

上投摩根双债增利债券型证券投资基金

招募说明书（更新）摘要

基金生效日期：[2013年12月11日]

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

重要提示：

1. 投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读招募说明书；
2. 基金的过往业绩并不预示其未来表现；
3. 本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。
4. 基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。
5. 基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。
6. 本招募说明书摘要所载内容截止日为2020年7月5日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2020年3月31日。

二〇二〇年七月

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称：上投摩根基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

法定代表人：陈兵

总经理：王大智

成立日期：2004 年 5 月 12 日

实缴注册资本：贰亿伍仟万元人民币

电话：8621-38794999

股东名称、股权结构及持股比例：

上海国际信托有限公司	51%
JPMorgan Asset Management (UK) Limited	49%

上投摩根基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2004]56 号文批准，于 2004 年 5 月 12 日成立的合资基金管理公司。2005 年 8 月 12 日，基金管理人完成了股东之间的股权变更事项。公司注册资本保持不变，股东及出资比例分别由上海国际信托有限公司 67%和摩根富林明资产管理（英国）有限公司 33%变更为目前的 51%和 49%。

2006 年 6 月 6 日，基金管理人的名称由“上投摩根富林明基金管理有限公司”变更为“上投摩根基金管理有限公司”，该更名申请于 2006 年 4 月 29 日获得中国证监会的批准，并于 2006 年 6 月 2 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

2009 年 3 月 31 日，基金管理人的注册资本由一亿五千万人民币增加到二亿五千万人民币，公司股东的出资比例不变。该变更事项于 2009 年 3 月 31 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何受处罚记录。

(二)主要人员情况

1. 董事会成员基本情况:

董事长: 陈兵

博士研究生, 高级经济师。

曾任上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理, 上海浦东发展银行总行资金财务部总经理助理, 上海浦东发展银行总行个人银行总部管理会计部、财富管理部总经理, 上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书, 上海国际信托有限公司党委副书记、总经理。

现任上海国际信托有限公司党委书记、总经理; 上投摩根基金管理有限公司董事长。

董事: Paul Bateman

大学本科学位。

曾任 Chase Fleming Asset Management Limited 全球总监、摩根资产管理全球投资管理业务行政总裁。

现任摩根资产管理全球主席、资产管理营运委员会成员及投资委员会成员。

董事: Daniel J. Watkins

学士学位。

曾任欧洲业务副首席执行官、摩根资产欧洲业务首席运营官、全球投资管理运营总监、欧洲运营总监、欧洲注册登记业务总监、卢森堡运营总监、欧洲注册登记业务及伦敦投资运营经理、富林明投资运营团队经理等职务。

现任摩根资产管理亚洲业务首席执行官、资产管理运营委员会成员、集团亚太管理团队成员。

董事: Richard Titherington

牛津大学政治、哲学和经济硕士学位。

曾任摩根资产管理环球新兴市场股票投资部总监。

现任摩根资产管理董事总经理、新兴市场及亚太股票组别投资总监。

董事: 王大智

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾地区负责人。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

董事：陈海宁

研究生学历、经济师。

曾任上海浦东发展银行金融部总经理助理、公投总部贸易融资部总经理、武汉分行副行长、武汉分行党委书记、行长、总行资产负债管理部总经理。

现任上海浦东发展银行总行信息科技部总经理。

董事：丁蔚

硕士研究生。

曾就职于中国建设银行上海分行个人银行业务部副总经理，上海浦东发展银行个人银行总部银行卡部总经理，个人银行总部副总经理兼银行卡部总经理。

现任上海浦东发展银行总行零售业务部总经理。

董事：林仪桥

硕士研究生、会计师、经济师。

曾任浦发银行总行资金总部投资组合业务部总经理助理，浦发银行总行金融市场部总经理助理，海口分行行长助理(挂职)，浦发银行总行金融机构部总经理助理。

现任浦发银行总行金融机构部副总经理和金融市场部（深圳）副总经理。

独立董事：刘红忠

国际金融系经济学博士。

现任复旦大学经济学院教授，复旦大学金融研究中心副主任；同时兼任申银万国期货有限责任公司、东海期货有限责任公司、兴业证券股份有限公司、交银国际信托有限公司独立董事和锦江国际集团有限公司外部董事。

独立董事：汪棣

美国加州大学洛杉矶分校金融专业工商管理硕士学位，并先后获得美国加州注册会计师执照和中国注册会计师证书。

曾担任普华永道金融服务部合伙人及普华永道中国投资管理行业主管合伙人。

现担任招商证券股份有限公司、复星联合健康保险股份有限公司、亚太财产保险有限公司及51信用卡有限公司独立董事、中国台湾旭昶生物科技股份有限公司监事。

独立董事：曾翀

英国特许公认会计师公会资深会员。

曾任香港赛马会集团财务总监，香港证监会产品咨询委员会委员，协康会名誉司库和执

行委员会和投资小组委员会成员，戴麟趾爵士康乐基金、警察子女教育信托基金和警察教育及福利信托基金投资咨询委员会主席，香港房屋协会资金管理特设委员会成员，以及另类投资管理协会（AIMA）全球投资者指导委员会成员。

现为独立顾问，宝积资本控股有限公司独立非执行董事以及安联环球投资香港有限公司兼职顾问。

独立董事：王学杰

华东政法大学法学学士、日本帝京大学民商法专业博士前期学位。

曾在日本 Sunroute 公司海外业务室专门从事有关亚太地区市场发展和设立企业的日常法律顾问工作。

现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人、律师。

2. 监事会成员基本情况：

监事：梁斌

学士学位。

曾在高伟绅律师事务所（香港）任职律师多年。

现任摩根大通集团中国法律总监。

监事：张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监。

现任上投摩根基金管理有限公司投资董事，管理上投摩根亚太优势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和上投摩根全球多元配置证券投资基金（QDII）。

监事：万隽宸

曾任上海国际集团有限公司高级法务经理，上投摩根基金管理有限公司首席风险官，尚腾资本管理有限公司董事。

现任尚腾资本管理有限公司总经理。

3. 总经理基本情况：

王大智先生，总经理

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾

区负责人。

4. 其他高级管理人员情况：

杨红女士，副总经理

毕业于同济大学，获技术经济与管理博士

曾任招商银行上海分行稽核监督部业务副经理、营业部副经理兼工会主席、零售银行部副总经理、消费信贷中心总经理；曾任上海浦东发展银行上海分行个人信贷部总经理、个人银行发展管理部总经理、零售业务管理部总经理。

杜猛先生，副总经理

毕业于南京大学，获经济学硕士学位。

历任天同证券、中原证券、国信证券、中银国际研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、基金经理、总经理助理/国内权益投资一部总监兼资深基金经理。

孙芳女士，副总经理

毕业于华东师范大学，获世界经济学硕士学位。

历任华宝兴业基金研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、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。

郭鹏先生，副总经理

毕业于上海财经大学，获企业管理硕士学位。

历任上投摩根基金管理有限公司市场经理、市场部副总监，产品及客户营销部总监、市场部总监兼互联网金融部总监、总经理助理。

刘鲁旦先生，副总经理

博士研究生。

历任华夏基金管理有限公司固定收益总监、中国国际金融股份有限公司资产管理部固定收益总监/董事总经理。

邹树波先生，督察长

获管理学学士学位。

曾任天健会计师事务所高级项目经理，上海证监局主任科员，上投摩根基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监。

卢蓉女士，首席信息官

硕士研究生。

曾任第一创业摩根大通证券有限责任公司(现更名为第一创业证券承销保荐有限责任公司)信息技术部负责人、嘉实基金管理有限公司投研体系首席信息官。

5. 本基金基金经理

唐璐女士,英国爱丁堡大学硕士,2008年2月至2010年4月任JPMorgan(EMEA)分析师,2011年3月加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任研究员、基金经理助理、基金经理,自2015年5月至2018年11月担任上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2015年12月至2020年5月担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理,自2015年12月至2018年9月担任上投摩根轮动添利债券型证券投资基金基金经理,自2016年5月起同时担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理,自2016年6月起同时担任上投摩根分红添利债券型证券投资基金及上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金经理,2016年8月至2018年9月担任上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2017年1月起同时担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理,2017年1月至2018年10月担任上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理,自2018年2月至2020年5月同时担任上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理,2018年2月至7月担任上投摩根安腾回报混合型证券投资基金基金经理,自2019年4月起同时担任上投摩根优信增利债券型证券投资基金和上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金基金经理,自2019年8月起同时担任上投摩根瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理。

杨鑫先生,上海交通大学硕士,现任债券投资部副总监兼资深基金经理。杨鑫先生自2005年9月至2010年8月,在东航财务公司任职;2010年9月至2017年5月,在银河基金管理有限公司历任债券研究员、固定收益部债券经理、固定收益部基金经理;2017年6月至2018年6月,在富国基金管理有限公司拟任基金经理;2018年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,历任专户投资二部副总监兼资深投资经理,现任债券投资部副总监兼资深基金经理。自2020年1月起任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理,自2020年4月起同时担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金及上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理杨成先生,其任职日期为2013年12月11日至2015年4月22日。历任基金经理马毅先生,其任职日期为2014年3月20日至2015年12月23日。历任基金经理帅虎先生,其任职日期为2014年11月17日至2018年6月22日。历任基金经理刘阳女士,其任职日期为2015年12月18日至2019年8月29日。

6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

杜猛，副总经理兼投资总监；孙芳，副总经理兼投资副总监；刘鲁旦，副总经理兼债券投资总监；张军，投资董事、国际投资部总监、投资绩效评估总监兼高级基金经理；朱晓龙，研究部总监兼基金经理；陈圆明，绝对收益投资部总监兼基金经理；聂曙光，债券投资部总监兼资深基金经理；孟晨波，总经理助理/货币市场投资部总监兼资深基金经理；任翔，固收研究部总监兼基金经理；钟维伦，资深投资经理；刘凌云，组合基金投资部总监兼基金经理；张文峰，组合基金投资部副总监兼投资经理；孟鸣，基金经理兼资深投资组合经理；叶承焘，投资经理；陈晨，投资经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，

服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 310 名，其中具有高级职称的专家 60 名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2020 年 6 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 529 只。

三、相关服务机构

(一) 基金销售机构:

1. 直销机构: 上投摩根基金管理有限公司(同上)

2. 代销机构:

(1) 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 田国立

客户服务电话: 95533

网址: www.ccb.com

(2) 中国农业银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 周慕冰

客户服务电话: 95599

网址: www.abchina.com

(3) 中国银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 刘连舸

客服电话: 95566

网址: www.boc.cn

(4) 招商银行股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址: 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法人代表: 李建红

客户服务中心电话: 95555

网址: www.cmbchina.com

(5) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：王菁

客户服务热线：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(6) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

客户服务热线：95528

网址：www.spdb.com.cn

(7) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

客户服务统一咨询电话：95511转3

网址：www.bank.pingan.com

(8) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：杨玉成

客服电话：95523

网址：www.swhysc.com

(9) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：021-962518

网址：www.shzq.com

(10) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区新闻路 669 号 博华大厦 21 楼

法定代表人：贺青

客户服务咨询电话：95521

网址：www.gt.ja.com

(11) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

(12) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：闫峻(代行)

客服热线：95525

网址：www.ebscn.com

(13) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008888888

网址：www.chinastock.com.cn

(14) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务咨询电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

(15) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

(16) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：翁振杰

客户服务电话：4008188118

网址：www.guodu.com

(17) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(18) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客户服务热线：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(19) 中信证券（山东）有限责任公司

注册和办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人：姜晓林

客户服务电话：95548

公司网址：www.sd.citics.com

(20) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：黄炎勋

客服电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

(21) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

长江证券客户服务网站：www.95579.com

(22) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人：何之江

客服电话：95511-8

网址：www.stock.pingan.com

(23) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(24) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网站： www.noah-fund.com

(25) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 11 号邮电新闻大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-818-8000

公司网站： www.myfund.com

(26) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

客户服务电话：400-817-5666

(27) 上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-799-1888

网址： www.520fund.com.cn

(28) 上海基煜基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

咨询电话：400-820-5369

网站： www.jiyufund.com.cn

(29) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

公司网址：www.harvestwm.cn

(30) 国金证券股份有限公司

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

(31) 中信期货有限公司

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层

1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

电话：400-990-8826

网站：www.citicsf.com

(32) 中国人寿保险股份有限公司

办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：王滨

客服电话：95519

公司网址：www.e-chinalife.com

(33) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客户服务热线：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

(34) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

(35) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网站：www.zlfund.cn www.jjmmw.com

(36) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6 楼

法定代表人：祖国明

客服电话：400-0766-123

公司网站：www.fund123.cn

(37) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

网站：www.1234567.com.cn

(38) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：凌顺平

客服电话：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

(39) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：胡学勤

客服电话：400-821-9031

网站：www.lufunds.com

(40) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

法定代表人：何静

客服电话：400-618-0707

网站：www.hongdianfund.com

(41) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网站：www.yingmi.cn

(42) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

网站：www.xincai.com

(43) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市通州区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层

法定代表人：王苏宁

客服电话：95118

网址：kenterui.jd.com

(44) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

客服电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

(45) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

(46) 北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼

法定代表人：葛新

客户服务热线：95055

公司网站：www.baiyingfund.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示。

(二) 登记机构

名称：上投摩根基金管理有限公司（同上）

(三) 律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

联系电话：021-5115 0298

传真：021-5115 0398

经办律师：刘佳、张兰

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

四、基金概况

基金名称：上投摩根双债增利债券型证券投资基金

基金类型：契约型开放式

五、基金份额的申购、赎回和转换

1. 基金申购份额的计算

申购费用 = (申购金额 × 申购费率) / (1 + 申购费率)

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

申购费率如下表所示：

A 类基金份额：

申购金额区间	费率
人民币 100 万以下	0.8%
人民币 100 万以上（含），500 万以下	0.4%
人民币 500 万以上（含）	每笔人民币 1,000 元

C 类基金份额申购费率为 0。

2. 基金赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回费率如下表所示：

A类基金份额：

持有基金份额期限	费率
小于七日	1.5%
大于等于七日小于一年	0.1%
大于等于一年小于两年	0.05%
两年以上（含）	0%

C类基金份额：

持有基金份额期限（N）	费率
N<7天	1.5%
7天≤N<30天	0.3%
N≥30天	0%

3. 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

六、基金的投资

（一）投资目标

本基金以信用债和可转债为主要投资对象，在有效控制风险的基础上，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的

金融工具，包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、权证等权益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于信用债和可转债（含分离交易可转债）的比例合计不低于非现金基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金所指信用债，是指金融债(不含政策性金融债)、公司债、企业债、短期融资券、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、资产支持证券等除国债、中央银行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具。

本基金可参与一级市场新股申购或增发，也可以直接在二级市场上买入股票、权证等权益类证券，并可持有由可转债转股获得的股票、因所持股票派发以及因投资可分离债券而产生的权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（三）投资策略

1. 大类资产配置策略

大类资产配置是资产管理的重要环节。大类资产配置策略试图基于投资者的投资目标、风险忍受度等，平衡投资组合的可投资品种（股票、债券和现金等）的风险收益特征，减少市场波动对组合的影响。不同的资产配置策略体现了不同投资组合的投资风格。本基金将判断宏观经济周期所处阶段，并依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则。

2. 债券投资策略

（1）债券类属配置策略

本基金将对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，评估不同债券板块之间的相对投资价值，确定债券类属配置策略，并根据市场变化及时进行调整。

（2）久期管理策略

本基金将基于对市场利率的变化趋势的预判，相应的调整债券组合的久期。本基金通过对影响债券投资的宏观经济变量和宏观经济政策等因素的综合分析，预测未来的市场利率的变动趋势，判断债券市场对上述因素及其变化的反应，并据此积极调整债券组合的久期。在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

（3）收益率曲线策略

本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。

（4）信用策略

本基金将深入挖掘信用债的投资价值，在承担适度风险的前提下追求较高收益。本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估，并结合外部评级机构的信用评级，分析违约风险以及合理信用利差水平，判断债券的投资价值，谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用债进行投资。

（5）可转债投资策略

可转债是指由公司发行的，投资者在一定时期内可选择一定条件转换成公司股票的公司债券。可转债同时具备了普通股票所不具备的债券特性和普通债券不具备的股票特性。本基金在进行可转债投资时将根据不同市场环境下可转债自身的股票特征、债券特性、流动性等基本要素，判断其股性和债性的相对价值，把握其价值走向，精选个券，从而获取较高的收益。

本基金还将积极跟踪可转换债券基本面的变化情况，如对应公司的业绩情况以及可能出现的下调转股价机会，寻找最佳的投资时机。此外，对于发行条款、票息、内嵌期权价值较高且公司基本面优良的可转换债券，因其内在价值较高，反映到二级市场上，会产生较大的

一、二级市场价差。因此，本基金还将积极关注可转换债券在一、二级市场上可能存在的价差所带来的投资机会，在严格控制风险的前提下，参与可转换债券的一级市场申购，获得稳定收益。

（6）回购策略

本基金将通过对回购利率和现券收益率以及其他投资品种收益率的比较，通过回购融入短期资金滚动操作，投资于收益率高于回购成本的债券以及其他获利机会，从而获得杠杆放大收益，并根据市场利率水平以及对利率期限结构的预期等，对回购放大的杠杆比例适时进行调整。

（7）中小企业私募债券投资策略

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，其中，投资决策流程和风险控制制度需经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

本基金对中小企业私募债的投资主要从自上而下判断景气周期和自下而上精选标的两个角度出发，通过自上而下的宏观环境分析、市场指标分析结合自下而上的基本面分析和估值分析，精选个券构建组合。为了提高对私募债券的投资效率，严格控制投资的信用风险，在个券甄选方面，本基金将通过信用调查方案对债券发行主体的信用状况进行分析。

（8）资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制组合投资风险的前提下投资于资产支持证券。本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。

3. 股票投资策略

本基金秉持内在价值至上的投资理念，深入分析中国经济发展的价值型驱动因素，运用安全边际策略有效挖掘价值低估的各类投资品种。本基金在控制宏观经济趋势、产业发展周期等宏观经济环境变量基础上，考察公司的商业模式、管理能力、财务状况等影响企业持续经营的因素。然后综合运用量化价值模型来衡量公司的价格是高估还是低估：根据不同的产业和行业特征，本基金将有针对性地选用不同的 P/B、P/E 等乘数法和 DCF 增长模型建立股票选择池。

（1）宏观经济分析

基于对宏观经济运行状况及政策分析、金融货币运行状况及政策分析、行业运行景气状况及政策分析的基础上，重点判断宏观经济周期对市场不同行业的影响，作为资产配置的依据。

（2）行业分析

将根据各行业所处生命周期、产业竞争结构、近期发展趋势等方面因素对各行业的相对盈利能力及投资吸引力进行评价，考察净资产收益率、营运周期、销售收入、净利润等指标，对各行业投资机会进行评估，并根据行业综合评价结果确定股票资产中各行业的权重。

（3）公司质地分析

企业在行业中的相对竞争力是决定企业成败和投资价值的关键，本基金将根据公司质地对上市公司当前和未来的竞争优势加以评估。公司质地良好的企业通常具备以下特征：企业在管理、品牌、资源、技术、创新能力中的某一方面或多个方面具有竞争对手在短时间内难以模仿的显著优势，从而能够获得超越行业平均的盈利水平和增长速度。本基金将通过包括实际调研在内的多种分析手段，对上市公司质地进行判断。

（4）估值水平分析

上市公司经过竞争优势指标筛选之后，将由研究团队进行估值水平考察。通过基本面和估值指标筛选的基础组合即被纳入公司策略性评价体系。本基金在对股票进行估值时，首先采用现金流折现模型(DCF)计算出股票的内在价值，其次在第二阶段采用乘法法(Multiple)，通过对对同行业公司的情况对样本公司价值进行比较修正，使得对于股票价值的评估更加准确可靠。

4. 投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%；

（2）本基金投资于信用债和可转债（含分离交易可转债）的比例合计不低于非现金基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；

（3）本基金保持不低于基金资产净值 5%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；

（4）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

- (5) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (6) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (7) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (13) 本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金持有一家企业发行的中小企业私募债，不得超过该债券的 10%；
- (14) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- (16) 本基金投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。
- 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (17) 本基金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的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- (18) 本基金管理人管理的全部开放式基金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%；本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%；
- (19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理

人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例或投资限制的，除上述（3）、（12）、（16）、（17）条所述情况外，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金不再受相关限制，不需要经基金份额持有人大会审议。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- 5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- 6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

（五）业绩比较基准

中证综合债券指数。

中证综合债券指数涵盖了在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间债券市场交易、信用评级在投资级以上的国债、金融债、企业债、央票及短期融资券，具有一定的投资代表性。基于指数的权威性和代表性以及本基金的投资范围和投资理念，选用该业绩比较基准能够真实、客观的反映本基金的风险收益特征。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用本基金，基金管理人可根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，在征得基金托管人同意、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

（六）风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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。

(七) 基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；

2. 有利于基金财产的安全与增值；

3. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益；

4. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理。

(八) 基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(九) 基金的投资组合报告

9.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,462,721.98	12.82
	其中：股票	5,462,721.98	12.82
2	固定收益投资	33,553,575.39	78.75
	其中：债券	33,553,575.39	78.75
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	484,891.80	1.14
7	其他各项资产	3,108,783.66	7.30
8	合计	42,609,972.83	100.00

9.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

9.2.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	398,327.00	1.20
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,492,114.98	13.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	294,316.00	0.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	132,069.60	0.40
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	145,894.40	0.44
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	5,462,721.98	16.52

9.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000876	新希望	7,660	240,753.80	0.73
2	002847	盐津铺子	4,220	235,687.00	0.71
3	603520	司太立	3,700	218,226.00	0.66
4	002714	牧原股份	1,700	207,757.00	0.63
5	300498	温氏股份	5,900	190,570.00	0.58
6	603638	艾迪精密	5,360	188,672.00	0.57
7	300122	智飞生物	2,720	183,300.80	0.55
8	603737	三棵树	1,980	175,982.40	0.53
9	000977	浪潮信息	4,361	169,119.58	0.51
10	300014	亿纬锂能	2,900	168,519.00	0.51

9.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	896,040.00	2.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,813,500.00	5.48
	其中：政策性金融债	1,813,500.00	5.48
4	企业债券	22,624,543.70	68.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,219,491.69	24.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,553,575.39	101.46

9.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	136040	15 石化 02	20,000	2,019,400.00	6.11
2	136130	16 葛洲 01	20,000	2,011,200.00	6.08
3	018007	国开 1801	18,000	1,813,500.00	5.48
4	143234	17 陕煤 01	16,000	1,613,760.00	4.88
5	122425	15 际华 01	16,000	1,611,520.00	4.87

9.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

9.7 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。

9.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.10 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。

9.11 投资组合报告附注

9.11.1 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。

9.11.2 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。

9.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,726.27
2	应收证券清算款	2,734,289.42
3	应收股利	-
4	应收利息	348,701.37
5	应收申购款	20,066.60

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,108,783.66

9.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113021	中信转债	568,540.00	1.72
2	113008	电气转债	532,349.40	1.61
3	110053	苏银转债	466,627.20	1.41
4	113508	新风转债	451,648.80	1.37
5	110045	海澜转债	432,282.80	1.31
6	113012	骆驼转债	426,695.60	1.29
7	128058	拓邦转债	407,844.22	1.23
8	113011	光大转债	351,300.00	1.06
9	113026	核能转债	339,602.20	1.03
10	113025	明泰转债	338,580.00	1.02
11	128022	众信转债	334,880.00	1.01
12	127012	招路转债	333,194.40	1.01
13	113009	广汽转债	332,554.80	1.01
14	113024	核建转债	332,293.50	1.00
15	123027	蓝晓转债	322,245.00	0.97
16	110048	福能转债	317,747.50	0.96
17	128032	双环转债	314,311.47	0.95
18	128048	张行转债	276,148.50	0.84
19	110038	济川转债	176,228.80	0.53
20	113516	苏农转债	151,452.00	0.46
21	128046	利尔转债	115,260.00	0.35
22	123004	铁汉转债	112,815.90	0.34
23	113027	华钰转债	110,404.80	0.33
24	110043	无锡转债	100,012.20	0.30
25	110041	蒙电转债	72,819.20	0.22

9.11.5 报告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。

9.11.6 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。

七、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、上投摩根双债增利债券A类：阶段	净值增长率①	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
基金成立日—2013/12/31	0.30%	0.04%	-0.20%	0.05%	0.50%	-0.01%
2014/1/1—2014/12/31	20.84%	0.34%	9.41%	0.16%	11.43%	0.18%
2015/1/1—2015/12/31	19.17%	0.79%	6.08%	0.07%	13.09%	0.72%
2016/1/1—2016/12/31	1.81%	0.39%	2.12%	0.08%	-0.31%	0.31%

2017/1/1 -2017/12 /31	-1.94%	0.24%	0.28%	0.05%	-2.22%	0.19%
2018/1/1 -2018/12 /31	-0.79%	0.26%	8.12%	0.06%	-8.91%	0.20%
2019/1/1 -2019/12 /31	9.89%	0.16%	4.67%	0.05%	5.22%	0.11%
2020/1/1 -2020/3/ 31	0.91%	0.31%	2.58%	0.10%	-1.67%	0.21%

2、上投摩 根双债增 利债券C 类：阶段	净值增长 率①	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
基金成立 日— 2013/12/ 31	0.30%	0.04%	-0.20%	0.05%	0.50%	-0.01%
2014/1/1 -2014/12 /31	20.29%	0.34%	9.41%	0.16%	10.88%	0.18%
2015/1/1 -2015/12 /31	19.28%	0.79%	6.08%	0.07%	13.20%	0.72%
2016/1/1 -2016/12	1.33%	0.39%	2.12%	0.08%	-0.79%	0.31%

/31						
2017/1/1						
-2017/12	-2.43%	0.24%	0.28%	0.05%	-2.71%	0.19%
/31						
2018/1/1						
-2018/12	-1.10%	0.26%	8.12%	0.06%	-9.22%	0.20%
/31						
2019/1/1						
-2019/12	9.38%	0.16%	4.67%	0.05%	4.71%	0.11%
/31						
2020/1/1						
-2020/3/31	0.83%	0.31%	2.58%	0.10%	-1.75%	0.21%

八、基金费用概览

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、销售服务费；
- 9、基金的证券账户开户费用和银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.4%年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定

节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3—7、9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费和销售服务费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

九、招募说明书更新部分说明

上投摩根双债增利债券型证券投资基金于2013年12月11日成立。现依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对2020年4月28日公告的《上投摩根双债增利债券型证券投资基金招募说明书（更新）》进行内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1. 在重要提示中，更新内容截止日为2020年7月5日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2020年3月31日。
2. 在“二、释义”中，对银行业监督管理机构的定义进行了更新。
3. 在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中，对董事、独立董事、监事、高级管理人员以及基金经理等信息进行了更新。

4. 在“三、基金管理人”的“内部控制制度”中，对基金管理人的风险管理体系的信息进行了更新。
5. 在“四、基金托管人”中，对基金托管人的信息进行了更新。
6. 在“五、相关服务机构”中，对代销机构的信息进行了更新。
7. 在“八、基金的投资”的“风险收益特征”中，对风险收益特征相关内容进行了修改。
8. 在“八、基金的投资”的“基金的投资组合报告”中，根据本基金实际运作情况更新了最近一期投资组合报告的内容。
9. 在“九、基金的业绩”中，根据基金的实际运作情况，对本基金成立以来的业绩进行了说明。
10. 在“二十二、其他应披露事项”章节，对本披露期内的重大事项进行了披露。

上投摩根基金管理有限公司

2020年7月