

中海上证 380 指数证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 27 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 2014 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 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.....	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.....	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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	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.....	16
§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.....	30
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	42
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 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.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
§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.....	45
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.....	50
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

§ 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	17,644,311.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险控制手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，年跟踪误差力争控制在 4% 以内，以实现对上证 380 指数的有效跟踪。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，按照成份股在上证 380 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪上证 380 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪上证 380 指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>1、股票投资策略：本基金通过完全复制指数的方法，根据上证 380 指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。</p> <p>2、债券投资策略：本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择，同时考虑基金的流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。</p>
业绩比较基准	上证 380 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	367,367.56
本期利润	183,491.90

加权平均基金份额本期利润	0.0093
本期加权平均净值利润率	0.93%
本期基金份额净值增长率	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	156,034.48
期末可供分配基金份额利润	0.0088
期末基金资产净值	17,800,346.12
期末基金份额净值	1.009
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.90%

注 1: 本报告期指自 2014 年 1 月 1 日至 2014 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

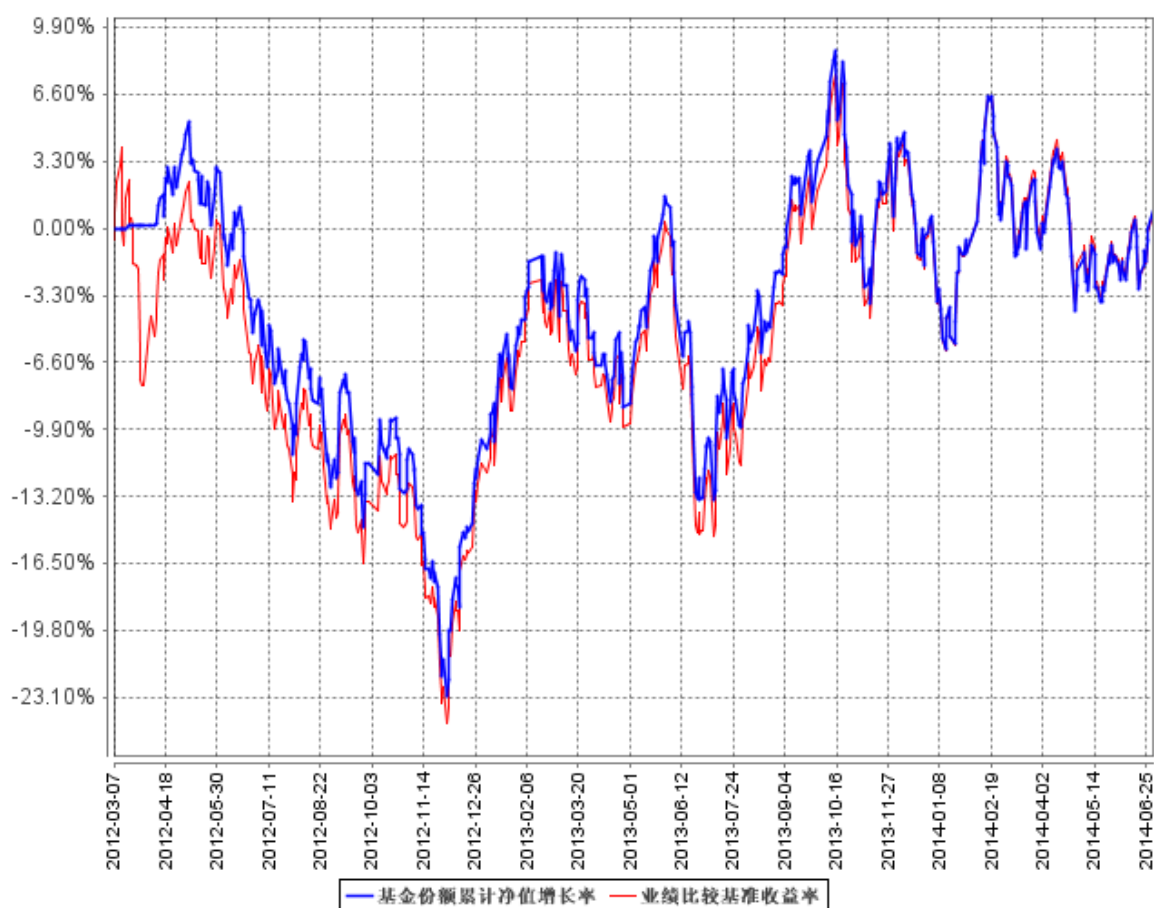
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.33%	0.84%	1.99%	0.83%	0.34%	0.01%
过去三个月	1.92%	0.93%	1.29%	0.94%	0.63%	-0.01%
过去六个月	0.50%	1.11%	0.48%	1.11%	0.02%	0.00%
过去一年	16.38%	1.18%	18.34%	1.20%	-1.96%	-0.02%
自基金合同生效日起至 今	0.90%	1.17%	0.68%	1.24%	0.22%	-0.07%

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 2014 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



§ 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 2014 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 20 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	2012年3月7	-	9	陈明星先

	<p>总监、本 基金基金 经理</p>	<p>日</p>		<p>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。</p>
--	-----------------------------	----------	--	--

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》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，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的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司风险管理部对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

4.3.2 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

1 月，市场受节前流动性紧张影响，大盘总体趋势下跌，但创业板维持了强势。2 月，市场受流动性宽松影响，大盘反弹，最高 2177 点，随后出现回调，多家银行暂停办理房地产夹层融资的

传闻更是加大了下跌的速度和幅度。3 月，市场受经济下滑较快影响，大盘下跌，最低下探至 1974 点，随后三个月在优先股和京津冀相关利好政策影响出现反弹，摸高 2079 点后再次出现回调，整体呈现锯齿型振荡走势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值 1.009 元(累计净值 1.009 元)。报告期内本基金净值增长率为 0.50%，高于业绩比较基准 0.02 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

展望下半年，市场流动性未来可能保持相对宽松局面，但是政府对于改革和保增长平衡的动态把握可能是影响市场的主要因素。如果下半年保增长持续有力进行，大盘有望继续向上，反之，若保增长力度不够或者改革推动适度加速，对大盘都有负面影响。

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

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。

4.7 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，本基金在本报告期末未发生利润分配。

§ 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

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 2014 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,047,159.29	1,181,008.53
结算备付金		715.24	3,625.17
存出保证金		3,644.79	45,536.14
交易性金融资产	6.4.7.2	16,839,192.43	21,170,691.57
其中：股票投资		16,839,192.43	21,170,691.57
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	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		263,820.46	175,193.71
应收利息	6.4.7.5	187.75	298.78
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,198.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		18,154,719.96	22,577,552.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		238,934.95	-
应付管理人报酬		10,956.00	14,965.16
应付托管费		2,191.21	2,993.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,725.75	18,172.61
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	96,565.93	50,275.56
负债合计		354,373.84	86,406.37
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	17,644,311.64	22,403,827.17
未分配利润	6.4.7.10	156,034.48	87,319.17
所有者权益合计		17,800,346.12	22,491,146.34
负债和所有者权益总计		18,154,719.96	22,577,552.71

注：报告截止日 2014 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年6月30日
一、收入		339,081.63	436,496.14
1.利息收入		4,198.47	15,957.10

其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,198.47	15,957.10
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		515,432.34	-560,061.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	349,467.51	-1,195,023.27
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	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	165,964.83	634,961.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-183,875.66	965,139.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,326.48	15,461.54
减：二、费用		155,589.73	595,272.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	73,409.62	283,699.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,681.96	56,739.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	18,297.81	86,337.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	49,200.34	168,494.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		183,491.90	-158,775.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		183,491.90	-158,775.89

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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	22,403,827.17	87,319.17	22,491,146.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	183,491.90	183,491.90
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）	-4,759,515.53	-114,776.59	-4,874,292.12
其中：1.基金申购款	1,154,319.22	-4,486.66	1,149,832.56
2.基金赎回款	-5,913,834.75	-110,289.93	-6,024,124.68
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）	17,644,311.64	156,034.48	17,800,346.12
项目	上年度可比期间 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

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
基金管理人负责人

宋宇
主管会计工作负责人

周琳
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”)、中国证券投资基金业协会于 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如财务报表附注 6.4.4 所列示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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	1,047,159.29
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	1,047,159.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,266,803.94	16,839,192.43	572,388.49
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	16,266,803.94	16,839,192.43	572,388.49

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**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	186.04
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	0.27
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	1.44
合计	187.75

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 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,725.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,725.75

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	42.00
其他	4,999.29
应付指数使用费	909.90
预提费用	90,614.74
合计	96,565.93

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,403,827.17	22,403,827.17
本期申购	1,154,319.22	1,154,319.22
本期赎回(以“-”号填列)	-5,913,834.75	-5,913,834.75
本期末	17,644,311.64	17,644,311.64

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	1,757,468.13	-1,670,148.96	87,319.17

本期利润	367,367.56	-183,875.66	183,491.90
本期基金份额交易产生的变动数	-396,234.38	281,457.79	-114,776.59
其中：基金申购款	97,106.28	-101,592.94	-4,486.66
基金赎回款	-493,340.66	383,050.73	-110,289.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,728,601.31	-1,572,566.83	156,034.48

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,939.32
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	78.01
其他	181.14
合计	4,198.47

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,483,845.05
减：卖出股票成本总额	7,134,377.54
买卖股票差价收入	349,467.51

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。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	165,964.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	165,964.83

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-183,875.66
——股票投资	-183,875.66
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-183,875.66

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,779.38
转出基金补偿收入	547.10
合计	3,326.48

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

交易所市场交易费用	18,297.81
银行间市场交易费用	-
合计	18,297.81

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	21,819.55
信息披露费	24,795.19
开户费	400.00
银行费用	228.00
指数使用费	1,957.60
合计	49,200.34

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的各关联方

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	1,869,845.30	18.01%	161,510.82	0.32%

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

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回购交易。

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	1,707.44	18.04%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	73,409.62	283,699.75
其中：支付销售机构的客户维护费	31,498.32	62,272.39

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	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,681.96	56,739.89

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	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 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	1,047,159.29	3,939.32	3,542,448.00	15,730.01

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（2014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
601012	隆基股份	2014年6月19日	重大事项停牌	15.50	2014年7月1日	15.60	3,965	52,893.10	61,457.50	-
600755	厦门国贸	2014年6月27日	重大事项停牌	4.85	2014年7月7日	4.74	11,398	50,880.08	55,280.30	-
600582	天地科技	2014年6月26日	重大事项停牌	7.97	-	-	6,201	76,536.71	49,421.97	-
600685	广船国际	2014年4月8日	重大事项停牌	17.13	-	-	2,842	42,948.47	48,683.46	-
600210	紫江企业	2014年6月26日	重大事项停牌	2.96	2014年7月3日	3.18	14,299	54,089.39	42,325.04	-
600260	凯乐科技	2014年6月9日	重大事项停牌	6.59	-	-	5,430	42,571.20	35,783.70	-
600864	哈投股份	2014年4月11日	重大事项	8.68	2014年7月15日	8.30	4,114	30,421.78	35,709.52	-

		日	停牌		日						
600682	南京新百	2014年3月3日	重大事项停牌	11.64	2014年7月4日	11.20	2,672	22,594.93	31,102.08	-	
600378	天科股份	2014年6月18日	重大事项停牌	12.84	2014年7月23日	13.50	2,193	20,549.93	28,158.12	-	
600135	乐凯胶片	2014年6月30日	重大事项停牌	8.87	2014年7月14日	9.76	2,955	25,503.22	26,210.85	-	
600227	赤天化	2014年6月6日	重大事项停牌	2.84	-	-	9,204	30,697.50	26,139.36	-	
600850	华东电脑	2014年4月4日	重大事项停牌	19.56	2014年7月11日	21.52	1,233	25,542.28	24,117.48	-	
600295	鄂尔多斯	2014年5月6日	重大事项停牌	7.38	-	-	3,159	29,492.54	23,313.42	-	
601777	力帆股份	2014年6月24日	重大事项停牌	6.39	2014年7月8日	6.70	3,639	25,658.35	23,253.21	-	
600666	西南药业	2014年4月25日	重大事项停牌	7.31	2014年8月12日	8.04	2,531	17,456.29	18,501.61	-	
600059	古越龙山	2014年6月30日	重大事项停牌	7.97	2014年7月1日	7.83	6,049	65,607.23	48,210.53	-	
600363	联创光电	2014年6月30日	重大事项停牌	8.27	2014年7月1日	8.29	4,597	37,600.10	38,017.19	-	
600507	方大特钢	2014年6月30日	重大事项停牌	3.16	2014年7月2日	3.03	6,323	27,844.36	19,980.68	-	

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。

6.4.13.3 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。2014 年 6 月 30 日，本基金股票资产持仓比例为 94.60%；2013 年 12 月 31 日，

本基金股票资产持仓比例为 94.13%。

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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	16,839,192.43	94.60	21,170,691.57	94.13
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	16,839,192.43	94.60	21,170,691.57	94.13

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（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	+5%	798,563.10	962,919.36
	-5%	-798,563.10	-962,919.36

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 （单位：人民币元）	本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	收益率绝对 VaR（%）	1.77	1.85

§ 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	16,839,192.43	92.75
	其中：股票	16,839,192.43	92.75
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	1,047,874.53	5.77
7	其他各项资产	267,653.00	1.47

8	合计	18,154,719.96	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	81,239.11	0.46
B	采矿业	634,663.31	3.57
C	制造业	9,055,790.03	50.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,177,833.19	6.62
E	建筑业	674,373.72	3.79
F	批发和零售业	1,724,939.20	9.69
G	交通运输、仓储和邮政业	1,499,633.22	8.42
H	住宿和餐饮业	34,001.52	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	866,019.36	4.87
J	金融业	-	-
K	房地产业	408,045.17	2.29
L	租赁和商务服务业	156,706.88	0.88
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,959.25	0.11
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	150,623.73	0.85
S	综合	356,364.74	2.00
	合计	16,839,192.43	94.60

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金为完全复制指数的股票型基金，不进行积极投资。

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	600570	恒生电子	5,961	175,253.40	0.98

2	600660	福耀玻璃	16,952	142,396.80	0.80
3	600594	益佰制药	3,399	139,800.87	0.79
4	601991	大唐发电	35,963	128,028.28	0.72
5	600587	新华医疗	1,690	125,989.50	0.71
6	600557	康缘药业	4,320	123,984.00	0.70
7	601929	吉视传媒	10,808	123,643.52	0.69
8	600879	航天电子	10,055	118,447.90	0.67
9	600642	申能股份	27,080	116,985.60	0.66
10	600867	通化东宝	8,776	114,351.28	0.64
11	600312	平高电气	8,159	113,736.46	0.64
12	600153	建发股份	20,642	112,498.90	0.63
13	600201	金宇集团	3,406	105,994.72	0.60
14	601333	广深铁路	41,201	104,650.54	0.59
15	600433	冠豪高新	10,239	104,540.19	0.59
16	601018	宁波港	45,869	104,122.63	0.58
17	600872	中炬高新	9,725	103,765.75	0.58
18	600068	葛洲坝	27,660	102,618.60	0.58
19	600388	龙净环保	4,229	102,130.35	0.57
20	600398	海澜之家	10,846	99,783.20	0.56
21	601618	中国中冶	58,349	99,776.79	0.56
22	600967	北方创业	7,904	99,195.20	0.56
23	600005	武钢股份	48,859	99,183.77	0.56
24	600029	南方航空	42,194	97,468.14	0.55
25	600873	梅花生物	18,430	94,545.90	0.53
26	600522	中天科技	7,112	93,096.08	0.52
27	600517	置信电气	9,052	91,968.32	0.52
28	601727	上海电气	23,868	91,653.12	0.51
29	600655	豫园商城	12,408	91,322.88	0.51
30	600525	长园集团	8,252	91,102.08	0.51
31	600694	大商股份	3,527	90,044.31	0.51
32	601898	中煤能源	22,252	89,675.56	0.50
33	600584	长电科技	10,102	89,200.66	0.50
34	600138	中青旅	4,051	88,230.78	0.50
35	600027	华电国际	28,730	88,201.10	0.50
36	601179	中国西电	24,701	88,182.57	0.50
37	600688	上海石化	26,777	88,096.33	0.49
38	600863	内蒙华电	23,312	87,886.24	0.49
39	600881	亚泰集团	23,318	85,810.24	0.48
40	600307	酒钢宏兴	37,660	84,358.40	0.47

41	600654	飞乐股份	9,161	82,907.05	0.47
42	600638	新黄浦	5,625	82,687.50	0.46
43	600811	东方集团	15,907	82,557.33	0.46
44	600717	天津港	10,300	82,194.00	0.46
45	600037	歌华有线	7,746	81,487.92	0.46
46	600175	美都控股	13,875	79,781.25	0.45
47	601877	正泰电器	3,627	79,467.57	0.45
48	600511	国药股份	3,452	78,360.40	0.44
49	601231	环旭电子	2,530	78,025.20	0.44
50	601238	广汽集团	10,351	77,943.03	0.44
51	600200	江苏吴中	7,497	77,893.83	0.44
52	600422	昆明制药	3,685	77,421.85	0.43
53	600436	片仔癀	980	75,979.40	0.43
54	600635	大众公用	15,739	75,389.81	0.42
55	600805	悦达投资	8,190	75,266.10	0.42
56	600820	隧道股份	15,419	74,782.15	0.42
57	600110	中科英华	14,157	74,324.25	0.42
58	600216	浙江医药	8,021	73,392.15	0.41
59	600410	华胜天成	6,098	72,505.22	0.41
60	600797	浙大网新	10,555	72,301.75	0.41
61	600664	哈药股份	11,608	72,201.76	0.41
62	600978	宜华木业	14,641	71,448.08	0.40
63	600478	科力远	3,153	71,446.98	0.40
64	600432	吉恩镍业	4,941	71,348.04	0.40
65	600219	南山铝业	13,976	70,159.52	0.39
66	600261	阳光照明	7,001	69,169.88	0.39
67	600062	华润双鹤	4,022	69,138.18	0.39
68	600572	康恩贝	4,942	68,545.54	0.39
69	600651	飞乐音响	9,195	68,043.00	0.38
70	601111	中国国航	20,429	67,211.41	0.38
71	600139	西部资源	4,835	66,723.00	0.37
72	600756	浪潮软件	2,665	66,411.80	0.37
73	600500	中化国际	10,272	66,151.68	0.37
74	600777	新潮实业	7,537	65,496.53	0.37
75	600183	生益科技	10,578	65,160.48	0.37
76	600323	瀚蓝环境	5,065	65,085.25	0.37
77	600366	宁波韵升	4,377	64,954.68	0.36
78	601106	中国一重	33,168	63,682.56	0.36
79	600776	东方通信	4,710	62,878.50	0.35

80	600284	浦东建设	6,674	62,802.34	0.35
81	600112	天成控股	4,884	62,612.88	0.35
82	600351	亚宝药业	6,748	62,081.60	0.35
83	601012	隆基股份	3,965	61,457.50	0.35
84	600835	上海机电	3,930	61,229.40	0.34
85	600038	哈飞股份	2,171	60,418.93	0.34
86	600884	杉杉股份	3,511	60,354.09	0.34
87	600161	天坛生物	3,266	60,029.08	0.34
88	600446	金证股份	1,947	59,850.78	0.34
89	600426	华鲁恒升	8,306	59,803.20	0.34
90	601158	重庆水务	11,940	58,983.60	0.33
91	600611	大众交通	8,763	57,572.91	0.32
92	600673	东阳光科	4,612	56,497.00	0.32
93	601666	平煤股份	13,889	56,111.56	0.32
94	600704	物产中大	6,761	55,981.08	0.31
95	600387	海越股份	3,704	55,856.32	0.31
96	600578	京能电力	16,919	55,832.70	0.31
97	600058	五矿发展	5,278	55,682.90	0.31
98	601001	大同煤业	10,165	55,602.55	0.31
99	600122	宏图高科	11,154	55,546.92	0.31
100	600755	厦门国贸	11,398	55,280.30	0.31
101	600171	上海贝岭	6,761	55,169.76	0.31
102	600317	营口港	23,564	54,904.12	0.31
103	600343	航天动力	4,499	54,392.91	0.31
104	600545	新疆城建	6,622	54,300.40	0.31
105	600761	安徽合力	5,502	54,139.68	0.30
106	600580	卧龙电气	7,034	53,950.78	0.30
107	600056	中国医药	5,032	53,490.16	0.30
108	600377	宁沪高速	9,579	53,067.66	0.30
109	600125	铁龙物流	10,996	53,000.72	0.30
110	600998	九州通	3,937	52,716.43	0.30
111	600160	巨化股份	10,847	52,499.48	0.29
112	600790	轻纺城	5,828	52,335.44	0.29
113	600509	天富热电	6,449	52,043.43	0.29
114	600270	外运发展	4,303	51,980.24	0.29
115	600289	亿阳信通	5,688	50,907.60	0.29
116	600536	中国软件	2,353	50,589.50	0.28
117	600662	强生控股	7,544	50,243.04	0.28
118	600667	太极实业	10,769	49,860.47	0.28

119	600188	兖州煤业	7,143	49,429.56	0.28
120	600582	天地科技	6,201	49,421.97	0.28
121	600825	新华传媒	6,272	48,984.32	0.28
122	600458	时代新材	5,531	48,783.42	0.27
123	600685	广船国际	2,842	48,683.46	0.27
124	600409	三友化工	11,133	48,651.21	0.27
125	600677	航天通信	3,349	48,359.56	0.27
126	600098	广州发展	10,152	48,222.00	0.27
127	600059	古越龙山	6,049	48,210.53	0.27
128	600626	申达股份	6,211	48,197.36	0.27
129	600017	日照港	18,511	47,943.49	0.27
130	601717	郑煤机	9,856	47,900.16	0.27
131	600481	双良节能	4,885	47,726.45	0.27
132	601588	北辰实业	19,445	47,640.25	0.27
133	600566	洪城股份	2,053	47,424.30	0.27
134	600064	南京高科	4,411	47,418.25	0.27
135	600720	祁连山	7,545	47,307.15	0.27
136	600285	羚锐制药	3,448	47,237.60	0.27
137	600846	同济科技	5,977	46,919.45	0.26
138	600859	王府井	2,946	46,546.80	0.26
139	600575	芜湖港	12,425	46,221.00	0.26
140	600742	一汽富维	2,235	46,197.45	0.26
141	600292	中电远达	2,421	46,095.84	0.26
142	601311	骆驼股份	4,292	46,010.24	0.26
143	601718	际华集团	18,614	45,790.44	0.26
144	601000	唐山港	10,317	45,188.46	0.25
145	601369	陕鼓动力	7,923	44,448.03	0.25
146	600527	江南高纤	9,430	44,038.10	0.25
147	600132	重庆啤酒	2,931	43,730.52	0.25
148	600460	士兰微	7,360	43,571.20	0.24
149	600073	上海梅林	5,922	43,052.94	0.24
150	600502	安徽水利	5,920	42,624.00	0.24
151	600563	法拉电子	1,281	42,593.25	0.24
152	600783	鲁信创投	2,639	42,382.34	0.24
153	600210	紫江企业	14,299	42,325.04	0.24
154	600668	尖峰集团	4,084	42,310.24	0.24
155	600824	益民集团	7,479	41,957.19	0.24
156	601002	晋亿实业	4,986	41,882.40	0.24
157	600004	白云机场	5,883	41,416.32	0.23

158	600551	时代出版	2,470	41,174.90	0.23
159	600420	现代制药	2,219	41,162.45	0.23
160	600438	通威股份	4,324	41,034.76	0.23
161	600482	风帆股份	3,816	40,831.20	0.23
162	600628	新世界	5,249	40,732.24	0.23
163	600874	创业环保	5,118	40,688.10	0.23
164	600636	三爱富	3,213	40,580.19	0.23
165	600329	中新药业	2,615	40,506.35	0.23
166	600141	兴发集团	4,093	40,152.33	0.23
167	600120	浙江东方	3,546	40,069.80	0.23
168	601222	林洋电子	1,765	39,871.35	0.22
169	601258	庞大集团	9,074	39,834.86	0.22
170	600096	云天化	5,636	39,621.08	0.22
171	600269	赣粤高速	14,386	39,561.50	0.22
172	600528	中铁二局	8,531	39,498.53	0.22
173	600567	山鹰纸业	19,509	39,213.09	0.22
174	600612	老凤祥	1,541	39,002.71	0.22
175	600395	盘江股份	6,100	38,857.00	0.22
176	600486	扬农化工	1,902	38,819.82	0.22
177	600729	重庆百货	1,983	38,747.82	0.22
178	600300	维维股份	9,590	38,743.60	0.22
179	600251	冠农股份	2,590	38,720.50	0.22
180	600826	兰生股份	2,610	38,680.20	0.22
181	600624	复旦复华	3,371	38,530.53	0.22
182	600389	江山股份	1,178	38,414.58	0.22
183	600363	联创光电	4,597	38,017.19	0.21
184	600993	马应龙	2,385	37,468.35	0.21
185	601918	国投新集	13,342	37,224.18	0.21
186	600380	健康元	7,336	36,973.44	0.21
187	600970	中材国际	5,399	36,821.18	0.21
188	600033	福建高速	16,708	36,590.52	0.21
189	600831	广电网络	4,694	36,284.62	0.20
190	601101	昊华能源	6,421	36,150.23	0.20
191	600260	凯乐科技	5,430	35,783.70	0.20
192	600971	恒源煤电	6,694	35,745.96	0.20
193	600864	哈投股份	4,114	35,709.52	0.20
194	600686	金龙汽车	3,958	35,424.10	0.20
195	600487	亨通光电	2,457	35,331.66	0.20
196	600708	海博股份	4,863	34,916.34	0.20

197	603766	隆鑫通用	3,948	34,900.32	0.20
198	600496	精工钢构	5,302	34,622.06	0.19
199	600021	上海电力	7,906	34,549.22	0.19
200	601886	江河创建	5,507	34,418.75	0.19
201	600495	晋西车轴	2,505	34,243.35	0.19
202	600754	锦江股份	2,072	34,001.52	0.19
203	600298	安琪酵母	2,298	33,504.84	0.19
204	600405	动力源	2,768	33,465.12	0.19
205	600750	江中药业	2,129	33,361.43	0.19
206	600586	金晶科技	11,398	33,282.16	0.19
207	600238	海南椰岛	5,270	33,253.70	0.19
208	601515	东风股份	2,791	33,157.08	0.19
209	600983	合肥三洋	2,554	33,150.92	0.19
210	601880	大连港	12,596	33,127.48	0.19
211	601058	赛轮股份	2,818	33,083.32	0.19
212	600403	大有能源	6,230	32,956.70	0.19
213	600350	山东高速	10,905	32,387.85	0.18
214	600571	信雅达	1,658	32,314.42	0.18
215	600176	中国玻纤	4,132	32,064.32	0.18
216	600088	中视传媒	2,202	31,973.04	0.18
217	600391	成发科技	2,310	31,854.90	0.18
218	600277	亿利能源	4,895	31,817.50	0.18
219	601608	中信重工	10,146	31,756.98	0.18
220	601139	深圳燃气	4,691	31,335.88	0.18
221	600106	重庆路桥	8,898	31,231.98	0.18
222	600039	四川路桥	5,593	31,208.94	0.18
223	600335	国机汽车	1,982	31,137.22	0.17
224	600682	南京新百	2,672	31,102.08	0.17
225	600459	贵研铂业	1,935	31,095.45	0.17
226	600622	嘉宝集团	5,181	31,086.00	0.17
227	600997	开滦股份	7,048	30,729.28	0.17
228	600425	青松建化	6,484	30,539.64	0.17
229	600976	武汉健民	1,517	30,309.66	0.17
230	600428	中远航运	10,321	30,240.53	0.17
231	600552	方兴科技	2,199	30,060.33	0.17
232	601678	滨化股份	3,997	29,897.56	0.17
233	600080	金花股份	2,975	29,809.50	0.17
234	600172	黄河旋风	4,630	29,724.60	0.17
235	600119	长江投资	2,542	29,690.56	0.17

236	600676	交运股份	5,207	29,471.62	0.17
237	600479	千金药业	2,552	29,424.56	0.17
238	600185	格力地产	3,505	29,371.90	0.17
239	600858	银座股份	4,187	29,350.87	0.16
240	600784	鲁银投资	5,831	29,213.31	0.16
241	600577	精达股份	6,202	29,211.42	0.16
242	601965	中国汽研	2,358	29,168.46	0.16
243	600236	桂冠电力	10,605	29,163.75	0.16
244	601700	风范股份	2,225	29,147.50	0.16
245	600439	瑞贝卡	7,479	29,018.52	0.16
246	600616	金枫酒业	3,687	28,758.60	0.16
247	600973	宝胜股份	3,514	28,533.68	0.16
248	600508	上海能源	3,620	28,525.60	0.16
249	601801	皖新传媒	2,131	28,491.47	0.16
250	600382	广东明珠	3,332	28,388.64	0.16
251	600614	鼎立股份	2,823	28,342.92	0.16
252	600378	天科股份	2,193	28,158.12	0.16
253	600470	六国化工	4,917	28,026.90	0.16
254	600830	香溢融通	3,635	27,989.50	0.16
255	600697	欧亚集团	1,563	27,883.92	0.16
256	600467	好当家	5,081	27,691.45	0.16
257	600082	海泰发展	6,062	27,582.10	0.15
258	600257	大湖股份	3,960	27,403.20	0.15
259	600963	岳阳林纸	9,092	27,366.92	0.15
260	601126	四方股份	1,926	27,349.20	0.15
261	600589	广东榕泰	5,265	26,956.80	0.15
262	600114	东睦股份	2,355	26,917.65	0.15
263	600020	中原高速	12,036	26,840.28	0.15
264	600480	凌云股份	3,283	26,690.79	0.15
265	600568	中珠控股	2,942	26,683.94	0.15
266	600501	航天晨光	2,607	26,591.40	0.15
267	603366	日出东方	1,959	26,466.09	0.15
268	600523	贵航股份	1,956	26,464.68	0.15
269	600135	乐凯胶片	2,955	26,210.85	0.15
270	600227	赤天化	9,204	26,139.36	0.15
271	600337	美克股份	4,484	25,738.16	0.14
272	600078	澄星股份	4,577	25,539.66	0.14
273	600794	保税科技	3,118	25,505.24	0.14
274	600723	首商股份	4,126	25,333.64	0.14

275	600195	中牧股份	1,932	25,135.32	0.14
276	600780	通宝能源	5,829	25,122.99	0.14
277	600559	老白干酒	1,195	25,059.15	0.14
278	600469	风神股份	2,669	24,928.46	0.14
279	600650	锦江投资	2,737	24,660.37	0.14
280	600488	天药股份	5,694	24,655.02	0.14
281	603077	和邦股份	1,896	24,648.00	0.14
282	600449	宁夏建材	3,351	24,529.32	0.14
283	600801	华新水泥	3,654	24,372.18	0.14
284	600850	华东电脑	1,233	24,117.48	0.14
285	600197	伊力特	2,658	24,028.32	0.13
286	600657	信达地产	7,567	23,987.39	0.13
287	600888	新疆众和	4,390	23,969.40	0.13
288	600778	友好集团	3,122	23,945.74	0.13
289	600468	百利电气	2,404	23,943.84	0.13
290	600491	龙元建设	7,209	23,717.61	0.13
291	600396	金山股份	5,181	23,625.36	0.13
292	600190	锦州港	5,973	23,414.16	0.13
293	600526	菲达环保	2,666	23,354.16	0.13
294	600295	鄂尔多斯	3,159	23,313.42	0.13
295	601777	力帆股份	3,639	23,253.21	0.13
296	601100	恒立油缸	2,503	23,177.78	0.13
297	600081	东风科技	1,662	23,085.18	0.13
298	600386	北巴传媒	2,471	23,029.72	0.13
299	600321	国栋建设	11,245	22,714.90	0.13
300	600327	大东方	3,939	22,688.64	0.13
301	600375	华菱星马	1,993	22,500.97	0.13
302	600246	万通地产	7,347	22,408.35	0.13
303	600218	全柴动力	2,445	22,273.95	0.13
304	600101	明星电力	2,815	22,097.75	0.12
305	600193	创兴资源	3,625	22,076.25	0.12
306	601566	九牧王	2,091	22,039.14	0.12
307	601388	怡球资源	2,038	21,990.02	0.12
308	600116	三峡水利	2,312	21,964.00	0.12
309	600990	四创电子	810	21,942.90	0.12
310	600168	武汉控股	2,933	21,850.85	0.12
311	600724	宁波富达	5,500	21,670.00	0.12
312	601908	京运通	3,028	21,589.64	0.12
313	600618	氯碱化工	2,895	21,509.85	0.12

314	600007	中国国贸	2,223	21,474.18	0.12
315	600510	黑牡丹	4,084	21,236.80	0.12
316	600995	文山电力	4,486	21,129.06	0.12
317	600565	迪马股份	6,316	21,095.44	0.12
318	600897	厦门空港	1,434	20,879.04	0.12
319	601208	东材科技	3,067	20,702.25	0.12
320	600012	皖通高速	4,712	20,638.56	0.12
321	600333	长春燃气	2,978	20,577.98	0.12
322	600869	远东电缆	2,504	20,407.60	0.11
323	600368	五洲交通	5,021	20,385.26	0.11
324	600845	宝信软件	685	20,351.35	0.11
325	600882	华联矿业	2,662	20,204.58	0.11
326	601233	桐昆股份	3,264	20,008.32	0.11
327	600507	方大特钢	6,323	19,980.68	0.11
328	601107	四川成渝	7,361	19,948.31	0.11
329	600280	中央商场	1,968	19,857.12	0.11
330	603001	奥康国际	1,443	19,841.25	0.11
331	600987	航民股份	3,578	19,679.00	0.11
332	600979	广安爱众	4,286	19,587.02	0.11
333	601010	文峰股份	2,775	19,369.50	0.11
334	600268	国电南自	3,880	19,244.80	0.11
335	600641	万业企业	4,817	19,123.49	0.11
336	601996	丰林集团	2,757	19,050.87	0.11
337	600054	黄山旅游	1,487	18,959.25	0.11
338	600743	华远地产	6,779	18,845.62	0.11
339	600666	西南药业	2,531	18,501.61	0.10
340	600278	东方创业	1,912	18,431.68	0.10
341	600687	刚泰控股	1,732	18,376.52	0.10
342	603308	应流股份	1,173	18,322.26	0.10
343	601636	旗滨集团	2,533	18,136.28	0.10
344	603993	洛阳钼业	2,699	18,083.30	0.10
345	600287	江苏舜天	2,935	18,050.25	0.10
346	600561	江西长运	1,681	17,717.74	0.10
347	603555	贵人鸟	1,368	17,414.64	0.10
348	600785	新华百货	1,635	17,249.25	0.10
349	600230	沧州大化	1,727	17,166.38	0.10
350	603167	渤海轮渡	1,782	17,053.74	0.10
351	601799	星宇股份	978	16,743.36	0.09
352	600248	延长化建	2,237	16,419.58	0.09

353	600258	首旅酒店	1,101	16,140.66	0.09
354	600353	旭光股份	2,236	15,920.32	0.09
355	600121	郑州煤电	3,898	15,903.84	0.09
356	600397	安源煤业	4,635	15,712.65	0.09
357	600532	宏达矿业	2,151	15,680.79	0.09
358	603399	新华龙	1,604	15,350.28	0.09
359	600318	巢东股份	1,775	15,211.75	0.09
360	601038	一拖股份	1,911	15,001.35	0.08
361	601567	三星电气	1,431	14,810.85	0.08
362	600513	联环药业	1,251	14,736.78	0.08
363	603128	华贸物流	1,507	14,557.62	0.08
364	600310	桂东电力	1,526	14,222.32	0.08
365	600167	联美控股	1,314	14,033.52	0.08
366	600548	深高速	3,724	13,629.84	0.08
367	601313	江南嘉捷	1,846	13,605.02	0.08
368	600833	第一医药	1,383	13,498.08	0.08
369	600560	金白天正	1,445	13,279.55	0.07
370	600097	开创国际	1,270	13,182.60	0.07
371	600975	新五丰	2,094	12,961.86	0.07
372	600828	成商集团	2,713	12,723.97	0.07
373	600829	三精制药	1,901	12,413.53	0.07
374	600985	雷鸣科化	1,083	12,075.45	0.07
375	601789	宁波建工	1,473	10,664.52	0.06
376	600262	北方股份	723	9,348.39	0.05
377	600623	双钱股份	635	7,175.50	0.04

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

注：本基金为完全复制指数的股票型基金，不进行积极投资。

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	600029	南方航空	107,416.00	0.48
2	600027	华电国际	103,648.00	0.46

3	600398	海澜之家	102,975.00	0.46
4	601111	中国国航	92,960.00	0.41
5	600216	浙江医药	84,036.00	0.37
6	600777	新潮实业	76,734.00	0.34
7	600366	宁波韵升	75,900.00	0.34
8	600797	浙大网新	71,416.00	0.32
9	600160	巨化股份	67,848.00	0.30
10	601717	郑煤机	67,678.00	0.30
11	601012	隆基股份	65,366.00	0.29
12	601588	北辰实业	62,499.00	0.28
13	600058	五矿发展	56,970.00	0.25
14	600064	南京高科	54,378.00	0.24
15	600395	盘江股份	53,180.98	0.24
16	600141	兴发集团	51,357.00	0.23
17	600566	洪城股份	50,652.00	0.23
18	600188	兖州煤业	48,981.00	0.22
19	600970	中材国际	47,925.00	0.21
20	600307	酒钢宏兴	46,716.00	0.21

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	600079	人福医药	214,452.61	0.95
2	600839	四川长虹	201,435.17	0.90
3	600718	东软集团	176,433.44	0.78
4	600499	科达洁能	159,124.42	0.71
5	601933	永辉超市	153,008.84	0.68
6	600827	友谊股份	142,713.22	0.63
7	601098	中南传媒	121,768.48	0.54
8	600648	外高桥	107,799.56	0.48
9	600787	中储股份	106,452.95	0.47
10	600521	华海药业	78,886.22	0.35
11	600596	新安股份	78,297.09	0.35
12	600435	北方导航	70,989.35	0.32

13	600433	冠豪高新	70,260.94	0.31
14	601872	招商轮船	69,171.42	0.31
15	600373	中文传媒	68,459.52	0.30
16	601929	吉视传媒	67,552.74	0.30
17	600570	恒生电子	57,198.88	0.25
18	600867	通化东宝	51,310.26	0.23
19	600595	中孚实业	49,635.82	0.22
20	600138	中青旅	48,877.48	0.22

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	2,969,344.46
卖出股票收入（成交）总额	7,483,845.05

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序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	3,644.79
2	应收证券清算款	263,820.46
3	应收股利	-
4	应收利息	187.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	267,653.00

7.12.4 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

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.6 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。

§ 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
793	22,250.08	49,518.95	0.28%	17,594,792.69	99.72%

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	990.36	0.0056%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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	22, 403, 827. 17
本报告期基金总申购份额	1, 154, 319. 22
减:本报告期基金总赎回份额	5, 913, 834. 75
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	17, 644, 311. 64

§ 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，本基金管理人免去朱冰峰先生督察长职务；聘请副总经理宋宇先生兼任代理督察长职务。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

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（特殊普通合伙），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	
东方证券	1	4,345,634.11	41.85%	3,957.00	41.82%	-
国联证券	1	1,869,845.30	18.01%	1,707.44	18.04%	-
中金公司	1	1,692,221.57	16.30%	1,541.63	16.29%	-
光大证券	1	1,511,898.86	14.56%	1,377.78	14.56%	-
兴业证券	1	454,218.46	4.37%	414.82	4.38%	-
国金证券	1	399,144.88	3.84%	363.34	3.84%	-
长江证券	1	110,271.29	1.06%	100.85	1.07%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	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	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中建银投证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-
中山证券	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：本报告期内新增了民生证券、中山证券的上海交易单元；因华泰联合证券合并入华泰证券，原华泰联合证券下交易单元全部转入华泰证券。

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
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中建银投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
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 2013 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报	2014 年 1 月 21 日
2	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	2014 年 2 月 26 日
3	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京恒天明泽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	2014 年 3 月 5 日
4	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构并开通	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 10 日

	基金转换及定期定额投资业务的公告		
5	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与光大证券股份有限公司手机客户端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 12 日
6	中海基金管理有限公司关于开通工商银行卡网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 18 日
7	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	2014 年 3 月 28 日
8	中海上证 380 指数证券投资基金 2013 年年度报告（正文）	中海基金网站	2014 年 3 月 29 日
9	中海上证 380 指数证券投资基金 2013 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 29 日
10	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华夏银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 16 日
11	中海上证 380 指数证券投资基金更新招募说明书（2014 年第 1 号）	中海基金网站	2014 年 4 月 19 日
12	中海上证 380 指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2014 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 19 日
13	中海上证 380 指数证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 19 日
14	中海基金管理有限公司关于子公司中海恒信资产管理（上海）有限公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 30 日
15	中海基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 5 月 10 日
16	中海基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 5 月 24 日
17	中海基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 6 月 14 日
18	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增浙江同花顺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	2014 年 6 月 20 日
19	中海基金管理有限公司关于旗下基金继续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	2014 年 6 月 20 日

20	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华夏银行股份有限公司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	2014 年 6 月 26 日
21	中海基金管理有限公司关于北京分公司营业场所地址变更的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 6 月 27 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
2014 年 8 月 27 日