

上投摩根双息平衡混合型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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：二〇一五年十月二十六日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人：中国建设银行股份有限公司根据基金合同约定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，对本基金的财务状况、净值表现核对无误。

基金管理人提醒投资者注意以下风险：

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 上投摩根双息平衡混合

基金主代码 523010

交易代码 523010

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2006年10月26日

报告期末基金的份额总额 2,564,039,447.60份

基金份额净值 1.0000元

基金净值增长率 4.47%

基金净值增长率标准差 1.20%

最近七日年化收益率 4.56%

风险收益特征 在保持资产流动性的同时，通过精选股票与债券的配置，力求在控制风险的前提下，为投资者创造稳定的收入。

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

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -85,967,624.69

2.本期利润 -796,165,621.03

3.期初现金差额本期利润 -4,3067

4.期末现金净值 2,462,141,626.28

5.期末基金份额净值 0.9963

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益(例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等)，计入费用后用于计算本期现金流量。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -23.08% 3.32% -4.12% 1.66% -10.36% 1.66%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额净值增长率和业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年4月26日至2015年9月30日)

上投摩根双息平衡混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

注：其他数据是指公司信息。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

孙勇 本基金基金经理、投资二部总监 2011-12-08 - 12年 华东师范大学金融学硕士，2003年7月至2006年10月任华夏银行基金行业研究员，自2006年12月加入上投摩根基金管理有限公司，现任基金经理，担任行业专家，基金经理助理，主管研究工作。自2011年7月起担任上投摩根双息双债基金经理，2012年1月起担任上投摩根双息平衡型证券投资基金基金经理，2013年1月起担任上投摩根双息平衡型证券投资基金基金经理。

4.2 公司治理情况

4.2.1 本报告期内本基金运作遵循《基金法》及其他法律法规的规定，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.2.2 本报告期内基金管理人不存在挪用基金仓位谋取个人利益的情况。

4.2.3 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而被基金份额持有人起诉。

4.2.4 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付报酬。

4.2.5 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.6 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付报酬。

4.2.7 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.8 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付报酬。

4.2.9 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.10 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.11 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.12 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.13 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.14 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.15 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.16 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.17 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.18 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.19 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.20 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.21 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.22 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.23 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.24 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.25 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.26 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.27 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.28 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.29 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.30 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.31 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.32 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.33 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.34 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.35 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.36 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.37 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.38 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.39 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.40 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.41 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.42 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.43 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.44 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.45 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.46 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.47 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.48 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.49 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.50 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.51 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.52 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.53 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.54 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.55 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.56 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.57 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.58 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.59 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.60 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.61 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.62 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.63 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.64 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.65 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.66 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.67 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.68 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.69 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.70 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.71 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.72 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.73 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.74 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.75 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.76 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.77 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.78 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.79 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.80 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.81 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.82 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.83 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.84 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.85 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.86 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.87 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.88 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.89 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.90 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.91 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

4.2.92 本报告期内基金管理人未因基金合同规定而向基金份额持有人支付费用。

<p