

# 上投摩根双息平衡混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

**重要提示:**  
 1. 投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读招募说明书。  
 2. 基金的过往业绩并不预示其未来表现。  
 3. 本招募说明书由基金管理人编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认、接受,并受《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定约束、承担义务。  
 4. 本招募说明书所载内容截止日为2012年10月25日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2012年9月30日。  
 二零一二年十二月

**一、基金管理人**  
 (一)基金管理人概况  
 本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司,基本情况如下:  
 上海浦东富阳路99号国际会议中心  
 办公地址:上海市浦东富阳路99号复且国际大厦20层  
 法定代表人:陈开元  
 成立时间:2004年5月12日  
 实缴资本:贰亿伍仟万元人民币  
 注册资本:肆亿玖仟玖佰玖拾玖万元人民币  
 客服电话:95588  
 网址:www.bankofshanghai.com  
 01 中国工商银行股份有限公司  
 注册地址:北京市西城区复兴门内大街6号光大大厦  
 法定代表人:李庆文  
 电话:010-83631616  
 客服电话:010-83639709  
 客服电话:95595  
 联系人:李庆文  
 网址:www.cibank.com  
 02 中信银行股份有限公司  
 注册地址:北京市朝阳区建国门外大街2号中信大厦A座  
 法定代表人:李庆文  
 电话:010-65551111  
 客服电话:95558  
 03 招商银行股份有限公司  
 注册地址:深圳市福田区深南大道7088号  
 法定代表人:李建强  
 电话:0755-83198888  
 客服电话:95555  
 04 交通银行股份有限公司  
 注册地址:上海市浦东新区银城中路188号交通银行大厦  
 法定代表人:彭纯  
 电话:021-38871234  
 客服电话:95559  
 05 浦发银行股份有限公司  
 注册地址:上海市中山东一路120号  
 法定代表人:孙志坚  
 电话:021-61111111  
 客服电话:95528  
 06 兴业银行股份有限公司  
 注册地址:福建省福州市湖东路154号  
 法定代表人:高建平  
 电话:021-82656077  
 客服电话:95561  
 07 兴业银行股份有限公司  
 注册地址:福建省福州市湖东路154号  
 法定代表人:高建平  
 电话:021-82656077  
 客服电话:95561

**基金合同生效日期: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**

2012年9月30日

序号	分类	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A 农林牧渔	1,965,448.80	0.09
2	B 采掘业	3,727,919.06	0.16
3	C 制造业	991,478,330.95	42.91
4	CO 食品饮料	181,321,214.14	7.85
5	C1 纺织、服装、皮毛	86,506,487.47	3.74
6	C2 化学、制药	1,676,100.01	0.07
7	C3 造纸、印刷	8,628,932.47	0.37
8	C4 石油、化学、塑胶、塑料	43,871,889.65	1.86
9	C5 电子	170,802,805.56	7.39
10	C6 金属、非金属	75,356,582.68	3.26
11	C7 机械、设备、仪表	162,258,781.93	7.02
12	C8 医药、生物制品	257,262,703.74	11.13
13	C99 其他制造业	4,791,267.36	0.21
14	D 电力、煤气、热力、生产和供应业	90,824,034.30	3.93
15	E 建筑业	98,265,966.20	4.25
16	F 交通运输、仓储业	4,019,945.19	0.17
17	G 信息技术业	141,320,829.79	6.12
18	H 批发和零售业	39,316,875.70	1.63
19	I 金融、保险业	125,169,462.95	5.42
10	J 房地产业	125,169,462.95	5.42
11	K 社会服务业	57,338,660.01	2.48
12	L 传播与文化产业	4,431,777.90	0.15
13	M 综合类	-	-
合计		1,680,969,972.22	72.75

3.报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

2012年9月30日

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600186	中国南车	4,160,213	73,801,178.62	3.19
2	603118	中国平安	1,500,584	62,934,492.96	2.72
3	000838	五粮液	1,778,572	60,293,590.80	2.61
4	601633	长城汽车	2,928,083	53,289,294.99	2.22
5	002236	大华股份	1,235,846	58,609,680.00	2.49
6	600795	中国电力	18,600,303	44,646,727.20	1.90
7	601699	潞安环能	12,601,599	39,316,988.88	1.63
8	300088	长信科技	2,655,822	39,306,165.60	1.70
9	600062	长安汽车	1,700,707	38,831,708.81	1.68
10	600518	美利纸业	2,064,777	32,664,777.14	1.41

4.报告期末按券种分类的债券投资组合

2012年9月30日

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1		国债	29,010,000.00	1.26
2		央行票据	144,688,500.00	6.26
3		中期票据	139,646,000.00	6.04
4		企业短期融资券	242,664,958.23	10.51
5		企业中期融资券	29,010,000.00	1.29
6		中期债券	-	-
7		可转债	131,328,744.10	5.68
8		其他	577,854,203.31	25.01
9		合计	-	-

5.报告期末按行业占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

2012年9月30日

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110208	工行转债	40,948,000.00	1.77
2	110015	石化转债	40,866,000.00	1.77
3	120405	12广发债	40,044,000.00	1.73
4	100700	07国债07	37,279,000.00	1.62
5	100580	12国债05	29,010,000.00	1.29

6.基金投资组合支持证券信息披露:本基金投资组合中市值占基金资产净值比例前十大持仓证券明细

2012年9月30日

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110208	工行转债	40,948,000.00	1.77
2	110015	石化转债	40,866,000.00	1.77
3	120405	12广发债	40,044,000.00	1.73
4	100700	07国债07	37,279,000.00	1.62
5	100580	12国债05	29,010,000.00	1.29

7.投资组合报告附注

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、处罚的情形。  
 2.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。  
 3.截至2012年9月30日,本基金的其他资产项目包括:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,665,783.64
2	应收利息	3,214,787.46
3	应收股利	-
4	应收申购款	7,730,495.24
5	其他应收款	110,572.22
6	其他流动资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,034,434.45

截至2012年9月30日,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110002	工行转债	40,866,000.00	1.77
2	110001	石化转债	26,234,200.00	1.14
3	110003	中信转债	21,250,000.00	0.92
4	110004	国投转债	17,852,716.00	0.76
5	110005	国电转债	8,306,600.00	0.36
6	110009	华电转债	4,289,311.00	0.19
7	110007	中钢转债	1,491,981.20	0.06
8	110001	国华转债	18,562.00	0.00

8.截至2012年9月30日,本基金未持有资产支持证券。  
 9.截至2012年9月30日,本基金前十名重仓持仓证券受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	持仓受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	受限原因说明
1	600186	中国南车	73,801,178.62	3.19	部分资产受限

注:本基金截至2012年9月30日持有的因公司重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的重大事项,本招募说明书在公布之日未作充分披露,经交易对手询价,本基金本报告期末其他前十名持仓中不存在在受限情况。  
 7.其他需要说明的重要事项  
 (四)投资组合报告附注  
 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、处罚的情形。  
 2.报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。  
 3.截至2012年9月30日,本基金的其他资产项目包括:

(二)基金管理人主要人员情况  
 1.董事会成员基本情况  
 陈开元先生,董事长  
 本科学历,毕业于上海财经大学,曾任上海市政府副市长,英国伦敦Capgemini & Lehman咨询公司董事,曾任上海市政府对外经济财务处处长,上海国际集团有限公司副总经理,现任上投摩根基金管理有限公司董事长。  
 独立董事:吴晓敏  
 大学本科学历,曾留学于安徽省委马列主义、中共安徽省委党校进修班,中共中央高级党校进修班。  
 曾任中国证监会主席,中国证监会银行行长,九届全国人大财经委员会。  
 现任PBO中国金融稳定发展委员会专家,周道炯先生长期从事证券金融市场监管工作,目前作为高级顾问为证券市场改革提供咨询服务。  
 独立董事:姜波义  
 博士,自1985年起任职于复旦大学,现任复旦大学教授,复旦大学国际金融研究中心主任。  
 独立董事:陈智宇  
 大学本科学历,毕业于上海财经大学,曾任上海财经大学教授,复旦大学国际金融研究中心主任。  
 独立董事:李春生  
 美国加州大学伯克利分校金融学博士,经济统计学学士。  
 曾任台湾大学财务管理学系专任教师,第一证券股份有限公司独立董事,台湾期货交易所董事,台湾证券交易所上市审查委员。  
 董事:Paul Rotman  
 毕业于美国Rutgers大学。  
 曾任Chase Fleming Asset Management Limited全球总裁,摩根资产管理全球投资管理业务CEO。  
 曾任摩根资产管理全球主席,摩根资产管理委员会主席及投资决策委员会成员,同时也是摩根大通高级委员会资深成员。  
 董事:王庆文  
 台湾政治大学工商管理硕士学位。  
 曾任摩根资产管理中国区总经理,摩根资产管理中国区行政总裁。  
 现任香港中汇集团董事,中汇集团有限公司董事,香港证券及期货事务监察委员会投资者产品咨询委员会成员,富时香港交易所台湾系列指数咨询委员会主席。  
 董事:周力  
 获美国亚里桑那大学工商管理硕士学位。  
 曾任毕马威会计师事务所亚洲区管理合伙人,现任摩根大通中国区董事及首席执行官。  
 董事:杨红建  
 复旦大学经济学院学士,中欧工商管理硕士MBA。  
 现任上海浦东发展银行总行副行长。  
 董事:林彬  
 硕士,工商管理硕士学位。  
 现任上海浦东发展银行总行副行长,党委副书记,纪委书记,海证期货有限公司董事长。  
 2.高级管理人员基本情况  
 2.1 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.2 基金经理  
 基金经理:李春生  
 复旦大学经济学院学士,中欧工商管理硕士MBA。  
 现任上海浦东发展银行总行副行长,党委副书记,纪委书记,海证期货有限公司董事长。  
 2.3 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.4 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.5 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.6 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.7 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.8 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.9 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.10 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.11 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.12 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.13 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.14 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.15 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.16 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.17 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.18 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.19 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.20 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.21 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.22 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.23 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.24 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.25 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.26 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.27 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.28 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.29 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.30 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官:姜波义  
 首席行政官:姜波义  
 首席人力资源官:姜波义  
 首席法律官:姜波义  
 首席投资者关系官:姜波义

2.31 基金管理人高级管理人员  
 董事长:陈开元  
 董事:林彬  
 首席财务官:姜波义  
 首席运营官:李春生  
 首席合规官:姜波义  
 首席风险官:姜波义  
 首席信息官:姜波义  
 首席市场官