

信息披露 disclosure

上投摩根双息平衡混合型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

配,每10份基金份额派发红利0.2650元,合计发放红利93,796,757.92元,符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵守法律法规、中国证监会颁布的基金托管业务管理办法,恪尽职守,履行了基金托管人应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守法、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对基金的资金资产净值计算、基金份额净值计算等方面进行了认真的复核,并对基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关基金投资运作有违反法律法规及基金合同的行为。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:上投摩根双息平衡混合型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产 附注号 期末数 上年度末数

货币资金 6.4.7.1 39,712,812.74 57,912,966.21

应收款项 6.4.7.2 1,428,960.99 12,682,044.77

有价证券 766,668.35 775,292.62

其中:股票投资 6.4.7.2 3,173,782,738.24 3,233,402,660.35

其中:债券投资 2,175,752,884.96 2,134,422,416.06

基金投资 963,729,751.17 908,980,249.29

银行存款 6.4.7.3 53,000,000.00 53,000,000.00

应收利息 6.4.7.5 26,579,947.29 17,272,445.86

应收股利 309,667,143.42 17,616,010.71

递延所得税资产 6.4.7.6 5,474,429.92 5,474,429.92

其他资产 6.4.7.6 3,586,813,150.40 3,488,198,344.12

资产总计 3,586,813,150.40 3,488,198,344.12

负债和所有者权益 附注号 期末数 上年度末数

短期借款 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

交易性金融负债 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

应付利息 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

应付股利 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

其他负债 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

所有者权益 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

其中:实收基金 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

未分配利润 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

所有者权益合计 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

负债和所有者权益总计 6.4.7.3 3,488,198,344.12 3,488,198,344.12

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.9586元,基金份额总额3,508,663,202.58份。

6.2利润表

会计主体:上投摩根双息平衡混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资产 附注号 本期数 上期数

一、收入 13,731,658.32 391,758,716.83

1.利息收入 23,842,798.36 15,781,053.33

其中:存款利息收入 6.4.7.11 51,999.76 431,945.64

债券利息收入 6.4.7.12 2,281,760.32 15,349,107.89

资产支持证券利息收入 6.4.7.13 15,860,803.33 347,360,957.45

其中:股票投资收益 6.4.7.12 152,155,007.78 335,733,259.05

基金投资收益 6.4.7.13 1,408,061.46 1,108,061.46

资产支持证券投资收益 6.4.7.13 1,408,061.46 1,108,061.46

其他业务收入 6.4.7.14 8,795,157.01 12,691,744.53

公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 6.4.7.16 -167,623,068.97 28,552,501.50

4.其他收益(损失以“-”号填列) 6.4.7.17 67,825.69 38,136.75

其中:公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 6.4.7.17 67,825.69 38,136.75

1.管理人报酬 24,875,544.64 19,579,364.44

2.托管费 4,148,925.58 3,263,227.48

3.销售服务费 15,077,427.19 14,768,931.71

5.其他收入 412,605.52 99,533.68

其中:卖出回购金融资产收入 412,605.52 99,533.68

6.其他收入 225,788.26 221,046.56

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) -31,085,643.04 353,929,612.56

减:所得税费用 31,085,643.04 353,929,612.56

净利润(净亏损以“-”号填列) -31,085,643.04 353,929,612.56

归属于基金管理人所有者权益变动(本期增加) -31,085,643.04 -31,085,643.04

一、本期计提折旧费用 19,771,258.63 6,671,206.74 26,442,465.37

二、本期计提减值准备 1,047,713,963.60 -9,052,334.04 1,038,661,627.56

三、本期计提公允价值变动损益 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

四、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

五、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

六、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

七、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

八、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

九、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十一、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十二、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十三、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十四、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十五、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十六、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十七、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十八、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

十九、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十一、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十二、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十三、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十四、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十五、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十六、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十七、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十八、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

二十九、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

三十、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

三十一、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

三十二、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

三十三、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

三十四、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

三十五、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

三十六、本期计提减值准备 1,027,942,704.97 15,732,547.74 -1,012,219,162.23

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方

上投摩根基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司 基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期与上年度可比期间的关联交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.2 关联方交易

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

当期发生的基金应支付的管理费 24,875,544.64 19,579,364.44

其中:支付销售机构的客户维护费 2,497,447.60 2,136,586.73

注:支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值15%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

当期发生的基金应支付的托管费 4,148,925.75 3,263,227.48

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

6.4.8.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日

中国建设银行 39,712,812.74 427,974.58 124,289,267.50 352,604.43

注:本基金的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。

6.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

6.4.8.8 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.9 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.10 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.11 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.12 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.13 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.14 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.15 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.16 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.17 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.18 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.19 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.20 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.21 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.22 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.23 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.24 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.25 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.26 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.27 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.28 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.29 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.30 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.31 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.32 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.33 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.34 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.35 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.36 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.37 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.38 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.39 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.40 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.41 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.42 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.43 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.44 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.45 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.46 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.47 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.48 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.49 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.50 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.51 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.52 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.53 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.54 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.55 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.56 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.57 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.58 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.59 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.60 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.61 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况