

中海上证 380 指数证券投资基金 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 8 月 28 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。本半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 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	29
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	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43
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	43
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.10 投资组合报告附注	43
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45

§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	48
§11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录	49
11.2 存放地点	49
11.3 查阅方式	49

§ 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	67,074,872.62 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	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。 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。 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。
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金半年度报告备置地点	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
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	-1,123,915.32
本期利润	-158,775.89

加权平均基金份额本期利润	-0.0020
本期加权平均净值利润率	-0.21%
本期基金份额净值增长率	-3.24%
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	-8,934,379.15
期末可供分配基金份额利润	-0.1332
期末基金资产净值	58,140,493.47
期末基金份额净值	0.867
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	-13.30%

注 1：本报告期指自 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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
过去一个月	-14.33%	1.59%	-14.82%	1.63%	0.49%	-0.04%
过去三个月	-8.35%	1.28%	-9.04%	1.30%	0.69%	-0.02%
过去六个月	-3.24%	1.27%	-3.84%	1.28%	0.60%	-0.01%
过去一年	-9.50%	1.25%	-8.86%	1.28%	-0.64%	-0.03%
自基金合同生效日起至 今	-13.30%	1.16%	-14.93%	1.27%	1.63%	-0.11%

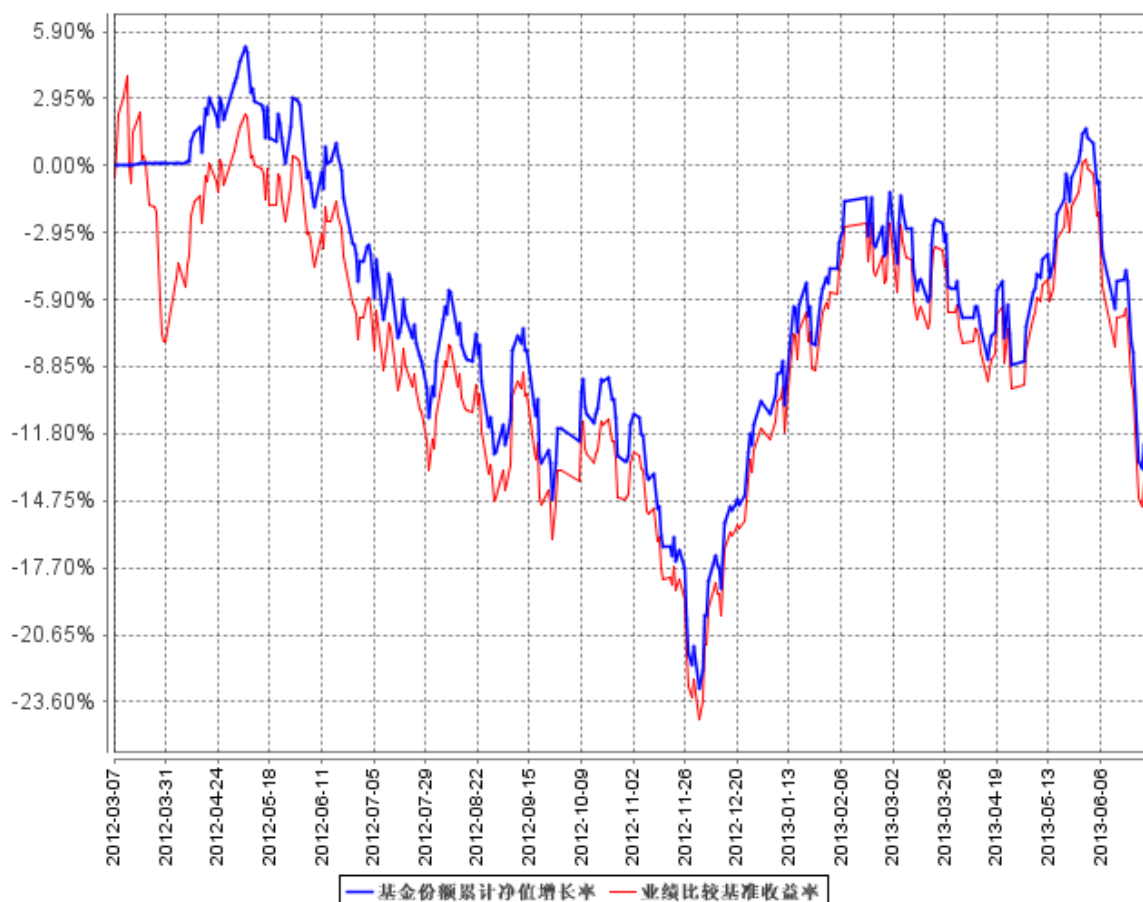
注 1：“自基金合同生效起至今”指 2012 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日。

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。

§ 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 2013 年 6 月

30 日，共管理证券投资基金 15 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、本基金基金经理	2012 年 3 月 7 日	-	8	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、中科大上海研发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 2013 年 1 月任中海上证 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 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司依据 2011 年修订的《中海基金公平交易管理办法》，从投资决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估等方面对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动进行全程公平交易管理。

投资决策内部控制方面：（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工作管理的需要外，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，由交易部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。(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，保证时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实。(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。

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 2013 年上半年所有组合在日内、3 日、5 日所有同向交易数据进行了采集，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 统计检验，绝大多数样本通过相关检验。(3)对 2013 年上半年所有组合同向交易的交易占优情况进行了统计，在同向交易采集样本数大于 30 个的前提下，日内、3 日、5 日的期间窗口下，部分组合对比的统计值未满足交易占优比 45%-55%的比例。需要指出的是，组合的同向交易的样本数越大，组合之间的交易占优情况满足交易占优比 45%-55%的比例越高。(4)对于不同时间期间的同组合反向交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量进行了综合分析，未发现异常情况。不同时间期间的不同组合的反向交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量进行了综合分析，未发现异常交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

1 月，市场延续上涨趋势，大盘指数上涨幅度不大，但是波动幅度加大，风格偏向小盘股。2 月，市场冲高 2444.80 点后出现回落，大盘股尤其是银行股和周期股下跌较多，中小盘下跌相对较少，尤其是创业板非常抗跌。3 月，市场成 N 字形震荡，大盘在季末最后一个交易日创出近期新低 2228.81 点。4 月，市场一路下探，随后展开反弹。5 月，市场振荡上行，中小盘上涨较多，尤其是创业板表现抢眼。6 月，在流动性意外急剧紧张的压力下，市场出现迅速的暴跌，大盘跌破 1949，并创出 1849 的新低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值 0.867 元(累计净值 0.867 元)。报告期内本基金净

值增长率为-3.24%，高于业绩比较基准 0.60 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

展望未来，市场流动性大部分时间会维持紧平衡，但经济下滑态势难改，在去杠杆的过程中，市场对经济下限和底线政府可能采取的措施维持迷茫的观察态度，市场目前维持振荡格局。如果期间出现流动性的重大利空，则大盘可能重回下跌趋势，如果大盘下半年创出年内新低，则大盘可望迎来一次较好的反弹行情。

380 指数基金以跟踪标的指数，控制跟踪误差为主要目标，以复制指数为主要操作策略。

4.6 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。

4.7 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，本基金本报告期内未发生利润分配。

§ 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

2013 年上半年，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

2013 年上半年，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。本报告期内，中海上证 380 指数证券投资基金未进行利润分配。

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 2013 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中海上证 380 指数证券投资基金

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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,542,448.00	4,223,024.38
结算备付金		-	12,186.89
存出保证金		5,251.78	333,333.36
交易性金融资产	6.4.7.2	54,606,586.46	73,624,767.65
其中：股票投资		54,606,586.46	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		283,062.42	-
应收利息	6.4.7.5	665.49	800.56
应收股利		25,094.24	-
应收申购款		2,174.38	592.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		58,465,282.77	78,194,705.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	-
应付赎回款		25,956.19	872.98
应付管理人报酬		40,131.99	46,311.66
应付托管费		8,026.38	9,262.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	28,330.21	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	6.4.7.8	222,344.53	62,037.06
负债合计		324,789.30	185,465.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	67,074,872.62	87,068,082.65
未分配利润	6.4.7.10	-8,934,379.15	-9,058,842.55
所有者权益合计		58,140,493.47	78,009,240.10
负债和所有者权益总计		58,465,282.77	78,194,705.72

注：报告截至日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.867 元，基金份额总额 67,074,872.62 份。

6.2 利润表

会计主体：中海上证 380 指数证券投资基金

本报告期：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 3 月 7 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		436,496.14	-2,444,216.81
1.利息收入		15,957.10	661,482.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,957.10	75,448.44
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）		-560,061.93	1,742,073.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,195,023.27	1,065,734.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	634,961.34	676,338.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	965,139.43	-5,042,663.22
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	15,461.54	194,891.21
减：二、费用		595,272.03	858,230.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	283,699.75	402,978.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,739.89	80,595.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	86,337.81	237,623.31
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	168,494.58	137,033.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-158,775.89	-3,302,447.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-158,775.89	-3,302,447.74

注：本基金合同生效日为 2012 年 3 月 7 日，上年度可比期间为 2012 年 3 月 7 日至 2012 年 6 月 30 日，下同。

6.3 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：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）	87,068,082.65	-9,058,842.55	78,009,240.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-158,775.89	-158,775.89
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）	-19,993,210.03	283,239.29	-19,709,970.74
其中：1.基金申购款	596,331.10	-36,865.10	559,466.00
2. 基金赎回款	-20,589,541.13	320,104.39	-20,269,436.74

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)	67,074,872.62	-8,934,379.15	58,140,493.47
项目	上年度可比期间 2012 年 3 月 7 日至 2012 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)	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)	-	-3,302,447.74	-3,302,447.74
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)	-153,313,799.24	-1,455,500.29	-154,769,299.53
其中：1.基金申购款	1,109,063.70	31,865.19	1,140,928.89
2.基金赎回款	-154,422,862.94	-1,487,365.48	-155,910,228.42
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)	113,911,554.67	-4,757,948.03	109,153,606.64

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：

黄鹏

宋宇

曹伟

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》及有关法律法规规定，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》核准募集。

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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《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。

6.4.3 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。

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

本基金在本报告期内不存在重大会计差错。

6.4.6 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：

6.4.6.1

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。

6.4.6.2

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。

6.4.6.3

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, 暂不征收企业所得税。

6.4.6.4

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。

6.4.6.5

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。

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	3, 542, 448. 00
定期存款	—
其中: 存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计:	3, 542, 448. 00

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		60, 330, 616. 95	54, 606, 586. 46	-5, 724, 030. 49
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		60, 330, 616. 95	54, 606, 586. 46	-5, 724, 030. 49

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 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。

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	663.33
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	—
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	2.16
合计	665.49

6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

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	28,330.21
银行间市场应付交易费用	—
合计	28,330.21

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	49.34
应付指数使用费	3,626.92

预提费用	218,668.27
合计	222,344.53

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	87,068,082.65	87,068,082.65
本期申购	596,331.10	596,331.10
本期赎回(以“-”号填列)	-20,589,541.13	-20,589,541.13
本期末	67,074,872.62	67,074,872.62

注：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。

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	-3,589,899.72	-5,468,942.83	-9,058,842.55
本期利润	-1,123,915.32	965,139.43	-158,775.89
本期基金份额交易产生的变动数	1,076,087.24	-792,847.95	283,239.29
其中：基金申购款	-31,072.81	-5,792.29	-36,865.10
基金赎回款	1,107,160.05	-787,055.66	320,104.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,637,727.80	-5,296,651.35	-8,934,379.15

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	15,730.01
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	111.49
其他	115.60
合计	15,957.10

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	34,355,861.97
减：卖出股票成本总额	35,550,885.24
买卖股票差价收入	-1,195,023.27

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金在本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金在本报告期无衍生工具投资收益。

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	634,961.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	634,961.34

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	965,139.43
——股票投资	965,139.43
——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	965,139.43

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	15,393.11
转出基金补偿收入	68.43
合计	15,461.54

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	86,337.81
银行间市场交易费用	-
合计	86,337.81

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	21,819.55
信息披露费	138,848.72
银行费用	261.00
指数使用费	7,565.31
合计	168,494.58

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**

本基金在本报告期无需要说明的或有事项。

6.4.8.2 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。

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**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易各关联方

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
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

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****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 3 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 6 月 30 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	161,510.82	0.32%	185,673,925.95	100.00%

债券交易

注：本报告期及上年度可比期间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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 3 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 6 月 30 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%

6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30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	147.01	0.32%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年3月7日(基金合同生效日)至2012年6月30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	158,091.62	100.00%	158,091.62	100.00%

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市场信息服务。

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 2013年1月1日至2013年6 月30日	上年度可比期间 2012年3月7日(基金合同生效日) 至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	283,699.75	402,978.18
其中：支付销售机构的客户维护费	62,272.39	73,636.67

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日) 至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,739.89	80,595.67

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。

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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未与关联方进行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**

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 3 月 7 日(基金合同生效日)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
中国工商银行股份有限公司	3,542,448.00	15,730.01	6,735,687.52	67,337.90

注：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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金在本报告期末未发生利润分配。

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

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

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
600433	冠豪高新	2013 年 6 月 13 日	重大事项停牌	15.77	-	-	33,093	122,307.84	521,876.61	-
601918	国投新集	2013 年 5 月 16 日	重大事项停牌	7.55	2013 年 8 月 23 日	5.05	45,773	618,486.81	345,586.15	-
600983	合肥三洋	2013 年 5 月 14 日	重大事项停牌	9.96	2013 年 8 月 14 日	10.90	21,728	170,440.62	216,410.88	-
600284	浦东建设	2013 年 6 月 24 日	重大事项停牌	9.50	-	-	20,207	182,964.04	191,966.50	-
601886	江河创建	2013 年 6 月 20 日	重大事项停牌	13.22	2013 年 7 月 16 日	13.78	9,576	88,781.93	126,594.72	-
600088	中视传媒	2013 年 5 月 30 日	重大事项停牌	14.29	-	-	8,773	125,443.15	125,366.17	-
600335	国机汽车	2013 年 3 月 25 日	重大事项停牌	13.43	2013 年 7 月 1 日	13.99	9,128	109,367.56	122,589.04	-
600175	美都控股	2013 年 5 月 29 日	重大事项停牌	2.78	2013 年 7 月 12 日	3.06	36,619	103,463.38	101,800.82	-
600368	五洲交通	2013 年 6 月 19 日	重大事项停牌	5.00	2013 年 7 月 3 日	4.50	19,075	82,160.50	95,375.00	-
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	9,042	91,076.32	66,006.60	-

		日	停牌		日					
600292	九龙 电力	2013 年 6 月 5 日	重大 事项 停牌	16.90	2013 年 7 月 1 日	17.50	10,695	128,716.21	180,745.50	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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发行的证券，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	-	-

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现困难，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。2013 年 6 月 30 日，本基金股票资产持仓比例为 93.92%。2012 年 12 月 31 日，本基金股票资产持仓比例为 94.38%。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	54,606,586.46	93.92	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	54,606,586.46	93.92	73,624,767.65	94.38

6.4.13.4.3.2 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（2013 年 6 月	上年度末（2012 年 12 月

		30 日)	31 日)
	+5%	2,567,446.18	3,425,772.39
	-5%	-2,567,446.18	-3,425,772.39

6.4.13.4.4 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 (2013 年 6 月 30 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	收益率绝对 VaR (%)	2.15	2.10

§ 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	54,606,586.46	93.40
	其中：股票	54,606,586.46	93.40
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	3,542,448.00	6.06
6	其他各项资产	316,248.31	0.54
7	合计	58,465,282.77	100.00

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	219,168.11	0.38
B	采矿业	986,190.96	1.70
C	制造业	27,531,887.02	47.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,417,899.79	5.88
E	建筑业	1,338,873.28	2.30
F	批发和零售业	5,479,965.77	9.43
G	交通运输、仓储和邮政业	4,474,638.86	7.70
H	住宿和餐饮业	118,107.72	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,233,855.44	2.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,375,099.11	2.37
L	租赁和商务服务业	617,411.04	1.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	417,513.31	0.72
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	1,210,173.25	2.08
S	综合	686,049.46	1.18
	合计	49,106,833.12	84.46

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	670,730.00	1.15
C	制造业	2,320,695.34	3.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,234,734.00	2.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	198,044.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	343,085.00	0.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	469,869.00	0.81
J	金融业	-	-
K	房地产业	199,511.00	0.34
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		
0	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	63,085.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	5,499,753.34	9.46

注：本基金为完全复制指数的股票型基金，不进行积极投资。为有效跟踪指数，同时根据中证指数有限公司指数样本股调整规则，本基金提前买入将于 7 月 1 日计入指数的样本股，所以积极投资组合的股票均为“将于 7 月 1 日计入指数的样本股”。

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	601991	大唐发电	146,581	753,426.34	1.30
2	600688	上海石化	76,677	627,984.63	1.08
3	600433	冠豪高新	33,093	521,876.61	0.90
4	600079	人福医药	19,373	505,247.84	0.87
5	600660	福耀玻璃	68,966	495,865.54	0.85
6	600867	通化东宝	32,664	486,366.96	0.84
7	600886	国投电力	140,433	474,663.54	0.82
8	600200	江苏吴中	30,260	473,266.40	0.81
9	600879	航天电子	68,727	461,158.17	0.79
10	600352	浙江龙盛	47,634	446,806.92	0.77
11	600005	武钢股份	199,411	446,680.64	0.77
12	600694	大商股份	15,419	446,071.67	0.77
13	600153	建发股份	66,489	418,215.81	0.72
14	600436	片仔癀	2,989	408,954.98	0.70
15	600594	益佰制药	12,860	397,502.60	0.68
16	601018	宁波港	191,280	386,385.60	0.66
17	600388	龙净环保	16,742	379,541.14	0.65
18	600880	博瑞传播	21,495	378,956.85	0.65
19	600557	康缘药业	14,166	376,107.30	0.65
20	600881	亚泰集团	91,889	357,448.21	0.61
21	600832	东方明珠	64,677	356,370.27	0.61
22	601933	永辉超市	30,166	352,037.22	0.61

23	601333	广深铁路	152,070	349,761.00	0.60
24	600718	东软集团	42,966	349,743.24	0.60
25	600267	海正药业	27,450	349,164.00	0.60
26	601918	国投新集	45,773	345,586.15	0.59
27	600872	中炬高新	47,506	333,967.18	0.57
28	600655	豫园商城	50,692	330,004.92	0.57
29	600587	新华医疗	7,927	328,494.88	0.57
30	600570	恒生电子	26,109	326,362.50	0.56
31	601877	正泰电器	16,407	325,514.88	0.56
32	600805	悦达投资	33,981	311,265.96	0.54
33	600458	时代新材	34,028	309,314.52	0.53
34	601727	上海电气	90,861	303,475.74	0.52
35	600312	平高电气	32,429	298,995.38	0.51
36	600138	中青旅	22,781	297,747.67	0.51
37	600110	中科英华	59,695	296,684.15	0.51
38	600596	新安股份	27,928	294,640.40	0.51
39	600811	东方集团	57,470	283,327.10	0.49
40	600517	置信电气	20,070	282,987.00	0.49
41	600521	华海药业	18,252	278,343.00	0.48
42	600651	飞乐音响	52,973	277,578.52	0.48
43	600499	科达机电	22,464	267,096.96	0.46
44	600635	大众公用	69,548	265,673.36	0.46
45	600584	长电科技	44,931	261,498.42	0.45
46	600527	江南高纤	45,869	256,407.71	0.44
47	600059	古越龙山	22,829	256,141.38	0.44
48	600522	中天科技	30,061	253,714.84	0.44
49	600572	康恩贝	22,336	247,706.24	0.43
50	600351	亚宝药业	39,020	239,582.80	0.41
51	600018	上港集团	95,047	235,716.56	0.41
52	600783	鲁信创投	17,744	235,640.32	0.41
53	600597	光明乳业	17,247	232,662.03	0.40
54	600478	科力远	12,558	231,067.20	0.40
55	600170	上海建工	33,760	230,918.40	0.40
56	600750	江中药业	12,824	228,651.92	0.39
57	600820	隧道股份	29,866	222,501.70	0.38
58	600435	北方导航	18,596	220,176.64	0.38
59	600219	南山铝业	46,798	219,482.62	0.38
60	600125	铁龙物流	40,988	217,236.40	0.37
61	600983	合肥三洋	21,728	216,410.88	0.37

62	600827	友谊股份	31,403	215,738.61	0.37
63	600387	海越股份	14,647	214,432.08	0.37
64	600874	创业环保	28,096	214,372.48	0.37
65	600633	浙报传媒	9,864	212,766.48	0.37
66	600808	马钢股份	130,600	208,960.00	0.36
67	601718	际华集团	86,009	208,141.78	0.36
68	600978	宜华木业	46,829	205,579.31	0.35
69	600638	新黄浦	20,802	200,947.32	0.35
70	600559	老白干酒	7,552	200,883.20	0.35
71	600096	云天化	24,868	198,695.32	0.34
72	601872	招商轮船	100,740	196,443.00	0.34
73	600835	上海机电	17,855	196,226.45	0.34
74	600729	重庆百货	10,031	194,300.47	0.33
75	601098	中南传媒	20,877	194,156.10	0.33
76	600284	浦东建设	20,207	191,966.50	0.33
77	600403	大有能源	22,364	190,541.28	0.33
78	600863	内蒙华电	33,083	186,918.95	0.32
79	600976	武汉健民	8,618	186,148.80	0.32
80	600377	宁沪高速	34,511	186,014.29	0.32
81	600261	阳光照明	14,663	185,926.84	0.32
82	600021	上海电力	45,061	185,651.32	0.32
83	600426	华鲁恒升	33,287	182,079.89	0.31
84	600038	哈飞股份	8,110	181,826.20	0.31
85	600422	昆明制药	6,829	180,968.50	0.31
86	600292	九龙电力	10,695	180,745.50	0.31
87	600582	天地科技	27,762	178,232.04	0.31
88	600017	日照港	76,687	174,846.36	0.30
89	600784	鲁银投资	38,592	174,049.92	0.30
90	600026	中海发展	49,722	173,032.56	0.30
91	600998	九州通	14,840	171,995.60	0.30
92	600717	天津港	34,183	171,598.66	0.30
93	600790	轻纺城	28,401	171,542.04	0.30
94	601216	内蒙君正	22,388	167,910.00	0.29
95	600298	安琪酵母	9,489	164,918.82	0.28
96	600486	扬农化工	4,692	164,783.04	0.28
97	600210	紫江企业	58,421	163,578.80	0.28
98	600778	友好集团	23,424	163,265.28	0.28
99	600004	白云机场	25,901	162,917.29	0.28
100	601369	陕鼓动力	24,067	162,452.25	0.28

101	600616	金枫酒业	22,829	161,629.32	0.28
102	600586	金晶科技	48,365	160,571.80	0.28
103	600122	宏图高科	48,585	160,330.50	0.28
104	600525	长园集团	26,014	160,246.24	0.28
105	600409	三友化工	43,711	159,982.26	0.28
106	601566	九牧王	13,260	158,191.80	0.27
107	600112	长征电气	17,495	158,154.80	0.27
108	600190	锦州港	36,266	158,119.76	0.27
109	601880	大连港	70,492	157,902.08	0.27
110	600502	安徽水利	23,367	157,727.25	0.27
111	600801	华新水泥	14,897	157,610.26	0.27
112	600280	南京中商	6,910	156,373.30	0.27
113	600161	天坛生物	10,933	154,264.63	0.27
114	600997	开滦股份	26,973	153,746.10	0.26
115	601258	庞大集团	25,816	152,572.56	0.26
116	601001	大同煤业	26,620	152,532.60	0.26
117	600285	羚锐制药	11,541	151,879.56	0.26
118	600270	外运发展	22,572	151,232.40	0.26
119	600410	华胜天成	24,847	151,069.76	0.26
120	600508	上海能源	15,268	148,404.96	0.26
121	600993	马应龙	9,362	147,919.60	0.25
122	600500	中化国际	30,910	147,749.80	0.25
123	600323	南海发展	22,070	147,648.30	0.25
124	600300	维维股份	34,712	147,526.00	0.25
125	601126	四方股份	10,162	146,840.90	0.25
126	600269	赣粤高速	49,220	144,706.80	0.25
127	600724	宁波富达	33,775	144,219.25	0.25
128	600511	国药股份	10,057	144,217.38	0.25
129	601231	环旭电子	9,082	141,951.66	0.24
130	600658	电子城	15,058	141,394.62	0.24
131	600668	尖峰集团	16,593	141,372.36	0.24
132	601100	恒立油缸	14,414	140,392.36	0.24
133	600481	双良节能	19,606	139,594.72	0.24
134	600120	浙江东方	12,543	139,352.73	0.24
135	600873	梅花集团	35,041	139,112.77	0.24
136	600859	王府井	8,582	138,256.02	0.24
137	600884	杉杉股份	12,805	138,165.95	0.24
138	601003	柳钢股份	61,085	136,830.40	0.24
139	601107	四川成渝	51,284	136,415.44	0.23

140	600480	凌云股份	21,277	136,385.57	0.23
141	600183	生益科技	30,135	135,607.50	0.23
142	600748	上实发展	23,184	134,467.20	0.23
143	600098	广州发展	26,464	133,378.56	0.23
144	600432	吉恩镍业	15,228	132,635.88	0.23
145	600545	新疆城建	27,368	131,913.76	0.23
146	600322	天房发展	42,679	128,463.79	0.22
147	601886	江河创建	9,576	126,594.72	0.22
148	600088	中视传媒	8,773	125,366.17	0.22
149	601222	林洋电子	8,341	124,614.54	0.21
150	601908	京运通	20,650	122,661.00	0.21
151	600335	国机汽车	9,128	122,589.04	0.21
152	600611	大众交通	23,836	121,801.96	0.21
153	600470	六国化工	20,588	120,439.80	0.21
154	600201	金宇集团	5,831	120,118.60	0.21
155	601777	力帆股份	22,721	119,739.67	0.21
156	600743	华远地产	45,473	119,593.99	0.21
157	600612	老凤祥	7,219	118,175.03	0.20
158	600754	锦江股份	9,396	118,107.72	0.20
159	600277	亿利能源	19,384	117,854.72	0.20
160	600825	新华传媒	23,563	117,343.74	0.20
161	600350	山东高速	40,828	117,176.36	0.20
162	600329	中新药业	8,957	115,724.44	0.20
163	600468	百利电气	10,062	114,203.70	0.20
164	601000	唐山港	43,518	114,017.16	0.20
165	600864	哈投股份	12,928	113,507.84	0.20
166	600375	华菱星马	10,739	113,403.84	0.20
167	600460	士兰微	20,140	112,582.60	0.19
168	600507	方大特钢	30,297	111,189.99	0.19
169	601010	文峰股份	18,085	110,680.20	0.19
170	600787	中储股份	17,338	110,616.44	0.19
171	600686	金龙汽车	11,821	110,526.35	0.19
172	600303	曙光股份	31,568	109,856.64	0.19
173	601678	滨化股份	15,412	109,733.44	0.19
174	600578	京能热电	15,664	108,551.52	0.19
175	600685	广船国际	10,965	107,895.60	0.19
176	600380	健康元	25,807	107,357.12	0.18
177	600509	天富热电	12,555	107,219.70	0.18
178	600720	祁连山	12,412	105,998.48	0.18

179	600251	冠农股份	7,573	104,658.86	0.18
180	600639	浦东金桥	14,587	104,005.31	0.18
181	600033	福建高速	54,453	103,460.70	0.18
182	600176	中国玻纤	13,552	103,401.76	0.18
183	600595	中孚实业	29,262	103,294.86	0.18
184	600184	光电股份	4,528	102,151.68	0.18
185	600420	现代制药	6,694	101,815.74	0.18
186	600175	美都控股	36,619	101,800.82	0.18
187	600428	中远航运	33,704	101,786.08	0.18
188	600548	深高速	35,408	101,620.96	0.17
189	600755	厦门国贸	27,295	101,537.40	0.17
190	600307	酒钢宏兴	35,661	99,850.80	0.17
191	600673	东阳光铝	14,968	99,686.88	0.17
192	600012	皖通高速	28,662	98,883.90	0.17
193	600268	国电南自	16,246	97,476.00	0.17
194	600459	贵研铂业	5,892	95,921.76	0.16
195	600368	五洲交通	19,075	95,375.00	0.16
196	600845	宝信软件	5,688	95,274.00	0.16
197	600056	中国医药	5,682	93,127.98	0.16
198	600563	法拉电子	5,250	92,715.00	0.16
199	600333	长春燃气	11,413	92,445.30	0.16
200	601801	皖新传媒	8,879	92,430.39	0.16
201	600487	亨通光电	4,865	92,386.35	0.16
202	600776	东方通信	20,721	92,001.24	0.16
203	600704	物产中大	16,944	90,311.52	0.16
204	600551	XD 时代出	8,556	89,153.52	0.15
205	600197	伊力特	8,904	87,437.28	0.15
206	600537	亿晶光电	9,167	86,903.16	0.15
207	600289	亿阳信通	12,279	86,689.74	0.15
208	600897	厦门空港	7,275	86,281.50	0.15
209	600195	中牧股份	7,734	86,156.76	0.15
210	600139	西部资源	14,302	85,955.02	0.15
211	600082	海泰发展	22,151	85,945.88	0.15
212	601139	深圳燃气	9,622	85,539.58	0.15
213	601636	旗滨集团	15,544	85,492.00	0.15
214	600113	浙江东日	10,245	85,135.95	0.15
215	601890	亚星锚链	13,727	83,322.89	0.14
216	600510	黑牡丹	17,581	83,158.13	0.14
217	600815	厦工股份	21,391	82,997.08	0.14

218	600513	联环药业	9,216	82,206.72	0.14
219	600761	安徽合力	10,433	80,960.08	0.14
220	601616	广电电气	23,417	80,086.14	0.14
221	600756	浪潮软件	9,486	78,923.52	0.14
222	601567	三星电气	9,770	78,843.90	0.14
223	600246	万通地产	25,147	78,207.17	0.13
224	600683	京投银泰	16,395	78,204.15	0.13
225	600007	中国国贸	8,394	77,476.62	0.13
226	600078	澄星股份	13,115	77,247.35	0.13
227	600467	好当家	14,574	76,513.50	0.13
228	600888	新疆众和	14,120	76,248.00	0.13
229	600831	广电网络	11,359	75,764.53	0.13
230	600496	精工钢构	11,099	75,695.18	0.13
231	601208	东材科技	13,459	75,639.58	0.13
232	600640	号百控股	9,364	75,380.20	0.13
233	603366	日出东方	4,957	74,949.84	0.13
234	600258	首旅股份	5,557	72,741.13	0.13
235	601058	赛轮股份	7,257	72,570.00	0.12
236	600581	八一钢铁	17,022	71,832.84	0.12
237	600488	天药股份	17,458	70,704.90	0.12
238	600446	金证股份	6,011	70,028.15	0.12
239	601238	广汽集团	9,472	69,713.92	0.12
240	603001	奥康国际	4,929	69,351.03	0.12
241	600676	交运股份	17,954	69,302.44	0.12
242	600495	晋西车轴	6,765	69,273.60	0.12
243	600662	强生控股	20,860	69,046.60	0.12
244	600345	长江通信	4,721	68,973.81	0.12
245	600278	东方创业	12,054	68,948.88	0.12
246	600858	银座股份	8,716	68,420.60	0.12
247	600967	北方创业	6,670	68,167.40	0.12
248	600667	太极实业	25,388	68,039.84	0.12
249	600979	广安爱众	12,933	67,898.25	0.12
250	601677	明泰铝业	9,510	67,521.00	0.12
251	600438	通威股份	13,080	67,100.40	0.12
252	600337	美克股份	12,465	67,061.70	0.12
253	600575	芜湖港	27,999	66,917.61	0.12
254	600580	卧龙电气	12,372	66,808.80	0.11
255	600328	兰太实业	9,042	66,006.60	0.11
256	600378	天科股份	7,466	65,924.78	0.11

257	601137	博威合金	5,344	65,089.92	0.11
258	600172	黄河旋风	10,378	64,654.94	0.11
259	600846	同济科技	12,163	63,977.38	0.11
260	600449	宁夏建材	9,443	63,929.11	0.11
261	600295	鄂尔多斯	9,569	63,920.92	0.11
262	600121	郑州煤电	11,591	63,170.95	0.11
263	600308	华泰股份	23,282	62,395.76	0.11
264	600491	龙元建设	16,520	61,950.00	0.11
265	600479	千金药业	6,030	61,807.50	0.11
266	600824	益民集团	13,878	61,618.32	0.11
267	600069	银鸽投资	14,499	61,475.76	0.11
268	600990	四创电子	2,641	61,297.61	0.11
269	600054	黄山旅游	5,971	61,143.04	0.11
270	600310	桂东电力	6,874	60,972.38	0.10
271	600396	金山股份	9,962	60,668.58	0.10
272	600469	风神股份	7,868	59,010.00	0.10
273	601518	吉林高速	27,153	58,922.01	0.10
274	600501	航天晨光	8,439	58,229.10	0.10
275	600075	新疆天业	9,432	57,912.48	0.10
276	601011	宝泰隆	7,807	57,381.45	0.10
277	600589	广东榕泰	11,044	57,097.48	0.10
278	600101	明星电力	6,166	56,912.18	0.10
279	600830	香溢融通	8,476	56,619.68	0.10
280	600523	贵航股份	6,213	56,414.04	0.10
281	601113	华鼎锦纶	16,331	55,852.02	0.10
282	600687	刚泰控股	4,617	55,542.51	0.10
283	603077	和邦股份	5,198	55,358.70	0.10
284	600828	成商集团	12,548	55,085.72	0.09
285	600262	北方股份	3,984	54,780.00	0.09
286	600416	湘电股份	11,392	54,567.68	0.09
287	600531	豫光金铅	5,759	54,364.96	0.09
288	600171	上海贝岭	12,392	54,029.12	0.09
289	601515	东风股份	4,489	53,419.10	0.09
290	600624	复旦复华	7,046	53,197.30	0.09
291	600869	三普药业	8,289	51,889.14	0.09
292	600343	航天动力	4,986	51,804.54	0.09
293	600628	新世界	9,400	51,700.00	0.09
294	600318	巢东股份	4,414	51,599.66	0.09
295	600439	瑞贝卡	16,310	50,724.10	0.09

296	600829	三精制药	7,571	49,968.60	0.09
297	600114	东睦股份	5,319	49,945.41	0.09
298	600425	青松建化	13,115	49,837.00	0.09
299	600742	一汽富维	3,562	49,654.28	0.09
300	600577	精达股份	13,546	49,442.90	0.09
301	600367	红星发展	5,754	48,736.38	0.08
302	600257	大湖股份	7,993	47,878.07	0.08
303	600106	重庆路桥	14,506	47,869.80	0.08
304	601008	连云港	16,500	47,190.00	0.08
305	600712	南宁百货	10,863	46,276.38	0.08
306	600283	钱江水利	5,771	45,533.19	0.08
307	600592	龙溪股份	6,351	45,155.61	0.08
308	600227	赤天化	15,833	44,015.74	0.08
309	600697	欧亚集团	2,385	43,860.15	0.08
310	600622	嘉宝集团	7,871	43,762.76	0.08
311	600644	乐山电力	6,096	43,647.36	0.08
312	601388	怡球资源	5,001	43,358.67	0.07
313	600131	岷江水电	9,602	43,209.00	0.07
314	600097	开创国际	3,976	42,940.80	0.07
315	600623	双钱股份	4,905	42,820.65	0.07
316	600363	联创光电	6,540	41,856.00	0.07
317	600116	三峡水利	4,714	41,294.64	0.07
318	600133	东湖高新	8,110	41,198.80	0.07
319	600619	海立股份	7,543	40,883.06	0.07
320	600560	金自天正	5,906	40,810.46	0.07
321	600995	文山电力	7,873	40,467.22	0.07
322	600249	两面针	8,104	40,033.76	0.07
323	600626	申达股份	13,001	39,393.03	0.07
324	601789	宁波建工	5,876	39,251.68	0.07
325	600561	江西长运	3,482	37,884.16	0.07
326	600327	大东方	9,827	37,342.60	0.06
327	600833	第一医药	5,590	36,894.00	0.06
328	600353	旭光股份	7,152	36,832.80	0.06
329	600785	新华百货	3,371	36,541.64	0.06
330	600039	四川路桥	7,009	36,376.71	0.06
331	600963	岳阳林纸	12,944	35,207.68	0.06
332	600382	广东明珠	5,932	34,939.48	0.06
333	600339	天利高新	10,521	34,719.30	0.06
334	600981	汇鸿股份	11,639	34,218.66	0.06

335	600666	西南药业	5,489	33,867.13	0.06
336	600371	万向德农	3,295	33,806.70	0.06
337	600857	工大首创	4,342	29,308.50	0.05
338	600423	柳化股份	6,932	28,143.92	0.05
339	600128	弘业股份	3,838	26,942.76	0.05
340	603128	华贸物流	4,851	24,157.98	0.04
341	600070	浙江富润	3,096	21,548.16	0.04
342	600975	新五丰	3,494	18,029.04	0.03
343	600648	外高桥	1,070	14,969.30	0.03

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	601158	重庆水务	134,900	694,735.00	1.19
2	600642	申能股份	119,750	455,050.00	0.78
3	601666	平煤股份	74,300	386,360.00	0.66
4	600804	鹏博士	35,600	377,004.00	0.65
5	601106	中国一重	186,400	376,528.00	0.65
6	601179	中国西电	120,899	369,950.94	0.64
7	600009	上海机场	24,600	293,232.00	0.50
8	600971	恒源煤电	29,100	224,070.00	0.39
9	600389	江山股份	5,500	187,220.00	0.32
10	600839	四川长虹	97,300	174,167.00	0.30
11	600664	哈药股份	27,500	163,350.00	0.28
12	600657	信达地产	45,900	142,749.00	0.25
13	600618	氯碱化工	23,200	138,040.00	0.24
14	600826	兰生股份	12,400	137,268.00	0.24
15	600073	上海梅林	21,100	131,453.00	0.23
16	600391	成发科技	9,900	93,555.00	0.16
17	600850	华东电脑	4,100	92,865.00	0.16
18	600987	航民股份	16,700	90,347.00	0.16
19	600236	桂冠电力	26,300	84,949.00	0.15
20	601233	桐昆股份	15,300	77,418.00	0.13
21	600238	海南椰岛	9,800	67,032.00	0.12
22	600373	中文传媒	3,700	63,085.00	0.11
23	600682	南京新百	7,100	60,776.00	0.10
24	600397	安源煤业	13,400	60,300.00	0.10

25	601313	江南嘉捷	8,700	58,986.00	0.10
26	600565	迪马股份	16,800	58,968.00	0.10
27	600162	香江控股	10,100	56,762.00	0.10
28	600230	沧州大化	5,100	55,182.00	0.09
29	600401	海润光伏	9,500	55,100.00	0.09
30	600568	中珠控股	5,800	46,516.00	0.08
31	601965	中国汽研	5,000	46,250.00	0.08
32	600692	亚通股份	5,300	33,178.00	0.06
33	601996	丰林集团	5,800	31,958.00	0.05
34	601700	风范股份	4,200	31,626.00	0.05
35	601038	一拖股份	4,193	28,512.40	0.05
36	603399	新华龙	2,000	22,160.00	0.04
37	603167	渤海轮渡	2,500	16,675.00	0.03
38	603766	隆鑫通用	2,300	16,376.00	0.03

注：本基金为完全复制指数的股票型基金，不进行积极投资。为有效跟踪指数，同时根据中证指数有限公司指数样本股调整规则，本基金提前买入将于 7 月 1 日计入指数的样本股，所以积极投资组合的股票均为“将于 7 月 1 日计入指数的样本股”。

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	600005	武钢股份	741,403.00	0.95
2	601158	重庆水务	692,908.00	0.89
3	600655	豫园商城	473,264.00	0.61
4	600642	申能股份	455,379.00	0.58
5	600219	南山铝业	453,430.01	0.58
6	600811	东方集团	415,358.00	0.53
7	601666	平煤股份	393,156.00	0.50
8	600804	鹏博士	389,650.00	0.50
9	600125	铁龙物流	376,515.23	0.48
10	601106	中国一重	375,095.00	0.48
11	601179	中国西电	374,808.92	0.48
12	600352	浙江龙盛	358,707.83	0.46
13	601001	大同煤业	353,512.94	0.45
14	600418	江淮汽车	353,290.00	0.45

15	600863	内蒙华电	333,405.25	0.43
16	600009	上海机场	287,355.00	0.37
17	600873	梅花集团	251,829.86	0.32
18	601991	大唐发电	243,344.00	0.31
19	600971	恒源煤电	229,840.12	0.29
20	600664	哈药股份	173,391.00	0.22

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。

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	600315	上海家化	1,263,164.49	1.62
2	600066	宇通客车	843,351.36	1.08
3	600702	沱牌舍得	540,879.56	0.69
4	600637	百视通	516,111.34	0.66
5	600779	水井坊	491,613.53	0.63
6	601888	中国国旅	490,408.93	0.63
7	600199	金种子酒	477,438.78	0.61
8	600601	方正科技	437,573.10	0.56
9	600027	华电国际	437,563.93	0.56
10	600765	中航重机	416,459.19	0.53
11	600008	首创股份	404,666.40	0.52
12	600062	华润双鹤	403,111.70	0.52
13	600200	江苏吴中	367,896.07	0.47
14	600418	江淮汽车	365,849.56	0.47
15	600388	龙净环保	338,908.75	0.43
16	600157	永泰能源	328,743.35	0.42
17	600022	山东钢铁	326,524.62	0.42
18	600332	广州药业	325,669.44	0.42
19	600312	平高电气	297,726.95	0.38
20	600153	建发股份	284,692.15	0.36

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。

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	15,567,564.62
卖出股票收入（成交）总额	34,355,861.97

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额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。

7.5 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。

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

注：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

注：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

注：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**

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.10 投资组合报告附注**7.10.1**

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。

7.10.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.10.3 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	5,251.78
2	应收证券清算款	283,062.42
3	应收股利	25,094.24
4	应收利息	665.49
5	应收申购款	2,174.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	316,248.31

7.10.4 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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600433	冠豪高新	521,876.61	0.90	重大事项停牌

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.10.6 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。

§ 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
1,216	55,160.26	30,761,462.24	45.86%	36,313,410.38	54.14%

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	2,971.56	0.0044%

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。

§ 9 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
本报告期期初基金份额总额	87,068,082.65
本报告期基金总申购份额	596,331.10
减：本报告期基金总赎回份额	20,589,541.13
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	67,074,872.62

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为江苏公证天业会计师事务所有限公司，本报告期内本基金未改聘为其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

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。

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	
海通证券	1	16,946,127.43	34.09%	15,427.61	34.09%	-
光大证券	1	13,881,500.67	27.93%	12,637.85	27.93%	-
长江证券	1	10,239,822.68	20.60%	9,322.53	20.60%	-
申银万国	1	3,293,413.59	6.63%	2,998.26	6.63%	-
国泰君安	2	2,978,463.06	5.99%	2,711.46	5.99%	-
中信证券	2	1,974,818.18	3.97%	1,798.03	3.97%	-
中金证券	1	233,149.95	0.47%	212.31	0.47%	-
国联证券	1	161,510.82	0.32%	147.01	0.32%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

中建银投证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-

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、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。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：本报告期内退租了安信证券的上海交易单元。

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：以上数据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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中建银投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中海上证 380 指数证券投资基金 2012 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2013 年 1 月 22 日
2	中海基金管理有限公司关于旗下 部分基金参与中国工商银行股份 有限公司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	2013 年 2 月 20 日
3	中海基金管理有限公司关于旗下 基金参与中国工商银行个人电子 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	2013 年 3 月 28 日
4	中海上证 380 指数证券投资基金 2012 年年度报告（正文）	中海基金网站	2013 年 3 月 30 日
5	中海上证 380 指数证券投资基金 2012 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2013 年 3 月 30 日

6	中海上证 380 指数证券投资基金更新招募说明书（2013 年第 1 号）	中海基金网站	2013 年 4 月 20 日
7	中海上证 380 指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2013 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 4 月 20 日
8	中海上证 380 指数证券投资基金 2013 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 4 月 20 日
9	中海基金管理有限公司关于变更中国银行直销账号的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 5 月 8 日
10	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增和讯信息科技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	2013 年 5 月 14 日
11	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海天天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	2013 年 5 月 23 日
12	中海基金管理有限公司关于旗下基金在上海天天基金销售有限公司调整定期定额投资业务起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 6 月 3 日
13	中海基金管理有限公司关于变更对账单服务方式的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 6 月 14 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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

11.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

11.3 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 8 月 28 日