

半年度報告 – 2022年6月30日

# 上投摩根雙息平衡 混合型證券投資基金

內地與香港互認基金系列



基金管理人：

香港主銷售商：

**上投摩根**  
基金 管理

**摩根**  
資產 管理

# 上投摩根双息平衡混合型证券投资基金

## 2022年中期报告

2022年6月30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

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

此(等)报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请。

只有基于现时招募说明书及香港说明文件(或同等文件)及最近之财务报告(如有)所作之认购方为有效。

本报告可能包含本基金若干并未获认可在香港发售或分销之股份类别。

投资者应注意，本未经审核半年度报告内若干数据以综合方法表述，因此当中包括并未在香港注册的股份类别之资产。

# 1 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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2022年8月30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。

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资产，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仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本基金乃依据中港基金互认安排已获香港证券及期货事务监察委员会（下称“香港证监会”）之认可在香港公开发售的内地基金。香港证监会认可不等于对该产品作出推介或认许，亦不是对该产品的商业利弊或表现作出保证，更不代表该产品适合所有投资者，或认许该产品适合任何个别投资者或任何类别的投资者。

本报告期自2022年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

|     |                                     |    |
|-----|-------------------------------------|----|
| 1   | 重要提示及目录                             | 1  |
| 1.1 | 重要提示                                | 1  |
| 2   | 基金简介                                | 4  |
| 2.1 | 基金基本情况                              | 4  |
| 2.2 | 基金产品说明                              | 4  |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 | 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 | 其他相关资料                              | 6  |
| 3   | 主要财务指标和基金净值表现                       | 7  |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 | 基金净值表现                              | 8  |
| 4   | 管理人报告                               | 11 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况                        | 11 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 15 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 15 |
| 4.4 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 15 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16 |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16 |
| 4.8 | 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 16 |
| 5   | 托管人报告                               | 17 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 17 |
| 5.3 | 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 17 |
| 6   | 半年度财务会计报告(未经审计)                     | 18 |
| 6.1 | 资产负债表                               | 18 |
| 6.2 | 利润表                                 | 20 |
| 6.3 | 净资产(基金净值)变动表                        | 22 |
| 6.4 | 报表附注                                | 23 |
| 7   | 投资组合报告                              | 44 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况                          | 44 |
| 7.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 45 |
| 7.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 46 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 49 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51 |
| 7.6 | 期末按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      | 51 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 51 |
| 7.8 | 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 51 |
| 7.9 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 51 |

|      |                                    |    |
|------|------------------------------------|----|
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策.....                | 51 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 52 |
| 7.12 | 本报告期投资基金情况.....                    | 52 |
| 7.13 | 投资组合报告附注.....                      | 52 |
| 8    | 基金份额持有人信息.....                     | 53 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 53 |
| 8.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 53 |
| 8.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 53 |
| 9    | 开放式基金份额变动.....                     | 54 |
| 10   | 重大事件揭示.....                        | 55 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议.....                   | 55 |
| 10.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....   | 55 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 55 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变.....                     | 55 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 55 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 55 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 56 |
| 10.8 | 其他重大事件.....                        | 58 |
| 11   | 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 58 |
| 12   | 备查文件目录.....                        | 59 |
| 12.1 | 备查文件目录.....                        | 59 |
| 12.2 | 存放地点.....                          | 59 |
| 12.3 | 查阅方式.....                          | 59 |
| 13   | 补充披露.....                          | 60 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |               |
|-----------------|-------------------|---------------|
| 基金名称            | 上投摩根双息平衡混合型证券投资基金 |               |
| 基金简称            | 上投摩根双息平衡混合        |               |
| 基金主代码           | 373010            |               |
| 交易代码            | 373010            |               |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |               |
| 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      | 1,040,452,395.28份 |               |
| 基金合同存续期         | 不定期               |               |
| 下属分级基金的基金简称     | 上投摩根双息平衡混合 A      | 上投摩根双息平衡混合 H  |
| 下属分级基金的交易代码     | 373010            | 960005        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,039,369,855.16份 | 1,082,540.12份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金重点投资高股息、高债息品种，获得稳定的股息与债息收入，同时把握资本利得机会以争取完全收益，力求为投资者创造绝对回报。   |
| 投资策略 | <p>本基金兼具红利与平衡基金特色，在借鉴JP摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念基础上，充分结合国内资本市场的实际特征，通过严格的证券选择，深入挖掘股息与债息的获利机会，并积极运用战略资产配置(SAA)和战术资产配置(TAA)策略，动态优化投资组合，以实现进可攻、退可守的投资布局。在达到预期投资回报后，本基金适度锁定投资收益，及时调整资产配置比例以保证基金表现持续平稳。</p> <p>1、股票选择策略</p> <p>(1) 红利股预筛选。注意考察公司持续盈利能力和分红能力，特别剔除“超能力现金分红”的公司。</p> <p>(2) 红利股甄别。筛选出现金股息率高、分红稳定、行业布局合理的高品质上市公司，最终形成本基金的备选股票池。</p> <p>(3) 红利股再调整。为构建核心股票池，以增加投资品种的长期稳定效益。</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>2、固定收益类投资策略<br/>为有效控制股票投资风险，优化组合流动性管理，并显著提高投资组合债息收益，本基金将考虑稳健性资产配置，进行债券、货币市场工具等品种的投资，并主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。</p> <p>3、资产配置策略<br/>本基金将以SAA资产配置策略为基准，更侧重运用TAA资产配置策略，积极构建稳健型投资组合。</p> <p>4、其他投资策略：包括存托凭证投资策略。</p>                               |
| 业绩比较基准 | 中证红利指数收益率 × 45% + 中债总指数收益率 × 55%。  |
| 风险收益特征 | <p>本基金是混合型证券投资基金，主要投资于红利股及相似条件下到期收益率较高的优良债券品种，风险高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金，属于中低风险的证券投资基金产品。</p> <p>根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。</p> |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                            | 基金托管人                 |
|-------------|------|----------------------------------|-----------------------|
| 名称          |      | 上投摩根基金管理有限公司                     | 中国建设银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 邹树波                              | 李申                    |
|             | 联系电话 | 021-38794888                     | 021-60637102          |
|             | 电子邮箱 | services@cifm.com                | lishen.zh@ccb.com     |
| 客户服务电话      |      | 400-889-4888                     | 021-60637111          |
| 传真          |      | 021-20628400                     | 021-60635778          |
| 注册地址        |      | 中国(上海)自由贸易试验区<br>富城路99号震旦国际大楼25楼 | 北京市西城区金融大街25号         |
| 办公地址        |      | 中国(上海)自由贸易试验区<br>富城路99号震旦国际大楼25楼 | 北京市西城区闹市口大街1号<br>院1号楼 |
| 邮政编码        |      | 200120                           | 100033                |
| 法定代表人       |      | 陈兵                               | 田国立                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券日报》  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cifm.com">http://www.cifm.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公场所                                      |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                             |
|--------|--------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 上投摩根基金管理有限公司 | 中国(上海)自由贸易试验区<br>富城路99号震旦国际大楼25楼 |



### 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

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年1月1日至2022年6月30日) |              |
|---------------|---------------------------|--------------|
|               | 上投摩根双息平衡混合A类              | 上投摩根双息平衡混合H类 |
| 本期已实现收益       | -63,947,566.53            | -60,542.69   |
| 本期利润          | -63,961,395.00            | -47,879.57   |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0608                   | -0.0474      |
| 本期加权平均净值利润率   | -6.91%                    | -5.38%       |
| 本期基金份额净值增长率   | -6.23%                    | -6.34%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日)          |              |
|               | 上投摩根双息平衡混合A类              | 上投摩根双息平衡混合H类 |
| 期末可供分配利润      | -104,764,386.84           | -105,678.03  |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1008                   | -0.0976      |
| 期末基金资产净值      | 934,605,468.32            | 976,862.09   |
| 期末基金份额净值      | 0.8992                    | 0.9024       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2022年6月30日)          |              |
|               | 上投摩根双息平衡混合A类              | 上投摩根双息平衡混合H类 |
| 基金份额累计净值增长率   | 309.92%                   | 18.74%       |

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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

上投摩根双息平衡混合 A 类

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③     | ②－④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | 5.93%    | 0.75%       | 0.17%      | 0.37%         | 5.76%   | 0.38% |
| 过去三个月      | 2.87%    | 1.10%       | -1.67%     | 0.65%         | 4.54%   | 0.45% |
| 过去六个月      | -6.23%   | 1.15%       | -1.05%     | 0.67%         | -5.18%  | 0.48% |
| 过去一年       | -3.48%   | 1.14%       | 0.55%      | 0.59%         | -4.03%  | 0.55% |
| 过去三年       | 29.24%   | 1.01%       | 8.97%      | 0.52%         | 20.27%  | 0.49% |
| 自基金合同生效起至今 | 309.92%  | 1.29%       | 195.37%    | 0.78%         | 114.55% | 0.51% |

上投摩根双息平衡混合 H 类

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 5.84%    | 0.75%       | 0.17%      | 0.37%         | 5.67%  | 0.38% |
| 过去三个月      | 2.74%    | 1.10%       | -1.67%     | 0.65%         | 4.41%  | 0.45% |
| 过去六个月      | -6.34%   | 1.15%       | -1.05%     | 0.67%         | -5.29% | 0.48% |
| 过去一年       | -3.65%   | 1.14%       | 0.55%      | 0.59%         | -4.20% | 0.55% |
| 过去三年       | 28.92%   | 1.01%       | 8.97%      | 0.52%         | 19.95% | 0.49% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.74%   | 0.98%       | 19.63%     | 0.49%         | -0.89% | 0.49% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根双息平衡混合型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2006年4月26日至2022年6月30日)

上投摩根双息平衡混合 A 类



注：本基金合同生效日为2006年4月26日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起6个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自2013年12月7日起，将基金业绩比较基准由“富时中国150红利指数收益率×45%+富时中国国债指数收益率×45%+同业存款利率×10%”变更为“中证红利指数收益率×45%+中债总指数收益率×55%”。

## 上投摩根双息平衡混合H类



注：本基金建仓期为本基金合同生效日起6个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。本类份额生效日为2016年3月17日，图示的时间段为本类份额生效日至本报告期末。

本基金自2013年12月7日起，将基金业绩比较基准由“富时中国150红利指数收益率×45%+富时中国国债指数收益率×45%+同业存款利率×10%”变更为“中证红利指数收益率×45%+中债总指数收益率×55%”。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2004年5月12日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司(2007年10月8日更名为“上海国际信托有限公司”)与摩根资产管理(英国)有限公司合资设立，注册资本为2.5亿元人民币，注册地上海。截至2022年6月底，公司旗下运作的基金共有八十四只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根核心中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根智选30混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场REITs指数型证券投资基金(QDII)、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选混合型证券投资基金、上投摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、上投摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、上投摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、上投摩根慧选成长股票型证券投资基金、上投摩根瑞泰38个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、上投摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、上投摩根MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根研究驱动股票型证券投资基金、上投摩根MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上投摩根瑞盛87个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、上投摩根优势成长混合型证券投资基金、上投摩根行业睿选股票型证券投资基金、上投摩根安荣

回报混合型证券投资基金、上投摩根中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、上投摩根景气甄选混合型证券投资基金、上投摩根均衡优选混合型证券投资基金、上投摩根中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、上投摩根月月盈30天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、上投摩根全景优势股票型证券投资基金、上投摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、上投摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、上投摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金(FOF)、上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理(助理)期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|---------|-----------------|------|--------|--|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 李博 | 本基金基金经理 | 2016-10-28      | -    | 13年    | 李博先生，上海交通大学硕士，自2009年3月至2010年10月在中银国际证券有限公司担任研究员，负责研究方面的工作。自2010年11月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任行业专家、基金经理、资深基金经理、国内权益投资部价值成长组组长兼资深基金经理，自2014年12月起担任上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金经理，2015年8月至2016年11月同时担任上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2015年9月起同时担任上投摩根阿尔法混合型证券投资基金基金经理，自2016年10月起同时担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理，自2018年11月起同时担任上投摩根核心精选股票型证券投资基金基金经理。 |

| 姓名 | 职务                                 | 任本基金的基金经理<br>(助理)期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明  |
|----|------------------------------------|---------------------|------|------------|---|
|    |                                    | 任职日期                | 离任日期 |            |   |
| 孙芳 | 副总经理<br>兼投资<br>副总监、<br>本基金<br>基金经理 | 2011-12-08          | -    | 19年        | 孙芳女士，华东师范大学经济学硕士，2003年7月至2006年10月任华宝兴业基金行业研究员。2006年12月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任行业专家、基金经理助理、研究部副总监、基金经理、总经理助理/国内权益投资二部总监兼资深基金经理、副总经理兼投资副总监。自2011年12月起担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理，自2012年11月起同时担任上投摩根核心优选混合型证券投资基金基金经理，2014年2月至2015年7月同时担任上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金经理，自2014年12月起同时担任上投摩根行业轮动混合型证券投资基金基金经理，自2021年2月起同时担任上投摩根行业睿选股票型证券投资基金基金经理。 |

| 姓名 | 职务                | 任本基金的基金经理<br>(助理)期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明   |
|----|-------------------|---------------------|------|------------|--|
|    |                   | 任职日期                | 离任日期 |            |  |
| 叶敏 | 本基金<br>基金经理<br>助理 | 2021-08-04          | -    | 14.5年      | 芝加哥大学工商管理硕士，现任研究部副总监兼基金经理助理。叶敏女士自2000年7月至2003年4月在普华永道会计师事务所担任审计师；自2006年2月至2007年6月在毕马威会计师事务所担任高级评估师；自2007年6月至2009年12月在晨星公司担任证券分析师；自2009年12月至2010年8月在上海好望角股权投资管理有限公司担任研究员；自2011年1月至2012年1月在江海证券有限公司担任资深研究员；2012年1月起加入上投摩根基金管理有限公司，历任研究助理、研究员、行业专家兼研究组长、研究部总监助理、研究部总监助理/基金经理助理，现任研究部副总监兼基金经理助理。 |

注：1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 孙芳女士自2022年8月18日起不再担任本基金基金经理。

4. 叶敏女士自2022年7月27日起不再担任本基金基金经理助理。



## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外，基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

## 4.3 管理人对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

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形：无。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022上半年，国内外宏观环境偏弱且如俄乌冲突之类黑天鹅事件频出，加之大宗商品持续上涨，美国进入加息周期，均对A股市场乃至全球金融市场都造成较大压力，以及随之产生大幅波动。同时，国内新冠疫情的反复对经济的恢复进程明显不利，导致消费和投资数据都弱于预期。但在政策面，我们看到措施积极，流动性充裕，信用环境改善，管理层跨周期调节进行稳增长稳就业的意图非常明显。总体而言，A股市场基本围绕着自身宏观经济状况和产业状况在波动，某些时间点受到事件性冲击而有些过激反应，但最终都有修复；并逐渐与美国市场脱钩。

从行业的表现来看，上半年表现突出的行业基本与其较高景气度一致，部分低估值的行业也在波动市场中表现较好。上半年表现居前的煤炭、汽车、电气设备等行业，其龙头公司均兑现了业绩的持续高增长或疫情修复后业绩的快速反弹；其他估值处于历史低位的板块如房地产、银行、建筑也在弱市中体现出较强的防御性。值得一提的是，在PPI超预期周期中，上游周期品有不少细分领域表现可圈可点，对周期的把握也能在上半年带来投资机会。

一季度本基金跑输基准，主要源于表现领先的煤炭和房地产只是标配，未能重仓；而在汽车、食品饮料、钢铁等行业的原有配置产生了负收益，综合导致业绩不如人意。二季度则明显跑赢基准，主要是我们判断二季度市场可能会发生结构转换，成长风格再次占优，因此在保持高股息的主体配置同时，尽量多地选择了高成长、经营明确向好、估值合理的新兴产业公司作为增强。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内上投摩根双息平衡混合A类份额净值增长率为：**-6.23%**，同期业绩比较基准收益率为：**-1.05%**，

上投摩根双息平衡混合H类份额净值增长率为：**-6.34%**，同期业绩比较基准收益率为：**-1.05%**。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美联储处于加息通道，欧洲受制于高通胀的压力，全球宏观环境的不确定性仍比较大；而国内经济在疫情缓解后预计会逐渐回升。政策方面还是暖意融融，稳增长进程还未到终点。综合内外部宏观环境，我们认为下半年市场大概率维持结构性行情，加大选股的准确率尤为重要。继续保持高股息的特色基础上，依然可以在科技、新能源、消费、医药这几个领域中，需要结合个股的具体情况来选择做增强。从下半年来看，我们认为新能源领域中还会涌现一些高景气、景气改善、盈利改善的细分市场，新的技术、不断下降的成本将促使电动车、风电、光伏的渗透率持续提升；同时智能化也有了越来越广泛的载体；军工在估值合理的情形下，以其稳定的供应格局、较为清晰的盈利增长，也还有一席之地；消费和医药则需要更深入地挖掘个股的经营状况；上游行业中，还有一些供给难以释放的瓶颈，在下游需求季节性爆发的时候带来高盈利弹性。以上均值值得在接下来的时间内重点关注，进行把握。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地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信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金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，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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 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：2022年6月30日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|----------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产：      |         | -                 | -                   |
| 银行存款     | 6.4.7.1 | 53,611,035.33     | 118,652,167.44      |
| 结算备付金    |         | 1,465,718.80      | 1,122,292.90        |
| 存出保证金    |         | 269,593.89        | 193,180.54          |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 894,077,119.51    | 922,422,878.59      |
| 其中：股票投资  |         | 693,989,020.60    | 690,552,278.59      |
| 基金投资     |         | -                 | -                   |
| 债券投资     |         | 200,088,098.91    | 231,870,600.00      |
| 资产支持证券投资 |         | -                 | -                   |
| 贵金属投资    |         | -                 | -                   |
| 其他投资     |         | -                 | -                   |
| 衍生金融资产   | 6.4.7.3 | -                 | -                   |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | -                 | -                   |
| 应收清算款    |         | 53,766.02         | -                   |
| 应收股利     |         | -                 | -                   |
| 应收申购款    |         | 213,387.84        | 48,107.03           |
| 递延所得税资产  |         | -                 | -                   |
| 其他资产     | 6.4.7.5 | -                 | 4,847,246.67        |
| 资产总计     |         | 949,690,621.39    | 1,047,285,873.17    |

| 负债和净资产      | 附注号     | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------------|---------|-------------------|---------------------|
| <b>负债：</b>  |         | -                 | -                   |
| 短期借款        |         | -                 | -                   |
| 交易性金融负债     |         | -                 | -                   |
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3 | -                 | -                   |
| 卖出回购金融资产款   |         | -                 | -                   |
| 应付清算款       |         | 5,900,031.42      | 20,117,034.42       |
| 应付赎回款       |         | 391,939.38        | 594,789.01          |
| 应付管理人报酬     |         | 1,122,659.98      | 1,307,245.19        |
| 应付托管费       |         | 187,109.99        | 217,874.20          |
| 应付销售服务费     |         | -                 | -                   |
| 应付投资顾问费     |         | -                 | -                   |
| 应交税费        |         | 5,475,677.31      | 5,490,204.14        |
| 应付利润        |         | -                 | -                   |
| 递延所得税负债     |         | -                 | -                   |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 1,030,872.90      | 1,150,763.86        |
| 负债合计        |         | 14,108,290.98     | 28,877,910.82       |
| <b>净资产：</b> |         | -                 | -                   |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 1,040,452,395.28  | 1,062,013,559.27    |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | -104,870,064.87   | -43,605,596.92      |
| 净资产合计       |         | 935,582,330.41    | 1,018,407,962.35    |
| 负债和净资产总计    |         | 949,690,621.39    | 1,047,285,873.17    |

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额：1,040,452,395.28份，其中：

A类，基金份额净值：0.8992，基金份额：1,039,369,855.16份，

H类，基金份额净值：0.9024，基金份额：1,082,540.12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：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期<br>2022年1月1日至<br>2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至<br>2021年6月30日 |
|------------------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、营业总收入                |          | <b>-55,824,073.03</b>          | <b>52,170,112.65</b>                |
| 1. 利息收入                |          | 135,106.61                     | 5,601,599.06                        |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.9  | 135,106.61                     | 258,743.53                          |
| 债券利息收入                 |          | -                              | 5,342,855.53                        |
| 资产支持证券利息收入             |          | -                              | -                                   |
| 买入返售金融资产收入             |          | -                              | -                                   |
| 证券出借利息收入               |          | -                              | -                                   |
| 其他利息收入                 |          | -                              | -                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | -55,966,973.69                 | 110,821,943.01                      |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.10 | -68,163,658.60                 | 106,770,603.88                      |
| 基金投资收益                 |          | -                              | -                                   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.11 | 2,550,794.61                   | -35,102.97                          |
| 资产支持证券投资收益             |          | -                              | -                                   |
| 贵金属投资收益                |          | -                              | -                                   |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.12 | -                              | -                                   |
| 股利收益                   | 6.4.7.13 | 9,645,890.30                   | 4,086,442.10                        |
| 其他投资收益                 |          | -                              | -                                   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.14 | -1,165.35                      | -64,281,920.59                      |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                              | -                                   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.15 | 8,959.40                       | 28,491.17                           |

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2022年1月1日至<br>2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至<br>2021年6月30日 |
|----------------------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | <b>8,185,201.54</b>            | <b>12,585,790.66</b>                |
| 1· 管理人报酬                   |          | 6,903,708.32                   | 8,477,238.85                        |
| 2· 托管费                     |          | 1,150,618.07                   | 1,412,873.07                        |
| 3· 销售服务费                   |          | -                              | -                                   |
| 4· 投资顾问费                   |          | -                              | -                                   |
| 5· 利息支出                    |          | -                              | -                                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                              | -                                   |
| 6. 信用减值损失                  |          | -                              | -                                   |
| 7. 税金及附加                   |          | 2,850.83                       | 15,055.52                           |
| 8· 其他费用                    | 6.4.7.16 | 128,024.32                     | 2,680,623.22                        |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-64,009,274.57</b>          | <b>39,584,321.99</b>                |
| 减：所得税费用                    |          | -                              | -                                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-64,009,274.57</b>          | <b>39,584,321.99</b>                |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | <b>-</b>                       | <b>-</b>                            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>-64,009,274.57</b>          | <b>39,584,321.99</b>                |

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

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：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日      |                |                 |                  |
|--|---------------------------------|----------------|-----------------|------------------|
|  | 实收基金                            | 其他综合<br>收益(若有) | 未分配利润           | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 1,062,013,559.27                | -              | -43,605,596.92  | 1,018,407,962.35 |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 1,062,013,559.27                | -              | -43,605,596.92  | 1,018,407,962.35 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -21,561,163.99                  | -              | -61,264,467.95  | -82,825,631.94   |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -              | -64,009,274.57  | -64,009,274.57   |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -21,561,163.99                  | -              | 2,744,806.62    | -18,816,357.37   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 17,860,651.18                   | -              | -2,073,426.47   | 15,787,224.71    |
| 2. 基金赎回款                                 | -39,421,815.17                  | -              | 4,818,233.09    | -34,603,582.08   |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                               | -              | -               | -                |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 1,040,452,395.28                | -              | -104,870,064.87 | 935,582,330.41   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                |                 |                  |
|  | 实收基金                            | 其他综合<br>收益(若有) | 未分配利润           | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 1,309,705,227.16                | -              | -117,438,311.12 | 1,192,266,916.04 |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 1,309,705,227.16                | -              | -117,438,311.12 | 1,192,266,916.04 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -167,685,645.02                 | -              | 47,536,570.46   | -120,149,074.56  |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -              | 39,584,321.99   | 39,584,321.99    |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -167,685,645.02                 | -              | 7,952,248.47    | -159,733,396.55  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 25,046,120.71                   | -              | -1,052,974.47   | 23,993,146.24    |
| 2. 基金赎回款                                 | -192,731,765.73                 | -              | 9,005,222.94    | -183,726,542.79  |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                               | -              | -               | -                |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 1,142,019,582.14                | -              | -69,901,740.66  | 1,072,117,841.48 |



报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王大智，主管会计工作负责人：郭海明，会计机构负责人：张璐

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上投摩根双息平衡混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]50号《关于同意上投摩根双息平衡混合型证券投资基金募集的批复》核准，由上投摩根富林明基金管理有限公司(后更名为“上投摩根基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币6,434,951,616.90元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第41号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》于2006年4月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为6,435,738,977.50份基金份额，其中认购资金利息折合787,360.60份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《关于上投摩根双息平衡混合型证券投资基金修改基金合同的公告》以及更新的《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，自2015年7月24日起，本基金根据销售对象的不同，将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的份额，称为A类基金份额；在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额，称为H类基金份额。本基金A类基金份额和H类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：在正常市场情况下，股票投资比例为基金总资产的20%-75%，债券为20%-75%，权证的投资比例为基金净资产的0-3%，并保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金重点投资对象为高股息、高债息品种，80%以上的非现金基金资产属于上述投资方向。考虑到国内股市发展现状，缺乏有效避险工具，本基金管理人将保留在极端市场情况下债券投资最高比例为95%，股票投资最低比例为0%的权利。本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率×45%+中债总指数收益率×55%。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于2022年8月30日批准报出。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况以及2022年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外,本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募基金证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年上半年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:1 会计政策变更的性质、内容和原因(a)金融资产和金融负债的分类 金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。(1)金融资产 金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。债务工具 本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:以摊余成本计量:本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。以公允价值计量且其变动计入当期损益:本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具,以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资,在资产负债表中以交易性金融资产列示。权益工具 权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表

中列示为交易性金融资产。(2)金融负债 金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。(3)衍生金融工具 本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。(b)金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认 金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。(c)收入/(损失)的确认和计量 股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。2 当期报表中受影响的项目名称和调整金额(a)金融工具 根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于2022年1月1日，本财务

报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为118,652,167.44元、1,122,292.90元、193,180.54元、4,847,246.67元和48,107.03元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产—应收利息和应收申购款，金额分别为118,664,707.28元、1,122,848.40元、193,276.24元、0.00元和48,107.30元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为922,422,878.59元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为927,256,933.95元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债—其他应付款，金额分别为20,117,034.42元、594,789.01元、1,307,245.19元、217,874.20元、930,420.50元和343.36元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债—应付交易费用和其他负债—其他应付款，金额分别为20,117,034.42元、594,789.01元、1,307,245.19元、217,874.20元、930,420.50元和343.36元。于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。(b)修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照10%的税率代扣代缴所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2022年6月30日 |
|--------|-------------------|
| 活期存款   | 53,611,035.33     |
| 等于：本金  | 53,604,385.38     |
| 加：应计利息 | 6,649.95          |
| 定期存款   | —                 |
| 等于：本金  | —                 |
| 加：应计利息 | —                 |
| 其他存款   | —                 |
| 等于：本金  | —                 |
| 加：应计利息 | —                 |
| 合计     | 53,611,035.33     |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2022年6月30日 |              |                |               |
|---------------|-------|-------------------|--------------|----------------|---------------|
|               |       | 成本                | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 649,154,593.46    | -            | 693,989,020.60 | 44,834,427.14 |
| 贵金属投资—金交所黄金合约 |       | -                 | -            | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 166,164,385.94    | 2,549,469.83 | 168,828,013.43 | 114,157.66    |
|               | 银行间市场 | 30,000,000.00     | 780,085.48   | 31,260,085.48  | 480,000.00    |
|               | 合计    | 196,164,385.94    | 3,329,555.31 | 200,088,098.91 | 594,157.66    |
| 资产支持证券        |       | -                 | -            | -              | -             |
| 基金            |       | -                 | -            | -              | -             |
| 其他            |       | -                 | -            | -              | -             |
| 合计            |       | 845,318,979.40    | 3,329,555.31 | 894,077,119.51 | 45,428,584.80 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产／负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产／负债期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 957.83            |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 920,716.92        |
| 其中：交易所市场    | 920,716.92        |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 其他应付款       | 102.21            |
| 预提费用        | 109,095.94        |
| 合计          | 1,030,872.90      |

#### 6.4.7.7 实收基金

上投摩根双息平衡混合 A 类

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                  |
|---------------|----------------------------|------------------|
|               | 基金份额                       | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,061,320,915.61           | 1,061,320,915.61 |
| 本期申购          | 17,314,472.39              | 17,314,472.39    |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -39,265,532.84             | -39,265,532.84   |
| 本期末           | 1,039,369,855.16           | 1,039,369,855.16 |

上投摩根双息平衡混合 H 类

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              |
|---------------|----------------------------|--------------|
|               | 基金份额                       | 账面金额         |
| 上年度末          | 692,643.66                 | 692,643.66   |
| 本期申购          | 546,178.79                 | 546,178.79   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -156,282.33                | -156,282.33  |
| 本期末           | 1,082,540.12               | 1,082,540.12 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

上投摩根双息平衡混合 A 类

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | 117,808,226.88 | -161,388,525.17 | -43,580,298.29  |
| 本期利润           | -63,947,566.53 | -13,828.47      | -63,961,395.00  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,461,351.86  | 4,238,658.31    | 2,777,306.45    |
| 其中：基金申购款       | 1,252,310.51   | -3,280,083.32   | -2,027,772.81   |
| 基金赎回款          | -2,713,662.37  | 7,518,741.63    | 4,805,079.26    |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -               |
| 本期末            | 52,399,308.49  | -157,163,695.33 | -104,764,386.84 |



上投摩根双息平衡混合H类

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分       | 未分配利润合计     |
|----------------|------------|-------------|-------------|
| 上年度末           | 79,910.83  | -105,209.46 | -25,298.63  |
| 本期利润           | -60,542.69 | 12,663.12   | -47,879.57  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 38,490.52  | -70,990.35  | -32,499.83  |
| 其中：基金申购款       | 54,534.40  | -100,188.06 | -45,653.66  |
| 基金赎回款          | -16,043.88 | 29,197.71   | 13,153.83   |
| 本期已分配利润        | -          | -           | -           |
| 本期末            | 57,858.66  | -163,536.69 | -105,678.03 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 119,152.84                 |
| 定期存款利息收入  | -                          |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | 13,979.93                  |
| 其他        | 1,973.84                   |
| 合计        | 135,106.61                 |

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 967,689,506.22             |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,032,847,073.71           |
| 减：交易费用     | 3,006,091.11               |
| 买卖股票差价收入   | -68,163,658.60             |



#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                          | 本期                   |
|-----------------------------|----------------------|
|                             | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 债券投资收益—利息收入                 | 3,011,692.35         |
| 债券投资收益—买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入 | -460,897.74          |
| 债券投资收益—赎回差价收入               | —                    |
| 债券投资收益—申购差价收入               | —                    |
| 合计                          | 2,550,794.61         |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                   |
|-------------------------|----------------------|
|                         | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额   | 147,187,457.00       |
| 减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额 | 142,840,667.40       |
| 减：应计利息总额                | 4,807,577.07         |
| 减：交易费用                  | 110.27               |
| 买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入   | -460,897.74          |

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |
|---------------|----------------------|
|               | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 9,645,890.30         |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | —                    |
| 基金投资产生的股利收益   | —                    |
| 合计            | 9,645,890.30         |

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产             | -1,165.35            |
| — 股票投资                 | -590,452.05          |
| — 债券投资                 | 589,286.70           |
| — 资产支持证券投资             | —                    |
| — 基金投资                 | —                    |
| — 贵金属投资                | —                    |
| — 其他                   | —                    |
| 2. 衍生工具                | —                    |
| — 权证投资                 | —                    |
| 3. 其他                  | —                    |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | —                    |
| 合计                     | -1,165.35            |

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 8,115.56             |
| 转换费收入   | 843.84               |
| 合计      | 8,959.40             |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |            |
|---------|----------------------|------------|
|         | 2022年1月1日至2022年6月30日 |            |
| 审计费用    |                      | 49,588.57  |
| 信息披露费   |                      | 59,507.37  |
| 证券出借违约金 |                      | -          |
| 银行汇划费   |                      | 328.38     |
| 其他      |                      | 600.00     |
| 账户维护费   |                      | 18,000.00  |
| 合计      |                      | 128,024.32 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 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（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金代销机构        |

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。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年1月1日至<br>2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至<br>2021年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 6,903,708.32                   | 8,477,238.85                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,135,095.80                   | 1,361,218.60                        |

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至<br>2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至<br>2021年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,150,618.07                   | 1,412,873.07                        |

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 × 0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目               | 本期<br>2022年1月1日至<br>2022年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至<br>2021年6月30日 |                  |
|------------------|--------------------------------|------------------|-------------------------------------|------------------|
|                  | 上投摩根双息<br>平衡混合A类               | 上投摩根双息<br>平衡混合H类 | 上投摩根双息<br>平衡混合A类                    | 上投摩根双息<br>平衡混合H类 |
| 期初持有的基金份额        | -                              | -                | 2,677,390.51                        | -                |
| 期间申购/买入总份额       | -                              | -                | -                                   | -                |
| 期间因拆分变动份额        | -                              | -                | -                                   | -                |
| 减：期间赎回/卖出总<br>份额 | -                              | -                | -                                   | -                |
| 期末持有的基金份额        | -                              | -                | 2,677,390.51                        | -                |
| 占基金总份额比例         | -                              | -                | 0.23%                               | -                |

##### 6.4.10.5.2 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

无。

#### 6.4.10.6 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  | 本期<br>2022年1月1日至<br>2022年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至<br>2021年6月30日 |            |
|--------|--------------------------------|------------|-------------------------------------|------------|
|        | 期末余额                           | 当期利息收入     | 期末余额                                | 当期利息收入     |
| 中国建设银行 | 53,611,035.33                  | 119,152.84 | 148,472,133.55                      | 248,136.26 |

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |          |        |       |        |           |              |              |    |
|----------------------|------|------------|----------|--------|-------|--------|-----------|--------------|--------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期      | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股)  | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
| 600941               | 中国移动 | 2021-12-24 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 57.58 | 60.26  | 87,363.00 | 5,030,361.54 | 5,264,494.38 | -  |
| 301219               | 腾远钴业 | 2022-03-10 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 96.80 | 87.82  | 266.00    | 25,749.04    | 23,360.12    | -  |

注：1、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、受限期为流通受限证券原始受限期。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在此限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监督和风险评估的评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行管控，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在此可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | -                 | -                  |
| A-1以下  | -                 | -                  |
| 未评级    | 149,455,795.62    | 39,940,000.00      |
| 合计     | 149,455,795.62    | 39,940,000.00      |

注：未评级的债券为国债

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 50,632,303.29     | 121,629,600.00     |
| AAA以下  | -                 | -                  |
| 未评级    | -                 | 70,301,000.00      |
| 合计     | 50,632,303.29     | 191,930,600.00     |

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。



#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制),本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年6月30日 | 1年以内                  | 1-5年                 | 5年以上     | 不计息                   | 合计                    |
|-------------------|-----------------------|----------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| <b>资产</b>         |                       |                      |          |                       |                       |
| 银行存款              | 53,611,035.33         | -                    | -        | -                     | 53,611,035.33         |
| 结算备付金             | 1,465,718.80          | -                    | -        | -                     | 1,465,718.80          |
| 存出保证金             | 269,593.89            | -                    | -        | -                     | 269,593.89            |
| 交易性金融资产           | 149,455,795.62        | 50,632,303.29        | -        | 693,989,020.60        | 894,077,119.51        |
| 买入返售金融资产          | -                     | -                    | -        | -                     | -                     |
| 应收证券清算款           | -                     | -                    | -        | 53,766.02             | 53,766.02             |
| 应收利息              | -                     | -                    | -        | -                     | -                     |
| 应收申购款             | 356.76                | -                    | -        | 213,031.08            | 213,387.84            |
| 其他资产              | -                     | -                    | -        | -                     | -                     |
| <b>资产总计</b>       | <b>204,802,500.40</b> | <b>50,632,303.29</b> | <b>-</b> | <b>694,255,817.70</b> | <b>949,690,621.39</b> |
| <b>负债</b>         |                       |                      |          |                       |                       |
| 卖出回购金融资产款         | -                     | -                    | -        | -                     | -                     |
| 应付证券清算款           | -                     | -                    | -        | 5,900,031.42          | 5,900,031.42          |
| 应付赎回款             | -                     | -                    | -        | 391,939.38            | 391,939.38            |
| 应付管理人报酬           | -                     | -                    | -        | 1,122,659.98          | 1,122,659.98          |
| 应付托管费             | -                     | -                    | -        | 187,109.99            | 187,109.99            |
| 应付销售服务费           | -                     | -                    | -        | -                     | -                     |
| 应付税费              | -                     | -                    | -        | 5,475,677.31          | 5,475,677.31          |
| 应付利息              | -                     | -                    | -        | -                     | -                     |
| 应付利润              | -                     | -                    | -        | -                     | -                     |
| 其他负债              | -                     | -                    | -        | 1,030,872.90          | 1,030,872.90          |
| <b>负债总计</b>       | <b>-</b>              | <b>-</b>             | <b>-</b> | <b>14,108,290.98</b>  | <b>14,108,290.98</b>  |
| <b>利率敏感度缺口</b>    | <b>204,802,500.40</b> | <b>50,632,303.29</b> | <b>-</b> | <b>680,147,526.72</b> | <b>935,582,330.41</b> |

| 上年度末<br>2021年12月31日 | 1年以内                  | 1-5年                 | 5年以上                | 不计息                   | 合计                      |
|---------------------|-----------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------|
| <b>资产</b>           |                       |                      |                     |                       |                         |
| 银行存款                | 118,652,167.44        | -                    | -                   | -                     | 118,652,167.44          |
| 结算备付金               | 1,122,292.90          | -                    | -                   | -                     | 1,122,292.90            |
| 存出保证金               | 193,180.54            | -                    | -                   | -                     | 193,180.54              |
| 交易性金融资产             | 180,764,000.00        | 48,980,600.00        | 2,126,000.00        | 690,552,278.59        | 922,422,878.59          |
| 应收利息                | -                     | -                    | -                   | 4,847,246.67          | 4,847,246.67            |
| 应收申购款               | 397.47                | -                    | -                   | 47,709.56             | 48,107.03               |
| <b>资产总计</b>         | <b>300,732,038.35</b> | <b>48,980,600.00</b> | <b>2,126,000.00</b> | <b>695,447,234.82</b> | <b>1,047,285,873.17</b> |
| <b>负债</b>           |                       |                      |                     |                       |                         |
| 应付证券清算款             | -                     | -                    | -                   | 20,117,034.42         | 20,117,034.42           |
| 应付赎回款               | -                     | -                    | -                   | 594,789.01            | 594,789.01              |
| 应付管理人报酬             | -                     | -                    | -                   | 1,307,245.19          | 1,307,245.19            |
| 应付托管费               | -                     | -                    | -                   | 217,874.20            | 217,874.20              |
| 应付交易费用              | -                     | -                    | -                   | 930,420.50            | 930,420.50              |
| 应交税费                | -                     | -                    | -                   | 5,490,204.14          | 5,490,204.14            |
| 其他负债                | -                     | -                    | -                   | 220,343.36            | 220,343.36              |
| <b>负债总计</b>         | <b>-</b>              | <b>-</b>             | <b>-</b>            | <b>28,877,910.82</b>  | <b>28,877,910.82</b>    |
| <b>利率敏感度缺口</b>      | <b>300,732,038.35</b> | <b>48,980,600.00</b> | <b>2,126,000.00</b> | <b>666,569,324.00</b> | <b>1,018,407,962.35</b> |

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                  |                     |
|----|--------------------|----------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币万元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2022年6月30日                | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|    | 1. 市场利率下降25个基点     | 增加约30                            | 增加约40               |
|    | 2. 市场利率上升25个基点     | 减少约30                            | 减少约40               |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为20%-75%，债券为20%-75%，权证的投资比例为基金净资产的0-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年6月30日 |                  | 上年度末<br>2021年12月31日 |                  |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产<br>净值比例(%) | 公允价值                | 占基金资产<br>净值比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 693,989,020.60    | 74.18            | 690,552,278.59      | 67.81            |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -                | -                   | -                |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                 | -                | 2,126,000.00        | 0.21             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                 | -                | -                   | -                |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                 | -                | -                   | -                |
| 其他            | -                 | -                | -                   | -                |
| 合计            | 693,989,020.60    | 74.18            | 692,678,278.59      | 68.02            |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设                     | 除中证红利指数以外的其他市场变量保持不变   |                                  |                     |
|------------------------|------------------------|----------------------------------|---------------------|
| 分析                     | 相关风险变量的变动              | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币万元) |                     |
|                        |                        | 本期末<br>2022年6月30日                | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|                        | 1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5% |                                  | 增加约7,102            |
| 2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5% |                        | 减少约7,102                         | 减少约8,232            |

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 688,701,166.10    | 681,068,381.09      |
| 第二层次          | 200,088,098.91    | 239,062,261.23      |
| 第三层次          | 5,287,854.50      | 2,292,236.27        |
| 合计            | 894,077,119.51    | 922,422,878.59      |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021年12月31日：同）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 693,989,020.60 | 73.08        |
|    | 其中：股票             | 693,989,020.60 | 73.08        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 200,088,098.91 | 21.07        |
|    | 其中：债券             | 200,088,098.91 | 21.07        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 55,076,754.13  | 5.80         |
| 8  | 其他各项资产            | 536,747.75     | 0.06         |
| 9  | 合计                | 949,690,621.39 | 100.00       |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值<br>(元)    | 占基金资产净值<br>比例(%) |
|----|------------------|----------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 26,662,193.21  | 2.85             |
| B  | 采矿业              | 52,045,069.31  | 5.56             |
| C  | 制造业              | 447,289,053.46 | 47.81            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 33,014,876.84  | 3.53             |
| E  | 建筑业              | 15,145,720.01  | 1.62             |
| F  | 批发和零售业           | 10,751,179.20  | 1.15             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -                |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,264,494.38   | 0.56             |
| J  | 金融业              | 42,415,924.31  | 4.53             |
| K  | 房地产业             | 51,827,086.88  | 5.54             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 9,573,423.00   | 1.02             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -                |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -                |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -                |
| P  | 教育               | -              | -                |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -                |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -                |
| S  | 综合               | -              | -                |
|    | 合计               | 693,989,020.60 | 74.18            |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值          | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 601899 | 紫金矿业 | 3,816,407 | 35,607,077.31 | 3.81                 |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 15,600    | 31,902,000.00 | 3.41                 |
| 3  | 600048 | 保利发展 | 1,655,562 | 28,906,112.52 | 3.09                 |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 51,100    | 27,287,400.00 | 2.92                 |
| 5  | 600089 | 特变电工 | 923,042   | 25,282,120.38 | 2.70                 |
| 6  | 601985 | 中国核电 | 3,527,694 | 24,199,980.84 | 2.59                 |
| 7  | 002714 | 牧原股份 | 360,623   | 19,931,633.21 | 2.13                 |
| 8  | 600383 | 金地集团 | 1,252,944 | 16,839,567.36 | 1.80                 |
| 9  | 601166 | 兴业银行 | 823,697   | 16,391,570.30 | 1.75                 |
| 10 | 600141 | 兴发集团 | 358,900   | 15,788,011.00 | 1.69                 |
| 11 | 600219 | 南山铝业 | 4,247,705 | 15,674,031.45 | 1.68                 |
| 12 | 601238 | 广汽集团 | 990,300   | 15,092,172.00 | 1.61                 |
| 13 | 601636 | 旗滨集团 | 1,178,723 | 15,028,718.25 | 1.61                 |
| 14 | 601009 | 南京银行 | 1,370,590 | 14,281,547.80 | 1.53                 |
| 15 | 002407 | 多氟多  | 268,524   | 13,133,508.84 | 1.40                 |
| 16 | 600210 | 紫江企业 | 1,946,936 | 12,440,921.04 | 1.33                 |
| 17 | 002895 | 川恒股份 | 353,200   | 11,941,692.00 | 1.28                 |
| 18 | 000568 | 泸州老窖 | 47,800    | 11,784,612.00 | 1.26                 |
| 19 | 600563 | 法拉电子 | 56,705    | 11,633,597.80 | 1.24                 |
| 20 | 000333 | 美的集团 | 189,765   | 11,459,908.35 | 1.22                 |
| 21 | 000422 | 湖北宜化 | 557,995   | 11,332,878.45 | 1.21                 |
| 22 | 600153 | 建发股份 | 821,106   | 10,731,855.42 | 1.15                 |
| 23 | 601669 | 中国电建 | 1,259,323 | 9,910,872.01  | 1.06                 |
| 24 | 601888 | 中国中免 | 41,100    | 9,573,423.00  | 1.02                 |
| 25 | 002304 | 洋河股份 | 52,054    | 9,533,690.10  | 1.02                 |
| 26 | 300772 | 运达股份 | 368,497   | 9,374,563.68  | 1.00                 |
| 27 | 000895 | 双汇发展 | 294,600   | 8,631,780.00  | 0.92                 |
| 28 | 002318 | 久立特材 | 527,131   | 8,428,824.69  | 0.90                 |
| 29 | 603606 | 东方电缆 | 108,330   | 8,298,078.00  | 0.89                 |
| 30 | 688033 | 天宜上佳 | 387,158   | 8,223,235.92  | 0.88                 |



| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 31 | 605068 | 明新旭腾 | 351,200 | 8,200,520.00 | 0.88         |
| 32 | 002531 | 天顺风能 | 479,900 | 7,913,551.00 | 0.85         |
| 33 | 000596 | 古井贡酒 | 30,730  | 7,672,051.80 | 0.82         |
| 34 | 300850 | 新强联  | 85,000  | 7,567,550.00 | 0.81         |
| 35 | 600809 | 山西汾酒 | 23,175  | 7,527,240.00 | 0.80         |
| 36 | 000625 | 长安汽车 | 434,457 | 7,524,795.24 | 0.80         |
| 37 | 601058 | 赛轮轮胎 | 640,400 | 7,217,308.00 | 0.77         |
| 38 | 601633 | 长城汽车 | 194,600 | 7,207,984.00 | 0.77         |
| 39 | 603035 | 常熟汽饰 | 436,300 | 7,207,676.00 | 0.77         |
| 40 | 603667 | 五洲新春 | 438,288 | 6,955,630.56 | 0.74         |
| 41 | 002142 | 宁波银行 | 193,041 | 6,912,798.21 | 0.74         |
| 42 | 600598 | 北大荒  | 456,000 | 6,730,560.00 | 0.72         |
| 43 | 600690 | 海尔智家 | 241,653 | 6,635,791.38 | 0.71         |
| 44 | 600096 | 云天化  | 206,700 | 6,506,916.00 | 0.70         |
| 45 | 000902 | 新洋丰  | 377,200 | 6,370,908.00 | 0.68         |
| 46 | 000002 | 万科A  | 296,654 | 6,081,407.00 | 0.65         |
| 47 | 600348 | 华阳股份 | 359,600 | 5,559,416.00 | 0.59         |
| 48 | 603816 | 顾家家居 | 95,420  | 5,403,634.60 | 0.58         |
| 49 | 600600 | 青岛啤酒 | 51,068  | 5,306,986.56 | 0.57         |
| 50 | 600941 | 中国移动 | 87,363  | 5,264,494.38 | 0.56         |
| 51 | 601800 | 中国交建 | 564,100 | 5,234,848.00 | 0.56         |
| 52 | 600507 | 方大特钢 | 738,063 | 5,159,060.37 | 0.55         |
| 53 | 603866 | 桃李面包 | 294,520 | 4,874,306.00 | 0.52         |
| 54 | 600887 | 伊利股份 | 124,500 | 4,849,275.00 | 0.52         |
| 55 | 601128 | 常熟银行 | 632,200 | 4,830,008.00 | 0.52         |
| 56 | 603179 | 新泉股份 | 165,740 | 4,806,460.00 | 0.51         |
| 57 | 600188 | 兖矿能源 | 119,600 | 4,721,808.00 | 0.50         |
| 58 | 600176 | 中国巨石 | 267,900 | 4,664,139.00 | 0.50         |
| 59 | 600933 | 爱柯迪  | 277,000 | 4,537,260.00 | 0.48         |
| 60 | 600309 | 万华化学 | 45,844  | 4,446,409.56 | 0.48         |
| 61 | 002493 | 荣盛石化 | 287,397 | 4,423,039.83 | 0.47         |
| 62 | 000883 | 湖北能源 | 864,600 | 4,418,106.00 | 0.47         |

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 63 | 300409 | 道氏技术 | 170,000   | 4,416,600.00 | 0.47         |
| 64 | 600863 | 内蒙华电 | 1,204,600 | 4,396,790.00 | 0.47         |
| 65 | 600123 | 兰花科创 | 267,000   | 4,392,150.00 | 0.47         |
| 66 | 002594 | 比亚迪  | 9,559     | 3,187,830.91 | 0.34         |
| 67 | 002487 | 大金重工 | 69,290    | 2,891,471.70 | 0.31         |
| 68 | 000822 | 山东海化 | 280,000   | 2,844,800.00 | 0.30         |
| 69 | 603197 | 保隆科技 | 56,900    | 2,798,911.00 | 0.30         |
| 70 | 002415 | 海康威视 | 71,785    | 2,598,617.00 | 0.28         |
| 71 | 601233 | 桐昆股份 | 130,850   | 2,077,898.00 | 0.22         |
| 72 | 601702 | 华峰铝业 | 73,800    | 974,160.00   | 0.10         |
| 73 | 600338 | 西藏珠峰 | 30,900    | 886,830.00   | 0.09         |
| 74 | 601088 | 中国神华 | 26,360    | 877,788.00   | 0.09         |
| 75 | 600566 | 济川药业 | 3,513     | 95,413.08    | 0.01         |
| 76 | 688667 | 菱电电控 | 424       | 61,238.32    | 0.01         |
| 77 | 601089 | 福元医药 | 1,749     | 36,816.45    | 0.00         |
| 78 | 301219 | 腾远钴业 | 266       | 23,360.12    | 0.00         |
| 79 | 600546 | 山煤国际 | 993       | 19,323.78    | 0.00         |
| 80 | 300390 | 天华超净 | 145       | 12,673.00    | 0.00         |
| 81 | 001268 | 联合精密 | 409       | 11,337.48    | 0.00         |
| 82 | 301198 | 喜悦智行 | 341       | 7,689.55     | 0.00         |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 49,566,614.94 | 4.87           |
| 2  | 000069 | 华侨城A | 31,256,383.00 | 3.07           |
| 3  | 600048 | 保利发展 | 28,363,563.00 | 2.79           |
| 4  | 601985 | 中国核电 | 27,164,276.01 | 2.67           |
| 5  | 600383 | 金地集团 | 26,019,352.24 | 2.55           |
| 6  | 601607 | 上海医药 | 18,861,947.46 | 1.85           |
| 7  | 600019 | 宝钢股份 | 15,341,261.00 | 1.51           |
| 8  | 601669 | 中国电建 | 15,213,345.00 | 1.49           |
| 9  | 601238 | 广汽集团 | 15,080,323.82 | 1.48           |
| 10 | 000422 | 湖北宜化 | 14,353,258.44 | 1.41           |
| 11 | 600863 | 内蒙华电 | 14,133,095.00 | 1.39           |
| 12 | 688033 | 天宜上佳 | 14,042,786.22 | 1.38           |
| 13 | 000895 | 双汇发展 | 13,933,002.00 | 1.37           |
| 14 | 000002 | 万科A  | 13,777,863.00 | 1.35           |
| 15 | 600141 | 兴发集团 | 13,741,955.11 | 1.35           |
| 16 | 600210 | 紫江企业 | 13,497,487.04 | 1.33           |
| 17 | 600123 | 兰花科创 | 12,896,661.88 | 1.27           |
| 18 | 601668 | 中国建筑 | 12,733,721.78 | 1.25           |
| 19 | 600011 | 华能国际 | 12,242,100.00 | 1.20           |
| 20 | 002895 | 川恒股份 | 11,976,145.00 | 1.18           |

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 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(%) |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1  | 002756 | 永兴材料  | 27,411,501.91 | 2.69           |
| 2  | 000858 | 五粮液   | 25,077,680.50 | 2.46           |
| 3  | 600782 | 新钢股份  | 23,994,328.98 | 2.36           |
| 4  | 000069 | 华侨城 A | 23,487,561.81 | 2.31           |
| 5  | 300750 | 宁德时代  | 19,592,160.00 | 1.92           |
| 6  | 600338 | 西藏珠峰  | 17,941,821.33 | 1.76           |
| 7  | 601877 | 正泰电器  | 17,841,250.40 | 1.75           |
| 8  | 600863 | 内蒙华电  | 17,689,207.11 | 1.74           |
| 9  | 601633 | 长城汽车  | 17,144,265.11 | 1.68           |
| 10 | 002815 | 崇达技术  | 16,865,151.10 | 1.66           |
| 11 | 600089 | 特变电工  | 16,640,701.17 | 1.63           |
| 12 | 601607 | 上海医药  | 16,091,866.67 | 1.58           |
| 13 | 002318 | 久立特材  | 14,571,839.25 | 1.43           |
| 14 | 600019 | 宝钢股份  | 14,165,066.84 | 1.39           |
| 15 | 000983 | 山西焦煤  | 13,802,354.15 | 1.36           |
| 16 | 600690 | 海尔智家  | 13,445,054.95 | 1.32           |
| 17 | 002304 | 洋河股份  | 13,354,506.72 | 1.31           |
| 18 | 000825 | 太钢不锈  | 12,722,049.54 | 1.25           |
| 19 | 600383 | 金地集团  | 12,544,238.79 | 1.23           |
| 20 | 601668 | 中国建筑  | 12,419,916.32 | 1.22           |

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本(成交)总额 | 1,036,874,267.77 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 967,689,506.22   |

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 149,455,795.62 | 15.97        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 31,260,085.48  | 3.34         |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 19,372,217.81  | 2.07         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债(可交换债) | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 200,088,098.91 | 21.39        |

## 7.6 期末按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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码    | 债券名称          | 数量(张)   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019658  | 21 国债 10      | 895,480 | 91,253,828.07 | 9.75         |
| 2  | 019666  | 22 国债 01      | 575,560 | 58,201,967.55 | 6.22         |
| 3  | 2120065 | 21 桂林银行三农债 02 | 300,000 | 31,260,085.48 | 3.34         |
| 4  | 136767  | 16 油服 04      | 190,000 | 19,372,217.81 | 2.07         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 本报告期投资基金情况

#### 7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 269,593.89 |
| 2  | 应收清算款 | 53,766.02  |
| 3  | 应收股利  | —          |
| 4  | 应收利息  | —          |
| 5  | 应收申购款 | 213,387.84 |
| 6  | 其他应收款 | —          |
| 7  | 待摊费用  | —          |
| 8  | 其他    | —          |
| 9  | 合计    | 536,747.75 |

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 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不存在流通受限情况。

#### 7.13.6 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

| 份额级别         | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额    | 持有人结构         |         |                  |        |
|--------------|----------|--------------|---------------|---------|------------------|--------|
|              |          |              | 机构投资者         |         | 个人投资者            |        |
|              |          |              | 持有份额          | 占总份额比例  | 持有份额             | 占总份额比例 |
| 上投摩根双息平衡混合A类 | 30,067   | 34,568.46    | 23,317,579.80 | 2.24%   | 1,016,052,275.36 | 97.76% |
| 上投摩根双息平衡混合H类 | 1        | 1,082,540.12 | 1,082,540.12  | 100.00% | -                | 0.00%  |
| 合计           | 30,068   | 34,603.31    | 24,400,119.92 | 2.35%   | 1,016,052,275.36 | 97.65% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别         | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 上投摩根双息平衡混合A类 | 70,339.07 | 0.0068%  |
|                  | 上投摩根双息平衡混合H类 | -         | -        |
|                  | 合计           | 70,339.07 | 0.0068%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                           | 份额级别         | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|------------------------------|--------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 上投摩根双息平衡混合A类 | 0                 |
|                              | 上投摩根双息平衡混合H类 | 0                 |
|                              | 合计           | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金              | 上投摩根双息平衡混合A类 | 0                 |
|                              | 上投摩根双息平衡混合H类 | 0                 |
|                              | 合计           | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 上投摩根双息平衡混合A类     | 上投摩根双息平衡混合H类 |
|-------------------------------|------------------|--------------|
| 基金合同生效日(2006年4月26日)<br>基金份额总额 | 6,435,738,977.50 | -            |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 1,061,320,915.61 | 692,643.66   |
| 本报告期基金总申购份额                   | 17,314,472.39    | 546,178.79   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 39,265,532.84    | 156,282.33   |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -                | -            |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 1,039,369,855.16 | 1,082,540.12 |



## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：无。

基金托管人：无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|--------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|        |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中泰证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 银河证券   | 3      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中金证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 太平洋证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 长城证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 广发证券   | 1      | 490,244,112.12 | 24.47%       | 456,565.66 | 24.47%     | -  |
| 国信证券   | 1      | 328,191,262.67 | 16.38%       | 305,643.96 | 16.38%     | -  |
| 浙商证券   | 1      | 295,243,992.12 | 14.73%       | 274,963.68 | 14.73%     | -  |
| 申万宏源证券 | 3      | 255,488,724.40 | 12.75%       | 237,933.66 | 12.75%     | -  |
| 光大证券   | 1      | 245,236,784.61 | 12.24%       | 228,388.13 | 12.24%     | -  |
| 招商证券   | 2      | 169,002,119.96 | 8.43%        | 157,382.44 | 8.43%      | -  |
| 中信建投证券 | 1      | 136,930,548.69 | 6.83%        | 127,522.50 | 6.83%      | -  |
| 东吴证券   | 1      | 59,640,197.25  | 2.98%        | 55,542.70  | 2.98%      | -  |
| 国泰君安证券 | 1      | 23,798,105.95  | 1.19%        | 22,163.16  | 1.19%      | -  |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

- 1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。
- 2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本基金本期无新增席位、注销席位。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称           | 债券交易          |                          | 回购交易 |                          | 权证交易     |                          |
|----------------|---------------|--------------------------|------|--------------------------|----------|--------------------------|
|                | 成交金额          | 占当期<br>债券成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期<br>回购成<br>交总额<br>的比例 | 成交<br>金额 | 占当期<br>权证成<br>交总额<br>的比例 |
| 中泰证券           | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 银河证券           | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 中金证券           | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 太平洋证券          | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 长城证券           | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 广发证券           | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 国信证券           | 29,559,819.20 | 26.99%                   | -    | -                        | -        | -                        |
| 浙商证券股份<br>有限公司 | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 申万宏源证券         | 22,376,057.00 | 20.43%                   | -    | -                        | -        | -                        |
| 光大证券           | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 招商证券           | 57,583,505.10 | 52.58%                   | -    | -                        | -        | -                        |
| 中信建投证券         | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 东吴证券           | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |
| 国泰君安证券         | -             | -                        | -    | -                        | -        | -                        |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式                 | 法定披露日期     |
|----|--|------------------------|------------|
| 1  | 上投摩根基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸 | 2022-01-05 |
| 2  | 上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告            | 同上                     | 2022-05-05 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根双息平衡混合型证券投资基金设立的文件；
2. 《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金托管协议》；
4. 《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

网址：[www.cifm.com](http://www.cifm.com)

### 13 补充披露

#### 补充披露1：期末基金资产组合情况

| 名称              | 数量(股)     | 公允价值(人民币元)    |
|-----------------|-----------|---------------|
| <b>(1) 股票投资</b> |           |               |
| <b>上市投资</b>     |           |               |
| <b>中国(100%)</b> |           |               |
| 紫金矿业            | 3,816,407 | 35,607,077.31 |
| 贵州茅台            | 15,600    | 31,902,000.00 |
| 保利发展            | 1,655,562 | 28,906,112.52 |
| 宁德时代            | 51,100    | 27,287,400.00 |
| 特变电工            | 923,042   | 25,282,120.38 |
| 中国核电            | 3,527,694 | 24,199,980.84 |
| 牧原股份            | 360,623   | 19,931,633.21 |
| 金地集团            | 1,252,944 | 16,839,567.36 |
| 兴业银行            | 823,697   | 16,391,570.30 |
| 兴发集团            | 358,900   | 15,788,011.00 |
| 南山铝业            | 4,247,705 | 15,674,031.45 |
| 广汽集团            | 990,300   | 15,092,172.00 |
| 旗滨集团            | 1,178,723 | 15,028,718.25 |
| 南京银行            | 1,370,590 | 14,281,547.80 |
| 多氟多             | 268,524   | 13,133,508.84 |
| 紫江企业            | 1,946,936 | 12,440,921.04 |
| 川恒股份            | 353,200   | 11,941,692.00 |
| 泸州老窖            | 47,800    | 11,784,612.00 |
| 法拉电子            | 56,705    | 11,633,597.80 |
| 美的集团            | 189,765   | 11,459,908.35 |
| 湖北宜化            | 557,995   | 11,332,878.45 |
| 建发股份            | 821,106   | 10,731,855.42 |
| 中国电建            | 1,259,323 | 9,910,872.01  |
| 中国中免            | 41,100    | 9,573,423.00  |
| 洋河股份            | 52,054    | 9,533,690.10  |
| 运达股份            | 368,497   | 9,374,563.68  |
| 双汇发展            | 294,600   | 8,631,780.00  |
| 久立特材            | 527,131   | 8,428,824.69  |
| 东方电缆            | 108,330   | 8,298,078.00  |

| 名称   | 数量(股)     | 公允价值(人民币元)   |
|------|-----------|--------------|
| 天宜上佳 | 387,158   | 8,223,235.92 |
| 明新旭腾 | 351,200   | 8,200,520.00 |
| 天顺风能 | 479,900   | 7,913,551.00 |
| 古井贡酒 | 30,730    | 7,672,051.80 |
| 新强联  | 85,000    | 7,567,550.00 |
| 山西汾酒 | 23,175    | 7,527,240.00 |
| 长安汽车 | 434,457   | 7,524,795.24 |
| 赛轮轮胎 | 640,400   | 7,217,308.00 |
| 长城汽车 | 194,600   | 7,207,984.00 |
| 常熟汽饰 | 436,300   | 7,207,676.00 |
| 五洲新春 | 438,288   | 6,955,630.56 |
| 宁波银行 | 193,041   | 6,912,798.21 |
| 北大荒  | 456,000   | 6,730,560.00 |
| 海尔智家 | 241,653   | 6,635,791.38 |
| 云天化  | 206,700   | 6,506,916.00 |
| 新洋丰  | 377,200   | 6,370,908.00 |
| 万科A  | 296,654   | 6,081,407.00 |
| 华阳股份 | 359,600   | 5,559,416.00 |
| 顾家家居 | 95,420    | 5,403,634.60 |
| 青岛啤酒 | 51,068    | 5,306,986.56 |
| 中国移动 | 87,363    | 5,264,494.38 |
| 中国交建 | 564,100   | 5,234,848.00 |
| 方大特钢 | 738,063   | 5,159,060.37 |
| 桃李面包 | 294,520   | 4,874,306.00 |
| 伊利股份 | 124,500   | 4,849,275.00 |
| 常熟银行 | 632,200   | 4,830,008.00 |
| 新泉股份 | 165,740   | 4,806,460.00 |
| 兖矿能源 | 119,600   | 4,721,808.00 |
| 中国巨石 | 267,900   | 4,664,139.00 |
| 爱柯迪  | 277,000   | 4,537,260.00 |
| 万华化学 | 45,844    | 4,446,409.56 |
| 荣盛石化 | 287,397   | 4,423,039.83 |
| 湖北能源 | 864,600   | 4,418,106.00 |
| 道氏技术 | 170,000   | 4,416,600.00 |
| 内蒙华电 | 1,204,600 | 4,396,790.00 |

| 名称                | 数量(股)   | 公允价值(人民币元)            |
|-------------------|---------|-----------------------|
| 兰花科创              | 267,000 | 4,392,150.00          |
| 比亚迪               | 9,559   | 3,187,830.91          |
| 大金重工              | 69,290  | 2,891,471.70          |
| 山东海化              | 280,000 | 2,844,800.00          |
| 保隆科技              | 56,900  | 2,798,911.00          |
| 海康威视              | 71,785  | 2,598,617.00          |
| 桐昆股份              | 130,850 | 2,077,898.00          |
| 华峰铝业              | 73,800  | 974,160.00            |
| 西藏珠峰              | 30,900  | 886,830.00            |
| 中国神华              | 26,360  | 877,788.00            |
| 济川药业              | 3,513   | 95,413.08             |
| 菱电电控              | 424     | 61,238.32             |
| 福元医药              | 1,749   | 36,816.45             |
| 腾远钴业              | 266     | 23,360.12             |
| 山煤国际              | 993     | 19,323.78             |
| 天华超净              | 145     | 12,673.00             |
| 联合精密              | 409     | 11,337.48             |
| 喜悦智行              | 341     | 7,689.55              |
| <b>合计</b>         |         | <b>693,989,020.60</b> |
| <b>(2) 债券投资</b>   |         |                       |
| <b>上市投资</b>       |         |                       |
| <b>中国 (100%)</b>  |         |                       |
| 21 国债 10          | 895,480 | 91,253,828.07         |
| 22 国债 01          | 575,560 | 58,201,967.55         |
| 21 桂林银行三农债 02     | 300,000 | 31,260,085.48         |
| 16 油服 04          | 190,000 | 19,372,217.81         |
| <b>合计</b>         |         | <b>200,088,098.91</b> |
| <b>总投资资产</b>      |         |                       |
|                   |         | <b>894,077,119.51</b> |
| <b>银行存款和结算备付金</b> |         | <b>55,076,754.13</b>  |
| <b>其他各项资产</b>     |         | <b>536,747.75</b>     |
| <b>资产合计</b>       |         | <b>949,690,621.39</b> |



补充披露2：投资组合变动表

| 序号 | 证券类别 | 占基金资产净值的比例(%)<br>2022年6月30日 | 占基金资产净值的比例(%)<br>2021年12月31日 |
|----|------|-----------------------------|------------------------------|
| 1  | 股票   | 74.18                       | 67.81                        |
| 2  | 债券   | 21.39                       | 22.77                        |

上投摩根基金管理有限公司

二〇二二年八月三十一日

[www.jpmorgan.com/hk/am/](http://www.jpmorgan.com/hk/am/)