

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：中邮创业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金管理人-中邮创业基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司（简称：中国银行）根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 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.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	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 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.....	43
7.8 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贵金属投资明细.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
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.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
§11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金
基金简称	中邮上证 380 指数增强
基金主代码	590007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 22 日
基金管理人	中邮创业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	37,007,093.75 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

	<p>金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%，其余基金资产可适当投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>2. 股票投资策略</p> <p>本基金被动投资组合采用完全复制的方法进行组合构建，按照成分股在上证 380 指数成分股权重分散化投资于上证 380 指数成分股；主动投资组合构建主要依据对上市公司宏观和微观的深入研究，优先在上证 380 指数成分股中对行业、个股进行适度超配或者低配；同时，在公司股票池的基础上，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选上证 380 指数成分股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。</p> <p>(1) 构建被动投资组合</p> <p>本基金采用完全复制基准指数的方法，按照个股在基准指数中的权重构建指数化股票投资组合，并根据基准指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。当遇到基准指数成分股调整或停牌、流动性不足等其他市场因素而无法根据指数权重配置某成分股时，本基金将首选与该成分股行业属性一致、相关性高的其他成分股进行替代；若成分股中缺乏符合要求的替代品种，本基金将在成分股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的替代品种。</p> <p>(2) 构建增强型投资组合</p> <p>本基金以指数化分散投资为主，基于中国证券市场作为一个新兴市场并非完全有效及指数编制本身的局限性，在严格控制跟踪误差的前提下，辅以适度的增强型主动管理；其目的有二，一是为了在跟踪目标指数的基础上适度获取超额收益；二是补偿较高的交易成本及其他费用。增强投资的方法包括：</p> <p>1) 仓位调整</p> <p>在能够明确判断市场将经历一段长期下跌过程时，基金的股票投资仓位可进行下调，股票资产最低可下调到占基金资产净值的 90%以适度规避市场系统性风险。</p> <p>2) 基本面优化</p> <p>基本面优化提高具备以下一项或多项特征股票的投资权重：</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 上市公司基本面较好(根据财务指标等判断)，具有鲜明的竞争优势，有持续增长能力。 ● 中长期估值水平明显高于目前估值水平，在同行业中，股票相对估值偏低。 ● 其他特殊个股，例如预期将纳入指数的个股。 ● 包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成
--	---

分股。

将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

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

3) 个股优选

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

3. 债券投资策略

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

4. 股票组合调整策略

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

(1) 定期调整

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

(2) 不定期调整

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

	<p>5. 跟踪误差控制策略</p> <p>本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。</p>
业绩比较基准	<p>本基金业绩比较基准为：上证 380 指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%。</p> <p>上证 380 指数是上海证券交易所和中证指数有限公司于 2010 年 11 月 29 日新推出的代表上交所中小市值成长性新兴蓝筹股指数，以反映传统蓝筹股之外的一批规模适中、成长性好、盈利能力强的上市公司股票的整体表现。该指数在确定样本空间时，除剔除上证 180 指数样本股外，还剔除了上市时间不足一个季度的股票、暂停上市的股票、经营状况异常或最近财务报告严重亏损的股票、股价波动较大市场表现明显受到操作的股票，以及成立 5 年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司，然后按照营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名，根据行业配比原则确定各二级行业内上市公司家数，选择排名前 380 名的公司作为上证 380 指数样本股。上证 380 指数以 2003 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点；指数样本每半年定期调整一次，实施时间分别为每年的 1 月和 7 月的第一个交易日。在两次定期调整之间，若上证 380 指数样本股进入上证 180 指数，该样本立即被调出上证 380 指数，并由该调出样本同行业排名最靠前的样本补足。</p> <p>随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时(如基金变更投资比例范围，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，或今后法律法规发生变化，又或市场推出代表性更强、投资者认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的指数等)，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。</p>
风险收益特征	<p>本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中邮创业基金管理有限公	中国银行股份有限公司

		司	
信息披露负责人	姓名	侯玉春	王永民
	联系电话	010-82295160-157	010-66594896
	电子邮箱	houyuc@postfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		010-58511618	95566
传真		010-82295155	010-66594942
注册地址		北京市海淀区西直门北大街60号首钢国际大厦10层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市海淀区西直门北大街60号首钢国际大厦10层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100082	100818
法定代表人		吴涛	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.postfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中邮创业基金管理有限公司	北京市海淀区西直门北大街60号首钢国际大厦10层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	19,014,460.00
本期利润	30,915,109.12
加权平均基金份额本期利润	0.8162
本期加权平均净值利润率	40.83%
本期基金份额净值增长率	62.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	25,146,814.63
期末可供分配基金份额利润	0.6795
期末基金资产净值	85,720,845.43
期末基金份额净值	2.316

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	145.00%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当前发生额）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

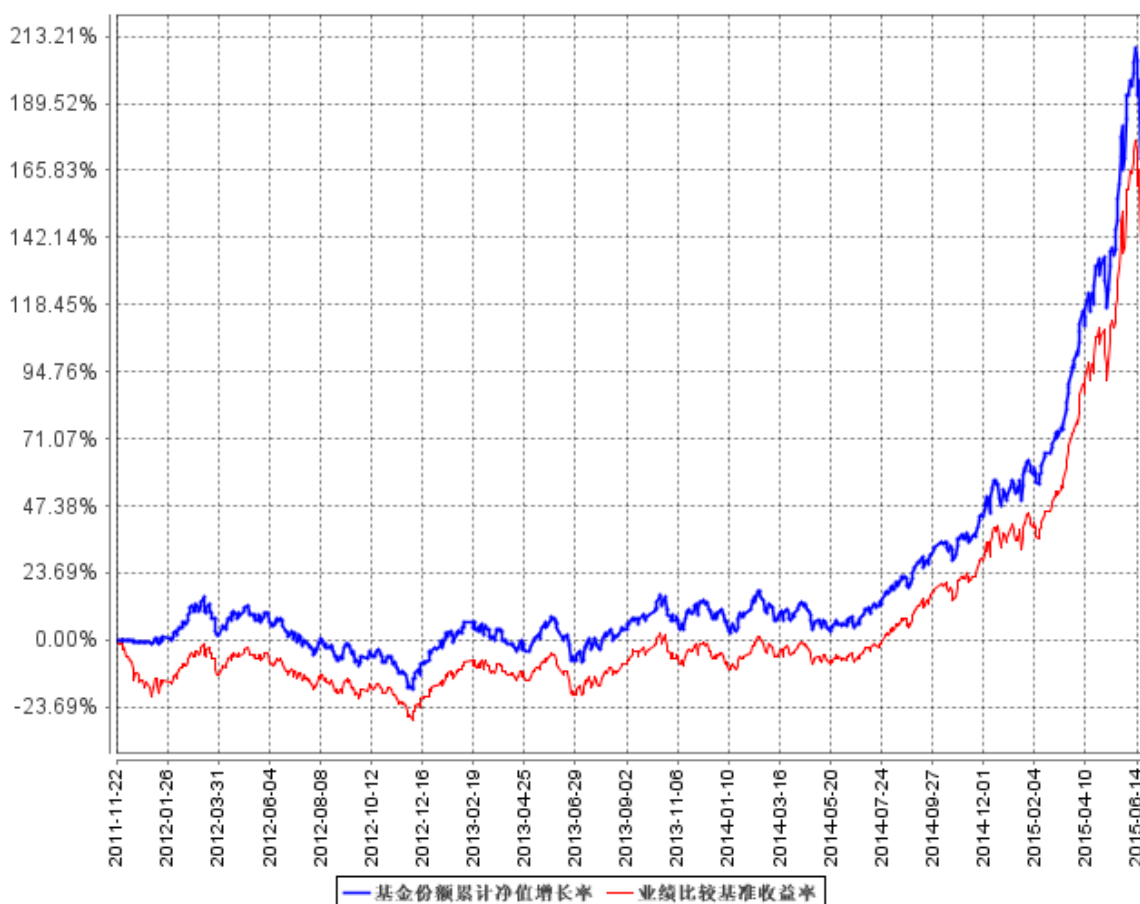
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-9.32%	3.74%	-8.64%	3.73%	-0.68%	0.01%
过去三个月	21.96%	2.79%	23.44%	2.85%	-1.48%	-0.06%
过去六个月	62.64%	2.22%	60.08%	2.27%	2.56%	-0.05%
过去一年	125.29%	1.74%	127.23%	1.78%	-1.94%	-0.04%
过去三年	139.75%	1.46%	145.07%	1.45%	-5.32%	0.01%
自基金合同生效起至今	145.00%	1.40%	117.71%	1.45%	27.29%	-0.05%

注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

上证 380 指数是上海证券交易所和中证指数有限公司于 2010 年 11 月 29 日新推出的代表上交所中小市值成长性新兴蓝筹股指数，以反映传统蓝筹股之外的一批规模适中、成长性好、盈利能力强的上市公司股票的整体表现。该指数在确定样本空间时，除剔除上证 180 指数样本股外，还剔除了上市时间不足一个季度的股票、暂停上市的股票、经营状况异常或最近财务报告严重亏损的股票、股价波动较大市场表现明显受到操作的股票，以及成立 5 年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司，然后按照营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名，根据行业配比原则确定各二级行业内上市公司家数，选择排名前 380 名的公司作为上证 380 指数样本股。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人中邮创业基金管理有限公司成立于 2006 年 5 月 18 日，旗下目前管理 20 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选股票型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业股票型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮

多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创业新优势灵活配置混合型证券投资基金。

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		
俞科进	基金经理	2015年6月3日	-	8年	中国人保寿险职员、长江证券金融工程研究员、中邮创业基金管理有限公司金融工程研究员。

注：基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的《关于基金经理注册通知》、《关于基金经理变更通知》《关于基金经理注销通知》日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

在证监会颁发《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》后，由金融工程部组织，对交易部和投资部相关人员进行培训，督促相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的顺利执行，公司与衡泰软件共同开发了公平交易系统，并按月度、季度、年度生成各只基金之间的交易价差

分析报告，逐一分析得出结论后发送给相关部门和人员。对于报告中产生的异常情况，在做出合理解释后，提请各部门相关人员引起重视，完善公司内部公平交易制度，使之更符合指导意见精神，并避免类似情况再次发生，最后妥善保存分析报告备查。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期内未出现异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年的上半年经济基本面总体继续低迷，PMI 指数持续在枯荣线 50 附近徘徊，但以新兴产业为代表的行业 PMI 显著强于主板。以互联网金融为代表的成长型新兴企业首先走出了一波持续上涨行情，之后主板以一带一路为主线再次启动了行情，带动市场持续走强并达到 5100 点的高点。在牛市预期的影响下投资者加杠杆进场提速，成也杠杆败也杠杆，市场经历暴涨后出现暴跌，特别是去杠杆造成了系统性风险扩散，前期涨幅相对较高板块在暴跌过程中跌幅居前，下跌过程中大小盘绝对跌幅没有明显差异即未见明显的风格切换，截至到二季度末小盘累计涨幅仍以明显的优势领先于大盘股。

本基金在做好常规跟踪复制之外，着重利用数量化策略进行增强投资。报告期内行业配置层面参照指数基准并结合量化模型各行业进行了一定程度的调整；选股方面，对价值、成长等风格因子根据市场环境进行调整，前期偏成长，后期价值、成长相对均衡，在全市场量化选股的基础上结合行业内选股策略进行优化选择。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金复权净值增长率 62.64%，业绩基准增长 60.08%，跑赢基准 2.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，在证金公司获得央行无限额度救市、央行出其不意迅速干预人民币汇率市场等重大事件的冲击之下，可能呈现阶段性货币宽松的局面，周期类行业基本面同比将有所改善，国企改革沿纵深方向各个维度继续展开，以互联网、环保、新能源、核电为代表的新兴行业仍在快速成长的过程中，但良莠不齐的局面将会有更多暴露，市场将会更加注重业绩的确定性，投资者将会用脚投票是真实成长还是业绩透支。随着各项政策陆续出台，行业空间巨大、个股业绩持续优良的个股的风险在二季度末得到一定程度释放，根据量化模型在控制整体风险暴露的前提下适当向重

点行业、优质个股偏离应该会带来良好汇报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金根据相关法律法规的规定及《基金合同》的约定，在报告期内共分红两次。第一次分红为 2012 年 2 月 22 日公告的对截至 2012 年 2 月 20 日可分配收益进行分配，权益登记日为 2012 年 2 月 24 日，利润分配总额为 2,095,035.17 元；第二次分红为 2012 年 3 月 21 日公告的对截至 2012 年 3 月 19 日可分配收益进行分配，权益登记日为 2012 年 3 月 23 日，利润分配总额为 3,087,377.52 元；本基金将继续按照相关法律法规的规定、《基金合同》的约定及基金实际运作情况进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中邮上证 380 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,971,177.63	4,238,136.13
结算备付金		112,026.26	87,194.99
存出保证金		8,999.88	3,661.53
交易性金融资产	6.4.7.2	79,834,655.00	54,308,812.68
其中：股票投资		79,834,655.00	54,308,812.68
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		5,231,165.99	-
应收利息	6.4.7.5	1,796.49	922.44
应收股利		-	-
应收申购款		1,019,783.45	172,354.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		93,179,604.70	58,811,081.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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		-	123,789.48
应付赎回款		6,948,709.45	429,094.35
应付管理人报酬		87,026.94	44,736.70

应付托管费		17,405.41	8,947.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	70,791.10	48,476.62
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	334,826.37	252,927.65
负债合计		7,458,759.27	907,972.14
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	37,007,093.75	40,670,312.59
未分配利润	6.4.7.10	48,713,751.68	17,232,797.23
所有者权益合计		85,720,845.43	57,903,109.82
负债和所有者权益总计		93,179,604.70	58,811,081.96

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.316 元，基金份额总额 37,007,093.75 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		31,774,891.54	298,065.25
1.利息收入		21,240.42	8,247.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,240.42	8,247.90
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）		19,708,002.07	740,028.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,311,574.89	431,212.97
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	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	396,427.18	308,815.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,900,649.12	-458,370.14
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	144,999.93	8,159.00

列)			
减：二、费用		859,782.42	597,945.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	371,639.93	146,210.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	74,328.02	29,242.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	210,209.27	98,515.82
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	203,605.20	323,977.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,915,109.12	-299,880.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,915,109.12	-299,880.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	40,670,312.59	17,232,797.23	57,903,109.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,915,109.12	30,915,109.12
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）	-3,663,218.84	565,845.33	-3,097,373.51
其中：1.基金申购款	57,648,616.41	67,196,776.22	124,845,392.63
2.基金赎回款	-61,311,835.25	-66,630,930.89	-127,942,766.14
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）	37,007,093.75	48,713,751.68	85,720,845.43
项目	上年度可比期间 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）	28,553,853.33	1,255,696.90	29,809,550.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-299,880.34	-299,880.34
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）	1,671,441.70	-114,928.34	1,556,513.36
其中：1.基金申购款	9,956,541.39	293,002.97	10,249,544.36
2.基金赎回款	-8,285,099.69	-407,931.31	-8,693,031.00
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）	30,225,295.03	840,888.22	31,066,183.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周克

基金管理人负责人

周克

主管会计工作负责人

吕伟卓

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股

票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为：股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致。

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

本报告期内本基金无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

2014 年 11 月 13 日，中国证券投资基金业协会发布了《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“新估值标准”），及《关于 2015 年 1 季度固定收益品种估值处理标准的通知》，中邮创业基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定，自 2015 年 3 月 30 日起，本公司对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《财政部 国家税务总局 证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
2. 自 2013 年 1 月 1 日起，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；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。
3. 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
4. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	6,971,177.63
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	6,971,177.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	59,514,386.12	79,834,655.00	20,320,268.88
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	59,514,386.12	79,834,655.00	20,320,268.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	1,746.74
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	45.01
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.14
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.60
合计	1,796.49

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	70,791.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	70,791.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24,151.00
预提费用	249,258.34
应付指数使用费	50,000.00
其他	11,417.03
合计	334,826.37

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,670,312.59	40,670,312.59
本期申购	57,648,616.41	57,648,616.41
本期赎回(以“-”号填列)	-61,311,835.25	-61,311,835.25
- 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	37,007,093.75	37,007,093.75

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	7,032,794.46	10,200,002.77	17,232,797.23
本期利润	19,014,460.00	11,900,649.12	30,915,109.12
本期基金份额交易产生的变动数	-900,439.83	1,466,285.16	565,845.33

其中：基金申购款	25,727,054.03	41,469,722.19	67,196,776.22
基金赎回款	-26,627,493.86	-40,003,437.03	-66,630,930.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,146,814.63	23,566,937.05	48,713,751.68

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	20,183.78
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	918.03
其他	138.61
合计	21,240.42

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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	70,963,047.17
减：卖出股票成本总额	51,651,472.28
买卖股票差价收入	19,311,574.89

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期本基金无衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	396,427.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	396,427.18

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	11,900,649.12
——股票投资	11,900,649.12
——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	11,900,649.12

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	144,999.93
合计	144,999.93

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	210,209.27
银行间市场交易费用	-
合计	210,209.27

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	49,586.76
银行费用	4,746.86
债券帐户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
其他	600.00
合计	203,605.20

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

本报告期内，本基金不存在或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生通过关联方交易单元进行交易的情况。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	371,639.93	146,210.40
其中：支付销售机构的客户维护费	173,419.03	65,466.17

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	74,328.02	29,242.07

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未与关联方发生银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2011 年 11 月 22 日）持有的基金份额	4,999,400.00	4,999,400.00
期初持有的基金份额	4,999,400.00	4,999,400.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,999,400.00	4,999,400.00
期末持有的基金份额	13.5000%	16.5400%

占基金总份额比例		
----------	--	--

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	6,971,177.63	20,183.78	2,108,357.10	7,671.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

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

本报告期内本基金未发生利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购/增发而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600872	中炬高新	2015 年 5 月 6 日	重大事项	21.62	-	-	33,000	372,550.00	713,460.00	-
601718	际华集团	2015 年 6 月 17 日	重大事项	15.12	2015 年 7 月 2 日	13.56	42,100	453,794.00	636,552.00	-
601311	骆驼股份	2015 年 6 月 18 日	重大事项	28.20	2015 年 7 月 15 日	25.38	20,000	357,613.00	564,000.00	-

600153	建发股份	2015年6月29日	重大事项	17.51	-	-	30,000	249,845.23	525,300.00	-
600277	亿利能源	2015年6月1日	重大事项	14.62	-	-	35,000	304,669.00	511,700.00	-
600978	宜华木业	2015年6月17日	重大事项	22.44	-	-	20,000	100,215.13	448,800.00	-
600395	盘江股份	2015年6月8日	重大事项	15.71	2015年8月19日	14.00	28,000	249,068.00	439,880.00	-
600335	国机汽车	2015年6月12日	重大事项	37.93	2015年7月21日	33.94	10,000	172,834.67	379,300.00	-
601789	宁波建工	2015年6月12日	重大事项	18.80	2015年8月13日	16.81	20,000	190,814.60	376,000.00	-
600167	联美控股	2015年5月26日	重大事项	25.76	-	-	14,000	156,100.00	360,640.00	-
600967	北方创业	2015年4月10日	重大事项	17.12	-	-	18,000	256,680.00	308,160.00	-
600312	平高电气	2015年6月19日	重大事项	22.58	-	-	13,000	175,500.00	293,540.00	-
600587	新华医疗	2015年5月21日	重大事项	58.63	2015年7月6日	47.42	5,000	115,579.20	293,150.00	-
600561	江西长运	2015年4月30日	重大事项	19.48	-	-	15,000	277,499.00	292,200.00	-
601877	正泰电器	2015年5月15日	重大事项	30.62	-	-	9,100	98,172.40	278,642.00	-
000732	泰禾集团	2015年6月24日	重大事项	34.20	2015年7月2日	30.58	8,000	287,757.00	273,600.00	-
601633	长城汽车	2015年6月18日	重大事项	42.76	2015年7月13日	38.50	6,000	331,139.49	256,560.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

(1) 风险管理政策

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

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

(2) 风险管理组织架构

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险指基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，而且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的困难而导致损失的风险。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分股票均是交易相对活跃的大盘股，变现能力较强。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,971,177.63	-	-	-	6,971,177.63
结算备付金	112,026.26	-	-	-	112,026.26
存出保证金	8,999.88	-	-	-	8,999.88
交易性金融资产	-	-	-	79,834,655.00	79,834,655.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,231,165.99	5,231,165.99
应收利息	-	-	-	1,796.49	1,796.49
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,019,783.45	1,019,783.45
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,092,203.77	-	-	86,087,400.93	93,179,604.70
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,948,709.45	6,948,709.45
应付管理人报酬	-	-	-	87,026.94	87,026.94
应付托管费	-	-	-	17,405.41	17,405.41
应付交易费用	-	-	-	70,791.10	70,791.10
应交税费	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	334,826.37	334,826.37
负债总计	-	-	-	7,458,759.27	7,458,759.27
利率敏感度缺口	7,092,203.77	-	-	78,628,641.66	85,720,845.43
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,238,136.13	-	-	-	4,238,136.13
结算备付金	87,194.99	-	-	-	87,194.99
存出保证金	3,661.53	-	-	-	3,661.53
交易性金融资产	-	-	-	54,308,812.68	54,308,812.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	922.44	922.44
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	172,354.19	172,354.19
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,328,992.65	-	-	54,482,089.31	58,811,081.96
负债					
应付证券清算款	-	-	-	123,789.48	123,789.48
应付赎回款	-	-	-	429,094.35	429,094.35
应付管理人报酬	-	-	-	44,736.70	44,736.70
应付托管费	-	-	-	8,947.34	8,947.34
应付交易费用	-	-	-	48,476.62	48,476.62
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	252,927.65	252,927.65
负债总计	-	-	-	907,972.14	907,972.14
利率敏感度缺口	4,328,992.65	-	-	53,574,117.17	57,903,109.82

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 其他价格风险

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金资产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(包括中小板和创业板，及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

于 2015 年 06 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	79,834,655.00	93.13	54,308,812.68	93.79
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	79,834,655.00	93.13	54,308,812.68	93.79

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1%		
	2. 固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	768,776.26	526,322.80

2. 基金净资产变动	-768,776.26	-526,322.80
------------	-------------	-------------

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，无风险收益率取 2015 年 6 月 30 日十年期国债收益率 3.60%，利用 2015 年 1 月 5 日以来基金日收益率与基金基准日收益率计算得到基金的 Beta 系数为 0.96。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	79,834,655.00	85.68
	其中：股票	79,834,655.00	85.68
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	7,083,203.89	7.60
7	其他各项资产	6,261,745.81	6.72
8	合计	93,179,604.70	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,842,375.00	3.32
C	制造业	39,458,987.00	46.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,601,568.00	6.53

E	建筑业	3,369,203.00	3.93
F	批发和零售业	8,087,524.00	9.43
G	交通运输、仓储和邮政业	6,831,920.00	7.97
H	住宿和餐饮业	238,400.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,203,740.00	2.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,953,320.00	2.28
L	租赁和商务服务业	291,456.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	278,460.00	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	600,000.00	0.70
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	617,350.00	0.72
S	综合	1,368,500.00	1.60
	合计	73,742,803.00	86.03

注：由于四舍五入原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	3,596,352.00	4.20
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	525,300.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	292,200.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	546,576.00	0.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	273,600.00	0.32
L	租赁和商务服务业	615,784.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	242,040.00	0.28
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	6,091,852.00	7.11

注：由于四舍五入原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600694	大商股份	15,000	829,200.00	0.97
2	600498	烽火通信	30,200	799,092.00	0.93
3	600835	上海机电	22,000	724,680.00	0.85
4	600872	中炬高新	33,000	713,460.00	0.83
5	601918	国投新集	43,500	669,465.00	0.78
6	600398	海澜之家	36,900	668,997.00	0.78
7	600426	华鲁恒升	35,000	649,600.00	0.76
8	601718	际华集团	42,100	636,552.00	0.74
9	600081	东风科技	30,000	636,300.00	0.74
10	601258	庞大集团	115,600	631,176.00	0.74
11	600601	方正科技	65,000	591,500.00	0.69
12	600612	老凤祥	11,000	588,940.00	0.69
13	600058	五矿发展	18,000	588,060.00	0.69
14	600761	安徽合力	35,000	585,550.00	0.68
15	600063	皖维高新	61,500	574,410.00	0.67
16	600143	金发科技	47,700	568,584.00	0.66
17	600409	三友化工	50,000	565,000.00	0.66
18	601311	骆驼股份	20,000	564,000.00	0.66
19	600783	鲁信创投	15,000	562,200.00	0.66
20	600195	中牧股份	20,000	562,000.00	0.66
21	600460	士兰微	60,000	553,800.00	0.65
22	600642	申能股份	54,800	548,548.00	0.64
23	600846	同济科技	43,700	541,443.00	0.63
24	600580	卧龙电气	30,000	534,900.00	0.62
25	600487	亨通光电	14,500	533,600.00	0.62
26	600106	重庆路桥	45,000	522,900.00	0.61
27	600201	金宇集团	7,200	512,064.00	0.60
28	600277	亿利能源	35,000	511,700.00	0.60
29	600396	金山股份	40,000	509,200.00	0.59

30	600446	金证股份	4,100	506,186.00	0.59
31	600391	成发科技	8,500	497,590.00	0.58
32	600012	皖通高速	38,000	493,240.00	0.58
33	601333	广深铁路	60,000	493,200.00	0.58
34	603005	晶方科技	10,000	489,100.00	0.57
35	600056	中国医药	20,000	486,800.00	0.57
36	600020	中原高速	65,000	482,300.00	0.56
37	600682	南京新百	12,400	465,372.00	0.54
38	600697	欧亚集团	15,000	464,700.00	0.54
39	600502	安徽水利	23,000	459,770.00	0.54
40	601608	中信重工	27,800	453,140.00	0.53
41	600298	安琪酵母	13,000	452,140.00	0.53
42	600978	宜华木业	20,000	448,800.00	0.52
43	601058	赛轮金宇	40,000	446,000.00	0.52
44	600566	济川药业	15,000	442,200.00	0.52
45	600395	盘江股份	28,000	439,880.00	0.51
46	600064	南京高科	22,500	438,750.00	0.51
47	603308	应流股份	15,000	438,600.00	0.51
48	600420	现代制药	10,000	435,000.00	0.51
49	600327	大东方	35,000	434,700.00	0.51
50	600655	豫园商城	27,000	433,350.00	0.51
51	600563	法拉电子	14,000	433,300.00	0.51
52	600742	一汽富维	14,000	426,720.00	0.50
53	600546	山煤国际	50,000	425,500.00	0.50
54	600021	上海电力	20,000	422,000.00	0.49
55	601012	隆基股份	26,800	421,832.00	0.49
56	600098	广州发展	30,000	420,900.00	0.49
57	600172	黄河旋风	20,000	416,600.00	0.49
58	600161	天坛生物	11,000	414,260.00	0.48
59	600571	信雅达	3,900	412,815.00	0.48
60	600525	长园集团	20,000	411,400.00	0.48
61	600343	航天动力	12,000	407,760.00	0.48
62	600594	益佰制药	7,000	406,910.00	0.47
63	600351	亚宝药业	30,000	406,200.00	0.47
64	600797	浙大网新	21,500	406,135.00	0.47
65	600176	中国巨石	15,000	405,900.00	0.47
66	600017	日照港	50,000	405,500.00	0.47
67	600820	隧道股份	30,000	403,200.00	0.47
68	600511	国药股份	8,000	403,120.00	0.47

69	600963	岳阳林纸	40,000	400,400.00	0.47
70	601233	桐昆股份	20,000	399,200.00	0.47
71	600122	宏图高科	24,000	394,080.00	0.46
72	601107	四川成渝	57,000	392,730.00	0.46
73	600169	太原重工	44,000	391,600.00	0.46
74	600522	中天科技	17,200	390,956.00	0.46
75	600236	桂冠电力	35,000	390,600.00	0.46
76	600850	华东电脑	7,000	387,730.00	0.45
77	600567	山鹰纸业	65,000	386,100.00	0.45
78	600350	山东高速	45,000	385,200.00	0.45
79	601799	星宇股份	10,000	382,400.00	0.45
80	600881	亚泰集团	30,000	381,300.00	0.44
81	600335	国机汽车	10,000	379,300.00	0.44
82	601139	深圳燃气	36,000	378,000.00	0.44
83	603766	隆鑫通用	15,000	376,500.00	0.44
84	601789	宁波建工	20,000	376,000.00	0.44
85	600038	中直股份	6,000	371,700.00	0.43
86	600239	云南城投	39,000	370,500.00	0.43
87	601000	唐山港	27,000	369,630.00	0.43
88	600863	内蒙华电	45,000	368,100.00	0.43
89	600987	航民股份	27,000	366,120.00	0.43
90	601126	四方股份	12,000	366,000.00	0.43
91	600507	方大特钢	40,000	361,600.00	0.42
92	600584	长电科技	18,900	361,179.00	0.42
93	600167	联美控股	14,000	360,640.00	0.42
94	600486	扬农化工	10,000	359,800.00	0.42
95	600114	东睦股份	20,000	359,200.00	0.42
96	600704	物产中大	15,000	358,200.00	0.42
97	600197	伊力特	23,000	357,650.00	0.42
98	600578	京能电力	40,000	357,200.00	0.42
99	600845	宝信软件	5,000	356,050.00	0.42
100	600054	黄山旅游	16,000	355,680.00	0.41
101	600125	铁龙物流	23,000	354,890.00	0.41
102	601199	江南水务	10,000	352,600.00	0.41
103	601222	林洋电子	10,000	350,900.00	0.41
104	600439	瑞贝卡	40,000	348,800.00	0.41
105	600684	珠江实业	24,000	345,120.00	0.40
106	600572	康恩贝	15,000	340,500.00	0.40
107	600120	浙江东方	10,000	338,900.00	0.40

108	600004	白云机场	20,000	338,000.00	0.39
109	600481	双良节能	14,000	335,300.00	0.39
110	600559	老白干酒	4,000	334,080.00	0.39
111	600824	益民集团	33,600	333,648.00	0.39
112	600436	片仔癀	5,000	333,350.00	0.39
113	600611	大众交通	20,000	333,000.00	0.39
114	600388	龙净环保	17,500	332,325.00	0.39
115	600657	信达地产	40,000	329,600.00	0.38
116	600260	凯乐科技	20,000	329,000.00	0.38
117	600551	时代出版	15,000	325,650.00	0.38
118	600428	中远航运	20,000	323,800.00	0.38
119	601158	重庆水务	30,000	322,200.00	0.38
120	600496	精工钢构	44,000	321,640.00	0.38
121	603993	洛阳钼业	26,000	321,360.00	0.37
122	600784	鲁银投资	20,000	321,000.00	0.37
123	600869	智慧能源	10,000	320,600.00	0.37
124	600666	西南药业	7,500	319,125.00	0.37
125	600983	惠而浦	20,000	317,800.00	0.37
126	601777	力帆股份	20,000	315,800.00	0.37
127	601678	滨化股份	35,000	313,950.00	0.37
128	600650	锦江投资	15,000	311,850.00	0.36
129	600967	北方创业	18,000	308,160.00	0.36
130	601179	中国西电	30,000	307,500.00	0.36
131	600269	赣粤高速	45,000	306,000.00	0.36
132	600307	酒钢宏兴	45,000	304,200.00	0.35
133	601886	江河创建	20,000	297,600.00	0.35
134	600422	昆药集团	8,000	295,440.00	0.34
135	600312	平高电气	13,000	293,540.00	0.34
136	600587	新华医疗	5,000	293,150.00	0.34
137	600033	福建高速	50,000	293,000.00	0.34
138	601801	皖新传媒	10,000	291,700.00	0.34
139	600138	中青旅	13,800	291,456.00	0.34
140	600780	通宝能源	30,000	291,300.00	0.34
141	600377	宁沪高速	30,000	290,400.00	0.34
142	600990	四创电子	3,000	288,960.00	0.34
143	600160	巨化股份	26,000	286,520.00	0.33
144	600528	中铁二局	17,000	285,090.00	0.33
145	600517	置信电气	18,000	281,700.00	0.33
146	600509	天富能源	20,000	281,400.00	0.33

147	601369	陕鼓动力	24,000	281,040.00	0.33
148	601877	正泰电器	9,100	278,642.00	0.33
149	603126	中材节能	18,000	278,460.00	0.32
150	600557	康缘药业	10,000	278,300.00	0.32
151	600280	中央商场	20,000	277,400.00	0.32
152	601001	大同煤业	30,000	277,200.00	0.32
153	600251	冠农股份	20,000	276,600.00	0.32
154	601231	环旭电子	16,000	272,160.00	0.32
155	600532	宏达矿业	15,000	266,100.00	0.31
156	600216	浙江医药	20,000	265,600.00	0.31
157	600562	国睿科技	4,500	260,820.00	0.30
158	600062	华润双鹤	10,000	260,400.00	0.30
159	603369	今世缘	7,000	259,630.00	0.30
160	600582	天地科技	15,000	256,350.00	0.30
161	601880	大连港	35,000	252,000.00	0.29
162	600859	王府井	8,000	252,000.00	0.29
163	600329	中新药业	10,000	251,900.00	0.29
164	600403	大有能源	28,000	250,320.00	0.29
165	600168	武汉控股	18,000	248,580.00	0.29
166	600970	中材国际	17,000	248,540.00	0.29
167	600897	厦门空港	8,000	244,880.00	0.29
168	600292	中电远达	8,000	244,320.00	0.29
169	600261	阳光照明	30,000	243,900.00	0.28
170	600170	上海建工	26,000	243,880.00	0.28
171	600743	华远地产	30,000	240,900.00	0.28
172	600548	深高速	28,000	239,400.00	0.28
173	600754	锦江股份	8,000	238,400.00	0.28
174	600459	贵研铂业	10,000	232,900.00	0.27
175	600884	杉杉股份	8,000	228,800.00	0.27
176	600039	四川路桥	35,000	228,550.00	0.27
177	600007	中国国贸	15,000	228,450.00	0.27
178	600180	瑞茂通	7,900	226,414.00	0.26
179	600596	新安股份	16,000	223,040.00	0.26
180	600811	东方集团	18,000	221,940.00	0.26
181	600976	健民集团	6,500	221,260.00	0.26
182	601168	西部矿业	20,000	218,400.00	0.25
183	600802	福建水泥	20,000	217,600.00	0.25
184	600284	浦东建设	13,000	212,030.00	0.25
185	600720	祁连山	20,000	211,800.00	0.25

186	600386	北巴传媒	13,000	211,380.00	0.25
187	600399	抚顺特钢	17,500	207,200.00	0.24
188	600188	兖州煤业	15,000	206,250.00	0.24
189	603699	纽威股份	8,000	199,920.00	0.23
190	600755	厦门国贸	17,600	197,824.00	0.23
191	600397	安源煤业	20,000	193,400.00	0.23
192	601002	晋亿实业	12,200	193,004.00	0.23
193	600526	菲达环保	9,000	187,650.00	0.22
194	603328	依顿电子	6,000	183,960.00	0.21
195	600116	三峡水利	10,000	177,500.00	0.21
196	600323	瀚蓝环境	10,000	172,800.00	0.20
197	601208	东材科技	15,000	171,300.00	0.20
198	600458	时代新材	6,500	163,150.00	0.19
199	600805	悦达投资	10,000	156,300.00	0.18
200	600536	中国软件	3,800	134,824.00	0.16
201	601717	郑煤机	12,000	130,920.00	0.15
202	600183	生益科技	2,500	25,475.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600415	小商品城	40,300	615,784.00	0.72
2	600153	建发股份	30,000	525,300.00	0.61
3	002241	歌尔声学	13,000	466,700.00	0.54
4	603366	日出东方	30,000	441,000.00	0.51
5	600037	歌华有线	13,000	409,500.00	0.48
6	002121	科陆电子	12,000	360,360.00	0.42
7	600873	梅花生物	30,000	313,200.00	0.37
8	600561	江西长运	15,000	292,200.00	0.34
9	002407	多氟多	10,000	285,100.00	0.33
10	000732	泰禾集团	8,000	273,600.00	0.32
11	002297	博云新材	15,000	272,250.00	0.32
12	601633	长城汽车	6,000	256,560.00	0.30
13	002701	奥瑞金	9,600	249,888.00	0.29
14	600096	云天化	16,000	247,040.00	0.29
15	603099	长白山	12,000	242,040.00	0.28
16	600660	福耀玻璃	15,000	214,200.00	0.25

17	603006	黎明股份	4,500	200,340.00	0.23
18	300159	新研股份	7,800	148,200.00	0.17
19	002100	天康生物	6,400	74,944.00	0.09
20	300295	三六五网	600	69,234.00	0.08
21	300075	数字政通	1,800	67,842.00	0.08
22	300236	上海新阳	2,100	66,570.00	0.08

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	601258	庞大集团	1,410,326.00	2.44
2	600446	金证股份	1,178,645.00	2.04
3	601106	中国一重	921,922.00	1.59
4	600021	上海电力	871,350.00	1.50
5	002086	东方海洋	840,303.00	1.45
6	600391	成发科技	802,455.00	1.39
7	603005	晶方科技	767,564.00	1.33
8	000651	格力电器	732,252.00	1.26
9	600682	南京新百	718,530.00	1.24
10	600063	皖维高新	717,090.00	1.24
11	600642	申能股份	711,737.00	1.23
12	600571	信雅达	710,857.80	1.23
13	300353	东土科技	699,877.00	1.21
14	600846	同济科技	674,728.00	1.17
15	601608	中信重工	665,605.00	1.15
16	600415	小商品城	646,809.00	1.12
17	600482	风帆股份	627,350.00	1.08
18	600601	方正科技	627,250.00	1.08
19	601633	长城汽车	571,139.49	0.99
20	603099	长白山	567,721.00	0.98

注：买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	600571	信雅达	1,216,737.00	2.10
2	002086	东方海洋	1,121,337.00	1.94
3	601258	庞大集团	1,022,408.00	1.77
4	300353	东土科技	1,005,702.22	1.74
5	600686	金龙汽车	965,221.00	1.67
6	601106	中国一重	959,242.00	1.66
7	000651	格力电器	840,733.85	1.45
8	600391	成发科技	790,650.00	1.37
9	600068	葛洲坝	729,700.00	1.26
10	600688	上海石化	728,518.06	1.26
11	600482	风帆股份	713,514.00	1.23
12	600867	通化东宝	697,293.00	1.20
13	300101	振芯科技	684,844.00	1.18
14	000758	中色股份	673,819.00	1.16
15	600021	上海电力	671,550.00	1.16
16	600704	物产中大	669,566.00	1.16
17	600446	金证股份	657,839.50	1.14
18	601012	隆基股份	639,120.00	1.10
19	600387	海越股份	631,565.00	1.09
20	002477	雏鹰农牧	591,711.00	1.02

注：卖出金额均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	65,276,665.48
卖出股票收入（成交）总额	70,963,047.17

注：买入股票成本及卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

7.12.3 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	8,999.88
2	应收证券清算款	5,231,165.99
3	应收股利	-
4	应收利息	1,796.49
5	应收申购款	1,019,783.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,261,745.81

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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

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	600872	中炬高新	713,460.00	0.83	重大事项
2	601718	际华集团	636,552.00	0.74	重大事项

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

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	600153	建发股份	525,300.00	0.61	重大事项

§ 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

6,193	5,975.63	4,999,400.00	13.51%	32,007,693.75	86.49%
-------	----------	--------------	--------	---------------	--------

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	0.00	0.0000%

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、基金投资和相关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

注：本公司从业人员持有本基金份额总量的数量区间为 0-50 万份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 11 月 22 日）基金份额总额	456,870,635.87
本报告期期初基金份额总额	40,670,312.59
本报告期基金总申购份额	57,648,616.41
减：本报告期基金总赎回份额	61,311,835.25
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	37,007,093.75

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经本公司总经理办公会审议通过，2015 年 2 月 13 日，聘任刘涛同志担任中邮核心优选股票型证券投资基金基金经理；2015 年 3 月 6 日，解聘陈刚同志担任中邮核心优选股票型证券投资基金基金经理；2015 年 3 月 13 日，聘任陈梁同志担任中邮核心主题股票型证券投资基金基金经理，

同时解聘刘霄汉同志担任该基金基金经理；2015 年 3 月 18 日，聘任张腾同志担任中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015 年 3 月 27 日，聘任卢章玥同志担任中邮货币市场基金基金经理；2015 年 4 月 17 日，聘任许忠海同志担任中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理；经本公司董事会审议通过，自 2015 年 6 月 3 日起，王金晖同志离任本公司副总经理；经本公司总经理办公会审议通过，2015 年 6 月 3 日，聘任俞科进同志担任中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金经理；2015 年 6 月 8 日，解聘方何同志担任中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015 年 6 月 15 日，解聘韩硕同志担任中邮货币市场基金基金经理；2015 年 6 月 19 日，聘任杨欢同志担任中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	110,935,682.68	81.43%	100,995.83	81.43%	-

齐鲁证券	1	25,304,029.97	18.57%	23,036.91	18.57%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

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

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

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2014 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 1 月 5 日
2	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 1 月 20 日
3	关于中邮创业基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定投及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 2 月 27 日
4	中邮创业基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 3 月 4 日
5	关于中邮创业基金管理有限公司旗下部分基金参加齐鲁证券有限公司网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 3 月 14 日
6	关于中邮基金官方微信平台上线“中邮上证 380 指数增强型证券投资基金”及申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 3 月 24 日
7	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2014 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2015 年 3 月 28 日

		券日报	
8	中邮创业基金管理有限公司旗下部分基金参加工商银行个人电子银行申购基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 3 月 31 日
9	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 4 月 22 日
10	关于中邮创业基金管理有限公司旗下部分基金参加农业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、证券日报	2015 年 5 月 29 日
11	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 6 月 4 日
12	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 6 月 9 日
13	关于中邮创业基金管理有限公司旗下部分基金参加光大证券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、证券日报	2015 年 6 月 13 日
14	关于中邮创业基金管理有限公司旗下部分基金参加交通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、证券日报	2015 年 6 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登陆基金管理人网站查阅。

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中邮创业基金管理有限公司。

客户服务中心电话：010-58511618 400-880-1618

基金管理人网址：www.postfund.com.cn

中邮创业基金管理有限公司

2015年8月26日