

# 中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：中邮创业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金管理人-中邮创业基金管理有限公司的董事会及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责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司（简称：中国银行）根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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正。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 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.....	37
7.7 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.....	37
7.8 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.....	37
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.10 投资组合报告附注.....	38
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39

<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>39</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	41
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>42</b>
12.1 备查文件目录.....	42
12.2 存放地点.....	42
12.3 查阅方式.....	42

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金
基金简称	中邮上证 380 指数增强
基金主代码	590007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 22 日
基金管理人	中邮创业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,565,435.77 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为股票指数增强型基金，以指数化分散投资为主，适度的增强型主动管理为辅，在严格控制跟踪偏离风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，分享中国经济增长的成果。在正常市场情况下，本基金力求控制基金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不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
投资策略	<p>本基金为股票指数增强型基金，以上证 380 指数为基金投资组合跟踪的标的指数。本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动增强，在基本面深入研究与量化投资技术的结合中，谋求基金投资组合在严控跟踪偏离风险与力争获得适度超额收益之间的最佳匹配。</p> <p>当预期成分股发生调整和成分股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>本基金的投资策略包括以下几个层面：</p> <p>1. 资产配置策略</p> <p>本基金为股票指数增强型基金，采用“被动投资为主，主动增强为辅”的投资策略。为实现有效跟踪并力争超越标的指数的投资目标，在资产类别配置上，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及备选成分股的资产占基金资</p>

产的比例不低于 80%，其余基金资产可适当投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券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的相关规定)。

## 2. 股票投资策略

本基金被动投资组合采用完全复制的方法进行组合构建，按照成分股在上证 380 指数成分股权重分散化投资于上证 380 指数成分股；主动投资组合构建主要依据对上市公司宏观和微观的深入研究，优先在上证 380 指数成分股中对行业、个股进行适度超配或者低配；同时，在公司股票池的基础上，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选上证 380 指数成分股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。

### (1) 构建被动投资组合

本基金采用完全复制基准指数的方法，按照个股在基准指数中的权重构建指数化股票投资组合，并根据基准指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。当遇到基准指数成分股调整或停牌、流动性不足等其他市场因素而无法根据指数权重配置某成分股时，本基金将首选与该成分股行业属性一致、相关性高的其他成分股进行替代；若成分股中缺乏符合要求的替代品种，本基金将在成分股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的替代品种。

### (2) 构建增强型投资组合

本基金以指数化分散投资为主，基于中国证券市场作为一个新兴市场并非完全有效及指数编制本身的局限性，在严格控制跟踪误差的前提下，辅以适度的增强型主动管理；其目的有二，一是为了在跟踪目标指数的基础上适度获取超额收益；二是补偿较高的交易成本及其他费用。增强投资的方法包括：

#### 1) 仓位调整

在能够明确判断市场将经历一段长期下跌过程时，基金的股票投资仓位可进行下调，股票资产最低可下调到占基金资产净值的 90%以适度规避市场系统性风险。

#### 2) 基本面优化

基本面优化提高具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

- 上市公司基本面较好(根据财务指标等判断)，具有鲜明的竞争优势，有持续增长能力。
- 中长期估值水平明显高于目前估值水平，在同行业中，股票相对估值偏低。
- 其他特殊个股，例如预期将纳入指数的个股。
- 包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成分股。

将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

- 基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑。
- 中长期估值水平明显低于目前估值水平，在同行业中，股票相对估值偏高。
- 短期内股价涨幅过高，预期短期内股价将大幅回调。
- 其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股等。

### 3) 个股优选

本基金将依托于本公司投研团队的研究成果，精选成分股之外的股票作为增强股票库，在合适的时机选择增强股票库中估值合理、成长明确的品种进行适量优化配置，获取超额收益。另外，本基金也可以适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发）。

### 3. 债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将通过对宏观经济形势和宏观经济政策分析，预测未来的利率趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期；通过对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析，预测收益率曲线的变化趋势，制定组合的期限结构配置策略；通过对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略。

### 4. 股票组合调整策略

本基金为股票指数增强型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、成分股流动性异常、成分股调整及配股、分红、增发等因素变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

#### (1) 定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的上证 380 指数对其成分股的调整而进行相应的跟踪调整。根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理在指数成分股调整生效前，分析并确定组合调整策略，并报投资决策委员会批准。基金经理通过执行批准后的组合调整策略，尽量减少成分股变更带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

#### (2) 不定期调整

若基金投资组合表现与指数组合表现偏离超过基金管理人确定的预警水平，基金经理将根据市场状况及个股权重偏离状况，制定组合调整策略，降低组合跟踪偏离度。

### 5. 跟踪误差控制策略

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指

	标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。
业绩比较基准	<p>本基金业绩比较基准为：上证 380 指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%。</p> <p>上证 380 指数是上海证券交易所和中证指数有限公司于 2010 年 11 月 29 日新推出的代表上交所中小市值成长性新兴蓝筹股指数，以反映传统蓝筹股之外的一批规模适中、成长性好、盈利能力强的上市公司股票的整体表现。该指数在确定样本空间时，剔除上证 180 指数样本股外，还剔除了上市时间不足一个季度的股票、暂停上市的股票、经营状况异常或最近财务报告严重亏损的股票、股价波动较大市场表现明显受到操作的股票，以及成立 5 年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司，然后按照营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名，根据行业配比原则确定各二级行业内上市公司家数，选择排名前 380 名的公司作为上证 380 指数样本股。上证 380 指数以 2003 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点；指数样本每半年定期调整一次，实施时间分别为每年的 1 月和 7 月的第一个交易日。在两次定期调整之间，若上证 380 指数样本股进入上证 180 指数，该样本立即被调出上证 380 指数，并由该调出样本同行业排名最靠前的样本补足。</p> <p>随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时(如基金变更投资比例范围，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，或今后法律法规发生变化，又或市场推出代表性更强、投资者认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的指数等)，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。</p>
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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		中邮创业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	唐州徽
	联系电话	010-82295160-157	95566
	电子邮箱	houyuc@postfund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		010-58511618	95566

传真	010-82295155	010-66594942
注册地址	北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100082	100818
法定代表人	吴涛	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	<a href="http://www.postfund.com.cn">http://www.postfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和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	中邮创业基金管理有限公司	北京市海淀区西直门北大街 60 号首 钢国际大厦 10 层

### § 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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	2,709,038.48
本期利润	-260,872.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0064
本期加权平均净值利润率	-0.67%
本期基金份额净值增长率	-4.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2013 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	-3,915,777.62
期末可供分配基金份额利润	-0.1202
期末基金资产净值	28,649,658.15
期末基金份额净值	0.880
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2013 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	-6.91%

注：1. 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。2. 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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。3. 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（为期末余额，不是当前发生额）。

#### 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

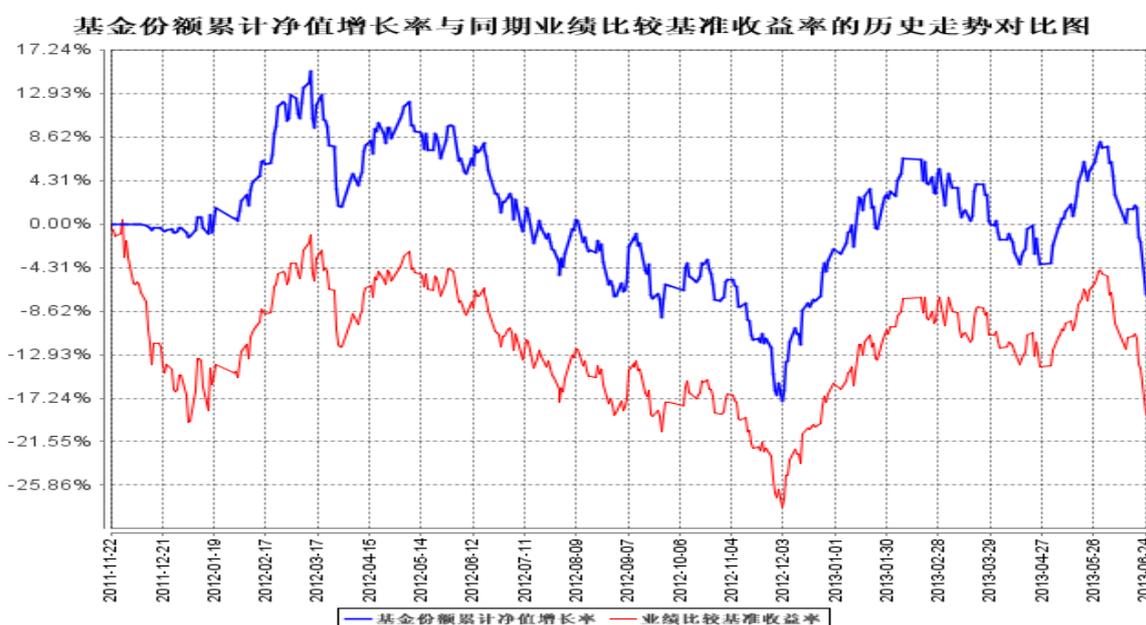
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-13.47%	1.63%	-14.82%	1.63%	1.35%	0.00%
过去三个月	-6.78%	1.32%	-9.04%	1.30%	2.26%	0.02%
过去六个月	-4.56%	1.32%	-3.84%	1.28%	-0.72%	0.04%
过去一年	-8.90%	1.31%	-8.86%	1.28%	-0.04%	0.03%
自基金合同生效起至今	-6.91%	1.22%	-19.04%	1.35%	12.13%	-0.13%

注：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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

上证 380 指数是上海证券交易所和中证指数有限公司于 2010 年 11 月 29 日新推出的代表上交所中

小市值成长性新兴蓝筹股指数，以反映传统蓝筹股之外的一批规模适中、成长性好、盈利能力强的上市公司股票的整体表现。该指数在确定样本空间时，剔除上证 180 指数样本股外，还剔除了上市时间不足一个季度的股票、暂停上市的股票、经营状况异常或最近财务报告严重亏损的股票、股价波动较大市场表现明显受到操作的股票，以及成立 5 年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司，然后按照营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名，根据行业配比原则确定各二级行业内上市公司家数，选择排名前 380 名的公司作为上证 380 指数样本股。

### 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



注：按相关法规及基金合同规定，本基金自合同生效日起 3 个月内为建仓期，报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

## § 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

基金管理人中邮创业基金管理有限公司成立于 2006 年 5 月 18 日，旗下目前管理 8 只开放式基金产品和 7 只专户理财产品，分别为中邮核心优选股票型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮战略新

兴产业股票型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮创业—兴业银行—灵活配置 1 号资产管理计划、中邮创业—华夏银行—灵活配置 1 号资产管理计划、中邮创业—农业银行—分级 1 号资产管理计划、中邮创业—农业银行—量化 1 号资产管理计划、中邮创业—农业银行—分级 2 号资产管理计划、中邮创业—农业银行—分级 3 号资产管理计划、中邮创业—光大银行—债券分级 1 号资产管理计划。

#### 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		
方何	基金经理	2011 年 11 月 22 日	-	7 年	理学硕士，7 年金融从业经历，2000 年 9 月至 2004 年 7 月在安徽大学统计学专业学习；2004 年 9 月至 2006 年 7 月在中国人民大学概率论与数理统计专业学习并获得硕士学位；2006 年 4 月至 2011 年 11 月任中邮创业基金管理有限公司研究员，负责金融工程研究；现任中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金经理、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的《关于基金经理注册通知》、《关于基金经理变更通知》、《关于基金经理注销通知》日期。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

本报告期内，本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，各基金在研究、投资、交易等各方面受到公平对待，确保各基金获得公平交易的机会。

报告期内，本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发生内幕交易的情况；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回及其他交易类业务、注册登记业务均按规定的程序、规则进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

#### 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

在证监会颁发《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》后，由金融工程部组织，对

交易部和投资部相关人员进行了培训，督促相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的顺利执行，公司与衡泰软件共同开发了公平交易系统，并按月度、季度、年度生成各只基金之间的交易价差分析报告，逐一分析得出结论后发送给相关部门和人员。对于报告中产生的异常情况，在做出合理解释后，提请各部门相关人员引起重视，完善公司内部公平交易制度，使之更符合指导意见精神，并避免类似情况再次发生，最后妥善保存分析报告备查。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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未超过该证券当日成交量的 5%。

### 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

今年初市场承接去年底关于改革预期、经济复苏以及城镇化主题继续反弹，并于 2 月中旬大盘股指数达到高点，此后市场风格转移，中小创业板继续反弹，而主板权重板块受到压制。二季度经济数据继续低于预期，政府稳增长政策力度较弱而转型的预期加强，这带来市场分化的加大，以主板为代表的上中游传统行业整体低迷，并在 6 月份的流动性危机下上证综指创出近几年的新低，与此同时，代表中国经济转型与未来方向的中小创业板块加速上涨，今年以来走出牛市特征。

本基金在做好常规跟踪复制之外，着重利用数量化策略进行增强投资，主要策略为量化多因子选股。期初本人延续去年底 GARP 策略选股，并在 2 月市场风格转移，估值因子失效后及时调整策略，加大了盈利质量、成长性等因子的权重，降低估值因子的权重，从而取得了一定效果。另外，报告期内本基金先后遭遇了持续的大额净赎回与净申购，给基金投资造成显著的冲击。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内复权净值下跌 4.56%，跑输基金基准 0.72 个百分点。跑输基准的客观原因是报告期内先后遭遇持续的大额净赎回与净申购冲击，而且多数给基金净值造成显著负向影响（不考虑交易成本，仅仓位 T+1 日的被动变动带来的负向冲击累计达 0.8 个百分点）。主观方面一季度在选股因子取舍上有所失误，带来一定的负向超额收益，所幸的是在二季度做了迅速调整，整体上应贡献了正向超额收益。

基金经理本人为报告期内基金净值跑输基准表示歉意！

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期宏观数据持续低迷，房地产持续调控压制地产新开工，并带来基建及制造业投资的全面

下滑，消费持续低位徘徊，仅在外围欧美经济回升下，出口有一定改善预期。经济转型期，传统产业衰退并面临持续去产能的阵痛，新兴的增长引擎尚未起航，整体经济预期仍将缓慢下行。流动性层面，在美国 QE 逐步退出、国内盘活存量金融去杠杆、IPO 重启背景下，下半年市场流动性将预期收紧。基本面和流动性的双重压力，不利于 3 季度市场表现。但考虑到当前市场低位，下半年十八届三中全会召开，新一届政府施政纲领的全面阐述，市场有望燃起深化改革的利好政策预期。总体上，我们认为主板市场下行空间不大，而对于中小创业板，流动性收紧下要关注其中高估值、成长性不及预期个股的风险。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本基金管理公司于本报告期内成立估值小组，成员由总经理、督察长、基金清算部经理、基金经理及基金会计组成。估值小组负责确定基金估值程序及标准以及对突发事件的处理，在采用估值政策和程序时，充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任和独立性，通过估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，本基金未能满足利润分配条件，故未进行利润分配。

## **§ 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**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中邮上证 380 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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**

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司

2013 年 8 月 27 日

## § 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：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,458,071.54	3,526,364.09
结算备付金		46,801.60	115,852.69
存出保证金		42,512.84	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	26,772,426.01	49,538,651.95
其中：股票投资		26,772,426.01	49,538,651.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	985,205.57
应收利息	6.4.7.5	454.86	714.43
应收股利		9,675.85	-
应收申购款		61,315.05	22,522.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29,391,257.75	54,439,310.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2012 年 12 月 31 日</b>
<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		-	-
应付证券清算款		333,064.21	71,714.06
应付赎回款		4,190.84	67,665.97
应付管理人报酬		25,265.58	42,472.69
应付托管费		5,053.12	8,494.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	35,985.83	58,531.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	338,040.02	420,254.97
负债合计		741,599.60	669,133.99
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	32,565,435.77	58,338,870.19
未分配利润	6.4.7.10	-3,915,777.62	-4,568,693.41
所有者权益合计		28,649,658.15	53,770,176.78
负债和所有者权益总计		29,391,257.75	54,439,310.77

注：报告截至日 2013 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.880 元，基金份额总额 32,565,435.77 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		488,504.50	9,683,187.88
1.利息收入		11,909.23	118,935.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,909.23	95,397.52
债券利息收入		-	11.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	23,527.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,409,359.39	11,994,467.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,127,510.97	11,579,811.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	4,678.99
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	281,848.42	409,976.73
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.16	-2,969,910.85	-2,635,944.14

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	37,146.73	205,728.73
<b>减: 二、费用</b>		749,376.87	1,672,349.62
1. 管理人报酬		194,022.92	487,479.65
2. 托管费		38,804.59	97,495.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	170,958.49	718,456.58
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	345,590.87	368,917.47
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-260,872.37	8,010,838.26
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-260,872.37	8,010,838.26

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

本报告期: 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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)	58,338,870.19	-4,568,693.41	53,770,176.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-260,872.37	-260,872.37
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)	-25,773,434.42	913,788.16	-24,859,646.26
其中: 1.基金申购款	12,580,157.95	-313,845.05	12,266,312.90
2. 基金赎回款	-38,353,592.37	1,227,633.21	-37,125,959.16
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	32,565,435.77	-3,915,777.62	28,649,658.15

项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	204,895,942.81	-880,703.08	204,015,239.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,010,838.26	8,010,838.26
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）	-135,037,604.90	-4,352,264.67	-139,389,869.57
其中：1.基金申购款	24,153,776.58	1,031,928.14	25,185,704.72
2.基金赎回款	-159,191,381.48	-5,384,192.81	-164,575,574.29
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）	-	-5,182,412.69	-5,182,412.69
五、期末所有者权益（基金净值）	69,858,337.91	-2,404,542.18	67,453,795.73

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：

周克

周克

刘 弢

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金（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”）证监许可[2011]1261 号《关于核准中邮上证 380 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准，由中邮创业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》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》发起，并于 2011 年 11 月 22 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集包括认购资金利息共募集 456,870,635.87 元，业经京都天华会计师事务所有限公司京都天华验字（2011）第 0203 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮上证 380 指数增强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、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券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。在正常市场情况下，本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为：股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%；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%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制，执行财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则、中国证券业协会 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础的财务报表符合企业会计准则的要求，真实完整地反映了基金财务状况、经营成果和所有者权益（基金净值）变动等有关信息。

#### 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

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。

#### 6.4.5 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》、财税字[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部国家税务总局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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金主要税项列示如下：

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。
2. 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。自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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。

3. 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。
4. 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。

## 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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	2,458,071.54
定期存款	-
其他存款	-
合计：	2,458,071.54

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	29,226,281.47	26,772,426.01	-2,453,855.46
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	29,226,281.47	26,772,426.01	-2,453,855.46

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购金融资产。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	418.68
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	18.99
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	17.19
合计	454.86

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	35,985.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	35,985.83

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14.16
预提费用	238,025.86
应付指数使用费	100,000.00
合计	338,040.02

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,338,870.19	58,338,870.19
本期申购	12,580,157.95	12,580,157.95

本期赎回(以“-”号填列)	-38,353,592.37	-38,353,592.37
本期末	32,565,435.77	32,565,435.77

#### 6.4.7.10 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
上年度末	-4,661,455.91	92,762.50	-4,568,693.41
本期利润	2,709,038.48	-2,969,910.85	-260,872.37
本期基金份额交易产生的变动数	1,424,106.90	-510,318.74	913,788.16
其中：基金申购款	-413,393.06	99,548.01	-313,845.05
基金赎回款	1,837,499.96	-609,866.75	1,227,633.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-528,310.53	-3,387,467.09	-3,915,777.62

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	10,701.35
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	598.95
其他	608.93
合计	11,909.23

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	63,500,423.20
减：卖出股票成本总额	60,372,912.23
买卖股票差价收入	3,127,510.97

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	281,848.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	281,848.42

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,969,910.85
——股票投资	-2,969,910.85
——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	-2,969,910.85

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	37,146.73
合计	37,146.73

注：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。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	170,958.49
银行间市场交易费用	-
合计	170,958.49

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	198,354.28
银行费用	2,665.01
债券帐户维护费	4,500.00

指数使用费	100,000.00
其他	400.00
合计	345,590.87

#### 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

本基金本报告期内不存在或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2013 年 8 月 27 日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化。

##### 6.4.9.2 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
中邮创业基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国邮政储蓄银行有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金代销机构

#### 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

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生通过关联方交易单元进行交易的情况。

##### 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	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	194,022.92	487,479.65
其中：支付销售机构的客户维护费	40,561.66	110,924.48

注：支付基金管理人中邮创业基金管理有限公司的基金管理费，按前一日基金资产净值的 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	38,804.59	97,495.92

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

**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**

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方发生银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2011 年 11 月 22 日）持有的基金份额	4,999,400.00	4,999,400.00
期初持有的基金份额	4,999,400.00	4,999,400.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,999,400.00	4,999,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.35%	7.16%

**6.4.10.4.2 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**

本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

**6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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
中国银行股份有限公司	2,458,071.54	10,701.35	4,910,237.99	70,011.73

公司				
----	--	--	--	--

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生在承销期内参与认购关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2013 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

本报告期末本基金未持有因认购/增发而持有的流通受限证券

##### 6.4.12.2 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
600284	浦东建设	2013 年 6 月 24 日	重大事项	9.50	2013 年 8 月 28 日	-	36,000	312,003.32	342,000.00	-
600328	兰太实业	2013 年 5 月 8 日	重大事项	7.30	2013 年 7 月 31 日	6.57	24,831	199,090.82	181,266.30	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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

###### （1）风险管理政策

本基金管理人根据中国证监会的要求，建立了科学合理层次分明的内控组织架构、控制程序、控制措施和控制职责。

本基金管理人已建立了一套较为完整的决策流程和业务操作流程，每个员工各司其责，监察稽核部定期对各部门、各业务流程进行监察稽核，充分保证了各项管理制度和业务流程的有效执行。

###### （2）风险管理组织架构

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、风险控制委员会、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。

公司上述风险管理职能部门运转正常，充分发挥各自的职能，不断揭示并化解各类风险。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险指基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而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，而且通过分散化投资以分散信用风险。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很小。

#### **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困难而导致损失的风险。本基金的流动性风险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。本基金所持大部分股票均是交易相对活跃的大盘股，变现能力较强。

本基金管理人设专人通过独立的检测系统对流动性指标进行监测和分析，并进行动态调整，充分保证本基金有充足的现金流。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指金融工具或证券的价值对市场参数变化的敏感性，是基金资产运作中所不可避免地承受因市场任何波动而产生的风险。本基金管理人已建立了一套较完整的系统性风险预警和监控系统，利用设定系统参数对市场风险进行度量和监控。主要通过调整 VaR 的最高和最低限以及日常 VaR 的值，实现对市场风险的控制和管理。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	不计息	合计
资产				
银行存款	2,458,071.54	-	-	2,458,071.54
结算备付金	46,801.60	-	-	46,801.60
存出保证金	42,512.84	-	-	42,512.84
交易性金融资产	-	-	26,772,426.01	26,772,426.01
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	454.86	454.86
应收股利	-	-	9,675.85	9,675.85
应收申购款	-	-	61,315.05	61,315.05
其他资产	-	-	-	-
资产总计	2,547,385.98	-	26,843,871.77	29,391,257.75
负债				
应付证券清算款	-	-	333,064.21	333,064.21
应付赎回款	-	-	4,190.84	4,190.84
应付管理人报酬	-	-	25,265.58	25,265.58
应付托管费	-	-	5,053.12	5,053.12
应付交易费用	-	-	35,985.83	35,985.83
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	338,040.02	338,040.02
负债总计	-	-	741,599.60	741,599.60
利率敏感度缺口	2,547,385.98	-	26,102,272.17	28,649,658.15
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	不计息	合计
资产				
银行存款	3,526,364.09	-	-	3,526,364.09
结算备付金	115,852.69	-	-	115,852.69
存出保证金	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	-	49,538,651.95	49,538,651.95
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	985,205.57	985,205.57
应收利息	-	-	714.43	714.43
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	22,522.04	22,522.04
其他资产	-	-	-	-
资产总计	3,642,216.78	-	50,797,093.99	54,439,310.77
负债				

应付证券清算款	-	-	71,714.06	71,714.06
应付赎回款	-	-	67,665.97	67,665.97
应付管理人报酬	-	-	42,472.69	42,472.69
应付托管费	-	-	8,494.54	8,494.54
应付交易费用	-	-	58,531.76	58,531.76
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	420,254.97	420,254.97
负债总计	-	-	669,133.99	669,133.99
利率敏感度缺口	3,642,216.78	-	50,127,960.00	53,770,176.78

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

##### 市场价格风险

市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为：股票资产占基金资产净值的比例为 90%-95%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，并保证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。

于 2013 年 06 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	26,772,426.01	93.45	49,538,651.95	92.13
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	26,772,426.01	93.45	49,538,651.95	92.13

**6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	1. 固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1%		
	2. 固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1%		
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（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	270,997.96	421,014.67
	2. 基金净资产变动	-270,997.96	-421,014.67

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，无风险收益率取 13 年 6 月 28 日十年期国债收益率 3.51%，利用 13 年基金日收益率与基金基准日收益率计算得到基金的 Beta 系数为 1.01。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无

## § 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	26,772,426.01	91.09
	其中：股票	26,772,426.01	91.09
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	2,504,873.14	8.52
6	其他各项资产	113,958.60	0.39
7	合计	29,391,257.75	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	290,600.00	1.01
C	制造业	11,379,465.05	39.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,767,432.70	6.17
E	建筑业	1,009,582.80	3.52
F	批发和零售业	3,957,798.55	13.81
G	交通运输、仓储和邮政业	2,114,576.19	7.38
H	住宿和餐饮业	251,400.00	0.88
I	信息传输、软件和信息技术服务业	526,275.00	1.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	936,482.80	3.27
L	租赁和商务服务业	216,360.78	0.76
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	717,629.70	2.50
S	综合	219,840.00	0.77
	合计	23,387,443.57	81.63

注：由于四舍五入原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 7.2.2 期末积极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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,951,382.44	6.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	308,000.00	1.08
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	-	-
J	金融业	331,800.00	1.16
K	房地产业	793,800.00	2.77
L	租赁和商务服务业	-	-
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	3,384,982.44	11.82

注：由于四舍五入原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 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

### 7.3.1 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	600694	大商股份	20,000	578,600.00	2.02
2	600153	建发股份	90,000	566,100.00	1.98
3	600527	江南高纤	86,000	480,740.00	1.68
4	600587	新华医疗	11,260	466,614.40	1.63
5	600724	宁波富达	100,000	427,000.00	1.49
6	600993	马应龙	25,512	403,089.60	1.41
7	600886	国投电力	119,040	402,355.20	1.40
8	601139	深圳燃气	43,550	387,159.50	1.35
9	600062	华润双鹤	19,300	386,386.00	1.35
10	600409	三友化工	95,100	348,066.00	1.21
11	600697	欧亚集团	18,600	342,054.00	1.19
12	600284	浦东建设	36,000	342,000.00	1.19
13	600750	江中药业	18,228	325,005.24	1.13
14	600743	华远地产	115,560	303,922.80	1.06
15	600597	光明乳业	22,209	299,599.41	1.05
16	600859	王府井	18,405	296,504.55	1.03
17	600298	安琪酵母	17,058	296,468.04	1.03
18	601000	唐山港	111,960	293,335.20	1.02
19	600387	海越股份	20,000	292,800.00	1.02
20	600004	白云机场	45,419	285,685.51	1.00
21	601231	环旭电子	18,000	281,340.00	0.98
22	600729	重庆百货	14,500	280,865.00	0.98
23	600827	友谊股份	40,000	274,800.00	0.96
24	601258	庞大集团	46,000	271,860.00	0.95
25	601098	中南传媒	28,950	269,235.00	0.94
26	600588	用友软件	30,000	268,200.00	0.94
27	600612	老凤祥	16,300	266,831.00	0.93
28	600880	博瑞传播	15,000	264,450.00	0.92
29	600967	北方创业	25,824	263,921.28	0.92
30	600469	风神股份	35,000	262,500.00	0.92
31	600686	金龙汽车	28,000	261,800.00	0.91
32	600170	上海建工	38,000	259,920.00	0.91
33	600570	恒生电子	20,646	258,075.00	0.90
34	601933	永辉超市	22,000	256,740.00	0.90
35	600754	锦江股份	20,000	251,400.00	0.88
36	600525	长园集团	40,000	246,400.00	0.86
37	600496	精工钢构	35,340	241,018.80	0.84
38	600270	外运发展	35,712	239,270.40	0.84

39	600863	内蒙华电	42,000	237,300.00	0.83
40	600098	广州发展	46,500	234,360.00	0.82
41	600318	巢东股份	20,000	233,800.00	0.82
42	600978	宜华木业	52,824	231,897.36	0.81
43	600262	北方股份	16,737	230,133.75	0.80
44	600038	哈飞股份	10,000	224,200.00	0.78
45	600805	悦达投资	24,000	219,840.00	0.77
46	600881	亚泰集团	55,800	217,062.00	0.76
47	600138	中青旅	16,554	216,360.78	0.76
48	600580	卧龙电气	40,000	216,000.00	0.75
49	600079	人福医药	8,277	215,864.16	0.75
50	600511	国药股份	15,000	215,100.00	0.75
51	601126	四方股份	14,880	215,016.00	0.75
52	600499	科达机电	18,000	214,020.00	0.75
53	601333	广深铁路	93,000	213,900.00	0.75
54	600396	金山股份	35,000	213,150.00	0.74
55	603001	奥康国际	14,880	209,361.60	0.73
56	600114	东睦股份	22,000	206,580.00	0.72
57	600684	珠江实业	18,000	205,560.00	0.72
58	600458	时代新材	22,608	205,506.72	0.72
59	600897	厦门空港	17,319	205,403.34	0.72
60	600388	龙净环保	9,000	204,030.00	0.71
61	601567	三星电气	25,110	202,637.70	0.71
62	601018	宁波港	100,000	202,000.00	0.71
63	600018	上港集团	80,900	200,632.00	0.70
64	600559	老白干酒	7,500	199,500.00	0.70
65	600522	中天科技	23,250	196,230.00	0.68
66	600480	凌云股份	29,760	190,761.60	0.67
67	600869	三普药业	30,000	187,800.00	0.66
68	600195	中牧股份	16,681	185,826.34	0.65
69	600481	双良节能	26,000	185,120.00	0.65
70	601877	正泰电器	9,300	184,512.00	0.64
71	600312	平高电气	20,000	184,400.00	0.64
72	601801	皖新传媒	17,670	183,944.70	0.64
73	600507	方大特钢	50,000	183,500.00	0.64
74	600582	天地科技	28,458	182,700.36	0.64
75	600328	兰太实业	24,831	181,266.30	0.63
76	601010	文峰股份	29,295	179,285.40	0.63
77	601908	京运通	30,000	178,200.00	0.62

78	601678	滨化股份	25,000	178,000.00	0.62
79	600720	祁连山	20,000	170,800.00	0.60
80	600403	大有能源	20,000	170,400.00	0.59
81	600017	日照港	74,400	169,632.00	0.59
82	600141	兴发集团	15,000	168,000.00	0.59
83	600176	中国玻纤	22,000	167,860.00	0.59
84	600502	安徽水利	24,688	166,644.00	0.58
85	600459	贵研铂业	10,000	162,800.00	0.57
86	600660	福耀玻璃	21,933	157,698.27	0.55
87	600197	伊力特	16,000	157,120.00	0.55
88	601107	四川成渝	57,939	154,117.74	0.54
89	600426	华鲁恒升	28,136	153,903.92	0.54
90	600780	XD 通宝能	26,600	151,088.00	0.53
91	600717	天津港	30,000	150,600.00	0.53
92	600829	三精制药	22,000	145,200.00	0.51
93	600283	钱江水利	18,000	142,020.00	0.50
94	600487	亨通光电	7,440	141,285.60	0.49
95	600172	黄河旋风	20,000	124,600.00	0.43
96	600139	西部资源	20,000	120,200.00	0.42
97	601515	东风股份	10,000	119,000.00	0.42
98	600963	岳阳林纸	30,000	81,600.00	0.28

### 7.3.2 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

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	600067	冠城大通	60,000	479,400.00	1.67
2	600089	特变电工	50,000	402,500.00	1.40
3	000525	红太阳	26,000	389,740.00	1.36
4	000625	长安汽车	40,000	371,600.00	1.30
5	300054	鼎龙股份	19,476	334,792.44	1.17
6	601901	方正证券	60,000	331,800.00	1.16
7	600239	云南城投	60,000	314,400.00	1.10
8	002375	亚厦股份	10,000	308,000.00	1.08
9	300072	三聚环保	15,000	240,750.00	0.84
10	300105	龙源技术	8,000	212,000.00	0.74

## 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	300285	国瓷材料	917,179.00	1.71
2	300001	特锐德	880,016.79	1.64
3	600153	建发股份	697,800.00	1.30
4	600089	特变电工	686,761.00	1.28
5	600805	悦达投资	660,450.00	1.23
6	002064	华峰氨纶	638,000.00	1.19
7	601012	隆基股份	629,068.95	1.17
8	600694	大商股份	618,700.00	1.15
9	000059	辽通化工	612,300.00	1.14
10	300165	天瑞仪器	610,940.01	1.14
11	600312	平高电气	556,365.00	1.03
12	002586	围海股份	521,355.00	0.97
13	600387	海越股份	513,300.00	0.95
14	000783	长江证券	507,298.57	0.94
15	300003	乐普医疗	482,250.00	0.90
16	600239	云南城投	472,400.00	0.88
17	600886	国投电力	469,840.00	0.87
18	000009	中国宝安	461,000.00	0.86
19	600724	宁波富达	456,259.00	0.85
20	600233	大杨创世	455,829.00	0.85

注：买入金额均按买入成交金额（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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300285	国瓷材料	1,079,752.24	2.01
2	600388	龙净环保	886,797.00	1.65
3	300001	特锐德	873,478.38	1.62
4	600067	冠城大通	804,404.00	1.50
5	002064	华峰氨纶	794,400.00	1.48

6	601918	国投新集	755,270.77	1.40
7	600070	浙江富润	753,623.50	1.40
8	601012	隆基股份	720,015.69	1.34
9	600153	建发股份	699,360.39	1.30
10	600375	华菱星马	613,295.50	1.14
11	600006	东风汽车	592,000.00	1.10
12	000059	辽通化工	565,527.00	1.05
13	300275	梅安森	564,803.20	1.05
14	600668	尖峰集团	533,700.50	0.99
15	002457	青龙管业	533,452.00	0.99
16	300165	天瑞仪器	512,000.00	0.95
17	002586	围海股份	500,584.00	0.93
18	002244	滨江集团	499,910.51	0.93
19	600157	永泰能源	498,988.00	0.93
20	000783	长江证券	490,526.00	0.91

注：卖出金额均按卖出成交金额（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

买入股票成本（成交）总额	40,576,597.14
卖出股票收入（成交）总额	63,500,423.20

注：买入股票成本及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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.9.2 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。

## 7.10 投资组合报告附注

**7.10.1** 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

**7.10.2** 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内股票。

### 7.10.3 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	42,512.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	9,675.85
4	应收利息	454.86
5	应收申购款	61,315.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	113,958.60

### 7.10.4 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。

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 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

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
3,227	10,091.55	7,247,111.18	22.25%	25,318,324.59	77.75%

### 8.2 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
基金管理人所有从业人员 持有本基金	1,242,468.73	3.8153%

注：1、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 万份。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0 万份。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 11 月 22 日）基金份额总额	456,870,635.87
本报告期期初基金份额总额	58,338,870.19
本报告期基金总申购份额	12,580,157.95
减：本报告期基金总赎回份额	38,353,592.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	32,565,435.77

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

## 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

经本公司总经理办公会审议通过，自 2013 年 05 月 27 日起增聘陈钢先生担任中邮核心优选股票型证券投资基金基金经理。

2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2013 年 6 月 1 日，中国银行股份有限公司发布公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

## 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

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 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	
中国银河证券股份有限公司	1	79,069,538.67	76.02%	71,984.67	76.28%	-
齐鲁证券有限公司	1	24,940,820.57	23.98%	22,380.98	23.72%	-
天风证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

(1) 券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与中邮创业基金管理有限公司有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

(2) 券商经纪人具有较强的综合服务能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据中邮创业基金管理有限公司所管理基金的特定要求，提供研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

(3) 券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠合理的佣金率。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券公司的选择。基金管理人与被选择的证券公司签订委托协议，报中国证监会备案并通知基金托管人。

2、报告期内租用交易单元变更情况：本报告期内本基金不存在交易单元退租情况。

### 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

本报告期本基金租用的证券公司交易单元未进行其他证券投资。

## 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	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2012 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2013 年 1 月 4 日
2	中邮创业基金管理有限公司旗下基金 2012 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2013 年 1 月 4 日
3	中邮创业基金管理有限公司关于增加东方证券、方正证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2013 年 1 月 12 日
4	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2012 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2013 年 1 月 22 日
5	关于中邮创业基金管理有限公司旗下基金开通数米基金销售公司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	2013 年 3 月 6 日
6	中邮创业基金管理有限公司关于增加数米基金销售公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2013 年 3 月 6 日
7	中邮创业基金管理有限公司旗下	中国证券报、上海证券报、	2013 年 3 月 29 日

	部分基金参加工商银行个人电子银行申购基金费率优惠的公告	证券时报、证券日报	
8	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2012 年年度报告 摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2013 年 3 月 30 日
9	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2012 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2013 年 3 月 30 日
10	中邮创业基金管理有限公司参加北京展恒基金销售有限公司网上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	2013 年 4 月 3 日
11	中邮创业基金管理有限公司参加和讯信息科技有限公司基金电子交易平台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	2013 年 4 月 18 日
12	中邮创业基金管理有限公司关于增加和讯信息科技有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2013 年 4 月 18 日
13	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2013 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2013 年 4 月 20 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮上证 380 指数增强型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金招募说明书》
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、营业执照
7. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

### 11.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登陆基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中邮创业基金管理有限公司。

客户服务中心电话：010-58511618 400-880-1618

基金管理人网址：[www.postfund.com.cn](http://www.postfund.com.cn)

中邮创业基金管理有限公司  
2013 年 8 月 28 日