

中海上证 380 指数证券投资基金 2013 年年度报告

2013 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：2014 年 3 月 29 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 2014 年 3 月 20 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 2013 年 1 月 1 日起至 2013 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	12
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
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
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	39
8.1 期末基金资产组合情况	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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贵金属投资明细	53

8.9 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	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12 投资组合报告附注	53
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
§10 开放式基金份额变动	55
§11 重大事件揭示	55
11.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	58
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 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
前端交易代码	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	22,403,827.17 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
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（特殊普通合伙）	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	2013 年	2012 年 3 月 7 日(基金)	2011 年
---------------	--------	--------------------	--------

		合同生效日)-2012 年 12 月 31 日	
本期已实现收益	2,208,980.01	-3,592,768.45	-
本期利润	9,654,414.08	-10,281,938.37	-
加权平均基金份额本期利润	0.1559	-0.0813	-
本期加权平均净值利润率	16.28%	-8.53%	-
本期基金份额净值增长率	12.05%	-10.40%	-
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	87,319.17	-9,058,842.55	-
期末可供分配基金份额利润	0.0039	-0.1040	-
期末基金资产净值	22,491,146.34	78,009,240.10	-
期末基金份额净值	1.004	0.896	-
3.1.3 累计期末指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	0.40%	-10.40%	-

注 1：本基金合同于 2012 年 3 月 7 日生效。

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	-2.81%	1.27%	-1.63%	1.32%	-1.18%	-0.05%
过去六个月	15.80%	1.24%	17.77%	1.29%	-1.97%	-0.05%
过去一年	12.05%	1.25%	13.25%	1.28%	-1.20%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	0.40%	1.19%	0.19%	1.28%	0.21%	-0.09%

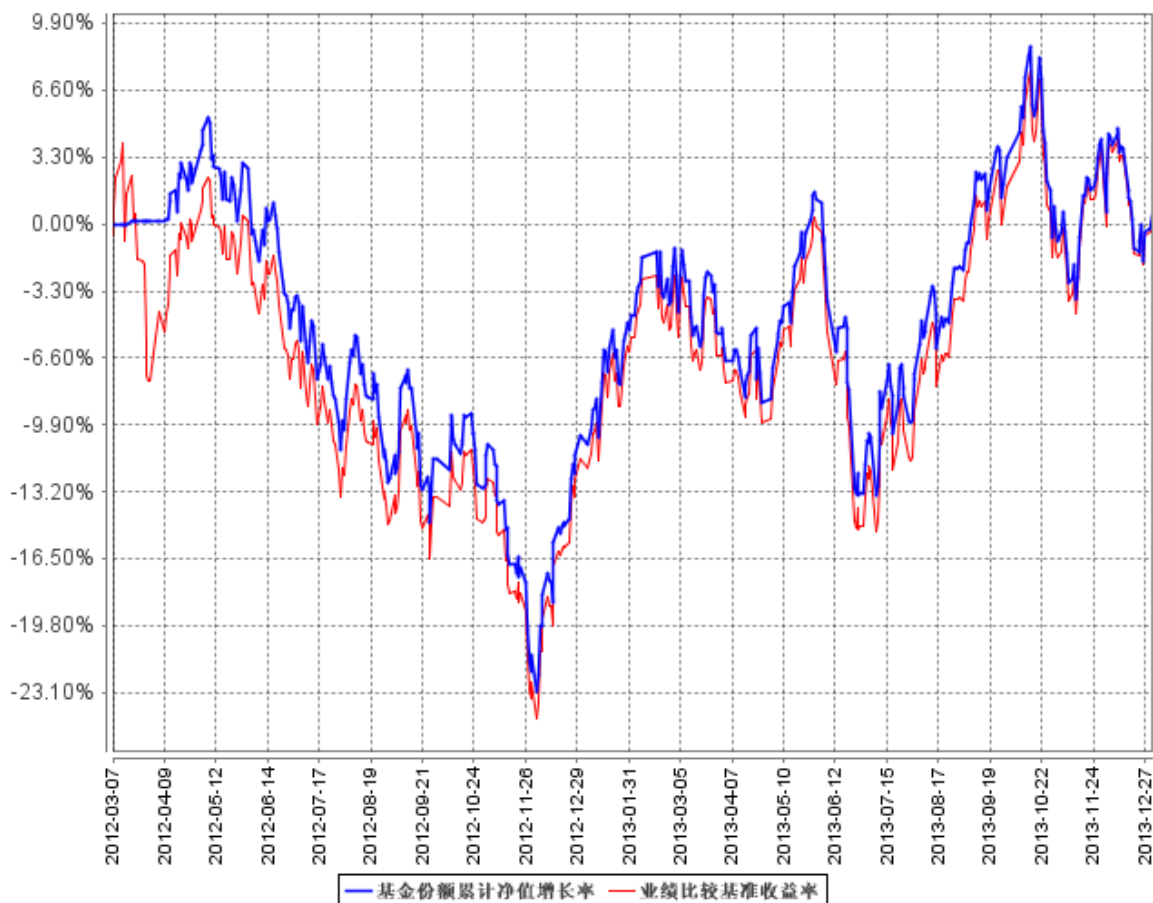
注 1：“自基金合同生效起至今”指 2012 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日。

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。

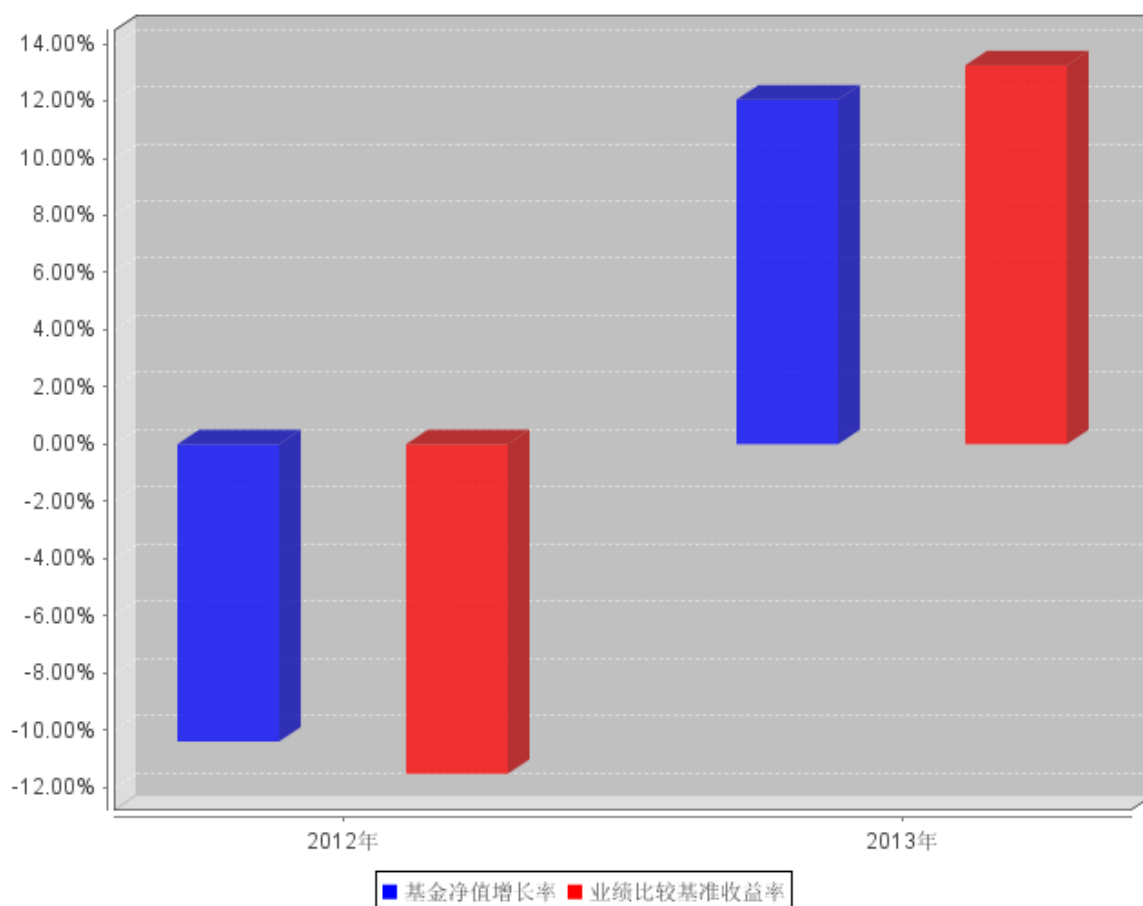
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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 2013 年 12 月 31 日未发生利润分配。

§ 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 2013 年 12 月

31 日，共管理证券投资基金 18 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 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 2013 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

2013 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组合间的交易占优比、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 3 日内反向交易；两两组合对同一投资品种 3 日内反向交易；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

2013 年春节前，市场表现为以银行股为龙头的大盘股行情冲高见顶，春节后，市场风格发生转换，市场风格切换为小盘股为主的行情，且持续到了年底。

1 月，市场延续以银行股为龙头的上涨趋势，从 2 月开始市场风格转向小盘股，一直到 5 月，小盘股都表现不错，尤其是创业板表现抢眼。到了 6 月，在流动性意外急剧紧张的压力下，市场出现快速暴跌，大盘跌破 1949，并创出 1849 的新低。7 月，在流动性警报缓解后，市场出现反弹，虽然期间受经济预期波动的影响有所反复，但总体上维持了反弹行情的持续，尤其是 9 月，在经济短期出现持续复苏、上海自贸区 and 优先股事件的刺激下，大盘出现较大反弹，主题投资活跃，且 9 月的主题投资行情一直持续到了 10 月。11 月，受“对三中全会预期”的影响市场波动较大，大盘先跌后涨。12 月，市场受年末资金紧张、对经济预期不佳以及美联储宣布 QE3 退出的影响，大盘总体趋势下跌。

2013 年，中海上证 380 指数基金以跟踪标的指数，控制跟踪误差为主要目标，以复制指数为操作策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值 1.004 元(累计净值 1.004 元)。报告期内本基金净值增长率为 12.05%。低于业绩比较基准 1.20 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，经济在 2014 年可能会有所回落，流动性会维持紧平衡且社会融资利率水平可能继续上移，结构性行情在 2014 年部分时间段将是主流，但在空间上将弱于 2013 年，总体上大盘在无明显利空的环境下将维持区间振荡行情。如果期间出现有关流动性、经济面等重大利空，则不排除大盘创新低的可能。

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。2014 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

本基金管理人按照企业会计准则、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。

本基金管理人设有估值委员会，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风险控制总监、监察稽核负责人、基金会计负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值

委员会会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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，本基金在本报告期末发生利润分配。

§ 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

本报告期内，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

本报告期内，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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	苏公 W[2014]A275 号

6.2 审计报告的基本内容

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 2013 年 12 月 31 日的资产负债表，2013 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	沈岩 华可天
会计师事务所的名称	江苏公证天业会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	无锡市梁溪路 28 号
审计报告日期	2014 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：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,181,008.53	4,223,024.38
结算备付金		3,625.17	12,186.89
存出保证金		45,536.14	333,333.36
交易性金融资产	7.4.7.2	21,170,691.57	73,624,767.65
其中：股票投资		21,170,691.57	73,624,767.65
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		175,193.71	-
应收利息	7.4.7.5	298.78	800.56
应收股利		-	-
应收申购款		1,198.81	592.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		22,577,552.71	78,194,705.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 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	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		14,965.16	46,311.66
应付托管费		2,993.04	9,262.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	18,172.61	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	50,275.56	62,037.06
负债合计		86,406.37	185,465.62
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	22,403,827.17	87,068,082.65
未分配利润	7.4.7.10	87,319.17	-9,058,842.55
所有者权益合计		22,491,146.34	78,009,240.10
负债和所有者权益总计		22,577,552.71	78,194,705.72

注 1：本基金合同生效日 2012 年 3 月 7 日。

注 2：报告截至日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.004 元，基金份额总额 22,403,827.17 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	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
一、收入		10,754,085.79	-8,663,994.06
1.利息收入		30,110.68	681,057.10
其中：存款利息收入	7.4.7.11	30,110.68	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）		3,231,666.69	-2,882,139.95
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,303,573.93	-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		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	928,092.76	1,143,462.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	7,445,434.07	-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	46,874.35	226,258.71

列)			
减：二、费用		1,099,671.71	1,617,944.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	448,003.32	741,128.57
2. 托管费	7.4.10.2.2	89,600.60	148,225.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	239,557.98	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	322,509.81	348,184.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,654,414.08	-10,281,938.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,654,414.08	-10,281,938.37

注：上年度可比期间指 2012 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日，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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	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）	-	9,654,414.08	9,654,414.08
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）	-64,664,255.48	-508,252.36	-65,172,507.84
其中：1. 基金申购款	3,819,885.25	5,626.31	3,825,511.56
2. 基金赎回款	-68,484,140.73	-513,878.67	-68,998,019.40
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）	22,403,827.17	87,319.17	22,491,146.34

项目	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		
	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

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>
基金管理人负责人	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。

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 2012 年 11 月 16 日新修订的《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, 真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和净值变动情况。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 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 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。

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 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	1,181,008.53	4,223,024.38
定期存款	-	-
其中:存款期限 1-3 个月	-	-

其他存款	-	-
合计：	1, 181, 008. 53	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 2013 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		20, 414, 427. 42	21, 170, 691. 57	756, 264. 15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
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		20, 414, 427. 42	21, 170, 691. 57	756, 264. 15
项目		上年度末 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
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末及上年度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及上年度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 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	276.68	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	1.60	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	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	20.50	-
合计	298.78	800.56

7.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	18,172.61	66,981.60
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	18,172.61	66,981.60

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	3.29
其他	4,999.29	-
应付指数使用费	1,276.27	4,033.77
预提费用	44,000.00	58,000.00
合计	50,275.56	62,037.06

7.4.7.9 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 12 月 31 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	3,819,885.25	3,819,885.25
本期赎回(以“-”号填列)	-68,484,140.73	-68,484,140.73
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	22,403,827.17	22,403,827.17

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。

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
上年度末	-3,589,899.72	-5,468,942.83	-9,058,842.55
本期利润	2,208,980.01	7,445,434.07	9,654,414.08
本期基金份额交易产生的变动数	3,138,387.84	-3,646,640.20	-508,252.36
其中：基金申购款	-44,695.65	50,321.96	5,626.31
基金赎回款	3,183,083.49	-3,696,962.16	-513,878.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,757,468.13	-1,670,148.96	87,319.17

7.4.7.11 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 12 月 31 日	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
活期存款利息收入	29,267.51	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	472.14	8,580.77
其他	371.03	0.10
合计	30,110.68	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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	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
卖出股票成交总额	98,666,932.88	93,168,896.48
减：卖出股票成本总额	96,363,358.95	97,194,499.29
买卖股票差价收入	2,303,573.93	-4,025,602.81

7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金在本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金在本报告期及上年度可比期间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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	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
股票投资产生的股利收益	928,092.76	1,143,462.86
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	928,092.76	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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	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
1. 交易性金融资产	7,445,434.07	-6,689,169.92
——股票投资	7,445,434.07	-6,689,169.92
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	7,445,434.07	-6,689,169.92

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	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
基金赎回费收入	46,569.05	219,903.36
转出基金补偿收入	305.30	6,355.35
合计	46,874.35	226,258.71

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	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
交易所市场交易费用	239,557.98	380,405.59
银行间市场交易费用	-	-
合计	239,557.98	380,405.59

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	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
审计费用	30,000.00	58,000.00
信息披露费	280,000.00	270,000.00
银行费用	563.00	421.00
指数使用费	11,946.81	19,763.43
合计	322,509.81	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
中海恒信资产管理（上海）有限公司（以下简称“中海恒信”）	基金管理人的控股子公司

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		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	
	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	4,582,097.19	3.40%	259,414,081.01	95.88%

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 12 月 31 日		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	
	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。

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 2013年1月1日至2013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	4,171.72	3.40%	4,024.71	22.15%
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%	-	-

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 2013年1月1日至2013年12月31日	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
当期发生的基金应支付的管理费	448,003.32	741,128.57
其中：支付销售机构的客户维护费	109,514.52	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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	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
当期发生的基金应支付的托管费	89,600.60	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：本基金本报告期间及上年度可比期间内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：本报告期及上年度可比期间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。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		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	
	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	1,181,008.53	29,267.51	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：本基金在本报告期及上年度可比期间未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（2013 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**

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。

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
600572	康恩贝	2013 年 11 月 25 日	重大事 项停牌	13.51	-	-	6,557	66,346.50	88,585.07	-
600686	金龙汽 车	2013 年 11 月 18 日	重大事 项停牌	8.73	2014 年 3 月 20 日	9.60	4,048	32,838.20	35,339.04	-
600639	浦东金 桥	2013 年 12 月 4 日	重大事 项停牌	11.76	2014 年 2 月 26 日	10.58	2,985	25,293.92	35,103.60	-

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 2013 年 12 月 31 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	—	—

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 2013 年 12 月 31 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

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。2013 年 12 月 31 日，本基金股票资产持仓比例为 94.13%。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 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	21,170,691.57	94.13	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	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	21,170,691.57	94.13	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（2013 年 12 月 31 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	+5%	962,919.36	3,425,772.39
	-5%	-962,919.36	-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（2013 年 12 月 31 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	收益率绝对 VaR (%)	1.85	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	21,170,691.57	93.77
	其中：股票	21,170,691.57	93.77
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,184,633.70	5.25
7	其他各项资产	222,227.44	0.98
8	合计	22,577,552.71	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	123,421.75	0.55
B	采矿业	729,428.05	3.24
C	制造业	11,138,985.64	49.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,493,597.17	6.64
E	建筑业	824,444.17	3.67
F	批发和零售业	2,679,041.54	11.91
G	交通运输、仓储和邮政业	1,754,783.40	7.80
H	住宿和餐饮业	43,189.92	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	935,460.95	4.16
J	金融业	—	—
K	房地产业	451,707.19	2.01

L	租赁和商务服务业	172,993.40	0.77
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	19,288.80	0.09
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	347,351.45	1.54
S	综合	421,894.54	1.88
	合计	21,135,587.97	93.97

8.2.2 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	35,103.60	0.16
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	35,103.60	0.16

注：本基金为完全复制指数的股票型基金，未进行积极投资。报告期末持有的积极投资股票（浦东金桥，代码：600639）于 12 月 5 日停牌，至报告期末仍未复牌，12 月 16 日，该股被调出上证 380 指数成份股。

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	601991	大唐发电	47,124	199,805.76	0.89
2	600839	四川长虹	61,924	188,248.96	0.84
3	600660	福耀玻璃	21,962	182,064.98	0.81
4	600388	龙净环保	5,414	181,477.28	0.81
5	600079	人福医药	6,389	181,128.15	0.81
6	600499	科达机电	8,420	169,157.80	0.75
7	600570	恒生电子	8,046	167,839.56	0.75
8	600718	东软集团	13,407	164,503.89	0.73
9	600642	申能股份	35,616	162,052.80	0.72
10	600433	冠豪高新	14,397	153,184.08	0.68
11	601333	广深铁路	53,237	148,531.23	0.66
12	600153	建发股份	20,687	147,912.05	0.66
13	600867	通化东宝	9,655	147,818.05	0.66
14	601018	宁波港	59,933	146,236.52	0.65
15	600872	中炬高新	12,437	141,408.69	0.63
16	601898	中煤能源	28,930	137,996.10	0.61
17	600557	康缘药业	4,512	137,255.04	0.61
18	600005	武钢股份	61,361	134,994.20	0.60
19	600811	东方集团	21,254	133,687.66	0.59
20	601618	中国中冶	75,672	132,426.00	0.59
21	600827	友谊股份	13,391	132,169.17	0.59
22	600694	大商股份	4,562	131,750.56	0.59
23	600068	葛洲坝	33,226	131,574.96	0.59
24	600587	新华医疗	1,870	130,731.70	0.58
25	600594	益佰制药	3,894	127,022.28	0.56
26	601933	永辉超市	9,522	126,547.38	0.56

27	600655	豫园商城	15,980	124,004.80	0.55
28	600805	悦达投资	11,206	122,929.82	0.55
29	600648	外高桥	3,766	121,378.18	0.54
30	600879	航天电子	12,811	119,910.96	0.53
31	600062	华润双鹤	5,323	119,075.51	0.53
32	601929	吉视传媒	13,994	117,409.66	0.52
33	600881	亚泰集团	29,805	116,835.60	0.52
34	600436	片仔癀	1,219	114,963.89	0.51
35	600201	金宇集团	4,427	114,083.79	0.51
36	601727	上海电气	30,725	113,682.50	0.51
37	600717	天津港	13,237	113,176.35	0.50
38	600635	大众公用	20,478	112,219.44	0.50
39	601877	正泰电器	4,483	111,537.04	0.50
40	600138	中青旅	6,320	111,358.40	0.50
41	601238	广汽集团	13,413	110,523.12	0.49
42	600110	中科英华	17,485	106,483.65	0.47
43	600863	内蒙华电	30,184	102,927.44	0.46
44	600200	江苏吴中	8,909	101,473.51	0.45
45	600312	平高电气	9,886	99,848.60	0.44
46	600521	华海药业	7,315	99,118.25	0.44
47	600478	科力远	3,780	98,053.20	0.44
48	601666	平煤股份	18,357	96,557.82	0.43
49	600522	中天科技	8,801	96,106.92	0.43
50	600387	海越股份	4,710	94,953.60	0.42
51	600688	上海石化	30,958	94,421.90	0.42
52	600422	昆明制药	3,982	93,935.38	0.42
53	600219	南山铝业	17,995	93,753.95	0.42
54	600998	九州通	6,156	92,278.44	0.41
55	600596	新安股份	8,694	92,069.46	0.41
56	601158	重庆水务	15,460	91,059.40	0.40
57	600517	置信电气	6,150	91,020.00	0.40
58	600873	梅花集团	14,508	90,529.92	0.40
59	600704	物产中大	7,949	90,221.15	0.40
60	600835	上海机电	5,074	89,556.10	0.40
61	601098	中南传媒	8,124	89,282.76	0.40
62	601106	中国一重	42,666	89,171.94	0.40
63	600654	飞乐股份	12,180	88,914.00	0.40
64	600572	康恩贝	6,557	88,585.07	0.39
65	600664	哈药股份	14,298	87,646.74	0.39

66	600500	中化国际	11,404	86,670.40	0.39
67	600511	国药股份	4,545	85,764.15	0.38
68	600978	宜华木业	14,899	85,371.27	0.38
69	600527	江南高纤	12,198	85,142.04	0.38
70	600638	新黄浦	6,889	84,321.36	0.37
71	600037	歌华有线	10,619	82,722.01	0.37
72	600292	中电远达	3,136	81,191.04	0.36
73	600525	长园集团	9,135	80,844.75	0.36
74	600584	长电科技	12,502	80,012.80	0.36
75	600435	北方导航	5,990	78,948.20	0.35
76	600161	天坛生物	3,698	78,619.48	0.35
77	600825	新华传媒	8,781	78,150.90	0.35
78	600755	厦门国贸	14,272	77,496.96	0.34
79	600112	天成控股	6,023	77,214.86	0.34
80	600171	上海贝岭	8,525	76,980.75	0.34
81	601369	陕鼓动力	11,547	76,787.55	0.34
82	600125	铁龙物流	13,468	76,632.92	0.34
83	600073	上海梅林	8,722	76,579.16	0.34
84	600038	哈飞股份	2,762	75,927.38	0.34
85	600787	中储股份	7,369	75,753.32	0.34
86	600132	重庆啤酒	4,618	74,765.42	0.33
87	600175	美都控股	15,557	73,895.75	0.33
88	600536	中国软件	1,950	73,456.50	0.33
89	600626	申达股份	8,143	72,879.85	0.32
90	600409	三友化工	15,672	72,874.80	0.32
91	601179	中国西电	22,186	72,548.22	0.32
92	600820	隧道股份	7,942	72,033.94	0.32
93	600967	北方创业	4,158	71,725.50	0.32
94	600783	鲁信创投	3,471	71,190.21	0.32
95	600096	云天化	7,952	70,772.80	0.31
96	601872	招商轮船	28,974	70,117.08	0.31
97	600098	广州发展	13,027	70,085.26	0.31
98	600426	华鲁恒升	10,188	68,972.76	0.31
99	600377	宁沪高速	12,238	68,288.04	0.30
100	600859	王府井	3,724	67,627.84	0.30
101	600458	时代新材	6,684	66,773.16	0.30
102	600284	浦东建设	6,309	66,686.13	0.30
103	601231	环旭电子	3,167	66,665.35	0.30
104	601718	际华集团	24,018	66,529.86	0.30

105	600261	阳光照明	4,700	65,283.00	0.29
106	601918	国投新集	16,374	65,168.52	0.29
107	600761	安徽合力	5,371	64,935.39	0.29
108	600289	亿阳信通	7,226	64,744.96	0.29
109	600502	安徽水利	7,741	64,405.12	0.29
110	600528	中铁二局	12,477	63,882.24	0.28
111	600651	飞乐音响	11,043	63,055.53	0.28
112	600183	生益科技	12,749	62,980.06	0.28
113	600720	祁连山	9,391	62,825.79	0.28
114	600017	日照港	24,064	61,122.56	0.27
115	600611	大众交通	9,872	61,008.96	0.27
116	601101	昊华能源	8,314	59,943.94	0.27
117	601001	大同煤业	10,252	59,256.56	0.26
118	601258	庞大集团	11,782	59,027.82	0.26
119	601311	骆驼股份	5,411	58,979.90	0.26
120	600389	江山股份	1,502	58,773.26	0.26
121	600481	双良节能	5,076	57,917.16	0.26
122	600120	浙江东方	4,588	57,579.40	0.26
123	600056	中国医药	2,634	57,447.54	0.26
124	600824	益民集团	10,248	56,876.40	0.25
125	600270	外运发展	5,564	56,697.16	0.25
126	600122	宏图高科	14,037	56,428.74	0.25
127	600677	航天通信	4,878	56,340.90	0.25
128	600059	古越龙山	5,926	56,237.74	0.25
129	600801	华新水泥	4,586	55,674.04	0.25
130	600628	新世界	6,505	55,097.35	0.24
131	600580	卧龙电气	8,837	55,054.51	0.24
132	600685	广船国际	3,236	54,720.76	0.24
133	600742	一汽富维	3,044	54,518.04	0.24
134	600545	新疆城建	8,549	54,457.13	0.24
135	600210	紫江企业	16,755	54,453.75	0.24
136	600884	杉杉股份	4,392	54,109.44	0.24
137	600509	天富热电	6,084	53,600.04	0.24
138	600582	天地科技	7,611	53,505.33	0.24
139	600403	大有能源	7,510	53,471.20	0.24
140	600874	创业环保	6,525	53,309.25	0.24
141	600373	中文传媒	2,964	52,996.32	0.24
142	600486	扬农化工	1,513	52,939.87	0.24
143	600971	恒源煤电	7,385	52,655.05	0.23

144	600620	天宸股份	5,849	52,641.00	0.23
145	600567	山鹰纸业	24,948	52,640.28	0.23
146	600323	瀚蓝环境	4,961	52,536.99	0.23
147	600351	亚宝药业	8,401	52,422.24	0.23
148	600578	京能电力	14,433	52,391.79	0.23
149	600004	白云机场	7,503	52,145.85	0.23
150	600307	酒钢宏兴	19,874	52,069.88	0.23
151	600260	凯乐科技	6,823	51,991.26	0.23
152	600997	开滦股份	9,330	51,968.10	0.23
153	600432	吉恩镍业	6,697	51,767.81	0.23
154	600575	芜湖港	15,893	51,493.32	0.23
155	600410	华胜天成	7,574	51,124.50	0.23
156	600612	老凤祥	2,185	50,954.20	0.23
157	600298	安琪酵母	2,933	50,652.91	0.23
158	600668	尖峰集团	5,187	50,313.90	0.22
159	600269	赣粤高速	17,182	50,171.44	0.22
160	600595	中孚实业	13,692	50,112.72	0.22
161	600551	时代出版	3,070	50,071.70	0.22
162	600251	冠农股份	3,316	50,071.60	0.22
163	600729	重庆百货	2,292	49,919.76	0.22
164	600826	兰生股份	3,247	49,873.92	0.22
165	600864	哈投股份	5,024	49,838.08	0.22
166	600238	海南椰岛	6,795	49,603.50	0.22
167	600482	风帆股份	4,821	49,367.04	0.22
168	600993	马应龙	2,832	49,050.24	0.22
169	600277	亿利能源	6,411	48,467.16	0.22
170	601139	深圳燃气	6,116	48,377.56	0.22
171	600439	瑞贝卡	9,566	48,021.32	0.21
172	600756	浪潮软件	3,635	47,763.90	0.21
173	600428	中远航运	13,512	47,427.12	0.21
174	600586	金晶科技	14,724	46,527.84	0.21
175	600508	上海能源	4,693	46,507.63	0.21
176	601222	林洋电子	2,237	46,462.49	0.21
177	600983	合肥三洋	3,087	46,397.61	0.21
178	600322	天房发展	13,921	46,217.72	0.21
179	600662	强生控股	10,130	46,091.50	0.20
180	600033	福建高速	21,444	45,890.16	0.20
181	600139	西部资源	6,194	45,711.72	0.20
182	600667	太极实业	13,258	45,607.52	0.20

183	600846	同济科技	7,993	45,480.17	0.20
184	600636	三爱富	3,994	45,451.72	0.20
185	600830	香溢融通	4,696	45,316.40	0.20
186	600420	现代制药	2,764	45,025.56	0.20
187	600021	上海电力	9,677	44,901.28	0.20
188	600380	健康元	9,314	44,893.48	0.20
189	600831	广电网络	5,962	44,476.52	0.20
190	601058	赛轮股份	3,155	44,233.10	0.20
191	601608	中信重工	13,046	43,965.02	0.20
192	600790	轻纺城	6,874	43,581.16	0.19
193	600236	桂冠电力	13,830	43,287.90	0.19
194	601880	大连港	16,260	43,251.60	0.19
195	600754	锦江股份	2,696	43,189.92	0.19
196	600363	联创光电	5,631	43,189.77	0.19
197	600750	江中药业	2,723	43,186.78	0.19
198	600350	山东高速	14,195	43,010.85	0.19
199	600088	中视传媒	2,767	42,943.84	0.19
200	600106	重庆路桥	11,459	42,856.66	0.19
201	600495	晋西车轴	3,231	42,487.65	0.19
202	600460	士兰微	7,069	42,414.00	0.19
203	600329	中新药业	3,313	41,810.06	0.19
204	601886	江河创建	5,327	41,763.68	0.19
205	600676	交运股份	6,642	41,446.08	0.18
206	600708	海博股份	5,554	41,432.84	0.18
207	600858	银座股份	5,476	41,398.56	0.18
208	600487	亨通光电	1,959	41,393.67	0.18
209	600784	鲁银投资	7,567	41,391.49	0.18
210	600496	精工钢构	5,908	41,356.00	0.18
211	600470	六国化工	6,325	41,112.50	0.18
212	600622	嘉宝集团	6,651	41,036.67	0.18
213	600616	金枫酒业	4,764	41,018.04	0.18
214	600780	通宝能源	7,930	40,601.60	0.18
215	600479	千金药业	3,221	40,552.39	0.18
216	601000	唐山港	13,106	40,104.36	0.18
217	600438	通威股份	4,474	40,042.30	0.18
218	600176	中国玻纤	5,289	40,037.73	0.18
219	600976	武汉健民	1,666	39,884.04	0.18
220	601515	东风股份	1,537	39,669.97	0.18
221	600317	营口港	11,211	39,350.61	0.17

222	600039	四川路桥	6,509	39,314.36	0.17
223	600195	中牧股份	2,474	38,916.02	0.17
224	600172	黄河旋风	5,862	38,747.82	0.17
225	601700	风范股份	2,996	38,738.28	0.17
226	600614	鼎立股份	3,705	38,643.15	0.17
227	600552	方兴科技	2,048	38,584.32	0.17
228	600257	大湖股份	5,158	38,581.84	0.17
229	600446	金证股份	2,497	38,578.65	0.17
230	600082	海泰发展	7,888	38,414.56	0.17
231	601100	恒立油缸	3,166	38,276.94	0.17
232	600459	贵研铂业	1,888	38,080.96	0.17
233	600425	青松建化	9,873	37,912.32	0.17
234	600285	羚锐制药	3,930	37,806.60	0.17
235	603077	和邦股份	2,698	37,772.00	0.17
236	600185	格力地产	4,482	37,514.34	0.17
237	600197	伊力特	3,435	37,475.85	0.17
238	600308	华泰股份	13,180	37,299.40	0.17
239	600468	百利电气	3,885	37,218.30	0.17
240	600116	三峡水利	3,597	37,121.04	0.17
241	600778	友好集团	3,996	37,042.92	0.16
242	600559	老白干酒	1,426	37,033.22	0.16
243	601126	四方股份	1,920	36,960.00	0.16
244	600467	好当家	6,590	36,772.20	0.16
245	601965	中国汽研	2,715	36,381.00	0.16
246	600815	厦工股份	9,161	36,369.17	0.16
247	600673	东阳光铝	3,808	36,328.32	0.16
248	601678	滨化股份	4,689	36,245.97	0.16
249	600563	法拉电子	1,594	36,199.74	0.16
250	603366	日出东方	2,507	35,524.19	0.16
251	600391	成发科技	2,934	35,413.38	0.16
252	600686	金龙汽车	4,048	35,339.04	0.16
253	603766	隆鑫通用	3,746	35,249.86	0.16
254	600624	复旦复华	3,798	35,245.44	0.16
255	600193	创兴资源	5,263	34,735.80	0.15
256	600337	美克股份	5,765	34,590.00	0.15
257	600776	东方通信	5,608	34,545.28	0.15
258	601566	九牧王	2,705	34,434.65	0.15
259	600078	澄星股份	5,911	34,342.91	0.15
260	600723	首商股份	5,263	34,314.76	0.15

261	600869	远东电缆	4,759	34,026.85	0.15
262	600020	中原高速	15,301	33,968.22	0.15
263	601801	皖新传媒	2,719	33,905.93	0.15
264	600526	菲达环保	1,657	33,819.37	0.15
265	600449	宁夏建材	4,332	33,746.28	0.15
266	600697	欧亚集团	1,799	33,695.27	0.15
267	600888	新疆众和	5,674	33,590.08	0.15
268	600963	岳阳林纸	10,370	33,495.10	0.15
269	600682	南京新百	2,947	33,477.92	0.15
270	600280	中央商场	2,553	32,729.46	0.15
271	600491	龙元建设	9,235	32,691.90	0.15
272	600571	信雅达	2,048	32,522.24	0.14
273	600227	赤天化	11,621	31,841.54	0.14
274	600335	国机汽车	2,441	31,708.59	0.14
275	601908	京运通	3,846	31,537.20	0.14
276	600501	航天晨光	3,357	31,455.09	0.14
277	600101	明星电力	3,611	31,379.59	0.14
278	600333	长春燃气	3,881	31,203.24	0.14
279	600657	信达地产	9,631	31,108.13	0.14
280	600568	中珠控股	3,648	31,008.00	0.14
281	600007	中国国贸	2,916	30,938.76	0.14
282	600488	天药股份	7,285	30,742.70	0.14
283	600382	广东明珠	4,195	30,329.85	0.13
284	600121	郑州煤电	5,975	30,114.00	0.13
285	600589	广东榕泰	5,981	30,084.43	0.13
286	600318	巢东股份	3,011	30,049.78	0.13
287	600368	五洲交通	6,513	29,959.80	0.13
288	600249	两面针	5,404	29,884.12	0.13
289	600507	方大特钢	8,128	29,829.76	0.13
290	600850	华东电脑	1,424	29,818.56	0.13
291	600724	宁波富达	7,110	29,790.90	0.13
292	600523	贵航股份	2,449	29,657.39	0.13
293	600135	乐凯胶片	3,703	29,624.00	0.13
294	600644	乐山电力	3,668	29,600.76	0.13
295	600794	保税科技	3,867	29,427.87	0.13
296	600785	新华百货	2,496	29,427.84	0.13
297	601777	力帆股份	4,583	29,377.03	0.13
298	600995	文山电力	5,781	29,367.48	0.13
299	600321	国栋建设	14,230	29,313.80	0.13

300	600190	锦州港	7,716	29,243.64	0.13
301	600343	航天动力	2,017	28,722.08	0.13
302	600990	四创电子	1,017	28,699.74	0.13
303	600113	浙江东日	3,226	28,485.58	0.13
304	600510	黑牡丹	4,594	27,977.46	0.12
305	600278	东方创业	2,468	27,863.72	0.12
306	600469	风神股份	3,433	27,807.30	0.12
307	601890	亚星锚链	4,105	27,790.85	0.12
308	600295	鄂尔多斯	3,100	27,590.00	0.12
309	600979	广安爱众	5,537	27,297.41	0.12
310	600565	迪马股份	8,003	27,290.23	0.12
311	600577	精达股份	7,072	27,227.20	0.12
312	601107	四川成渝	9,509	27,195.74	0.12
313	601208	东材科技	3,818	26,535.10	0.12
314	600531	豫光金铅	2,840	26,355.20	0.12
315	601313	江南嘉捷	3,229	26,348.64	0.12
316	600712	南宁百货	6,606	26,225.82	0.12
317	600480	凌云股份	3,744	26,208.00	0.12
318	600987	航民股份	4,638	26,204.70	0.12
319	600375	华菱星马	2,509	26,093.60	0.12
320	600397	安源煤业	6,083	25,852.75	0.11
321	600114	东睦股份	1,733	25,804.37	0.11
322	601996	丰林集团	3,555	25,773.75	0.11
323	600378	天科股份	2,487	25,765.32	0.11
324	601233	桐昆股份	4,198	25,229.98	0.11
325	600327	大东方	5,004	25,070.04	0.11
326	600268	国电南自	4,941	25,050.87	0.11
327	600246	万通地产	8,479	24,758.68	0.11
328	600287	江苏舜天	3,705	24,749.40	0.11
329	600618	氯碱化工	3,687	24,666.03	0.11
330	600396	金山股份	3,353	24,611.02	0.11
331	600658	电子城	2,094	24,583.56	0.11
332	600345	长江通信	1,807	24,177.66	0.11
333	600683	京投银泰	5,482	24,065.98	0.11
334	600897	厦门空港	1,611	24,052.23	0.11
335	601388	怡球资源	2,597	23,866.43	0.11
336	601038	一拖股份	2,531	23,791.40	0.11
337	600581	八一钢铁	5,734	23,681.42	0.11
338	600012	皖通高速	5,959	23,478.46	0.10

339	600367	红星发展	2,778	23,474.10	0.10
340	601011	宝泰隆	2,330	23,346.60	0.10
341	600561	江西长运	2,147	23,294.95	0.10
342	600386	北巴传媒	2,825	23,108.50	0.10
343	600248	延长化建	2,827	22,248.49	0.10
344	600743	华远地产	8,668	22,103.40	0.10
345	600310	桂东电力	1,969	21,836.21	0.10
346	601636	旗滨集团	2,718	21,662.46	0.10
347	600666	西南药业	3,100	21,514.00	0.10
348	600882	华联矿业	2,604	21,456.96	0.10
349	603001	奥康国际	1,433	21,294.38	0.09
350	600184	光电股份	982	21,014.80	0.09
351	603128	华贸物流	1,890	20,638.80	0.09
352	600097	开创国际	1,624	20,608.56	0.09
353	600845	宝信软件	820	20,500.00	0.09
354	600054	黄山旅游	1,880	19,288.80	0.09
355	600687	刚泰控股	1,688	19,175.68	0.09
356	600230	沧州大化	1,643	18,943.79	0.08
357	600353	旭光股份	2,806	18,716.02	0.08
358	603167	渤海轮渡	2,241	18,712.35	0.08
359	600828	成商集团	3,487	18,515.97	0.08
360	601010	文峰股份	2,696	18,413.68	0.08
361	600258	首旅酒店	1,252	18,053.84	0.08
362	601567	三星电气	1,796	17,546.92	0.08
363	600131	岷江水电	4,262	17,346.34	0.08
364	600167	联美控股	1,657	16,851.69	0.07
365	600513	联环药业	1,560	16,723.20	0.07
366	601518	吉林高速	7,458	16,631.34	0.07
367	600070	浙江富润	2,054	16,493.62	0.07
368	600829	三精制药	2,445	16,210.35	0.07
369	601789	宁波建工	1,945	16,124.05	0.07
370	600548	深高速	4,731	15,943.47	0.07
371	600975	新五丰	2,595	15,829.50	0.07
372	600560	金自天正	1,818	15,543.90	0.07
373	600833	第一医药	1,799	15,345.47	0.07
374	601137	博威合金	883	13,236.17	0.06
375	603399	新华龙	1,146	12,903.96	0.06
376	600371	万向德农	1,271	11,629.65	0.05
377	600262	北方股份	724	10,331.48	0.05

378	601113	华鼎锦纶	2,023	8,274.07	0.04
379	600623	双钱股份	823	7,900.80	0.04

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

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	600639	浦东金桥	2,985	35,103.60	0.16

注：本基金为完全复制指数的股票型基金，未进行积极投资。报告期末持有的积极投资股票（浦东金桥，代码：600639）于 12 月 5 日停牌，至报告期末仍未复牌，12 月 16 日，该股被调出上证 380 指数成份股。

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	837,573.00	1.07
2	600804	鹏博士	810,336.00	1.04
3	601158	重庆水务	742,963.00	0.95
4	600009	上海机场	662,619.00	0.85
5	600863	内蒙华电	566,109.25	0.73
6	600655	豫园商城	551,012.00	0.71
7	600642	申能股份	543,539.00	0.70
8	600219	南山铝业	511,812.01	0.66
9	600811	东方集团	473,592.00	0.61
10	601001	大同煤业	448,071.44	0.57
11	601666	平煤股份	446,835.00	0.57
12	600352	浙江龙盛	444,981.83	0.57
13	601179	中国西电	442,344.92	0.57
14	601991	大唐发电	425,171.40	0.55
15	601106	中国一重	421,616.00	0.54
16	600125	铁龙物流	418,937.23	0.54
17	600839	四川长虹	403,708.00	0.52
18	601238	广汽集团	358,772.09	0.46

19	600418	江淮汽车	353,290.00	0.45
20	600664	哈药股份	324,620.00	0.42

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	600804	鹏博士	1,174,653.45	1.51
3	600832	东方明珠	982,575.82	1.26
4	600880	博瑞传播	877,516.33	1.12
5	600066	宇通客车	843,351.36	1.08
6	601991	大唐发电	822,363.80	1.05
7	600886	国投电力	820,292.86	1.05
8	600352	浙江龙盛	800,051.20	1.03
9	600009	上海机场	797,462.92	1.02
10	600388	龙净环保	756,190.62	0.97
11	600200	江苏吴中	734,119.42	0.94
12	600718	东软集团	703,559.01	0.90
13	600660	福耀玻璃	697,741.07	0.89
14	601158	重庆水务	688,254.51	0.88
15	600153	建发股份	685,305.80	0.88
16	600018	上港集团	677,537.43	0.87
17	600079	人福医药	668,743.24	0.86
18	600570	恒生电子	652,072.93	0.84
19	600267	海正药业	651,041.58	0.83
20	600597	光明乳业	641,848.60	0.82

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	36,463,848.80
卖出股票收入（成交）总额	98,666,932.88

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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	45,536.14
2	应收证券清算款	175,193.71
3	应收股利	-
4	应收利息	298.78
5	应收申购款	1,198.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	222,227.44

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	600639	浦东金桥	35,103.60	0.16	重大事项停牌

8.12.6 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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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
874	25,633.67	49,518.95	0.22%	22,354,308.22	99.78%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,971.56	0.0133%

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
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	3,819,885.25
减：本报告期基金总赎回份额	68,484,140.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,403,827.17

§ 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。

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（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期内已预提审计费 44000 元，截至 2013 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	
海通证券	2	31,622,002.45	23.44%	28,789.12	23.44%	-
中金证券	1	28,663,211.78	21.25%	26,094.87	21.25%	-
申银万国	1	19,877,967.27	14.74%	18,097.56	14.74%	-
光大证券	1	13,881,500.67	10.29%	12,637.85	10.29%	-
兴业证券	1	13,522,929.49	10.02%	12,311.76	10.02%	-
长江证券	1	10,239,822.68	7.59%	9,322.53	7.59%	-
中信证券	2	7,071,167.46	5.24%	6,438.07	5.24%	-
国联证券	1	4,582,097.19	3.40%	4,171.72	3.40%	-
国泰君安	2	4,235,747.82	3.14%	3,856.39	3.14%	-
国信证券	1	1,203,075.94	0.89%	1,095.33	0.89%	-
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	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
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，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：本报告期内租用了海通证券的深圳交易单元；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：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
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

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 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	中海基金网站	2013 年 4 月 20 日

	新招募说明书（2013 年第 1 号）		
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
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	2013 年 7 月 2 日
15	中海上证 380 指数证券投资基金 2013 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 7 月 18 日
16	中海基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购金额及定期定额最低申购金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 8 月 1 日
17	中海基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在网上直销平台单笔申购最低金额及定期定额最低申购金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 8 月 1 日
18	中海基金管理有限公司关于设立中海恒信资产管理（上海）有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 8 月 2 日
19	中海基金管理有限公司关于调整网上直销基金转换补差费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 8 月 12 日
20	中海基金管理有限公司关于方培池先生兼任中海恒信资产管理（上海）有限公司总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 8 月 21 日

21	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司网上交易系统申购及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 8 月 22 日
22	中海上证 380 指数证券投资基金 2013 年半年度报告（正文）	中海基金网站	2013 年 8 月 28 日
23	中海上证 380 指数证券投资基金 2013 年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 8 月 28 日
24	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增万银财富（北京）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 9 月 14 日
25	中海基金管理有限公司关于开展官网直销基金转换补差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 9 月 26 日
26	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海好买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 10 月 10 日
27	中海上证 380 指数证券投资基金更新招募说明书（2013 年第 2 号）	中海基金网站	2013 年 10 月 21 日
28	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 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 10 月 21 日
29	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得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 10 月 22 日
30	中海上证 380 指数证券投资基金 2013 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 10 月 25 日
31	中海基金管理有限公司关于开展官网直销基金转换补差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 10 月 29 日
32	中海基金管理有限公司关于调整官网直销基金转换补差费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 11 月 27 日
33	中海基金管理有限公司关于开展官网直销 e 通宝定投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 11 月 27 日
34	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京增财基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 12 月 3 日

	及定期定额投资业务的公告		
35	中海基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 12 月 12 日
36	中海基金管理有限公司关于在中海基金官方淘宝店开展直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 12 月 18 日
37	中海基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 12 月 24 日
38	中海基金管理有限公司关于旗下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 12 月 27 日
39	中海基金管理有限公司关于开展官网直销 e 通宝定投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 12 月 27 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
2014 年 3 月 29 日