

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年八月二十五日

重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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2011年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2.1 基金基本情况
基金名称:上投摩根双息平衡混合
基金代码:373010
交易代码:373010
基金运作方式:契约型基金
基金合同生效日:2006年4月26日
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额:3,065,007,449.31份
基金合同存续期:不定期

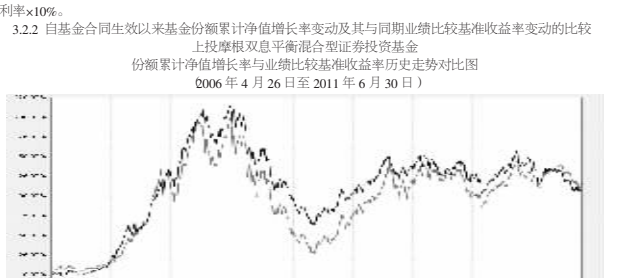
2.2 基金产品说明
投资目标:本基金重点投资高股息、高股息品种,获得稳定的股息与利息收入,同时控制资本利得收益以弥补固定收益,力求为投资者创造稳定回报。
投资策略:本基金兼具红利与平衡基金特色,在借鉴全球资产配置管理理念基础上,通过严格的证券选择,深入挖掘股息与利息的获利机会,并积极运用股指期货配置(SAA)和资产配置(TAA)策略,动态优化投资组合,以实现投资收益,及时调整资产配置比例以保证基金表现持续平衡。
业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:当时中国150红利指数收益率*45%+当时中国国债指数收益率*45%+同业存款利率*10%。

2.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
名称:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人:尹东
客户服务热线:400-889-4888

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标
3.2 基金净值表现
3.2.1 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
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 2 columns: Item, Value. Contains financial data for the period ending 2011.6.30, including revenue, expenses, and net income.

Table with 2 columns: Item, Value. Contains performance metrics for the period ending 2011.6.30, including return on assets and return on equity.



注:1.本基金合同生效日为2006年4月26日,图示时间为2006年4月26日至2011年6月30日。
2.本基金业绩自2006年4月26日至2006年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.2 基金托管人及其管理基金的经验

Table with 4 columns: Name, Position, Tenure, Description. Lists the members of the fund's management and supervision committees.

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2011年上半年持有国债的占比,加上海外地域政治动荡,避险情绪提升,因此压制上半年整体市场的表现。在资金面方面,由于压制通胀,银行信贷额度管控,提升存款准备金及加息等各类措施不断,也在一定程度上抑制了下半年的信贷增速将开始回落。
4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 基金管理人公平交易制度的执行情况

4.4 异常交易行为的专项说明
4.4.1 异常交易行为的专项说明
4.4.2 基金管理人公平交易制度的执行情况

4.5 基金管理人公平交易制度的执行情况
4.5.1 公平交易制度的执行情况
4.5.2 基金管理人公平交易制度的执行情况

4.6 基金管理人公平交易制度的执行情况
4.6.1 公平交易制度的执行情况
4.6.2 基金管理人公平交易制度的执行情况

4.7 基金管理人公平交易制度的执行情况
4.7.1 公平交易制度的执行情况
4.7.2 基金管理人公平交易制度的执行情况

4.8 基金管理人公平交易制度的执行情况
4.8.1 公平交易制度的执行情况
4.8.2 基金管理人公平交易制度的执行情况

上投摩根双息平衡混合型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6.1 资产负债表
单位:人民币元
资产: 120,227,807.35
负债: 168,612,219.61
所有者权益: 1,411,547.30

6.2 利润表
单位:人民币元
营业收入: 509,568.66
营业支出: 509,568.66
利润总额: 0.00
净利润: 0.00

6.3 所有者权益(净资产)变动表
单位:人民币元
期初余额: 1,411,547.30
本期增加: 0.00
期末余额: 1,411,547.30

6.4 关联方关系
6.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关系方发生变化的情况
6.4.2 本报告期与基金发生关联交易的关系方
6.4.2.1 关联方名称
6.4.2.2 关联交易内容

6.4.2.2 关联交易内容
注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.3 关联方为关联方交易而进行的其他交易
6.4.3.1 关联方名称
6.4.3.2 关联交易内容

6.4.3.2 关联交易内容
注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,其计算公式为:
日托管费=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.3.2 关联交易内容
注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,其计算公式为:
日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。
6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.3.2 关联交易内容
注:本基金持有流通受限证券
6.4.3.1 因认购未开放新增证券而期末持有的流通受限证券
6.4.3.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

7 投资组合报告
7.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细
7.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名资产支持证券投资明细
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细

7.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细
序号:1, 股票代码:600585, 股票名称:海螺水泥, 公允价值:193,932,392.57, 占基金资产净值比例:6.72%

7.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细
序号:1, 债券代码:110002, 债券名称:工行转债, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名资产支持证券投资明细
序号:1, 证券代码:110002, 证券名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.18 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
序号:1, 权证代码:110002, 权证名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

注:买入金额"钱"买入股票成本", 卖出金额"钱"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.1 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%). Lists top 20 stocks sold.

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
金额单位:人民币元
买入股票的成本(成交)总额: 3,480,458,771.23
卖出股票的收入(成交)总额: 3,941,108,176.75

注:买入金额"钱"买入股票成本", 卖出金额"钱"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists bond portfolio details.

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
金额单位:人民币元
序号:1, 债券代码:110002, 债券名称:工行转债, 数量:200,000, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注
7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
7.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有存在基金合同规定备选股票库之外的股票。
7.9.3 期末其他各项资产构成

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists other assets.

7.9.4 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:1, 债券代码:110002, 债券名称:工行转债, 公允价值:26,184,239.40, 占基金资产净值比例:0.94%

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。
7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份
持有人户数(户): 4,245,674.73

8.2 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况
本报告期末基金管理人从业人员未持有本基金。
8.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

8.4 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。
10.1 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。
10.3 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.4 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。
10.5 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.6 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。
10.7 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.8 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。
10.9 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.10 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。
10.11 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.12 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.13 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.14 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.15 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.16 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.17 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.18 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.19 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.20 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.21 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.22 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.23 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.24 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.25 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.26 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.27 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.28 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.29 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.30 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.31 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.32 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.33 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.34 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.35 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.36 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.37 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.38 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.39 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.40 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.41 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.42 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.43 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.44 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.45 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.46 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.47 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.48 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.49 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.50 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.51 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.52 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.53 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.54 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.55 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.56 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.57 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.58 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.59 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.60 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.61 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.62 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.63 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.64 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.65 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.66 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.67 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.68 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.69 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.70 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.71 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.72 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.73 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.74 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.75 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.76 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.77 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.78 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.79 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.80 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.81 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.82 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.83 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.84 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.85 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.86 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.87 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.88 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.89 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.90 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.91 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.92 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.93 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.94 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.95 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.96 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.97 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.98 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.99 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.100 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.101 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.102 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.103 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额