

重要提示：基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

上投摩根双息平衡混合型证券投资基金

2007年年度报告摘要

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

一、基金简介
(一)基金名称
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：双息平衡
基金代码：370101

四、基金投资组合
(一)基金资产配置
截至2007年12月31日，基金资产总额为1,159,719,464.67元，其中投资于股票资产的比例为10.26%...

一、股票资产
(一)基金资产配置
截至2007年12月31日，基金资产总额为1,159,719,464.67元，其中投资于股票资产的比例为10.26%...

二、基金业绩
截至2007年12月31日，基金净值增长率为118.81%，同期业绩比较基准收益率为10.03%...

资产负债表
截至2007年12月31日
资产：银行存款 415,221,047.37, 债券投资 6,637,038,201.86, 股票投资 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

二、基金业绩
截至2007年12月31日，基金净值增长率为118.81%，同期业绩比较基准收益率为10.03%...

主要财务指标
2007年
1. 本期利润 5,660,780.10922(元)
2. 本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 5,021,668.76381(元)

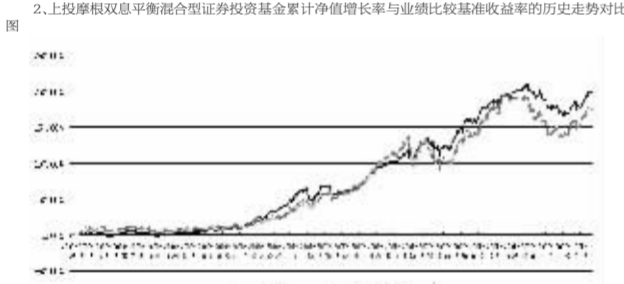
资产负债表续
截至2007年12月31日
负债：应付债券 38,975,562.78, 应付利息 9,191,746.69, 应付股利 1,531,367.73, 其他 4,481,879.39

三、基金管理人、基金托管人、基金销售机构
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

净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② ①-② ③-④

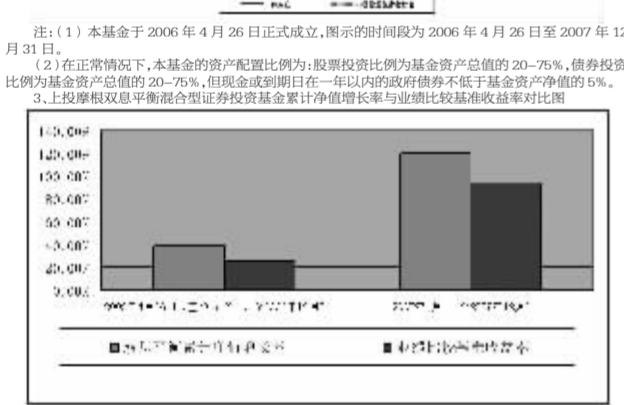
资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

四、基金管理人、基金托管人、基金销售机构
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



资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

五、基金管理人、基金托管人、基金销售机构
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



资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

六、基金管理人、基金托管人、基金销售机构
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

基金资产净值
截至2007年12月31日
基金资产净值 1,159,719,464.67元

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

七、基金管理人、基金托管人、基金销售机构
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

基金资产净值
截至2007年12月31日
基金资产净值 1,159,719,464.67元

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

八、基金管理人、基金托管人、基金销售机构
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

基金资产净值
截至2007年12月31日
基金资产净值 1,159,719,464.67元

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

九、基金管理人、基金托管人、基金销售机构
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

基金资产净值
截至2007年12月31日
基金资产净值 1,159,719,464.67元

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

十、基金管理人、基金托管人、基金销售机构
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

资产负债表
截至2007年12月31日
资产：银行存款 415,221,047.37, 债券投资 6,637,038,201.86, 股票投资 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
负债：应付债券 38,975,562.78, 应付利息 9,191,746.69, 应付股利 1,531,367.73, 其他 4,481,879.39

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02

资产负债表续
截至2007年12月31日
所有者权益：未分配利润 1,806,730,220.11, 其他 129,768,674.02