

中海医疗保健主题证券投资基金 (原中海上证 380 指数证券投资基金)

2015 年第 2 季度报告

2015 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

报告送出日期：2015 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 中海医疗保健主题证券投资基金（转型后）

基金简称	中海医疗保健主题股票
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	2015 年 6 月 9 日
报告期末基金份额总额	33,892,981.82 份
投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业上市公司，在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、一级资产配置 一级资产配置主要采取自上而下的方式。 本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、医疗保健行业发展趋势等分析判断，采取自上而下的分析方法，比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征，动态确定基金资产在固定收益类和权益类资产的配置比例。 2、股票投资策略 （1）医疗保健主题行业的界定 本基金将沪深两市中从事医疗保健行业的上市公司定义为医疗保健主题类公司，具体包括以下几类公司： 1）主营业务从事医疗行业（包括但不限于化学制药、中药、生物制品、医药商业、医疗器械和医疗服务等行

	业)的公司; 2) 主营业务有利于公众健康(包括但不限于保健食品、养老等行业)的公司; 3) 当前非主营业务提供的产品或服务隶属于医疗保健行业,且未来这些产品或服务有望成为主要利润来源的公司。当未来由于经济增长方式的转变、产业结构的升级,从事或受益于上述投资主题的外延也将逐渐扩大,本基金将视实际情况调整上述医疗保健主题的识别及认定。 (2) 医疗保健主题类股票的投资策略 本基金投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金对医疗保健主题类的个股将采用定量分析与定性分析相结合的方法,选择其中具有优势的上市公司进行投资。 1) 定量方式 本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析,以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。 2) 定性方式 本基金主要通过实地调研等方法,综合考察评估公司的核心竞争优势,重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势的公司,并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司,以确保最大程度地规避投资风险。本基金管理人重点考察上市公司的竞争优势包括:公司管理竞争优势、技术或产品竞争优势、品牌竞争优势、规模优势等方面。 3、债券投资策略 (1) 久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。利用宏观经济分析模型,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性,即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点,确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。 (2) 期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。 (3) 债券类别配置/个券选择:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值,以其历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债、资产支持证券等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债
--	---

	等利率债券，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

注：2015 年 6 月 9 日，中海上证 380 指数证券投资基金变更为中海医疗保健主题证券投资基金。

2.2 中海上证 380 指数证券投资基金（转型前）

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
报告期末基金份额总额	21,314,619.49 份
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×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。
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

注: 2015 年 6 月 9 日, 中海上证 380 指数证券投资基金变更为中海医疗保健主题证券投资基金。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 (转型后)

单位: 人民币元

主要财务指标	转型后
	报告期 (2015 年 6 月 9 日 — 2015 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	12,389,714.85
2. 本期利润	-6,309,516.95
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2744
4. 期末基金资产净值	58,242,082.36
5. 期末基金份额净值	1.718

注 1: 本期指 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 6 月 30 日, 上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 2: 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 主要财务指标 (转型前)

单位: 人民币元

主要财务指标	转型前
	报告期 (2015 年 4 月 1 日 — 2015 年 6 月 8 日)
1. 本期已实现收益	6,755,548.36
2. 本期利润	14,650,752.44
3. 加权平均基金份额本期利润	0.6068
4. 期末基金资产净值	41,225,823.70
5. 期末基金份额净值	1.934

注 1: 本期指 2015 年 4 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日, 上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 2：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。

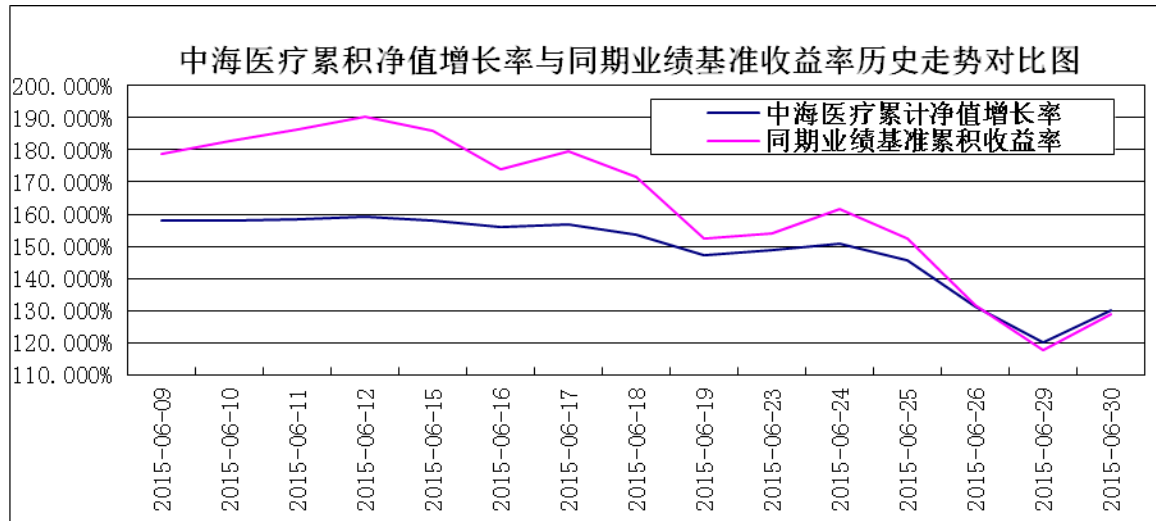
3.3 基金净值表现（转型后）

3.3.1 本报告期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	净值增长率 ①	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
2015.6.9-2015.6.30	-11.17%	2.47%	-17.72%	3.92%	6.56%	-1.45%

注：本基金的业绩比较基准为中证医药卫生指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。因此，我们选取市场认同度很高的中证医药卫生指数和中证全债指数作为计算业绩基准指数的基础指数。在一般市场状况下，本基金投资于医药保健主题类证券的比例控制在 80%左右，其他资产投资比例控制在 20%左右。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 80%、20%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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



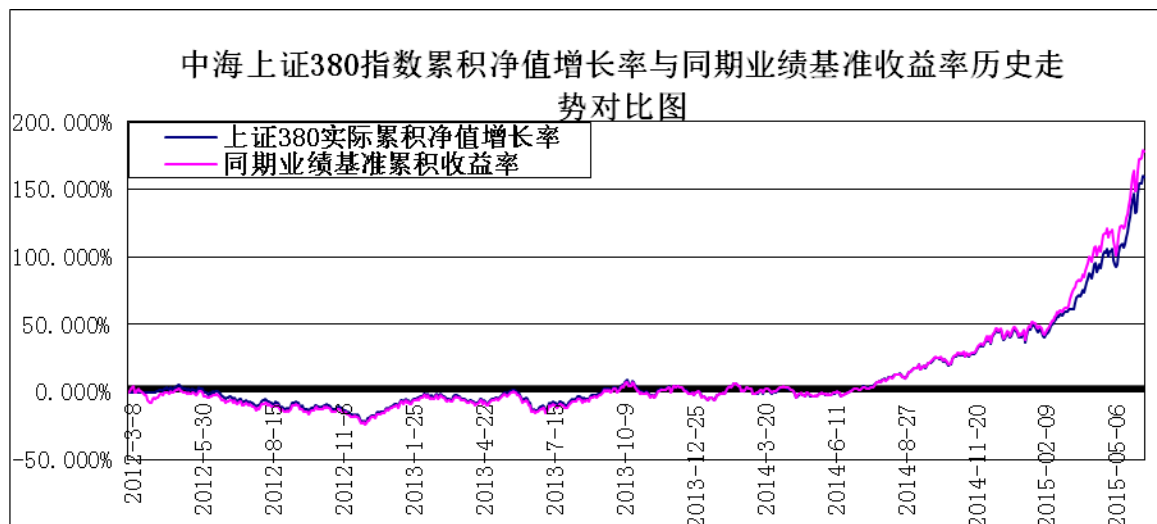
注：本基金转型日期为 2015 年 6 月 9 日。截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

3.4 基金净值表现（转型前）

3.4.1 本报告期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	净值增长率 ①	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
2015.4.1-2015.6.8	48.88%	2.13%	50.03%	2.23%	-1.15%	-0.10%

3.4.2 自基金合同生效以来基金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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2015 年 6 月 30 日	10 年	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 2015 年 6 月任中海上证 380 指数证券投资基金基金经理。
郑磊	本基金基金经理、中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015 年 6 月 9 日	-	5 年	郑磊先生，复旦大学医学与卫生事业管理专业硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司助理研究员。2013 年 1 月进入我公司工作，历任分析师、高级分析师兼中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2014 年 12 月至今任中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 6 月至今任中海医疗保健主题股票型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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

转型前：

4 月和 5 月，大盘受大量入市增量资金推动，不断创出新高。截至 6 月 8 日，大盘继续创出新高。

2 季度，从季初至 6 月 9 日，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。

转型后：

2015 年 2 季度，宏观经济运行平稳，构成影响市场的主要因素来自于政策与流动性两个方面，

在宽松货币政策与改革预期的引导下，市场热度持续大幅上升，但进入六月后，在查场外配资的影响下，市场出现一定的流动性风险，上证指数和创业板都出现较大的回调。医药行业整体运行平稳，虽然行业增速下一个台阶，但企业增长呈现分化，产品梯队丰富的公司有望获得更为确定的成长；在市场风险偏好下降的情况下，主题投资的热度有所下降。

本基金在报告期内完成了初步建仓工作，主要增持了互联网医疗、基因测序等新兴成长领域，同时增持了估值合理且基本面趋势向上的白马成长股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前：

截至 2015 年 6 月 8 日，本基金份额净值 1.9340 元（累计净值 2.3440 元）。报告期内本基金净值增长率为 48.88%，低于业绩比较基准 1.15 个百分点。

转型后：

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金净值 1.718 元（累计净值 2.128 元）。报告期内本基金 A 类净值增长率为-11.17%，高于业绩比较基准 6.56 个百分点。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金转型前，2015 年 4 月 1 日至 2015 年 5 月 6 日以及 2015 年 5 月 11 日至 2015 年 6 月 8 日，本基金分别出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金转型后，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

转型后：中海医疗保健主题股票型证券投资基金

报告期（2015 年 6 月 9 日—2015 年 6 月 30 日）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	44,910,258.61	71.54
	其中：股票	44,910,258.61	71.54
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	13,752,301.46	21.91
7	其他资产	4,116,587.14	6.56
8	合计	62,779,147.21	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	0.00	0.00%
B	采掘业	111,800.57	0.19%
C	制造业	30,543,257.27	52.44%
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,032.96	0.05%
E	建筑业	989.12	0.00%
F	批发和零售业	5,372,473.45	9.22%
G	交通运输、仓储和邮政业	140,174.49	0.24%
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00%
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,153,044.83	3.70%
J	金融业	0.00	0.00%
K	房地产业	1,139,613.68	1.96%
L	租赁和商务服务业	89,585.48	0.15%
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00%
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00%
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	5,218,552.00	8.96%
R	文化、体育和娱乐业	87.51	0.00%
S	综合	112,647.25	0.19%
	合计	44,910,258.61	77.11%

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	300147	香雪制药	69,100	2,128,280.00	3.65
2	300244	迪安诊断	25,000	2,098,500.00	3.60
3	600867	通化东宝	85,600	1,877,208.00	3.22
4	600420	现代制药	42,000	1,827,000.00	3.14
5	600812	华北制药	148,300	1,800,362.00	3.09
6	600521	华海药业	55,724	1,741,375.00	2.99
7	002022	科华生物	40,600	1,731,996.00	2.97
8	600479	千金药业	80,800	1,712,152.00	2.94
9	300015	爱尔眼科	52,400	1,690,424.00	2.90
10	002644	佛慈制药	31,100	1,554,378.00	2.67

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注**5.11.1**

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,521.53
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,076.71
5	应收申购款	4,033,871.30
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	54,117.60
9	合计	4,116,587.14

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

转型前：中海上证 380 指数证券投资基金

报告期（2015 年 4 月 1 日—2015 年 6 月 8 日）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	36,109,954.78	86.53
	其中：股票	36,109,954.78	86.53
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	4,202,073.63	10.07
7	其他资产	1,419,218.30	3.40
8	合计	41,731,246.71	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	117,649.44	0.29
B	采掘业	1,338,234.09	3.25
C	制造业	19,250,606.52	46.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,362,565.97	5.73
E	建筑业	1,785,761.13	4.33
F	批发和零售业	3,757,519.55	9.11
G	交通运输、仓储和邮政业	2,939,228.69	7.13
H	住宿和餐饮业	60,909.92	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,353,387.99	3.28
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	1,107,696.72	2.69
L	租赁和商务服务业	639,258.01	1.55
M	科学研究和技术服务业	27,108.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	88,186.78	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	249,475.87	0.61

S	综合	908,525.95	2.20
	合计	35,986,114.63	87.29

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	0.00	0.00
B	采掘业	0.00	0.00
C	制造业	83,706.00	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	40,134.15	0.10
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	123,840.15	0.30

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601106	中国一重	23,809	454,037.63	1.10
2	601727	上海电气	19,463	442,588.62	1.07
3	600415	小商品城	24,820	422,188.20	1.02
4	600029	南方航空	30,375	357,513.75	0.87
5	600068	葛洲坝	21,183	305,670.69	0.74
6	600446	金证股份	1,455	302,363.55	0.73

7	600820	隧道股份	15,026	294,058.82	0.71
8	601179	中国西电	21,819	293,465.55	0.71
9	600219	南山铝业	20,589	276,716.16	0.67
10	600005	武钢股份	38,811	273,617.55	0.66

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600290	华仪电气	3,400	62,390.00	0.15
2	600575	皖江物流	9,765	40,134.15	0.10
3	603306	华懋科技	400	21,316.00	0.05

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,521.53
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	204,471.07
5	应收申购款	1,189,225.7
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	1,419,218.30

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告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十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 6 月 9 日）基金份额总额	21,314,619.49
基金合同生效日至报告期期末基金总申购份额	27,111,667.45
减：基金合同生效日至报告期期末基金总赎回份额	14,533,305.12
基金合同生效日至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	33,892,981.82

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 备查文件目录**8.1 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、中海医疗保健主题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、中海医疗保健主题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、中海医疗保健主题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

8.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

8.3 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
2015 年 7 月 20 日