级市 三的规定。 多6 开放式基金份额变动 | 市场主动投资分离交易可转债附送的权证,技 单位:化 |
| | | | 国投瑞银双偿债券 4 | 国投瑞银双债债券で |

| | | 单位:(|
|--|--------------------|--|
| | 国投瑞银双债债券 A | 国投瑞银双债债券 C |
| 报告期期初基金份额总额 | 275,447,722.84 | 24,888,956.91 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 48,470,034.87 | 66,911,067.42 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 90,363,427.14 | 43,898,810.60 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(分额减少以""填列) | - | = |
| 报告期期末基金份额总额 | 233,554,330.57 | 47,901,213.73 |
| 注:1、本基金包括 A、C 两类份额。募集期仪 川证券交易所上市交易;封闭期结束后转为上市升 2、本基金双债 C 类基金份额自 2014 年 3 月 2 | 于放式基金 (OF):封闭期结束转为 | 在基金合同生效后3年内封闭运作,在汽 开放式后,本基金包括A、C两类份额。 |

2.本基金双债 《基金份衡目 2014年3月29日起开始运作日开始申除赎回。
2.本基金双债 《基金份衡目 2014年3月29日起开始产价。
报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金价的。
8. 第46投资者基金情况
报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更进行公告,指定媒体公告时间为 2014年12月27日。
2. 报告期内基金管理人对本基金分红进行公告,指定媒体公告时间分别为 2014年12月10日、2014年11月11日及
2014年10月17日。
3. 本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务都总经理助理职务。本基金托管人2014年11月3日发布公告,聘任赵乘甫为中国建设银行投资托管业务都总经理。
9.1 备查文件目录

9.1 备查文件目录

2.014年 II 月 03 日发布公告,则让总观用为中国建设银行设置任富业务部总总理。

9 备查文件目录

6 干核在阻设部银双价增利债券型证券投资基金募集的批复》证监许可[2011]127 号)

6 干核在阻设部银双价增利债券型证券投资基金资本的批复》证监许高度2011]87 号)

6 计记载级双价增利债券型证券投资基金资本的。

6 记货程权利用等时间要证券投资金资金资金。

6 记货程权利用等时间要证券投资金资金。

6 记货程权利用等时间要证券投资金资金。

6 记货程权人业务核批件

本报告期与在中国证金会销售企具数据设计上推露的信息之份能文

12 在规程。

12 在规程。

中国下条管深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

存货预计。旧外www.lassdic.com

3 查询日式。

20 有效性。

20 有效性。

10 有效性。

20 有效性,

20 有效性,

20 有效性。

20 有效性,

2

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金

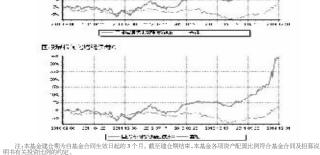
2014 第四季度 报告

2014年 12月 31日

| 报告送出日期:2015年01月21日 | | § 1 重要提示 | | |
|---|---|---|--|--|
| 基金管理人的董事会及董事保证本报告所 个别及连带责任。 基金托管人中国建设银行股份有限公 合报告等内容,保证复核内容不存在虚假证 | 司根据本基金合 | 股记载、误导性陈述或重大遗 司规定,于2015年1月19日: | | |
| 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽引 基金的过往业绩并不代表其未来现 本报告中财务资料未经审计。 本报告即 2014年10月1日起至12月 | 的原则管理和运 。投资有风险,投 | 用基金资产,但不保证基金- | 一定盈利。 细阅读本 | 態金的招募说明书。 |
| 7-18-13/12014 T 10/11 HRGE 12/1 | | 2 基金产品概况 | | |
| 基金简称 | 国投瑞银(| 尤化增强债券 | | |
| 基金主代码 | 121012 | | | |
| 交易代码 | 121012 | | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放 | 枚式 | | |
| 基金合同生效日 | 2010年 09 | 月08日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 366,018,31 | 5.82 份 | | |
| 投资目标 | | 在追求基金资产稳定增值、有效控制风险和保持资金流动性的基础上,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。 | | |
| 投资策略 | 票、权证及 本基: 含分离交 品种。 本基: 证等权基: 的比例不 | 法律、法规或中国证监会允许 金主要投资于国情、金融债,少 易可转债)、短期融资券、资产 条既可以参与一级市场新股目 类资产。 金数债券类资产的投资比例不 | 下基金投资 "专持证券 "支持证券 中购或增发 下低于基金 证投资的i | 企业债、公司债、次级债、可转换债券 、债券回购、银行存款等固定收益证券 新股,也可以在二级市场买人股票、权 资产的 80%:股票、权证等权益类资产 七例不超过基金资产净值的 3%:持有 |
| 业绩比较基准 | 中债总指 | 效收益率×90%+沪深 300 指数 | (收益率×1 | 0% |
| 风险收益特征 | | 贵券型基金,属证券投资基金 ,于混合型基金和股票型基金 | | 风险品种,风险与预期收益高于货币市 |
| 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 | 国投瑞银信 | 尤化增强债券 A/B | 国投 | 瑞银优化增强债券 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 121012 前 | 端)/128012 (后端) | 1281 | 12 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 300,329,11 | 5.39 份 | 65,61 | 89,200.43 份 |
| 3.1 主要财务指标 | §3 主要 | 财务指标和基金净值表现 | 1 | 单位:人民币元 |
| showing Life 11- ton | | 报告期 2014年 | 手10月01 | 日-2014年12月31日) |
| 主要财务指标 | | 国投瑞银优化增强债券 | A/B | 国投瑞银优化增强债券C |
| | | | 15.802.788.95 | |

| | | 半世:八尺川儿 | | | |
|---|------------------------------|-----------------|--|--|--|
| 主要财务指标 | 报告期 2014年10月01日-2014年12月31日) | | | | |
| 土安则为佰怀 | 国投瑞银优化增强债券 A/B | 国投瑞银优化增强债券 C | | | |
| 本期已实现收益 | 57,051,732.85 | 15,802,788.95 | | | |
| 本期利润 | 58,084,168.50 | 12,410,720.89 | | | |
| 加权平均基金份額本期利润 | 0.1744 | 0.1893 | | | |
| 期末基金资产净值 | 396,686,386.76 | 86,860,762.77 | | | |
| 期末基金份额净值 | 1.321 | 1.322 | | | |
| 注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益 | | 女益 扣除相关费用后的余额,本 | | | |

| 阶段 | 净值增长率① | 准差② | 收益率3 | 收益率标准差 ④ | ①-③ | 2-4 |
|---|---|---|-----------------------------|--|---|---------|
| 过去三个月 | 15.27% | 0.67% | 6.09% | 0.26% | 9.18% | 0.41% |
| 国投瑞银优化增强债券 C | | | | | | , |
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标 准差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | 2-4 |
| 过去三个月 | 15.06% | 0.68% | 6.09% | 0.26% | 8.97% | 0.42% |
| 注:1、本基金以中倾息指数收至 结算有限量好公司编制的中国债务 收益类证券,具有广泛的市场代表性 数是由中证指数公司开发的中国 A 为中国 A 股市场中代表性强,流动 票投资业绩比较基准。 2.本基金对业绩比较基准采用 3.2.2 自基金合同生效以来基 | 指数。该指数 生,能够反映债 股市场统一指 性高的主流投 每日再平衡的 | 同时覆盖了上; 券市场总体走! 数,它的样本选 资股票,能够反 计算方法。 | 势,适合作为本 泊沪深两个证 映A股市场总 | 银行间以及银 基金的债券投 券市场,覆盖了 体发展趋势,具 | 厅柜台债券市场 资业绩比较基础 大部分流通市 有权威性,适合 | 值,其成份股票 |



| ., | 4.1 基金約 | と理 (成基金经理小約 | | 4 管理人报告 | | |
|----|---------|-------------|-------------|---------|--------|---|
| Г | 姓名 | 职务 | 任本基金的基 | 6金经理期限 | 证券从业年限 | 说明 |
| Г | | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | 李怡文 | 本基金基金经理 | 2010年09月08日 | | 13 | 中国籍、硕士、具有基金从业资格。 管任 Foley Rev Insestment Company 分析师、中国 建设设计 6等港 资产组合经理。 2008年6月加入国股瑞银、现任国投 瑞银烷化均强债券基金、国投瑞银链 海洋条准合金金、国政瑞银统商基 金、国及瑞银新币品混合基金和国投 瑞银发增和基金金金、国 |

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | | 项目 | | | 金額 | Ŀ | i基金总资产的比例 (%) |
|--------|---|---------------------------|-----------------|----------|----------------|---|---------------|
| 1 | 权益投资 | | | | 63,354,499.90 | | 10.31 |
| | 其中:股票 | | | | 63,354,499.90 | | 10.31 |
| 2 | 基金投资 | | | | _ | | _ |
| 3 | 固定收益投资 | | | | 489,004,357.07 | | 79.61 |
| | 其中:债券 | | | | 489,004,357.07 | | 79.61 |
| | 资产支持证券 | | | | _ | | _ |
| 4 | 贵金属投资 | | | | _ | | _ |
| 5 | 金融衍生品投资 | \$ | | | | | |
| 6 | 买人返售金融资 | | | | 6,000,000,00 | | 0.98 |
| 0 | - 0 - 2 - 3 - 3 - 3 - 3 - 3 - 3 - 3 - 3 - 3 | 。 购的买人返售金融资产 | e e | | 0,000,000.00 | | 0.98 |
| 7 | 银行存款和结節 | | | | 40.174.764.80 | | 6.54 |
| | 银行仔紙和绍昇 其他资产 | MEN 至日17 | | | -, , , , , | | |
| 8 | 共他與广 | 4.11 | | | 15,693,770.23 | | 2.56 |
| 9 | 771-WII-11-1276CZ.II | 合计 /分类的股票投资组 | | | 614,227,392.00 | | 100.00 |
| 5.2 1 | 区古州本1911出 | 2万矢的収录1又页组 | | | | | 金额单位:人民币元 |
| 代码 | | 行业类别 | | | 公允价值 | Ľ | i基金资产净值比例 %) |
| A | 农、林、牧、渔业 | | | | 25,850.00 | | 0.01 |
| B C | 采矿业 制造业 | | | | 49.627.291.10 | | 10.26 |
| D | | 及水生产和供应业 | | | 49,027,291.10 | | 10.20 |
| E | 建筑业 | (00-24-10) 1-10 Old 11-10 | | | _ | | _ |
| F | 批发和零售业 | | | | = | | - |
| G | 交通运输、仓储和 | 加邮政业 | | | - | | - |
| H I | 住宿和餐饮业 | 和信息技术服务业 | | | 3,609,240.00 | | 0.75 |
| J | 金融业 | NIESSIX/NIRSTIE | | | 5,009,240.00 | | 0.73 |
| K | 房地产业 | | | | - | | - |
| L | 租赁和商务服务 | | | | 10,031,158.80 | | 2.07 |
| M | 科学研究和技术 | | | | - | | - |
| N | 水利、环境和公共 | | | | - | | - |
| 0 | 居民服务、修理和 | | | | - | | - |
| P | | 教育 | | | - | | - |
| Q | | 卫生和社会工作 | | | - | | |
| R | | 文化、体育和娱乐业 | | | - | | - |
| S | | 综合 | | | - | | |
| 5 2 t | 日生間士扱ハム | 合计 公价值占基金资产净 | 信下侧于 小型: | どが1前十-ペ | 63,354,499.9 | | 13.09 |
| 3.3 1 | x = #1.7~19:2071 | JUI 国口盔亚贝厂伊 | IEL-UPIX/IME | LEABOL X | 10人7万1又贝约700 | | 金额单位:人民币元 |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 € | ł) | 公允价值 | | 占基金资产净值比例 66) |
| | | 2年4年人4日 | | | | | |

| , | 002730 | | | 0,000 | | | 0.01 |
|--------|-----------------|-----------|--------|---------------|----------------|-------|----------------|
| 10 | 601226 | 华电重工 | | 2,000 | 37,1 | 20.00 | 0.01 |
| 5.4 ‡ | 设告期末按债券 | 品种分类的债券投资 | 组合 | | | | 金额单位:人民币元 |
| 污 | | 债券品种 | | | 公允价值 | Ŀ | i基金资产净值比例 66) |
| 1 | 国家债券 | | | - | | | - |
| 2 | 央行票据 | | | | - | | - |
| 3 | 金融债券 | | | | 30,021,000.00 | | 6.21 |
| | 其中:政策性金融 | 独债 | | | 30,021,000.00 | | 6.21 |
| 4 | 企业债券 | | | | 255,662,199.10 | | 52.87 |
| 5 | 企业短期融资券 | | | | 120,074,000.00 | | 24.83 |
| 6 | 中期票据 | | | 52,212,000.00 | | | 10.80 |
| 7 | 可转债 | | | | 31,035,157.97 | | 6.42 |
| 8 | 其他 | | | | - | 1 | - |
| 9 | | 合计 | | | 489,004,357.07 | | 101.13 |
| 5.5 fl | 设告期末按公 允 | 价值占基金资产净值 | 北例大小排門 | 予的前五名 | :债券投资明细 | | 金额单位:人民币元 |
| 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 66) |

10,031,158.8

| 9 | | 合计 | | 489,004,357.07 | 101.13 |
|-------|-----------|--|-----------|----------------|---------------|
| 5.5 f | 设告期末按公允 | 2价值占基金资产净值比例 | 列大小排序的前五名 | 4.债券投资明细 | 金额单位:人民币: |
| 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 66) |
| 1 | 101451002 | 14兴发 MTN001 | 300,000 | 31,701,000.00 | 6.56 |
| 2 | 1280313 | 12农房债 | 300,000 | 30,315,000.00 | 6.27 |
| 3 | 122165 | 12国电 03 | 252,200 | 25,144,340.00 | 5.20 |
| 4 | 1480337 | 14龙泉国投债 | 200,000 | 20,744,000.00 | 4.29 |
| 5 | 011474007 | 14 映煤化 SCP007 | 200,000 | 20,060,000.00 | 4.15 |
| 本基 | 金本报告期末元 | 2价值占基金资产净值比例 卡持有资产支持证券。 >价值占其金资产净值比例 | | | |

5.4 报告明末收益分别而且治验鉴费产价和且10%入内银产内则且上点取率确以更快多 基础企业批准则末收益价值品基金资产净值化例大小排序的前五名权证投资明细 基础企业批准则未不得看处证 9.4 报告则未不是成功就是相联及多局能已证明 19.4 报告则未未是成功就是相联交易情况已证明 19.4 报告则未未是成功就是相联交易情况已证明

000538

| 1 | 存出保证金 | | | | | | | 164,430.11 |
|--------|----------|-----|-----------|-------|--------------|--------------|-------------------|----------------|
| 2 | 应收证券清算制 | į. | | | | 4,628,276.45 | | |
| 3 | 应收股利 | | | | | | | - |
| 4 | 应收利息 | | | | | | | 10,516,551.43 |
| 5 | 应收申购款 | | | | 384,512.24 | | | |
| 6 | 其他应收款 | | | | = | | | |
| 7 | 待摊费用 | | | | = | | | |
| 8 | 其他 | | | | | | | - |
| 9 | | | 合计 | | | | | 15,693,770.23 |
| 5.11.4 | 4 报告期末持有 | 写的处 | 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 66) |
| 1 | 110015 | 石化 | 持债 | | 14,440,48 | 37.60 | | 2.99 |
| 2 | 125089 | 深机 | 传债 | | 3,912,08 | 35.45 | | |
| 3 | 110023 | 民生 | 传债 | | 3,871,56 | 50.00 | | 0.80 |
| 4 | 113001 | 中行 | 持债 | | 3,466,90 | 02.60 | 0 | |
| 5 | 110022 | 同仁 | 传债 | | 3,138,93 | 36.80 | 0.0 | |
| 6 | 110020 | 南山 | 传债 | | 6,98 | 30.50 | | 0.00 |
| 5.11.5 | 5 报告期末前 | 一名股 | :票中存在流通受限 | 情况的说明 | 1 | | | |
| 序号 | 股票 代码 | | 股票名称 | | 是限部分的 允价值 | | 占基金资产净值 比例 66) | 流通受限情况 说明 |
| 1 | 600497 | | 宣涌来由 | | 4 600 220 00 | | 0.07 | ##-H-##TREORES |

| 表主承销的证券,未从二级市场主动司的规定。 | 投资分离交易可转债附送的权 |
|-----------------------|--|
| 86 升放式基金份额受动 | 单 |
| 国投瑞银优化增强债券 A/B | 国投瑞银优化增强债券 C |
| 329,097,884.02 | 57,591, |
| 165,364,124.94 | 100,732, |
| 194,132,893.57 | 92,635, |
| - | |
| 300,329,115.39 | 65,689,2 |
| | /东主承省的证券,未从二级市场主动 市的规定。 6 开放式基金份额变动 国投端银优化增强债券 A/B 329/97.884.02 165.364.124.94 194.132.893.57 |

\$7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。 1. 报告期内基金管报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更进行公告,指定媒体公告时间为 2014 年 12 月 27 日。 2. 本基金托管人 2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金 托管人 2014年11月03日安布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。 89 **备查欠相录**

9.3 宣岡万八 投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件 咨询电话;400-880-6868

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司

基金管理人的董事会及董事保证本报告所教资料不存在虚拟记载,误判性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担 作别及连带程仁。 基金作名人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报 告省内容、保证复权内容不存在虚拟虚拟。误导性陈述或重大遗漏。 基金管组入来还以滤实信用、验验是对的眼的管理应用基金管产。但不保证基金一定盈利。 基金管组之证或料不代表其未来表现。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积察说明书。 本报告申财务资料未经制计。 本报告申财务资料未经制计。 本报告明的资料未经制计。 § 2 基金产品概况 设告期末基金份额总额 本基金采取中且上而下的债券分析方法。确定债券税即组合,并管理组合风险。 本基金采下均减收益单曲线设行基本价值评估,计算不可资产类别,不同剩余期限 债券品价的调整回租,并对强则超励间提出行货件,得到投资评级、在此基础上, 实出内观收益单低下均减收益单价债券。又内海収益单高下场减收益率价券。 债券投资资格工业包括公、到额级、收益单据域额、类别运养解析工,参选择策 略。在不同的时期,不可以上推路付进合效益和风险的贡献不定相同,具体采用的种策 都以决于债券租份之价的风险强度。 风险收益特征

| | | 单位:人民币: | | | | |
|----------------|-----------------|------------------------------|--|--|--|--|
| 主要财务指标 | 报告期 2014年10月01日 | 报告期 2014年10月01日-2014年12月31日) | | | | |
| 主定利为自由外 | 国投瑞银纯债债券 A | 国投瑞银纯债债券 B | | | | |
| 1.本期已实现收益 | 618,018.45 | 10,200,474.62 | | | | |
| 2.本期利润 | 765,637.56 | 5,190,832.41 | | | | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0305 | 0.0151 | | | | |
| 4.期末基金资产净值 | 12,223,534.82 | 197,182,696.35 | | | | |
| 5.期末基金份額爭值 | 1.057 | 1.061 | | | | |

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),计人费用后

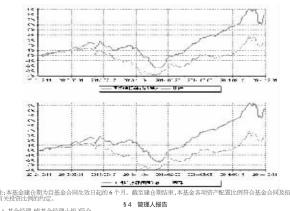
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 净值增长率标 准差② 业绩比较基准 收益率(3) 收益率标准差 净值增长率① 0.11% 业绩比较基准 收益率③ ④ 争值增长率标 准差② 1)-3) 2-4

金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。 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 自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

国投瑞银纯债债券型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31日



| | 比例的约定。 E理 (成基金经理小组 | §4 1)简介 | 4 管理人报告 | | |
|-----|-----------------------|-----------------|---------|--------|---|
| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金 | 金经理期限 | 证券从业年限 | 说明 |
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李怡文 | 本基金基金经理 | 2012年12月11日 | | 13 | 中国籍。硕士、具有基金从业资格。 曾任 Floky Rey Investment Company 分析师、中 建设银行 德港 游产组合经理。 2008年6月加入国投瑞银、现任国标 编银序化增强债券基金。国投瑞银职 海联本混合基金。国投瑞银矿 海银产编银新机遇混合基金和国挤 编银发增和基金基金经理。 |
| 刘兴旺 | 本基金基金经理 | 2013年 05 月 11 日 | | 9 | 中国籍,硕士,具有基金从业资格。 曾任职申银万国证券、华宝兴业基 金、泰信基金。2012年11月加入国 投瑞银。现任国投瑞银统价债券基金和 投瑞银少添利一年期定期开放债券 基金基金经理。 |

| 注:任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格》 |
|---|
| 理办法》的相关规定。 |
| 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明 |
| 在报告期内,本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银纯债债券型证券投资基金基金 |
| 合同》等有关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉,忠实尽职的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内 |
| 基金的投资决策规范,基金运作合法合规,没有损害基金份额持有人利益的行为。 |
| 4.3 公平交易专项说明 |
| 4.3.1 公平交易制度的执行情况 |
| 本报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则 |
| 实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控 |
| 分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公 |
| 交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。 |
| 4.3.2 异常交易行为的专项说明 |
| 本基金于本报告期内不存在异常交易行为。 |
| 基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过 |
| |

| 的可求 出 | 报告期内基金的投资策略和运作分析。 健備市先扬后,整体延续前一个季度的牛市走势使然了具 MLF,市场卡市氛围浓厚,收益率曲线平坦。 市以及股市单边中市等响,大荣资产整路整块组。 (高用尤其缺较而调整幅度较大。 但组推、我们深取积极应对策略、提高组合流动性。在程制内基金的处域表现。 提告明末、本基金 A 类仍额命值为 1057 元. B 类优性关节,2000。 同期业绩基地传来为 1.750 元. B 类优性关节,2000。 同期业绩基地传来为 1.66% 基 报告期以基金特有人数或基金产产价值预整设明 经本租分期股股公司 104% 对 105% 对 105 | 化下移。曲线一度出现倒挂。信用报 现,加之打削股以及年末资金面景 市场调整的冲击以及由此带来的 管理好组合流动性的制度下努力 繁命值为16日,元本报告别 A 条金净值增长率高于业绩基准收益 等有人数量不满二百人或者基金资 短烟整和下行压力,定向政策仍有空 调制概率增长。这会压制国内货店收 就是成品。并可及策划。 | 接同步收窄;12月初受中登 探冲击,利率以及信用做地 短期集中赎回压力使得本基 基础组合收益。 份鄉停值增长率为1,73% B· 率,主要是超配信用值,获得 产净值低于五干万元的情形。 定面,随着外汇占款的趋势性 策集全面放松的空间和哪里。 让上照迟,我以上,一条便 |
|------------------------|---|---|--|
| 5.1 | 报告期末基金资产组合情况 | | AMEMA 107 |
| 序号 | 項目 | 金额 | 金額单位:人民币: 占基金总资产的比例 %。) |
| 1 | 权益投资 | 2001000 | LIMENTAL HOLLDS 46) |
| 1 | 其中:股票 | _ | - |
| | | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 325,468,197.31 | 93.36 |
| | 其中:债券 | 325,468,197.31 | 93.36 |
| | 资产支持证券 | = | - |
| 4 | 贵金属投资 | = | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买人返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买人返售金融资产 | = | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 7,571,215.60 | 2.17 |
| 8 | 其他资产 | 15,573,987.50 | 4.47 |
| 9 | 合计 | 348,613,400.41 | 100.00 |
| 本基 5.3 本基 5.4 | 报告期未按行业分类的股票投资组合 金本报告期未未持有股票投资。 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小非内 金本报告期未未持有股票投资。 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 | | 金額单位:人民币: |
| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 %) |
| 1 | 国家债券 | 3,791,158.00 | 1.81 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 9,999,000.00 | 4.77 |
| | 其中:政策性金融债 | 9,999,000.00 | 4.77 |
| 4 | 企业债券 | 194,562,039.31 | 92.91 |
| | 企业短期融资券 | 60,336,000.00 | 28.81 |
| 5 | 中期票据 | 56,780,000.00 | 27.11 |
| 5 | 中州:宗佑 | | |
| | 可转债 | _ | - |
| 6 | | - | = |

| | 5.5 指 | 8告期末按公允 | 2价值占基金资产净值比例 | | | 金额单位:人民币 |
|---|---|---|-----------------------------|------------------------------------|---------------|---|
| | 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 | 122911 | 10鞍城投 | 392,400 | 39,514,680.00 | 18.87 |
| | 2 | 041469031 | 14鲁西 CP001 | 300,000 | 30,159,000.00 | 14.40 |
| | 3 | 122579 | 09远洋债 | 240,000 | 24,048,000.00 | 11.48 |
| | 4 | 101459029 | 14常熟经营 MTN001 | 200,000 | 20,972,000.00 | 10.01 |
| | 5 | 101462008 | 14绵阳投控 MTN002 | 200,000 | 20,972,000.00 | 10.01 |
| | 5.9 指 根据2 5.10 根据2 5.11 : 5.11.1 5.11.1 5.11.2 | 经告期末本基金 本基金合同规定 报告期末本基本基金合同规定 投资组合报告 本基金投资的 | 的前十名证券的发行主体。 前十名股票均属于基金合 | (交易。 紀说明 (交易。 本期没有被监管部门立》 | | 一年内未受到公开谴责。 |
| 女 | | | ~ | | | 单位:人民币: |
| 攵 | 序号 | 711027 | 名称 | | 金額 | 单位:人民币: |
| 女 | 序号 | 存出保证金 | | | 金額 | 单位:人民币: 9,188.79 |
| 女 | | 存出保证金 | 名称 | | 金額 | , |

| 序号 | 名称 | 金額 |
|--------------------------------|---|-----------------------------------|
| 1 | 存出保证金 | 9,188.79 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,018,990.00 |
| 3 | 应收股利 | = |
| 4 | 应收利息 | 9,410,240.70 |
| 5 | 应收申购款 | 124,318.0 |
| 6 | 其他应收款 | 11,250.00 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 15,573,987.50 |
| 本基金 5.11.5 本基金 5.11.6 | 1 报告期末特有的处于转股期的可转换债券明细 金本报告期末未持有可转换债券 1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 金本报告期末未持有股票投资。 1 投资组合报告附注的其他文字描述部分 金本期末报终并经行股票。 生现除按册别在主面保 | 月 的证券,未从二级市场主动投资分离交易可转储附送的权证 |

本基金本期末投资托官行取示、不及以上的 资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。 §6 开放式基金份额变动

42,158,394.0

存放网址;http://www.ubssdic.com 9.3 查阅方式 投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件