

中海上证 380 指数证券投资基金 2012 年年度报告

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 月 30 日

§ 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。本年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 26 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。

本报告期自 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)起至 2012 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3 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.....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	51
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	51
8.9 投资组合报告附注.....	51
§9 基金份额持有人信息	52

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
§10 开放式基金份额变动	53
§11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
11.2 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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	56
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中海上证 380 指数证券投资基金
基金简称	中海上证 380 指数
基金主代码	399011
交易代码	399011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 3 月 7 日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	87,068,082.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险控制手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，年跟踪误差力争控制在 4% 以内，以实现对上证 380 指数的有效跟踪。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，按照成份股在上证 380 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪上证 380 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪上证 380 指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>1、股票投资策略：本基金通过完全复制指数的方法，根据上证 380 指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。</p> <p>2、债券投资策略：本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择，同时考虑基金的流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。</p>
业绩比较基准	上证 380 指数收益率 \times 95% + 商业银行活期存款利率 (税后) \times 5%
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、

	较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
--	---

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		中海基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王莉	赵会军
	联系电话	021-38429808	010-66105799
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9788、 021-38789788	95588
传真		021-68419525	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		黄鹏	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	江苏公证天业会计师事务所有限公司	无锡市梁溪路 28 号
注册登记机构	中海基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2012 年 3 月 7 日	2011 年	2010 年
---------------	----------------	--------	--------

	(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日		
本期已实现收益	-3,592,768.45	-	-
本期利润	-10,281,938.37	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0813	-	-
本期加权平均净值利润率	-8.53%	-	-
本期基金份额净值增长率	-10.40%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-9,058,842.55	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.1040	-	-
期末基金资产净值	78,009,240.10	-	-
期末基金份额净值	0.896	-	-
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	-10.40%	-	-

注 1: 本报告期指自 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

注 2: 以上所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、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注 3: 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。

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

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
过去三个月	1.36%	1.23%	2.21%	1.27%	-0.85%	-0.04%
过去六个月	-6.47%	1.25%	-5.22%	1.28%	-1.25%	-0.03%
自基金合同生效日起至 今	-10.40%	1.11%	-11.53%	1.27%	1.13%	-0.16%

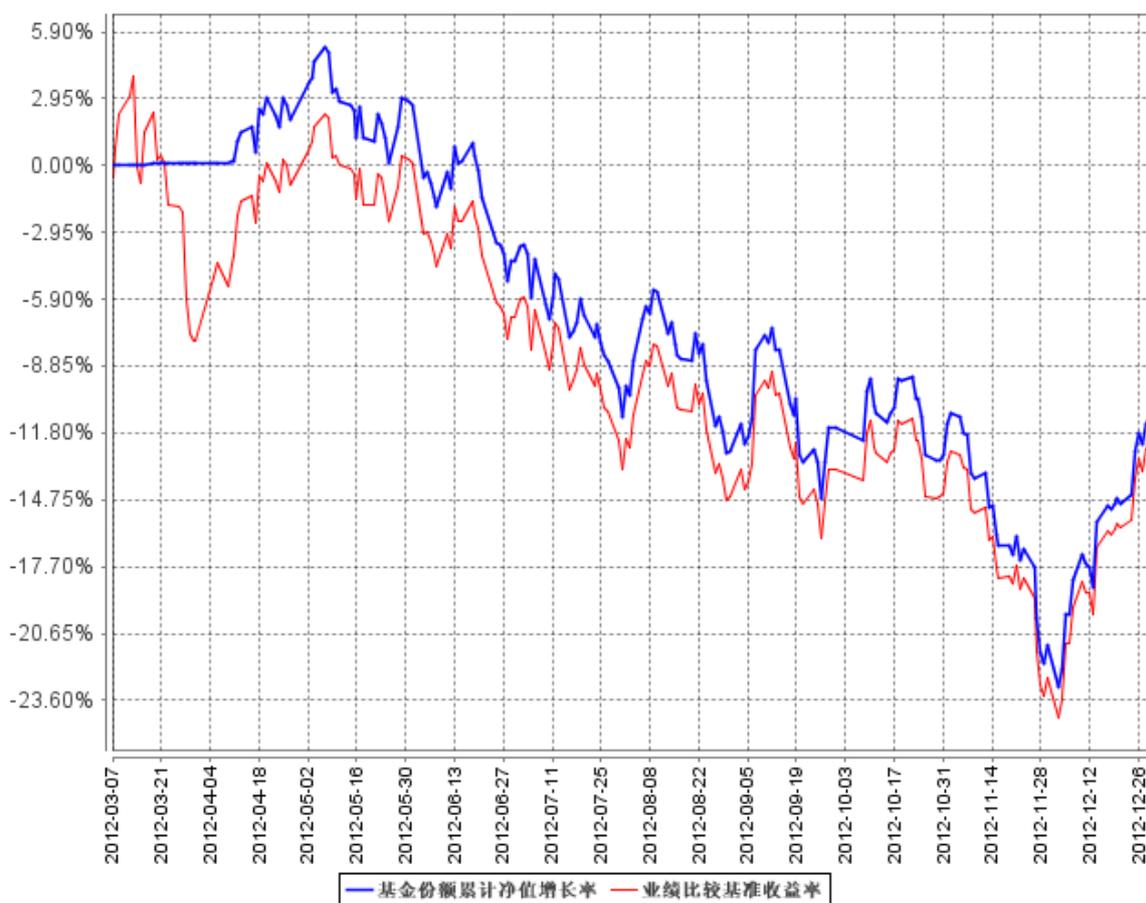
注 1: “自基金合同生效起至今”指 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

注 2: 本基金的业绩比较基准为: 上证 380 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%, 由于本基金为上证 380 指数基金, 指数化投资比例最高为 95%, 因此我们选取上证 380 指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为 90%-95%, 在一般市场状况下, 本基金股票投资比例保持在 95%左右, 日常现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值

的 5%。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重，以使业绩比较更加合理。本基金业绩基准指数每日按照 95%、5%的比例对基础指数和商业银行活期存款利率（税后）进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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

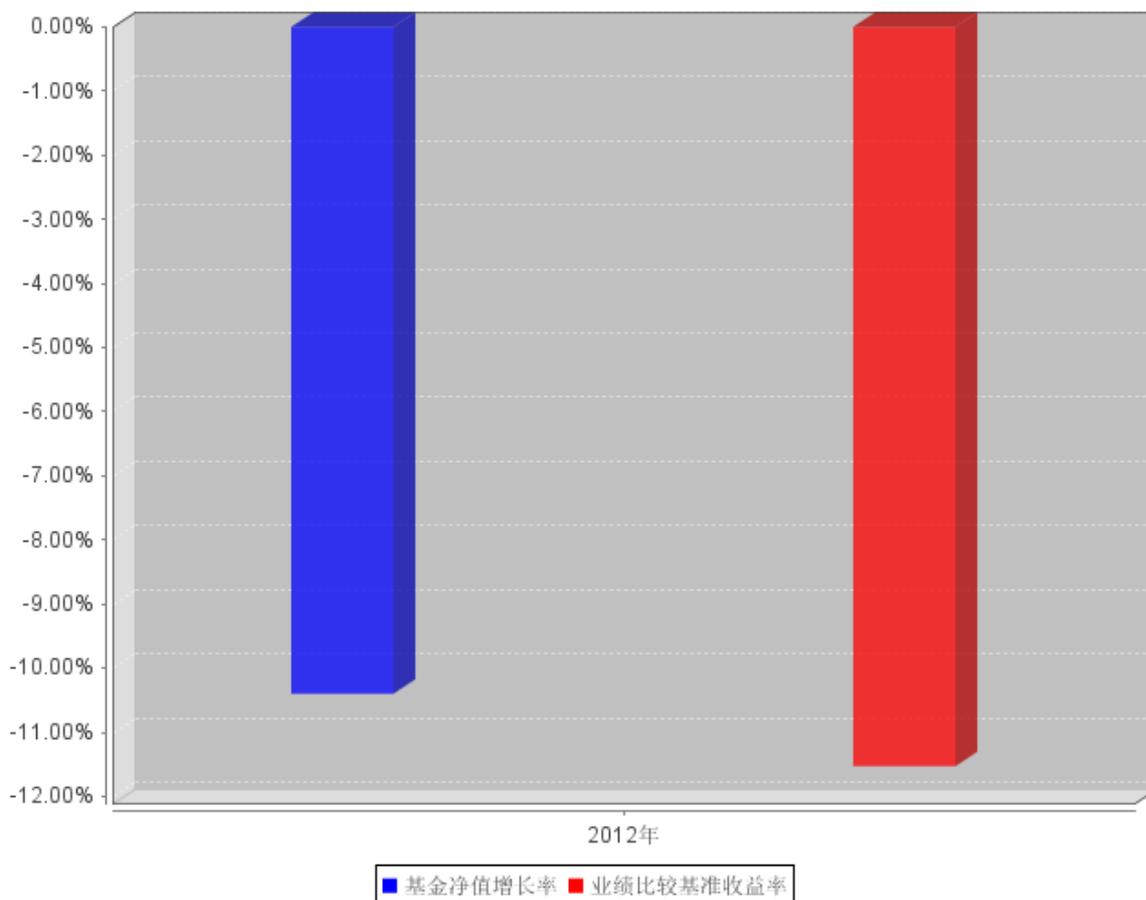
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按相关法规规定，本基金自基金合同 2012 年 3 月 7 日生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上图中 2012 年度是指 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日，相关数据未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日无利润分配。

§ 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

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2012 年 12 月 31 日，共管理开放式证券投资基金 13 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
陈明星	金融工程 总监、本 基金、中 海上证 50 指数增强 型证券投 资基金基 金经理	2012 年 3 月 7 日	-	7	陈明星先生，中国科学技术大学金融学专业硕士。历任安徽省公路运输管理局职员、中科大上海研究发展中心有限公司项目经理、平安资产管理有限公司分析师。2007 年 10 月进入本公司工作，曾任金融工程分析师兼基金经理助理，现任金融工程总监。2010 年 3 月至今任中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金经理，2012 年 3 月至今任中海上证 380 指数证券投资基金基金经理。

注 1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注 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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司 2011 年修订了《中海基金公平交易管理办法》，从投研决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估、监察稽核和信息披露等方面对股票、债券、可转债的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动进行全程公平交易管理。

投研决策内部控制方面：（1）公司研究平台共享，基金经理和专户投资经理通过研究平台平等获取研究信息。（2）公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监因业务管理的需要外，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

交易执行内部控制方面：(1) 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据研究报告独立确定申购价格和数量，在获配额度确定后，根据公司制度规定应遵循公平原则对获配额度进行分配，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配，如有特殊情况，制度规定需书面留痕。

(2) 投资交易指令统一通过交易室下达，通过启用公平交易模块，力求保证时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡交易原则得以落实。(3) 根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数被动投资组合外）的同日反向交易。(4) 债券场外交易，交易部在银行间市场上公平公正地进行询价，并由风险管理部对询价收益率偏离、交易对手及交易方式进行事前审核。(5) 在特殊情况下，投资组合因合规性或应对大额赎回等原因需要进行特定交易时，由投资组合经理发起暂停投资风控阈值的流程，在获得相关审批后，由风险管理部暂时关闭投资风控系统的特定阈值。完成该交易后，风险管理部立即启动暂停的投资风控阈值。

行为监控和分析评估方面：(1) 公司每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。(2) 公司对所有组合在 2012 年全年日内，3 日，5 日同向交易数据进行了采集，并进行两两比对，对于相关采集样本进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验。

(3) 对于不同时间期间的同组合反向交易及公司制度规定的异常交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时机等进行综合分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2012 年全年，公司遵循《中海基金公平交易管理办法》相关要求，整体上贯彻执行制度约定，加强了对投资组合公平交易的事后分析，

(1) 对于两两组合的同向交易，我们从日内、3 日、5 日三个时间区间进行假设价差为零，T 分布的检验，对于未通过假设检验的情况，公司结合比较两两组间的交易占优比、采集的样本数量是否达到一定水平从而具有统计学意义、模拟利益输送金额的绝对值、模拟利益输送金额占组合资产平均净值的比例、模拟利益的贡献率占组合收益率的比例、两两组合的持仓相似度及两两组合收益率差的比较等多方面进行综合比较。

(2) 对于两两组合的反向交易，公司采集同一组合对同一投资品种相邻交易日反向交易、5 日反向交易；两两组合对同一投资品种相邻交易日反向交易、5 日反向交易；并结合市场该投资品种的总成交量进行综合分析。

(3) 对于公司制度规定的异常交易，相关组合经理均根据制度要求提交审批单并书面留痕。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未发现组合存在有可能导致重大不公平交易和利

益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，风险管理部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

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

2012 年，市场波荡起伏，大盘先涨后跌年底再大涨。5 月初之前，国内 PMI 转好，流动性渐趋宽松，政府着力出台新的引导机构资金入市的政策，市场估值吸引力强，大盘出现一波较大的上涨，尽管在冲高 2478 点出现回调，但是市场期待经济在 2 季度筑底的预期，使得 4 月份市场迎来一波回调后较大的反弹，但是高点未能超过 2 月底的高点。

然而，随着后续一系列经济数据的表现严重低于市场预期，市场随后迎来了较大的下跌。接着，3 季度，热钱加速流出，市场流动性宽松有限，加上经济见底的预期一再落空，市场连续下跌，到了 12 月，PMI 连续走好，十八大后市场对于经济预期迅速转好以及海外资金看好中国，带来了股市的强劲上涨，以银行股为龙头的低估值大盘股上涨非常迅猛，中小板和创业板表现稍微落后。

2012 年，380 指数基金以跟踪标的指数为目标，按照复制方法进行操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值 0.896 元(累计净值 0.896 元)。报告期内本基金净值增长率为-10.40%，高于业绩比较基准 1.13 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，基于市场一致预期，经济将继续温和复苏，流动性整体适度宽松环境有望继续保持，具有明显估值优势和成长空间的各类板块股票将会继续有表现机会，当然由于经济复苏过程的复杂性，外围环境的不确定性以及通胀可能出现的反复，中间的过程可能会比较曲折。展望新的一年，面对高度复杂和不确定的市场，我们将继续积极把握各种机会，以期取得较好的业绩。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由监察稽核部门遵守独立、客观、公正的原则，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方法对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行检查，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

管理人各项业务能遵循国家法律法规、中国证监会规章制度、管理人内部的规章制度以及各项业务规范流程，运行符合合法性、合规性的要求，主要内控制度基本有效。

在本报告期内，管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 根据基金监管法律法规的不断更新与完善，推动各部门加强内部制度建设，确保制度对各项业务和管理环节的全覆盖、提高制度和流程的合规性、合理性和可操作性。

(2) 开展基金法律法规和管理人内部各项基本制度的培训学习工作，树立员工规范意识、合规意识和风险意识，形成员工主动、自觉进行内部控制的风险管理文化，构建主动进行管理人内部风险控制和自觉接受监察稽核的平台。

(3) 全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金销售、投资的合法合规。通过电脑监控、现场检查、人员询问、重点抽查等方法开展工作，不断提高全体员工的风险意识，保证了基金的合法合规运作。

(4) 按照中国证监会的要求，在管理内部严格推行风险控制自我评估制度。通过各部门的参与和自我评估，明确了各部门的风险点，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。

(5) 根据监管部门的要求，完成与基金投资业务相关的定期监察报告，报送中国证监会和董事会。

管理人自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。2013 年我们将继续紧紧抓住风险控制和合规性两条主线，构建一个制度修订规范化、风险责任岗位化、风险检测细致化、风险评估科学化的长效风险控制机制，提高内部监察工作的计划性、科学性和有效性，实现基金合法合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建

立了负责估值工作决策和执行的估值核算小组，组成人员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等，成员均具有多年基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理，但对于非活跃投资品种，投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，本基金在本报告期不满足有关基金分红条件，不进行利润分配。

§ 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

2012 年，本基金托管人在对中海上证 380 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2012 年，中海上证 380 指数证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海上证 380 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的中海上证 380 指数证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中海上证 380 指数证券投资基金份额全体持有人
引言段	我们审计了后附的中海上证 380 指数证券投资基金（以下简称上证 380 基金）财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表，2012 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及

	财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是上证 380 基金的管理人中海基金管理有限公司管理层的责任, 这种责任包括: (1) 按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。 我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为, 上证 380 基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制, 公允反映了上证 380 基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	夏正曙 华可天
会计师事务所的名称	江苏公证天业会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	无锡市梁溪路 28 号
审计报告日期	2013 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 中海上证 380 指数证券投资基金

报告截止日: 2012 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------	--------------------------

资产:			
银行存款	7.4.7.1	4,223,024.38	-
结算备付金		12,186.89	-
存出保证金		333,333.36	-
交易性金融资产	7.4.7.2	73,624,767.65	-
其中: 股票投资		73,624,767.65	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	800.56	-
应收股利		-	-
应收申购款		592.88	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		78,194,705.72	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		872.98	-
应付管理人报酬		46,311.66	-
应付托管费		9,262.32	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	66,981.60	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	62,037.06	-
负债合计		185,465.62	-
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	87,068,082.65	-
未分配利润	7.4.7.10	-9,058,842.55	-
所有者权益合计		78,009,240.10	-
负债和所有者权益总计		78,194,705.72	-

注 1: 本基金合同生效日 2012 年 3 月 7 日, 无上年度末比较数据, 下同。

注 2: 报告截至日 2012 年 12 月 31 日, 基金份额净值 0.896 元, 基金份额总额 87,068,082.65 份。

7.2 利润表

会计主体: 中海上证 380 指数证券投资基金

本报告期: 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2012年3月7日(基金合 同生效日)至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
一、收入		-8,663,994.06	-
1.利息收入		681,057.10	-
其中:存款利息收入	7.4.7.11	95,023.50	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		586,033.60	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-2,882,139.95	-
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-4,025,602.81	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,143,462.86	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-6,689,169.92	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	226,258.71	-
二、费用		1,617,944.31	-
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	741,128.57	-
2.托管费	7.4.10.2.2	148,225.72	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	380,405.59	-
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	348,184.43	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-10,281,938.37	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号		-10,281,938.37	-

填列)			
-----	--	--	--

注：本基金合同生效日 2012 年 3 月 7 日，无去年同期比较数据，下同。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海上证 380 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	267,225,353.91	-	267,225,353.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,281,938.37	-10,281,938.37
三、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)	-180,157,271.26	1,223,095.82	-178,934,175.44
其中：1. 基金申购款	2,160,635.66	-90,985.52	2,069,650.14
2. 基金赎回款	-182,317,906.92	1,314,081.34	-181,003,825.58
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	87,068,082.65	-9,058,842.55	78,009,240.10
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-

2. 基金赎回款	-	-	-
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>黄鹏</u>	<u>宋宇</u>	<u>曹伟</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中海上证 380 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定,经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1507 号《关于核准中海上证 380 指数证券投资基金募集的批复》核准,于 2012 年 2 月 6 日至 2012 年 3 月 2 日向社会公开募集。募集期结束并经江苏公证天业会计师事务所有限公司验资,首次发行募集的实收基金为人民币 267,209,149.21 元,有效认购金额产生的利息为人民币 16,204.70 元,共计人民币 267,225,353.91 元。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为中海基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行;有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于 2012 年 3 月 7 日生效,该日的基金份额总额为 267,225,353.91 份。

7.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期为 2012 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

7.4.4.3.1 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

7.4.4.3.2 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

7.4.4.4.1 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

7.4.4.4.2 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，

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。

7.4.4.4.3 当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.4.4 本基金金融工具的成本计价方法具体如下：

7.4.4.4.4.1 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

7.4.4.4.4.2 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按实际成交价款入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，并按上述会计处理方法核算；

卖出证券交易所交易和银行间同业市场交易的债券均于成交日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

7.4.4.4.4.3 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

7.4.4.4.4.4 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付

的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述 7.4.4.4.2 和 7.4.4.4.3 中的相关方法进行计算。

7.4.4.4.5 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

本基金以上述原则确定的公允价值进行估值，本基金主要金融工具的估值方法如下：

7.4.4.5.1 上市证券的估值

7.4.4.5.1.1 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

7.4.4.5.1.2 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

7.4.4.5.1.3 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，

按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

7.4.4.5.1.4 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

7.4.4.5.2 未上市证券的估值

7.4.4.5.2.1 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值，即依照上述 7.4.4.5.1.1 和 7.4.4.5.1.4 的相关方法进行估值；

7.4.4.5.2.2 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

7.4.4.5.2.3 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值，即依照上述 7.4.4.5.1.1 和 7.4.4.5.1.4 的相关方法进行估值；

7.4.4.5.2.4 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，应按中国证监会相关规定处理；

7.4.4.5.3 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

7.4.4.5.4 全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

7.4.4.5.5 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 7.4.4.5.1 中的相关方法进行估值；

7.4.4.5.6 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

7.4.4.5.7 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

7.4.4.5.8 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动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；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，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也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

基金管理人的管理人报酬根据《中海上证 380 指数证券投资基金基金合同》的规定按基金资产净值的 0.75% 的年费率逐日计提。

基金托管人的托管费根据《中海上证 380 指数证券投资基金基金合同》的规定按基金资产净

值的 0.15% 的年费率逐日计提。

基金的指数使用费根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，且收取下限为每季度（包括基金成立当季）人民币 5 万元。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内不存在会计政策变更的情况。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内不存在会计估计变更的情况。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内不存在重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税字 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

7.4.6.1 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

7.4.6.2 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

7.4.6.3 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1% 的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 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。

7.4.6.5 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	4,223,024.38	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,223,024.38	-

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	80,313,937.57	73,624,767.65	-6,689,169.92
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	80,313,937.57	73,624,767.65	-6,689,169.92
项目	上年度末 2011 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		-	-	-

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	795.06	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5.50	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	800.56	-

7.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	66,981.60	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	66,981.60	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3.29	-
应付指数使用费	4,033.77	-
预提费用	58,000.00	-
合计	62,037.06	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	267,225,353.91	267,225,353.91
本期申购	2,160,635.66	2,160,635.66
本期赎回(以“-”号填列)	-182,317,906.92	-182,317,906.92
本期末	87,068,082.65	87,068,082.65

注 1:本基金合同生效日为 2012 年 3 月 7 日,募集期间认购资金本金为人民币 267,209,149.21 元,折合 267,209,149.21 份基金份额,有效认购金额产生的利息为人民币 16,204.70 元,折合 16,204.70 份基金份额。

注 2:其中本期申购包含红利再投、转换入份额,本期赎回包含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-3,592,768.45	-6,689,169.92	-10,281,938.37
本期基金份额交易产生的变动数	2,868.73	1,220,227.09	1,223,095.82
其中:基金申购款	-6,855.88	-84,129.64	-90,985.52
基金赎回款	9,724.61	1,304,356.73	1,314,081.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,589,899.72	-5,468,942.83	-9,058,842.55

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	86,442.63	-
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	8,580.77	-
其他	0.10	-
合计	95,023.50	-

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	93,168,896.48	-
减：卖出股票成本总额	97,194,499.29	-
买卖股票差价收入	-4,025,602.81	-

7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金在本报告期无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金在本报告期无衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,143,462.86	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,143,462.86	-

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年3月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
1. 交易性金融资产	-6,689,169.92	-
——股票投资	-6,689,169.92	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-6,689,169.92	-

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
基金赎回费收入	219,903.36	-
转出基金补偿收入	6,355.35	-
合计	226,258.71	-

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
交易所市场交易费用	380,405.59	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	380,405.59	-

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
审计费用	58,000.00	-

信息披露费	270,000.00	-
银行费用	421.00	-
指数使用费	19,763.43	-
合计	348,184.43	-

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金在本报告期内无需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金在本报告期内无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
工商银行	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司（“中海信托”）	基金管理人的股东
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司（“法国洛希尔银行”）	基金管理人的股东
华英证券有限责任公司	基金管理人股东的控股子公司
中海石油财务有限责任公司	基金管理人的关联方

注：华英证券有限责任公司为基金管理人股东国联证券的控股子公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月7日(基金合同生效日)至 2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国联证券	259,414,081.01	95.88%	-	-

债券交易

注：本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月7日(基金合同生效日)至 2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
国联证券	520,000,000.00	50.00%	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月7日(基金合同生效日)至2012年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国联证券	223,144.79	95.79%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国联证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

沪市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金

深市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金

国联证券符合我司选择证券经营机构、使用其席位作为基金专用交易席位的标准，与其签订的席位租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和 market 信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月7日(基金合同生效 日)至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	741,128.57	-
其中：支付销售机构的客户维护费	149,940.18	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

(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，逐日累计至每月月底，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月7日(基金合同生效 日)至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	148,225.72	-

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

(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，逐日累计至每月月底，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期 2012 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金基金合同生效日为 2012 年 3 月 7 日，本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金基金合同生效日为 2012 年 3 月 7 日，本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月7日(基金合同生效日)至 2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,223,024.38	86,442.63	-	-

注 1：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。

注 2：本基金基金合同生效日为 2012 年 3 月 7 日。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
600815	厦工股份	2012年12月21日	2013年1月8日	增发流通受限	6.42	6.99	5,174	33,217.08	36,166.26	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600110	中科英华	2012年11月19日	重大事项停牌	3.61	2013年3月11日	3.97	89,644	349,548.70	323,614.84	-
600236	桂冠电力	2012年12月21日	重大事项停牌	3.98	2013年2月5日	4.36	64,073	245,042.61	255,010.54	-
600784	鲁银投	2012年10月8日	重大事	5.18	2013年1月4日	5.70	47,181	241,884.49	244,397.58	-

	资		项停牌							
600580	卧龙电 气	2012 年 11 月 20 日	重大事 项停牌	3.94	2013 年 1 月 9 日	4.33	19,320	111,070.04	76,120.80	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金投资决策委员会议事规则》、《中海基金投资业务流程》、《中海基金权限管理办法》、《中海基金研究管理办法》、《中海基金股票库管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能的信用风险。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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性极小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 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 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
A-1	0.00	-
A-1 以下	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	-	-

7.4.13.2.2 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 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
AAA	0.00	-
AAA 以下	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	0.00	-

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现困难，从而对基金收益造成的不利影响。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。

本基金为纯被动指数基金，所持证券均为上证 380 指数成份股，故持仓证券的流动性完全由指数成份股的市场活跃度所决定。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

本基金严格控制现金或者到期日在一年以内的政府债券持有量在基金资产净值中的占比保持在 5% 以上的水平。2012 年 12 月 31 日，本基金股票资产持仓比例为 94.38%。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金为纯被动指数基金，市场风险完全由其复制的上证 380 指数所决定。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为纯被动指数基金，且完全复制上证 380 指数部分不得低于基金资产净值的 90%，因此利率风险不是本基金的主要风险。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金没有持有外汇资产及负债，故汇率变化不会对本基金产生重大的影响。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指除利率和汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险，本基金的其他价格风险主要由股票价格变动对基金资产造成损失的可能性。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	73,624,767.65	94.38	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	73,624,767.65	94.38	-	-

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	测算组合市场价格风险的数据为上证 380 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定上证 380 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	Beta 系数是根据报表日持仓资产在过去 100 个交易日收益率与其对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
	假定市场无风险利率为一年定期存款利率。		
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（单位：人民币元）	
		本期末（2012 年 12 月 31 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	+5%	3,425,772.39	-
-5%	-3,425,772.39	-	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	假定基金收益率的分布服从正态分布。		
	根据基金单位净值收益率在报表日过去 100 个交易日的分布情况。		
	以 95% 的置信区间计算基金日收益率的绝对 VaR 值 (不足 100 个交易日不予计算)。		
分析	风险价值	本期末 (2012 年 12 月 31 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	收益率绝对 VaR (%)	2.10	-

§ 8 投资组合报告

8.1 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	73,624,767.65	94.16
	其中: 股票	73,624,767.65	94.16
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	4,235,211.27	5.42
6	其他各项资产	334,726.80	0.43
7	合计	78,194,705.72	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	397,714.29	0.51
B	采掘业	2,450,538.43	3.14
C	制造业	38,791,842.65	49.73
C0	食品、饮料	3,899,191.54	5.00

C1	纺织、服装、皮毛	742,609.79	0.95
C2	木材、家具	408,856.92	0.52
C3	造纸、印刷	568,974.02	0.73
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,142,967.87	7.87
C5	电子	1,934,466.92	2.48
C6	金属、非金属	6,194,306.75	7.94
C7	机械、设备、仪表	11,239,202.22	14.41
C8	医药、生物制品	6,815,067.95	8.74
C99	其他制造业	846,198.67	1.08
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,181,026.60	5.36
E	建筑业	2,268,983.19	2.91
F	交通运输、仓储业	6,256,249.34	8.02
G	信息技术业	3,344,362.02	4.29
H	批发和零售贸易	6,667,243.93	8.55
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	2,309,365.28	2.96
K	社会服务业	1,689,529.55	2.17
L	传播与文化产业	1,575,954.95	2.02
M	综合类	3,691,957.42	4.73
	合计	73,624,767.65	94.38

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金为完全复制指数的股票型基金，未进行积极投资。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例（%）
1	600315	上海家化	19,775	1,008,327.25	1.29
2	600066	宇通客车	35,114	884,872.80	1.13
3	600660	福耀玻璃	89,252	782,740.04	1.00
4	600153	建发股份	102,229	718,669.87	0.92
5	600694	大商股份	18,287	644,982.49	0.83
6	601333	广深铁路	220,423	643,635.16	0.83
7	601018	宁波港	247,875	637,038.75	0.82
8	600886	国投电力	106,524	613,578.24	0.79
9	600881	亚泰集团	119,699	600,888.98	0.77
10	600079	人福医药	24,444	571,745.16	0.73

11	601991	大唐发电	134,591	542,401.73	0.70
12	600718	东软集团	69,841	537,077.29	0.69
13	600702	沱牌舍得	18,622	536,499.82	0.69
14	600267	海正药业	35,138	523,204.82	0.67
15	600637	百视通	31,927	506,681.49	0.65
16	600570	恒生电子	43,593	488,677.53	0.63
17	600779	水井坊	25,183	487,794.71	0.63
18	601727	上海电气	119,372	485,844.04	0.62
19	600832	东方明珠	86,452	480,673.12	0.62
20	600157	永泰能源	50,806	478,084.46	0.61
21	600199	金种子酒	24,526	471,144.46	0.60
22	601918	国投新集	49,091	469,800.87	0.60
23	600138	中青旅	29,202	464,895.84	0.60
24	600557	康缘药业	22,335	464,568.00	0.60
25	601933	永辉超市	18,324	461,948.04	0.59
26	601888	中国国旅	16,687	457,557.54	0.59
27	600635	大众公用	109,189	452,042.46	0.58
28	600170	上海建工	57,785	451,300.85	0.58
29	600027	华电国际	112,631	443,766.14	0.57
30	600312	平高电气	60,248	438,002.96	0.56
31	600601	方正科技	184,630	437,573.10	0.56
32	600688	S 上石化	82,541	436,641.89	0.56
33	600594	益佰制药	21,599	432,195.99	0.55
34	600436	片仔癀	3,968	432,194.56	0.55
35	600062	华润双鹤	18,797	426,691.90	0.55
36	600805	悦达投资	35,247	419,439.30	0.54
37	600978	宜华木业	83,101	408,856.92	0.52
38	600582	天地科技	35,995	408,543.25	0.52
39	600022	山东钢铁	179,698	393,538.62	0.50
40	600141	兴发集团	21,578	389,267.12	0.50
41	600879	航天电子	59,578	388,448.56	0.50
42	600200	江苏吴中	53,118	382,449.60	0.49
43	600522	中天科技	47,294	373,149.66	0.48
44	601877	正泰电器	20,265	372,268.05	0.48
45	600458	时代新材	28,468	371,507.40	0.48
46	600827	友谊股份	42,348	363,345.84	0.47
47	600478	科力远	15,970	358,686.20	0.46
48	600997	开滦股份	34,842	356,085.24	0.46
49	600808	马钢股份	168,798	351,099.84	0.45

50	600559	老白干酒	9,469	350,258.31	0.45
51	600880	博瑞传播	36,311	350,038.04	0.45
52	600820	隧道股份	37,241	338,893.10	0.43
53	600426	华鲁恒升	43,150	334,412.50	0.43
54	601872	招商轮船	130,498	334,074.88	0.43
55	600260	凯乐科技	36,236	333,733.56	0.43
56	600586	金晶科技	97,156	332,273.52	0.43
57	600300	维维股份	47,994	330,678.66	0.42
58	600388	龙净环保	15,097	330,624.30	0.42
59	600018	上港集团	124,621	327,753.23	0.42
60	600729	重庆百货	12,671	324,250.89	0.42
61	600110	中科英华	89,644	323,614.84	0.41
62	600508	上海能源	20,075	323,006.75	0.41
63	600059	古越龙山	28,148	321,450.16	0.41
64	600332	广州药业	16,457	319,594.94	0.41
65	601718	际华集团	104,089	313,307.89	0.40
66	600867	通化东宝	32,795	311,552.50	0.40
67	600750	江中药业	15,588	307,395.36	0.39
68	600724	宁波富达	41,413	304,385.55	0.39
69	600584	长电科技	71,787	304,376.88	0.39
70	600597	光明乳业	30,933	304,071.39	0.39
71	600403	大有能源	14,697	302,611.23	0.39
72	600859	王府井	12,468	298,733.28	0.38
73	600778	友好集团	27,647	296,928.78	0.38
74	600528	中铁二局	44,084	294,481.12	0.38
75	600651	飞乐音响	62,174	292,217.80	0.37
76	600432	吉恩镍业	21,516	290,466.00	0.37
77	601558	华锐风电	54,683	287,632.58	0.37
78	600801	华新水泥	18,858	286,075.86	0.37
79	601369	陕鼓动力	31,704	285,970.08	0.37
80	600063	皖维高新	107,408	284,631.20	0.36
81	600026	中海发展	60,188	279,272.32	0.36
82	600717	天津港	46,212	279,120.48	0.36
83	600638	新黄浦	27,456	277,305.60	0.36
84	600008	首创股份	62,405	272,709.85	0.35
85	600587	新华医疗	8,622	268,230.42	0.34
86	600572	康恩贝	27,284	266,019.00	0.34
87	600210	紫江企业	75,432	264,766.32	0.34
88	600748	上实发展	30,840	263,682.00	0.34

89	600098	广州发展	34,457	261,184.06	0.33
90	600588	用友软件	26,298	259,298.28	0.33
91	601566	九牧王	16,004	258,944.72	0.33
92	600872	中炬高新	56,114	258,124.40	0.33
93	600527	江南高纤	55,545	257,173.35	0.33
94	600236	桂冠电力	64,073	255,010.54	0.33
95	600268	国电南自	43,478	254,346.30	0.33
96	600021	上海电力	54,621	253,441.44	0.32
97	600596	新安股份	33,569	251,767.50	0.32
98	601098	中南传媒	28,104	251,249.76	0.32
99	600470	六国化工	27,034	248,172.12	0.32
100	600122	宏图高科	61,665	246,660.00	0.32
101	601890	亚星锚链	33,135	246,524.40	0.32
102	600351	亚宝药业	46,144	246,408.96	0.32
103	600616	金枫酒业	27,786	245,906.10	0.32
104	601880	大连港	86,398	244,506.34	0.31
105	600784	鲁银投资	47,181	244,397.58	0.31
106	600797	浙大网新	55,285	238,831.20	0.31
107	600502	安徽水利	20,364	238,258.80	0.31
108	600500	中化国际	40,995	236,951.10	0.30
109	600499	科达机电	26,603	233,042.28	0.30
110	600004	白云机场	32,764	232,296.76	0.30
111	600783	鲁信创投	20,835	230,226.75	0.30
112	600377	宁沪高速	44,150	230,021.50	0.29
113	600517	置信电气	16,562	228,555.60	0.29
114	600269	赣粤高速	65,951	225,552.42	0.29
115	600765	中航重机	29,415	223,848.15	0.29
116	600067	冠城大通	33,356	218,815.36	0.28
117	600543	莫高股份	21,821	217,773.58	0.28
118	601003	柳钢股份	70,472	217,053.76	0.28
119	600815	厦工股份	30,941	216,277.59	0.28
120	600790	轻纺城	35,123	214,601.53	0.28
121	600525	长园集团	33,355	210,803.60	0.27
122	600096	云天化	16,251	210,612.96	0.27
123	600456	宝钛股份	11,807	209,456.18	0.27
124	600998	九州通	18,909	208,566.27	0.27
125	601010	文峰股份	14,621	207,471.99	0.27
126	601107	四川成渝	61,702	206,084.68	0.26
127	600511	国药股份	13,935	203,032.95	0.26

128	600409	三友化工	53,276	202,448.80	0.26
129	600612	老凤祥	9,267	199,703.85	0.26
130	600546	山煤国际	9,780	199,023.00	0.26
131	600595	中孚实业	40,118	198,182.92	0.25
132	600720	祁连山	18,443	195,495.80	0.25
133	601100	恒立油缸	17,346	195,142.50	0.25
134	600197	伊力特	12,781	193,632.15	0.25
135	600176	中国玻纤	18,909	191,926.35	0.25
136	600270	外运发展	27,043	191,734.87	0.25
137	600240	华业地产	39,673	190,827.13	0.24
138	600835	上海机电	23,659	190,691.54	0.24
139	600038	哈飞股份	10,115	190,364.30	0.24
140	600435	北方导航	22,956	189,846.12	0.24
141	600139	西部资源	19,674	189,067.14	0.24
142	601678	滨化股份	18,960	189,031.20	0.24
143	601000	唐山港	56,566	188,364.78	0.24
144	600743	华远地产	47,279	187,224.84	0.24
145	600428	中远航运	47,634	187,201.62	0.24
146	600290	华仪电气	36,701	186,808.09	0.24
147	600017	日照港	64,344	185,954.16	0.24
148	600350	山东高速	54,884	183,861.40	0.24
149	600422	昆明制药	9,381	182,648.07	0.23
150	600782	新钢股份	43,895	180,847.40	0.23
151	600510	黑牡丹	23,049	180,704.16	0.23
152	600704	物产中大	24,726	180,499.80	0.23
153	600521	华海药业	15,819	180,336.60	0.23
154	600787	中储股份	23,327	180,317.71	0.23
155	600755	厦门国贸	40,279	178,435.97	0.23
156	600983	合肥三洋	23,038	175,319.18	0.22
157	600161	天坛生物	13,994	174,085.36	0.22
158	601777	力帆股份	26,981	172,408.59	0.22
159	601216	内蒙君正	27,710	172,356.20	0.22
160	600754	锦江股份	12,164	172,242.24	0.22
161	600183	生益科技	40,740	171,515.40	0.22
162	600006	东风汽车	57,046	170,567.54	0.22
163	600433	冠豪高新	18,562	169,656.68	0.22
164	601126	四方股份	11,882	168,605.58	0.22
165	600639	浦东金桥	18,579	167,211.00	0.21
166	600303	曙光股份	38,038	166,606.44	0.21

167	600993	马应龙	11,830	165,856.60	0.21
168	600292	九龙电力	13,150	165,427.00	0.21
169	601258	庞大集团	31,741	164,100.97	0.21
170	600033	福建高速	73,439	163,768.97	0.21
171	600481	双良节能	23,592	163,728.48	0.21
172	600480	凌云股份	24,933	163,061.82	0.21
173	600078	澄星股份	19,019	161,090.93	0.21
174	600190	锦州港	43,562	159,872.54	0.20
175	600578	京能热电	21,222	158,740.56	0.20
176	600307	酒钢宏兴	48,061	157,640.08	0.20
177	600976	武汉健民	10,166	157,573.00	0.20
178	600633	浙报传媒	11,510	155,385.00	0.20
179	601519	大智慧	35,015	155,116.45	0.20
180	600888	新疆众和	16,439	155,019.77	0.20
181	600380	健康元	34,283	154,273.50	0.20
182	600056	中国医药	7,634	154,130.46	0.20
183	600611	大众交通	31,710	153,159.30	0.20
184	600112	长征电气	14,375	152,950.00	0.20
185	600874	创业环保	32,314	151,552.66	0.19
186	600467	好当家	20,646	151,128.72	0.19
187	600261	阳光照明	17,436	150,995.76	0.19
188	600285	羚锐制药	13,951	150,391.78	0.19
189	601886	江河幕墙	6,867	149,700.60	0.19
190	600685	广船国际	12,059	149,531.60	0.19
191	600531	豫光金铅	8,633	147,883.29	0.19
192	600280	南京中商	4,097	146,754.54	0.19
193	600575	芜湖港	20,618	146,593.98	0.19
194	600491	龙元建设	25,671	145,811.28	0.19
195	600507	方大特钢	37,450	145,680.50	0.19
196	600825	新华传媒	29,757	144,916.59	0.19
197	600495	晋西车轴	10,080	142,934.40	0.18
198	600667	太极实业	37,107	142,490.88	0.18
199	600673	东阳光铝	18,787	142,029.72	0.18
200	600684	珠江实业	9,477	141,681.15	0.18
201	600737	中粮屯河	27,013	141,548.12	0.18
202	600509	天富热电	17,501	141,408.08	0.18
203	601908	京运通	23,222	140,493.10	0.18
204	600548	深高速	40,455	137,547.00	0.18
205	600012	皖通高速	34,030	137,481.20	0.18

206	600761	安徽合力	15,265	136,469.10	0.17
207	600581	八一钢铁	23,003	136,407.79	0.17
208	600487	亨通光电	6,633	136,308.15	0.17
209	600277	亿利能源	22,818	135,538.92	0.17
210	600326	西藏天路	15,405	134,485.65	0.17
211	600658	电子城	17,407	133,511.69	0.17
212	600120	浙江东方	15,571	133,132.05	0.17
213	600195	中牧股份	10,542	133,040.04	0.17
214	600121	郑州煤电	17,322	132,859.74	0.17
215	600496	精工钢构	16,482	132,350.46	0.17
216	600113	浙江东日	12,986	130,769.02	0.17
217	600468	百利电气	12,315	130,539.00	0.17
218	600858	银座股份	13,880	130,055.60	0.17
219	601636	旗滨集团	18,731	126,996.18	0.16
220	600284	浦东建设	14,376	126,077.52	0.16
221	601677	明泰铝业	11,011	124,314.19	0.16
222	600449	宁夏建材	13,495	123,479.25	0.16
223	600231	凌钢股份	25,849	122,782.75	0.16
224	600438	通威股份	18,250	122,092.50	0.16
225	600333	长春燃气	14,471	121,701.11	0.16
226	600175	美都控股	41,592	120,200.88	0.15
227	600329	中新药业	11,268	119,440.80	0.15
228	600897	厦门空港	9,043	118,734.59	0.15
229	600308	华泰股份	34,120	118,396.40	0.15
230	601801	皖新传媒	11,405	118,383.90	0.15
231	600069	银鸽投资	22,591	117,925.02	0.15
232	600545	新疆城建	18,962	117,754.02	0.15
233	601139	深圳燃气	12,347	117,666.91	0.15
234	600295	鄂尔多斯	13,226	117,579.14	0.15
235	600410	华胜天成	18,483	117,367.05	0.15
236	600662	强生控股	29,242	115,798.32	0.15
237	600375	华菱星马	12,943	114,545.55	0.15
238	600439	瑞贝卡	25,961	113,709.18	0.15
239	600322	天房发展	29,335	113,526.45	0.15
240	600776	东方通信	26,032	112,978.88	0.14
241	600683	京投银泰	22,075	112,582.50	0.14
242	600201	金宇集团	7,878	112,340.28	0.14
243	600193	创兴资源	9,296	112,202.72	0.14
244	601011	宝泰隆	10,244	111,864.48	0.14

245	600185	格力地产	15,839	110,239.44	0.14
246	601208	东材科技	16,987	109,056.54	0.14
247	600420	现代制药	8,554	108,892.42	0.14
248	600479	千金药业	8,904	106,848.00	0.14
249	600298	安琪酵母	6,478	105,785.74	0.14
250	600184	光电股份	5,432	105,489.44	0.14
251	601222	林洋电子	9,665	105,251.85	0.13
252	600668	尖峰集团	10,402	104,956.18	0.13
253	600831	广电网络	15,940	104,725.80	0.13
254	600282	南钢股份	44,361	104,691.96	0.13
255	600117	西宁特钢	20,999	103,525.07	0.13
256	600628	新世界	15,267	103,052.25	0.13
257	600686	金龙汽车	15,199	102,897.23	0.13
258	600742	一汽富维	5,803	102,713.10	0.13
259	600459	贵研铂业	5,517	101,898.99	0.13
260	600425	青松建化	10,278	101,649.42	0.13
261	600172	黄河旋风	14,907	101,069.46	0.13
262	600106	重庆路桥	25,176	100,704.00	0.13
263	601218	吉鑫科技	13,089	99,999.96	0.13
264	600289	亿阳信通	17,188	99,690.40	0.13
265	601137	博威合金	6,397	99,665.26	0.13
266	600054	黄山旅游	7,815	98,312.70	0.13
267	600387	海越股份	11,404	98,302.48	0.13
268	600676	交运股份	23,614	97,761.96	0.13
269	600537	亿晶光电	12,196	97,202.12	0.12
270	600227	赤天化	26,573	96,991.45	0.12
271	600563	法拉电子	6,486	96,446.82	0.12
272	600606	金丰投资	15,530	96,441.30	0.12
273	600963	岳阳林纸	23,502	96,123.18	0.12
274	601177	杭齿前进	10,360	95,415.60	0.12
275	600337	美克股份	16,813	95,161.58	0.12
276	600577	精达股份	20,290	94,957.20	0.12
277	600697	欧亚集团	4,274	94,669.10	0.12
278	601567	三星电气	11,522	94,595.62	0.12
279	600469	风神股份	10,769	94,228.75	0.12
280	600589	广东榕泰	17,055	94,143.60	0.12
281	600460	士兰微	25,145	94,042.30	0.12
282	600622	嘉宝集团	13,530	93,898.20	0.12
283	600829	三精制药	10,238	92,244.38	0.12

284	600368	五洲交通	23,985	92,102.40	0.12
285	600116	三峡水利	7,537	91,423.81	0.12
286	600513	联环药业	10,617	91,412.37	0.12
287	600824	益民集团	20,472	91,100.40	0.12
288	600171	上海贝岭	19,154	90,981.50	0.12
289	600501	航天晨光	11,341	90,954.82	0.12
290	600310	桂东电力	8,779	89,984.75	0.12
291	600845	宝信软件	6,464	89,914.24	0.12
292	601518	吉林高速	34,386	89,747.46	0.12
293	600967	北方创业	4,900	89,719.00	0.12
294	600864	哈投股份	15,765	89,545.20	0.11
295	600088	中视传媒	9,561	89,490.96	0.11
296	600323	南海发展	13,476	87,863.52	0.11
297	600278	东方创业	14,385	87,460.80	0.11
298	600101	明星电力	9,360	86,954.40	0.11
299	600330	天通股份	16,222	85,652.16	0.11
300	600644	乐山电力	9,359	85,166.90	0.11
301	600075	新疆天业	12,675	84,922.50	0.11
302	600830	香溢融通	12,623	84,574.10	0.11
303	600416	湘电股份	16,583	84,573.30	0.11
304	600367	红星发展	8,168	83,722.00	0.11
305	600802	福建水泥	11,434	83,468.20	0.11
306	600979	广安爱众	17,231	82,019.56	0.11
307	600039	四川路桥	12,557	81,243.79	0.10
308	600488	天药股份	15,252	80,988.12	0.10
309	600257	大湖股份	12,110	80,773.70	0.10
310	600785	新华百货	5,511	80,185.05	0.10
311	600710	常林股份	19,048	80,001.60	0.10
312	600828	成商集团	15,866	79,488.66	0.10
313	601008	连云港	22,545	78,456.60	0.10
314	600523	贵航股份	8,117	78,410.22	0.10
315	600131	岷江水电	14,439	76,815.48	0.10
316	600725	云维股份	18,435	76,689.60	0.10
317	600846	同济科技	17,821	76,630.30	0.10
318	600339	天利高新	16,334	76,279.78	0.10
319	600580	卧龙电气	19,320	76,120.80	0.10
320	600258	首旅股份	6,697	76,010.95	0.10
321	601113	华鼎锦纶	19,285	75,404.35	0.10
322	600693	东百集团	10,306	74,718.50	0.10

323	600650	锦江投资	10,930	74,433.30	0.10
324	601058	赛轮股份	9,759	73,973.22	0.09
325	600133	东湖高新	13,251	73,543.05	0.09
326	600995	文山电力	13,091	72,785.96	0.09
327	600283	钱江水利	8,008	71,431.36	0.09
328	600712	南宁百货	15,480	71,362.80	0.09
329	600255	鑫科材料	12,608	71,109.12	0.09
330	600866	星湖科技	15,206	70,555.84	0.09
331	600318	巢东股份	6,347	70,388.23	0.09
332	600360	华微电子	18,668	70,191.68	0.09
333	600363	联创光电	10,286	70,047.66	0.09
334	600226	升华拜克	11,604	69,624.00	0.09
335	600382	广东明珠	9,756	69,365.16	0.09
336	600345	长江通信	5,879	69,313.41	0.09
337	600262	北方股份	4,930	68,477.70	0.09
338	600966	博汇纸业	14,138	66,872.74	0.09
339	600626	申达股份	19,386	66,493.98	0.09
340	600097	开创国际	5,388	66,272.40	0.08
341	600328	兰太实业	9,918	65,756.34	0.08
342	600810	神马股份	12,009	65,569.14	0.08
343	600327	大东方	14,128	64,847.52	0.08
344	600343	航天动力	6,643	64,835.68	0.08
345	600536	中国软件	6,024	63,673.68	0.08
346	600862	南通科技	16,739	63,608.20	0.08
347	600371	万向德农	4,395	62,628.75	0.08
348	600807	天业股份	8,683	62,170.28	0.08
349	600619	海立股份	9,371	61,005.21	0.08
350	600423	柳化股份	10,929	60,546.66	0.08
351	600981	汇鸿股份	15,439	60,057.71	0.08
352	600279	重庆港九	9,542	59,923.76	0.08
353	600857	工大首创	6,610	59,159.50	0.08
354	600105	永鼎股份	11,266	59,033.84	0.08
355	600477	杭萧钢构	13,028	58,626.00	0.08
356	600128	弘业股份	6,654	58,222.50	0.07
357	600249	两面针	12,606	58,113.66	0.07
358	600081	东风科技	8,931	58,051.50	0.07
359	600592	龙溪股份	8,655	57,123.00	0.07
360	600560	金自天正	7,632	56,476.80	0.07
361	600990	四创电子	3,438	56,005.02	0.07

362	600051	宁波联合	7,892	55,322.92	0.07
363	600114	东睦股份	6,706	53,580.94	0.07
364	600624	复旦复华	9,491	51,346.31	0.07
365	600666	西南药业	7,952	51,051.84	0.07
366	600446	金证股份	7,538	50,353.84	0.06
367	600822	上海物贸	11,267	50,250.82	0.06
368	600806	昆明机床	10,638	49,041.18	0.06
369	600623	双钱股份	5,833	48,822.21	0.06
370	600071	凤凰光学	6,948	42,313.32	0.05
371	600561	江西长运	4,975	41,790.00	0.05
372	600889	南京化纤	8,584	39,658.08	0.05
373	600070	浙江富润	5,043	38,528.52	0.05
374	600975	新五丰	5,992	36,910.72	0.05
375	600152	维科精华	8,264	36,196.32	0.05
376	600233	大杨创世	4,287	35,753.58	0.05
377	600841	上柴股份	1,882	21,116.04	0.03
378	600648	外高桥	1,853	17,807.33	0.02

8.3.2 期末积极投资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

注：本基金为完全复制指数的股票型基金，未进行积极投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600018	上港集团	4,210,094.77	5.40
2	601991	大唐发电	3,170,080.87	4.06
3	600011	华能国际	2,960,627.83	3.80
4	601727	上海电气	2,923,674.16	3.75
5	601933	永辉超市	2,054,414.39	2.63
6	601558	华锐风电	1,992,428.77	2.55
7	600546	山煤国际	1,469,745.64	1.88
8	601918	国投新集	1,391,610.00	1.78
9	600066	宇通客车	1,371,033.05	1.76
10	600153	建发股份	1,284,646.99	1.65

11	600377	宁沪高速	1,273,991.50	1.63
12	601333	广深铁路	1,269,835.72	1.63
13	600267	海正药业	1,269,132.37	1.63
14	600881	亚泰集团	1,213,923.00	1.56
15	600315	上海家化	1,210,026.49	1.55
16	600694	大商股份	1,194,491.18	1.53
17	600403	大有能源	1,183,126.30	1.52
18	601258	庞大集团	1,153,461.66	1.48
19	601018	宁波港	1,152,144.00	1.48
20	600027	华电国际	1,086,507.46	1.39

注：本报告期内累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600018	上港集团	3,601,064.01	4.62
2	600011	华能国际	3,418,437.55	4.38
3	601991	大唐发电	2,676,049.04	3.43
4	601727	上海电气	2,138,644.30	2.74
5	601558	华锐风电	1,565,880.84	2.01
6	601933	永辉超市	1,285,894.24	1.65
7	600535	天士力	1,275,655.28	1.64
8	600546	山煤国际	1,058,938.58	1.36
9	600143	金发科技	923,899.47	1.18
10	600377	宁沪高速	904,265.94	1.16
11	601139	深圳燃气	896,943.54	1.15
12	600998	九州通	895,467.67	1.15
13	600027	华电国际	866,493.17	1.11
14	600060	海信电器	846,933.76	1.09
15	601098	中南传媒	746,589.45	0.96
16	600350	山东高速	731,563.35	0.94
17	601258	庞大集团	711,980.04	0.91
18	600315	上海家化	696,394.77	0.89
19	600970	中材国际	694,721.10	0.89
20	601216	内蒙君正	682,049.12	0.87

注：本报告期内累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	177,508,436.86
卖出股票收入（成交）总额	93,168,896.48

注：本报告期内买入股票成本总额和卖出股票收入都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2

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。

8.9.3 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	333,333.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	800.56
5	应收申购款	592.88
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	334,726.80

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金为完全复制指数的股票型基金，未进行积极投资。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,542	56,464.39	40,760,462.24	46.81%	46,307,620.41	53.19%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	20,113.16	0.0231%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年3月7日）基金份额总额	267,225,353.91
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,160,635.66
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	182,317,906.92
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	87,068,082.65

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

本报告期内，本基金管理人聘请俞忠华先生担任副总经理职务。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请江苏公证天业会计师事务所有限公司提供审计服务，本报告期内已预提审计费 58000 元，截至 2012 年 12 月 31 日暂未支付；本基金成立以来一直由该会计师事务所提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管机构及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国联证券	1	259,414,081.01	95.88%	223,144.79	95.79%	-
长江证券	1	5,362,963.19	1.98%	4,688.97	2.01%	-
中金证券	1	3,666,231.40	1.36%	3,200.92	1.37%	-
海通证券	1	1,515,593.95	0.56%	1,379.72	0.59%	-
东方证券	1	303,633.82	0.11%	276.28	0.12%	-
国信证券	1	299,453.01	0.11%	272.43	0.12%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中建银投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

申银万国	1	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演，联合调研和各类投资研讨会。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报监察稽核部审核后确定租用交易单元。

注 2：本表中所列交易单元均为本报告期内新增。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示

注 4：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国联证券	-	-	520,000,000.00	50.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中建银投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	520,000,000.00	50.00%	-	-

11.8 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	中海上证 380 指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 3 月 8 日
2	中海上证 380 指数证券投资基金开放日常申购和赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 3 月 30 日
3	中海上证 380 指数证券投资基金开放转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 3 月 30 日
4	中海上证 380 指数证券投资基金开放定期定额投资业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 3 月 30 日
5	关于中海上证 380 指数证券投资基金参与销售机构基金定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 3 月 30 日
6	关于中海上证 380 指数证券投资基金参与销售机构基金网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 3 月 30 日
7	关于中海上证 380 指数证券投资基金实行网上交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 3 月 30 日
8	中海基金管理有限公司关于中海上证 380 指数证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 3 月 30 日
9	关于中海上证 380 指数证券投资基金开放日常申购和赎回业务的更正公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 4 月 7 日

10	中海基金管理有限公司关于开通上海银行卡（借记卡）、邮储银行卡（借记卡）网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 4 月 27 日
11	中海基金管理有限公司关于开通中国银行卡（借记卡）、温州银行卡（借记卡）网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 5 月 25 日
12	中海基金管理有限公司关于开通交通银行卡（借记卡）网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 6 月 19 日
13	基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 6 月 19 日
14	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 6 月 28 日
15	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与中信银行股份有限公司网上银行及移动银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 6 月 28 日
16	中海基金管理有限公司关于新增杭州数米基金销售有限公司为开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 7 月 5 日
17	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增杭州数米基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 7 月 13 日
18	中海上证 380 指数证券投资基金 2012 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 7 月 19 日
19	中海上证 380 指数证券投资基金 2012 年半年度报告（正文）	中海基金网站	2012 年 8 月 24 日
20	中海上证 380 指数证券投资基金 2012 年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 8 月 24 日
21	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳众禄基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 9 月 12 日
22	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与招商证券股份有限公司网上交易系统基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 10 月 12 日
23	中海基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、上海证	2012 年 10 月 17 日

	基金增设特定申购费率的公告	券报、证券时报、证券日报	
24	中海上证 380 指数证券投资基金更新招募说明书（2012 年第 1 号）	中海基金网站	2012 年 10 月 19 日
25	中海上证 380 指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2012 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 10 月 19 日
26	中海上证 380 指数证券投资基金 2012 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 10 月 24 日
27	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 10 月 25 日
28	中海基金管理有限公司关于开通支付宝账户网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 11 月 29 日
29	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与中国银行网上银行、手机银行基金申购及基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 11 月 30 日
30	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 12 月 5 日
31	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与中信建投证券股份有限公司定期定额申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2012 年 12 月 28 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海上证 380 指数证券投资基金的文件
- 2、中海上证 380 指数证券投资基金基金合同
- 3、中海上证 380 指数证券投资基金托管协议
- 4、中海上证 380 指数证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021) 38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司
2013 年 3 月 30 日