



上投摩根双债增利债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

重要提示：
1. 基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整；
2. 本招募说明书中基金投资组合比例数据为截止日本基金募集的最终基金资产净值为基础计算的，且投资组合比例数据仅供参考，不作为基金业绩的考核标准，也不表明投资于本基金没有风险；
3. 投资有风险，投资人认购（申购）基金时应认真阅读本招募说明书；
4. 基金的过往业绩并不预示其未来业绩；
5. 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金资产一定盈利，也不保证最低收益；
6. 本招募说明书所载内容截止日为2015年6月10日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2015年3月31日。

二零一五年七月
一、基金管理人
（一）基金管理人概况
名称：上投摩根基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道1628号
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1628号
法定代表人：陈翔
总经理：陈翔
成立日期：2004年5月12日
注册资本：贰亿肆仟万元人民币
股权结构：上投摩根资产管理（英国）有限公司 51%
JPMorgan Asset Management (UK) Limited 49%

上投摩根基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2004]36号文批准，于2004年5月12日成立。基金管理人于2005年8月12日，经中国证监会证监基金字[2005]181号文批准，变更为“上投摩根基金管理有限公司”。该变更事项于2006年4月19日获得中国证监会的批准，并于2006年6月2日在国家工商总局完成注册登记手续。

2009年3月31日，基金管理人由资本金一亿五千万人民币增加到2.5亿元人民币。公司股东出资比例不变，该变更事项于2009年3月31日在国家工商总局完成变更登记手续。

基金管理人无任何处罚记录。
（二）主要人员情况
1. 董事会成员基本情况
陈翔先生，董事长
李南先生，副董事长
先任职于上海市财政局第三分局，共青团上海市财政局委员会、英国伦敦Coopers & Lybrand 咨询公司等，曾任上海市财政局对外经济事务处处长，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。

董事：Paul Bateman
曾任英国巴克莱银行资产管理部全球业务副主管，现任上投摩根资产管理（英国）有限公司全球业务副主管，摩根资产管理全球投资管理业务COO，现任摩根资产管理全球主席、摩根资产管理主席及投资委员会成员，同时也是摩根大通高管委员会成员。

董事：David Flannery
曾任花旗银行全球资产管理部全球业务副主管，现任摩根资产管理全球主席、摩根资产管理主席及投资委员会成员，同时也是摩根大通高管委员会成员。

董事：Jon Lawicki
获美国伊利诺伊大学博士学位及德克萨斯州法学院法学博士学位。
曾任美国P&G Management 公司的全球业务副主管，现任摩根资产管理全球主席、摩根资产管理主席及投资委员会成员，同时也是摩根大通高管委员会成员。

董事：陈东岳
曾任上海浦东发展银行总行风险管理部总经理，现任上海浦东发展银行总行风险管理部总经理，兼任上海浦东发展银行总行风险管理部总经理。

董事：胡皓
曾任上海浦东发展银行总行风险管理部总经理，现任上海浦东发展银行总行风险管理部总经理。

董事：李伟
曾任上海浦东发展银行总行风险管理部总经理，现任上海浦东发展银行总行风险管理部总经理。

董事：李进
曾任上海浦东发展银行总行风险管理部总经理，现任上海浦东发展银行总行风险管理部总经理。

核准文号：中国证监会证监许可[2013]245号

核准日期：[2013年9月25日]

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

核准文号：中国证监会证监许可[2013]245号

核准日期：[2013年9月25日]

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

9. 报告期内被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
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

核准文号：中国证监会证监许可[2013]245号

核准日期：[2013年9月25日]

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

9. 报告期内被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
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,755,445.90 38.67
8 其他 14,330,010.20 --
9 合计 24,281,421.60 107.25

9. 报告期内被公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细
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 132001 14国债08 8,640 1,468,627.20 6.49
2 110023 民生转债 9,070 1,245,038.80 5.50
3 010001 国开1001 11,870 1,215,962.80 5.37
4 121001 12国债07 11,300 1,215,962.80 5.37
5 企业债 14,330,010.20 63.21
6 中期票据 14,330,010.20 --
7 可转债 8,75