

中海医疗保健主题股票型证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	7
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、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现（转型前）	10
3.2 基金净值表现（转型后）	12
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
4.9 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	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	21
§6 审计报告（转型前）	21
6.1 审计报告基本信息	21
6.2 审计报告的基本内容	21
§6 审计报告（转型后）	22
6.1 审计报告基本信息	22
6.2 审计报告的基本内容	22
§7 年度财务报表(转型前)	23
7.1 资产负债表(转型前)	23
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	27
§7 年度财务报表(转型后)	50

7.1 资产负债表（转型后）	50
7.2 利润表	52
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	52
7.4 报表附注	53
§8 投资组合报告(转型前)	74
8.1 期末基金资产组合情况	74
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	74
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	76
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	86
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	87
8.6 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	87
8.7 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	88
8.8 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	88
8.9 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	88
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	88
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	88
8.12 投资组合报告附注	88
§8 投资组合报告(转型后)	89
8.1 期末基金资产组合情况	89
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	90
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)	90
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	91
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	97
8.6 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	97
8.7 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	97
8.8 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	97
8.9 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	97
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	97
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	98
8.12 投资组合报告附注	98
§9 基金份额持有人信息(转型前)	99
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	99
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	99
9.3 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	99
§9 基金份额持有人信息(转型后)	99
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	99
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	99
9.3 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	100
§10 开放式基金份额变动	100
§11 重大事件揭示	100
11.1 基金份额持有人大会决议	100
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	100
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	101
11.4 基金投资策略的改变	101
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	101

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	101
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	101
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	104
11.8 其他重大事件（转型后）	106
11.8 其他重大事件（转型前）	114
§12 备查文件目录.....	117
12.1 备查文件目录.....	117
12.2 存放地点.....	118
12.3 查阅方式.....	118

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

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
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	21,314,619.49 份
基金合同存续期（若有）	不定期

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	中海医疗保健主题股票型证券投资基金
基金简称	中海医疗保健主题股票
基金主代码	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
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	47,376,235.33 份
基金合同存续期（若有）	不定期

2.2 基金产品说明（转型前）

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（若有）	上证 380 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征（若有）	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。

2.2 基金产品说明（转型后）

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（若有）	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（若有）	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。

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

信息披露负责人	姓名	王莉	公司
	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中海基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日		2014 年	2013 年
	转型前	转型后		
本期已实现收益	16,745,283.09	-4,325,097.46	3,389,565.18	2,208,980.01
本期利润	26,803,862.81	-14,102,285.87	6,543,506.17	9,654,414.08
加权平均基金份额本期利润	0.2356	-0.3400	0.3679	0.1557
本期加权平均净值利润率	16.25%	-24.83%	33.62%	16.26%

本期基金份额净值增长率	88.57%	-22.08%	40.94%	12.05%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末		2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	9,928,956.60	24,030,808.07	156,034.48	-8,934,379.15
期末可供分配基金份额利润	0.4658	0.5072	0.0097	-0.3988
期末基金资产净值	41,225,823.70	71,407,043.40	22,765,566.66	22,491,146.34
期末基金份额净值	1.934	1.507	1.415	1.004
3.1.3 累计期末指标	2015 年末		2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	159.10%	-22.08%	41.50%	0.40%

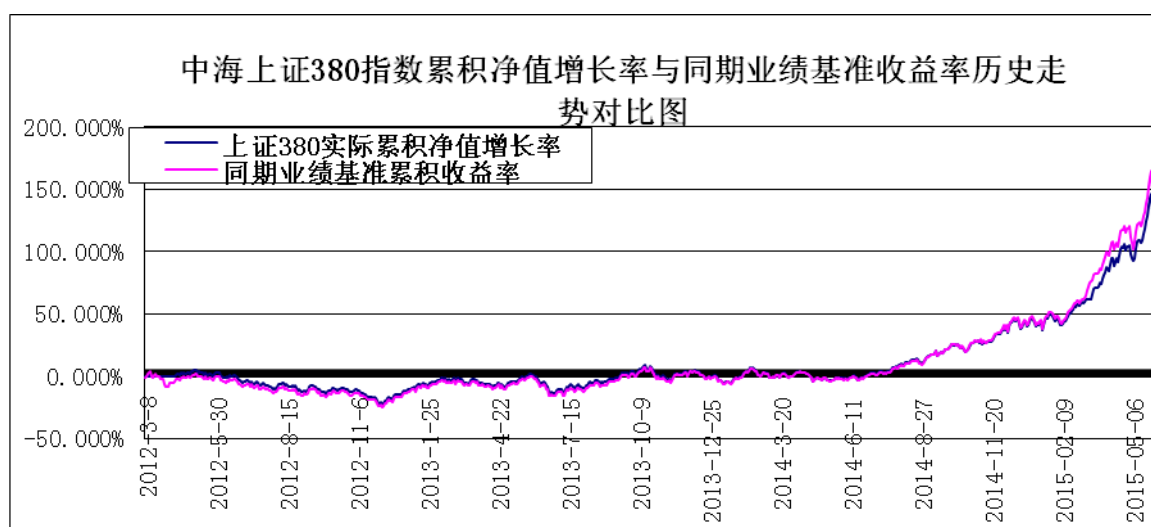
3.2 基金净值表现（转型前）

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	转型前					
	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	65.56%	1.88%	74.66%	1.96%	-9.10%	-0.08%
过去六个月	88.57%	1.80%	100.88%	1.85%	-12.31%	-0.05%
过去一年	164.38%	1.44%	183.26%	1.47%	-18.88%	-0.03%
过去三年	162.77%	1.31%	189.62%	1.34%	-26.85%	-0.03%
自基金合同生效起至今	159.10%	1.28%	178.04%	1.34%	-18.94%	-0.06%

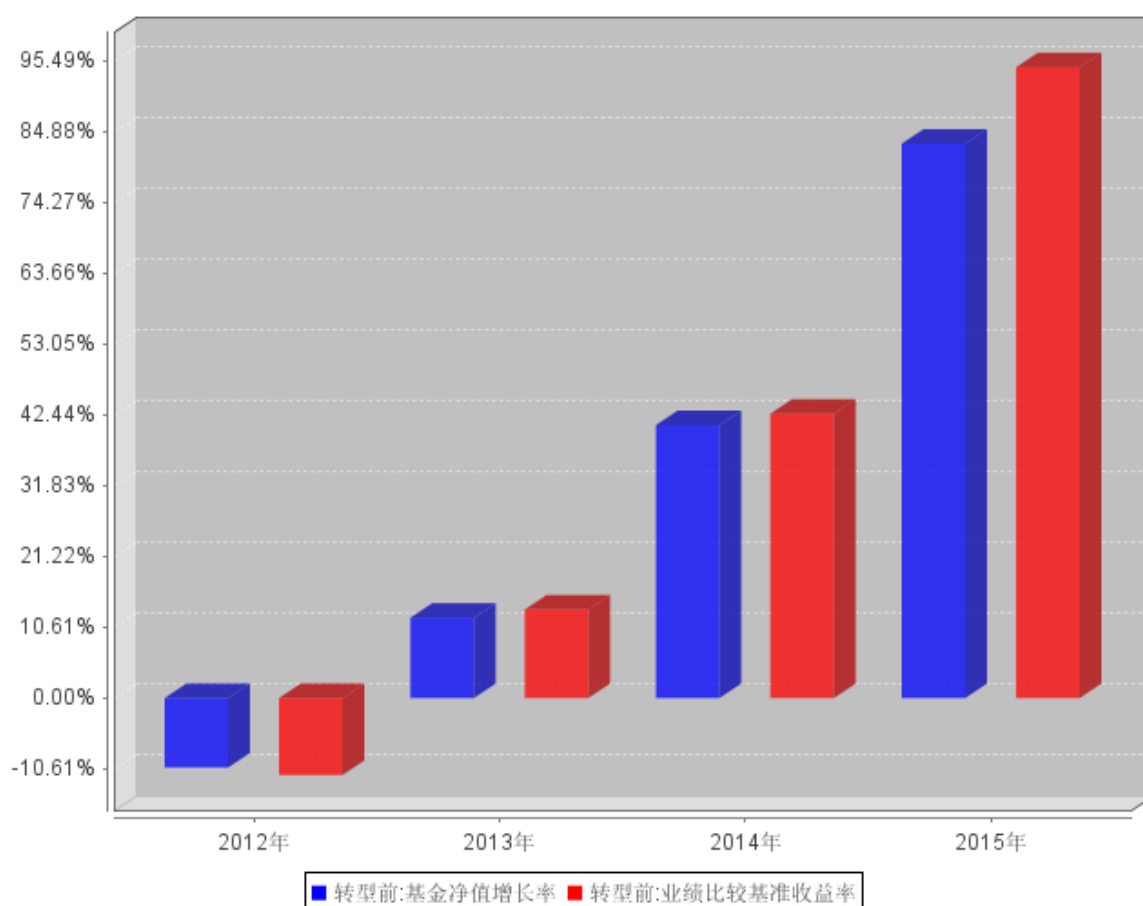
注：1，“自基金合同生效起至今”指 2012 年 3 月 7 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 8 日。

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:上图中 2015 年度是指 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日,相关数据未按自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现（转型后）

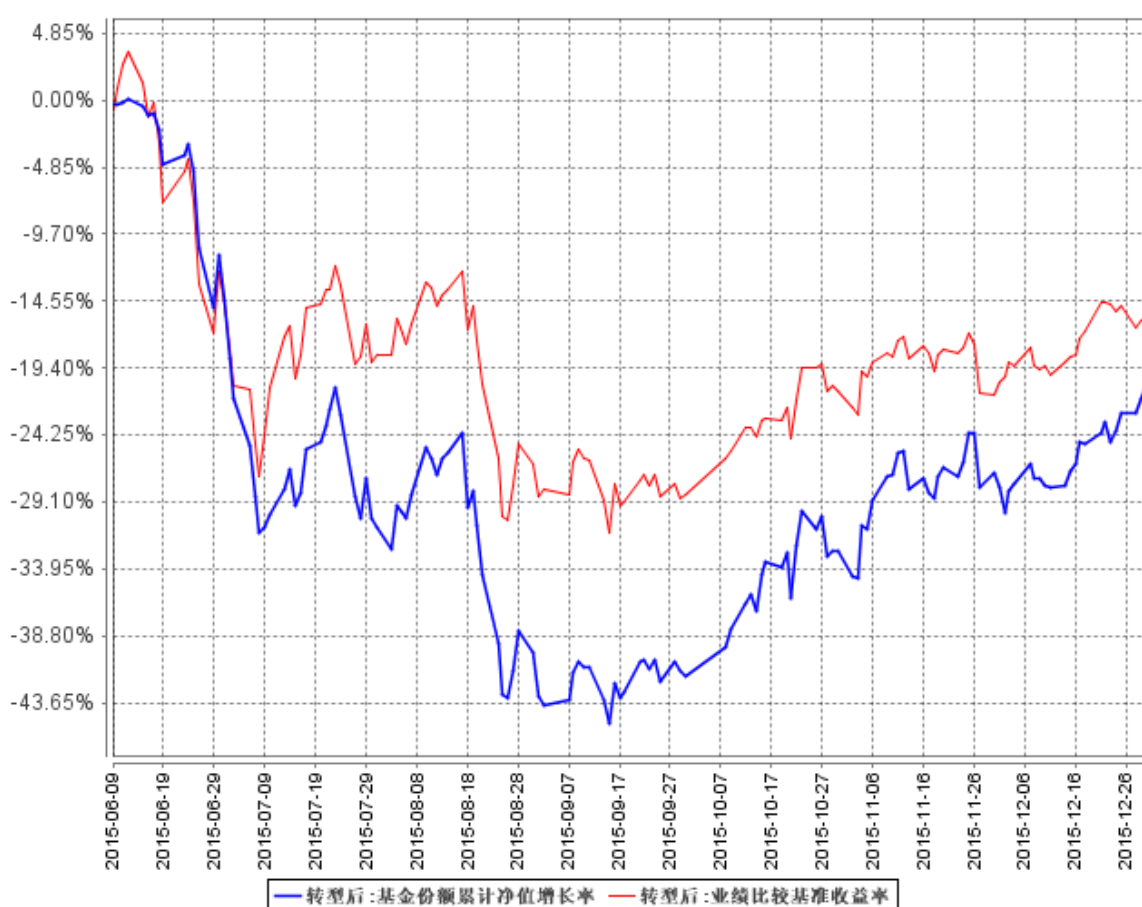
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型后						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	33.72%	2.24%	17.25%	1.52%	16.47%	0.72%
过去六个月	-12.28%	2.86%	-4.41%	2.34%	-7.87%	0.52%
自基金合同生效起至今	-22.08%	2.81%	-16.29%	2.43%	-5.79%	0.38%

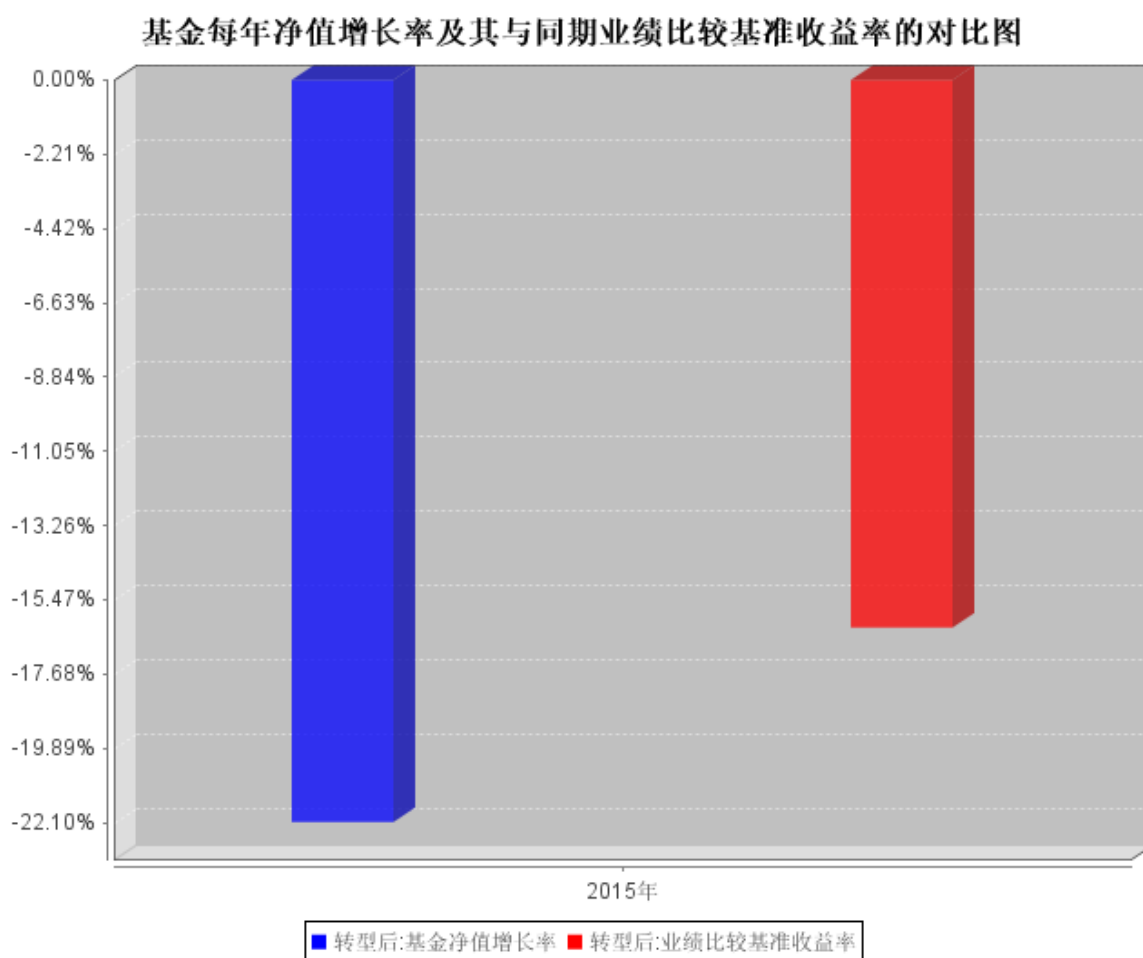
注：“自基金合同生效起至今”指 2015 年 6 月 9 日(基金转型生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：上图中 2015 年度是指 2015 年 6 月 9 日(基金转型生效日)至 2015 年 12 月 31 日，相关数据未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	4.1000	1,642,363,891.63	3,019,885.25	1,645,383,776.88	-
2014	-	-	-	-	-
2013	-	-	-	-	-
合计	4.1000	1,642,363,891.63	3,019,885.25	1,645,383,776.88	-

转型后

注：本基金在转型后未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2015 年 12 月 31 日，共管理证券投资基金 30 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	本基金基金经理	2012 年 3 月 7 日	2015 年 6 月 8 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，历任金融工程分析师兼基金经理助理、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。
--	--	--	--	--	--

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
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，复旦大学社会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。
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司 2011 年修订了《中海基金公平交易管理办法》，从投研决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估、监察稽核和信息披露等方面对股票、债券、可转债的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动进行全程公平交易管理。

投研决策内部控制方面：（1）公司研究平台共享，基金经理和专户投资经理通过研究平台平等获取研究信息。（2）公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监因业务管理的需要外，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

交易执行内部控制方面：（1）对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据研究报告独立确定申购价格和数量，在获配额度确定后，根据公司制度规定应遵循公平原则对获配额度进行分配，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配，如有特殊情况，制度规定需书面留痕。

(2) 投资交易指令统一通过交易室下达, 通过启用公平交易模块, 力求保证时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡交易原则得以落实。(3) 根据公司制度, 通过系统禁止公司组合之间 (除指数被动投资组合外) 的同日反向交易。(4) 债券场外交易, 交易部在银行间市场上公平公正地进行询价, 并由风控稽核部对询价收益率偏离、交易对手及交易方式进行事前审核。(5) 在特殊情况下, 投资组合因合规性或应对大额赎回等原因需要进行特定交易时, 由投资组合经理发起暂停投资风控阈值的流程, 在获得相关审批后, 由风控稽核部暂时关闭投资风控系统的特定阈值。完成该交易后, 风控稽核部立即启动暂停的投资风控阈值。

行为监控和分析评估方面: (1) 公司每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。(2) 公司对所有组合在 2015 年全年日内, 3 日, 5 日同向交易数据进行了采集, 并进行两两比对, 对于相关采集样本进行了 95% 置信区间, 假设溢价率为 0 的 T 分布检验。(3) 对于不同时间期间的同组合反向交易及公司制度规定的异常交易, 公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时机等进行综合分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2015 年全年, 公司遵循《中海基金公平交易管理办法》相关要求, 整体上贯彻执行制度约定, 加强了对投资组合公平交易的事后分析,

(1) 对于两两组合的同向交易, 我们从日内、3 日、5 日三个时间区间进行假设价差为零, T 分布的检验, 对于未通过假设检验的情况, 公司结合比较两两组组合间的交易占优比、采集的样本数量是否达到一定水平从而具有统计学意义、模拟利益输送金额的绝对值、模拟利益输送金额占组合资产平均净值的比例、模拟利益的贡献率占组合收益率的比例、两两组合的持仓相似度及两两组合收益率差的比较等多方面进行综合比较。

(2) 对于两两组合的反向交易, 公司采集同一组合对同一投资品种 3 日内反向交易; 两两组合对同一投资品种 3 日内反向交易; 并结合市场该投资品种的总成交量进行综合分析。

(3) 对于公司制度规定的异常交易, 相关组合经理均根据制度要求提交审批单并书面留痕。

综合而言, 本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估, 执行了公平交易制度, 公平对待了旗下各投资组合。本报告期内, 未发现组合存在有可能导致重大不公平交易和利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，风控稽核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

2015 年以来，市场经历了剧烈的波动，尤其是以创业板为代表的泛成长股表现出了显著的估值泡沫化。报告期内本基金坚持了以成长风格为主导的投资思路，遵循自下而上的原则进行选股，立足于医药产业，集中配置了互联网医疗、精准医疗、健康养老等行业内成长空间向上的个股。

尽管我们预期到了随着泛成长股估值水平的显著泡沫化及由此引发的市场风险正在愈加突出，但以主题投资名义演绎的成长股行情显然超出了我们的预期，成为了全年剧烈波动行情中的特有风景。尽管我们始终保持谨慎的态度，并把风险控制作为组合管理的首要任务，但是仍然自觉或不自觉的参与到了行情其中，最后见识了市场的力量并承担了相应的业绩波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值 1.507 元（累计净值 1.917 元）。报告期内本基金净值增长率为-22.08%，低于业绩比较基准 5.79 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

2015 年以来，为了对冲宏观经济的下行风险，国家管理机构采取了以量化宽松为核心的政策组合，维稳经济的预期逐步强化。展望 2016 年，随着汇率波动信号的出现以及美联储进入加息通道，预计国内货币政策将进入观望期，市场进入存量资金的博弈阶段，从而可能引导市场风格的逐步改变。

根据盈利、流动性与估值的综合分析，预期 2016 年市场以震荡为主，趋势性的机会需要等待。而对于成长股为代表的医药行业而言，我们认为新技术、新模式仍然将成为行业的核心驱动因素。以互联网医疗、精准医疗为代表的新产业方向，将为企业打开新的成长空间，也将带来更多的投资机会。此外，传统领域的企业也将通过稳定的成长性，提供稳健的投资回报率。

基于较为谨慎的预期，本基金 2016 年将采取更加均衡的投资策略，在以确定性增长作为组合管理首要原则的同时，将更加注重产业转型的着力点。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由监察稽核部门遵守独立、客观、公正的原则，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方法对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行检查，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

管理人各项业务能遵循国家法律法规、中国证监会规章制度、管理人内部的规章制度以及各项业务规范流程，运行符合合法性、合规性的要求，主要内控制度基本有效。

在本报告期内，管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 根据基金监管法律法规的不断更新与完善，推动各部门加强内部制度建设，确保制度对各项业务和管理环节的全覆盖、提高制度和流程的合规性、合理性和可操作性。

(2) 开展基金法律法规和管理人内部各项基本制度的培训学习工作，树立员工规范意识、合规意识和风险意识，形成员工主动、自觉进行内部控制的风险管理文化，构建主动进行管理人内部风险控制和自觉接受监察稽核的平台。

(3) 全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金销售、投资的合法合规。通过电脑监控、现场检查、人员询问、重点抽查等方法开展工作，不断提高全体员工的风险意识，保证了基金的合法合规运作。

(4) 按照中国证监会的要求，在管理内部严格推行风险控制自我评估制度。通过各部门的参与和自我评估，明确了各部门的风险点，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。

(5) 根据监管部门的要求，完成与基金投资业务相关的定期监察报告，报送中国证监会和董事会。

管理人自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。2016 年我们将继续紧紧抓住风险控制和合规性两条主线，构建一个制度修订规范化、风险责任岗位化、风险检测细致化、风险评估科学化的长效风险控制机制，提高内部监察工作的计划性、科学性和有效性，实现基金合法合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风

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证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供证券交易所及银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，本基金于 2015 年 3 月 19 日实施了利润分配，实际分配金额为 1,645,383,776.88 元。

4.9 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

本报告期内，本基金分别于 2015 年 1 月 5 日至 2015 年 3 月 13 日、2015 年 3 月 24 日至 2015 年 5 月 6 日、2015 年 5 月 11 日至 2015 年 6 月 24 日、2015 年 8 月 24 日至 2015 年 9 月 30 日出现超过连续二十个工作日基金份额持有人不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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医疗保健主题股票型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，中海医疗保健主题股票型证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海医疗保健主题股票型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，中海医疗保健主题股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 1,645,383,776.88 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的中海医疗保健主题股票型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 20739 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中海上证 380 指数证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的中海上证 380 指数证券投资基金(以下简称“中海上证 380 指数基金”)的财务报表，包括 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日)的资产负债表、2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日)止期间的的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中海上证 380 指数基金 的基金管理人中海基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控

	制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述中海上证 380 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中海上证 380 指数基金 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 赵钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2016 年 3 月 23 日

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 20750 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中海医疗保健主题股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的中海医疗保健主题股票型证券投资基金(以下简称“中海医疗保健基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中海医疗保健基金 的基金管理人中海基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由

	于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述中海医疗保健基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中海医疗保健基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 赵钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2016 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：中海上证 380 指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 8 日

单位：人民币元

资 产	附注号	报告期初至转型前	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	4,144,187.43	1,232,673.56
结算备付金		57,886.20	9,917.94
存出保证金		25,521.53	3,807.97
交易性金融资产	7.4.7.2	36,109,954.78	21,571,532.19
其中：股票投资		36,109,954.78	21,571,532.19

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	63,199.43
应收利息	7.4.7.5	204,471.07	341.13
应收股利		-	-
应收申购款		1,189,225.70	38,048.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		41,731,246.71	22,919,520.24
负债和所有者权益	附注号	报告期初至转型前	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		420,624.36	76,289.37
应付管理人报酬		6,296.13	14,819.83
应付托管费		1,259.22	2,963.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	30,056.59	13,579.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	47,186.71	46,300.64
负债合计		505,423.01	153,953.58
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	21,314,619.49	16,088,014.18
未分配利润	7.4.7.10	19,911,204.21	6,677,552.48
所有者权益合计		41,225,823.70	22,765,566.66
负债和所有者权益总计		41,731,246.71	22,919,520.24

注：报告截止日 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.934 元，基金份额总额 21,314,619.49 份。

7.2 利润表

会计主体：中海上证 380 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 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 8 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		27,480,153.49	6,908,771.22
1. 利息收入		622,018.63	9,149.76
其中：存款利息收入	7.4.7.11	622,018.63	9,149.76
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）		10,667,919.84	3,727,322.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	10,608,106.63	3,464,365.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	59,813.21	262,957.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	10,058,579.72	3,153,940.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	6,131,635.30	18,358.20
减：二、费用		676,290.68	365,265.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	394,444.03	146,077.96
2. 托管费	7.4.10.2.2	78,888.83	29,215.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	142,946.14	95,234.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	60,011.68	94,737.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,803,862.81	6,543,506.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,803,862.81	6,543,506.17

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海上证 380 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 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）	16,088,014.18	6,677,552.48	22,765,566.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,803,862.81	26,803,862.81
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）	5,226,605.31	1,631,813,565.80	1,637,040,171.11
其中：1. 基金申购款	4,053,284,192.13	2,494,359,771.62	6,547,643,963.75
2. 基金赎回款	-4,048,057,586.82	-862,546,205.82	-4,910,603,792.64
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）	-	-1,645,383,776.88	-1,645,383,776.88
五、期末所有者权益（基金净值）	21,314,619.49	19,911,204.21	41,225,823.70
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	6,543,506.17	6,543,506.17
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）	-6,315,812.99	46,727.14	-6,269,085.85
其中：1. 基金申购款	17,004,382.51	4,833,040.17	21,837,422.68
2. 基金赎回款	-23,320,195.50	-4,786,313.03	-28,106,508.53
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）	16,088,014.18	6,677,552.48	22,765,566.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>黄鹏</u>	<u>宋宇</u>	<u>周琳</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中海上证 380 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法律法规规定，经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1507 号《关于核准中海上证 380 指数证券投资基金募集的批复》核准募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为中海基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司；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，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公 W[2012]B015 号验资报告予以验证。

根据《中海基金管理有限公司关于中海上证 380 指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金份额持有人大会于 2015 年 6 月 9 日表决通过了《关于中海上证 380 指数证券投资基金转型相关事项的议案》。根据《关于中海上证 380 指数证券投资基金转型相关事项议案的说明》以及相关法律法规的规定，经与本基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，本基金管理人将《中海上证 380 指数证券投资基金基金合同》、《中海上证 380 指数证券投资基金托管协议》修订为《中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同》、《中海医疗保健主题股票型证券投资基金托管协议》，并已经中国证监会准予变更注册。《中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同》和《中海医疗保健主题股票型证券投资基金托管协议》自 2015 年 6 月 9 日起生效，原《中海上证 380 指数证券投资基金基金合同》、《中海上证 380 指数证券投资基金托管协议》自同一起失效。《中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同》生效之后，原中海上证 380 基金份额持有人转为中海医疗保健主题股票型证券投资基金份额持有人。

根据《中海上证 380 指数证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括上证 380 指数的成份股、备选成份股、现金或者到期日在一年以内的政府债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的配置比例为：投资于上证 380 指数成份股和备选成份股的资产为基金资产净值的 90%-95%；权证投资为基金资产净值的 0-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5%-10%。本业绩比较基准为：上证 380 指数

收益率 $\times 95\%$ +商业银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中海上证 380 指数证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日)止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款

项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证

具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》

提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红

利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 8 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	4,144,187.43	1,232,673.56
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,144,187.43	1,232,673.56

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 8 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	22,141,169.92	36,109,954.78	13,968,784.86
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		22,141,169.92	36,109,954.78	13,968,784.86
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	估值增值
股票		17,661,327.05	21,571,532.19	3,910,205.14
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		17,661,327.05	21,571,532.19	3,910,205.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 8 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	203,904.16	334.93
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	497.51	4.50
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-

应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	69.40	1.70
合计	204,471.07	341.13

7.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 8 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	30,056.59	13,579.77
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	30,056.59	13,579.77

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 8 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,571.35	245.06
预提费用	39,206.22	40,000.00
应付指数使用费	1,409.85	1,056.29
其他	4,999.29	4,999.29
合计	47,186.71	46,300.64

7.4.7.9 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 8 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	16,088,014.18	16,088,014.18
本期申购	4,053,284,192.13	4,053,284,192.13
本期赎回（以“-”号填列）	-4,048,057,586.82	-4,048,057,586.82
- 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	21,314,619.49	21,314,619.49
-----	---------------	---------------

注：其中本期申购包含红利再投、转换入份额；本期赎回包含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,686,008.30	1,991,544.18	6,677,552.48
本期利润	16,745,283.09	10,058,579.72	26,803,862.81
本期基金份额交易产生的变动数	1,633,881,442.09	-2,067,876.29	1,631,813,565.80
其中：基金申购款	1,660,654,820.17	833,704,951.45	2,494,359,771.62
基金赎回款	-26,773,378.08	-835,772,827.74	-862,546,205.82
本期已分配利润	-1,645,383,776.88	-	-1,645,383,776.88
本期末	9,928,956.60	9,982,247.61	19,911,204.21

7.4.7.11 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8日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	483,688.82	8,538.62
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	576.30	378.35
其他	137,753.51	232.79
合计	622,018.63	9,149.76

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月8日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	48,964,841.46	33,143,071.01
减：卖出股票成本总额	38,356,734.83	29,678,705.81
买卖股票差价收入	10,608,106.63	3,464,365.20

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益—申购差价收入。

7.4.7.13.5 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益—其他投资收益。

7.4.7.16 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 8 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	59,813.21	262,957.07
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	59,813.21	262,957.07

7.4.7.17 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 8 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	10,058,579.72	3,153,940.99
——股票投资	10,058,579.72	3,153,940.99
——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	10,058,579.72	3,153,940.99

7.4.7.18 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 8 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	6,113,716.47	12,289.03
转出基金补偿收入	17,918.83	6,069.17
合计	6,131,635.30	18,358.20

7.4.7.19 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 8 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
----	--------------------------------------	---

交易所市场交易费用	142,946.14	95,234.01
银行间市场交易费用	-	-
合计	142,946.14	95,234.01

7.4.7.20 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 8 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	17,424.81	40,000.00
信息披露费	21,781.41	50,000.00
持有人大会费	10,000.00	-
银行费用	287.00	442.00
指数使用费	10,518.46	3,895.39
开户费	-	400.00
合计	60,011.68	94,737.39

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《关于准予中海上证 380 指数证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2014]1292 号）的批复，本基金的基金管理人召开了份额持有人大会，于 2015 年 6 月 9 日表决通过了《关于中海上证 380 指数证券投资基金转型相关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

自 2015 年 6 月 9 日起，《中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同》正式生效，中海上证 380 指数证券投资基金转型成中海医疗保健主题股票型证券投资基金。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司（“中海信托”）	基金管理人的股东
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司（“法国洛希尔银行”）	基金管理人的股东

中海恒信资产管理（上海）有限公司（以下简称“中海恒信”）	基金管理人的控股子公司
------------------------------	-------------

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国联证券	14,035,217.14	15.29%	3,320,371.03	5.53%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 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	12,778.16	15.29%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
国联证券	3,028.11	5.57%	1,320.67	9.73%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结

算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	394,444.03	146,077.96
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	33,315.63	61,780.50

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日的基金资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	78,888.83	29,215.69

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日的基金资产净值）

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 8 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,144,187.43	483,688.82	1,232,673.56	8,538.62

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2015 年 3 月 19 日	-	2015 年 3 月 19 日	4.1000	1,642,363,891.63	3,019,885.25	1,645,383,776.88	-
合计	-	-	-	4.1000	1,642,363,891.63	3,019,885.25	1,645,383,776.88	-

7.4.12 期末（2015 年 6 月 8 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金在本报告期末没有因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
600410	华胜天成	2015 年 5 月 28 日	重大事项 未公告	47.84	2015 年 7 月 22 日	43.06	5,191	150,326.73	248,337.44	-
600872	中炬高新	2015 年 5 月 4 日	重大事项 未公告	21.73	2015 年 9 月 8 日	19.46	11,013	132,718.21	239,312.49	-
600201	金宇集团	2015 年 6 月 1 日	重大事项 未公告	86.84	2015 年 6 月 9 日	95.52	2,722	127,863.54	236,378.48	-
600582	天地科技	2015 年 6 月 8 日	重大事项 未公告	24.35	2015 年 6 月 15 日	26.01	6,474	100,309.89	157,641.90	-
600587	新华医疗	2015 年 5 月 22 日	重大事项 未公告	58.63	2015 年 7 月 3 日	52.77	2,326	87,588.26	136,373.38	-
600482	风帆股份	2015 年 5 月 28 日	重大事项 未公告	42.46	2015 年 10 月 22 日	38.14	2,517	45,123.96	106,871.82	-
600628	新世界	2015 年 4 月 8 日	重大事项 未公告	14.27	2015 年 6 月 17 日	15.70	6,561	76,129.83	93,625.47	-
600277	亿利能源	2015 年 6 月 1 日	重大事项 未公告	14.62	2015 年 10 月 12 日	13.12	6,163	64,350.39	90,103.06	-
600614	鼎立股份	2015 年 3 月 30 日	重大事项 未公告	23.69	2015 年 6 月 23 日	26.06	3,688	57,384.44	87,368.72	-
600963	岳阳林纸	2015 年 4 月 9 日	重大事项 未公告	7.74	2015 年 6 月 17 日	8.51	10,502	64,245.49	81,285.48	-
600831	广电网络	2015 年 5 月 29 日	重大事项 未公告	24.47	2015 年 6 月 17 日	25.00	3,222	42,329.43	78,842.34	-
600790	轻纺城	2015 年 5 月 25 日	重大事项 未公告	13.38	2015 年 8 月 18 日	12.04	5,786	43,477.00	77,416.68	-
600387	海越股份	2015 年 6 月 2 日	重大事项 未公告	28.36	2015 年 6 月 30 日	25.52	2,549	42,878.72	72,289.64	-
601877	正泰电器	2015 年 5 月 18 日	重大事项 未公告	30.62	2015 年 11 月 27 日	28.50	2,317	59,028.25	70,946.54	-
600416	湘电股份	2015 年 5 月 22 日	重大事项 未公告	22.64	2015 年 7 月 20 日	20.35	3,059	47,691.75	69,255.76	-
600318	巢东股份	2015 年 6 月 8 日	重大事项 未公告	37.48	2015 年 6 月 24 日	33.73	1,705	36,933.71	63,903.40	-
600869	智慧能源	2015 年 5 月 11 日	重大事项 未公告	29.14	2015 年 7 月 31 日	26.23	1,864	24,642.45	54,316.96	-
600562	国睿科技	2015 年 5 月 20 日	重大事项 未公告	70.82	2015 年 6 月 26 日	63.74	713	38,210.54	50,494.66	-
600327	大东方	2015 年 6 月 1 日	重大事项 未公告	19.21	2015 年 6 月 15 日	21.13	2,520	24,576.28	48,409.20	-
600470	六国化	2015 年 6 月 4 日	重大事项	14.08	2015 年 6 月 16 日	13.50	3,121	26,430.81	43,943.68	-

	工		未公告							
600667	太极实业	2015 年 1 月 5 日	重大事项 未公告	5.27	2015 年 6 月 30 日	5.80	8,158	33,204.84	42,992.66	-
603308	应流股份	2015 年 5 月 29 日	重大事项 未公告	32.69	2015 年 6 月 16 日	35.96	1,284	25,077.91	41,973.96	-
600756	浪潮软件	2015 年 1 月 13 日	重大事项 未公告	24.33	2015 年 6 月 24 日	26.76	1,665	33,680.51	40,509.45	-
600575	皖江物流	2014 年 9 月 10 日	重大事项 未公告	4.11	2015 年 9 月 16 日	4.52	9,765	35,857.40	40,134.15	-
600568	中珠控股	2015 年 4 月 28 日	重大事项 未公告	24.12	2015 年 10 月 12 日	21.69	1,318	20,616.85	31,790.16	-
600785	新华百货	2015 年 6 月 3 日	重大事项 未公告	29.93	2015 年 6 月 9 日	27.90	1,022	16,592.86	30,588.46	-
600882	华联矿业	2015 年 5 月 19 日	重大事项 未公告	13.42	2015 年 11 月 30 日	12.52	2,226	21,667.04	29,872.92	-
600333	长春燃气	2015 年 5 月 29 日	重大事项 未公告	11.97	2015 年 7 月 9 日	10.77	2,464	22,185.04	29,494.08	-
600561	江西长运	2015 年 5 月 4 日	重大事项 未公告	19.48	2015 年 8 月 20 日	17.36	1,421	21,378.82	27,681.08	-
600778	友好集团	2015 年 6 月 2 日	重大事项 未公告	16.10	2015 年 10 月 13 日	14.41	1,583	16,946.80	25,486.30	-
600167	联美控股	2015 年 5 月 27 日	重大事项 未公告	25.76	2015 年 12 月 7 日	24.10	978	15,753.76	25,193.28	-
600828	成商集团	2015 年 4 月 14 日	重大事项 未公告	8.63	2015 年 6 月 29 日	9.49	2,763	20,479.49	23,844.69	-
603006	联明股份	2015 年 4 月 21 日	重大事项 未公告	49.47	2015 年 6 月 30 日	44.52	301	10,940.22	14,890.47	-
600258	首旅酒店	2015 年 3 月 17 日	重大事项 未公告	18.70	2015 年 12 月 25 日	20.41	656	9,446.97	12,267.20	-
600366	宁波韵升	2015 年 5 月 22 日	重大事项 未公告	39.01	2015 年 8 月 12 日	31.58	3,194	61,965.64	124,597.94	-
600521	华海药业	2015 年 5 月 22 日	重大事项 未公告	28.06	2015 年 6 月 9 日	27.91	3,224	54,149.50	90,465.44	-
600676	交运股份	2015 年 5 月 27 日	重大事项 未公告	21.20	2015 年 7 月 7 日	17.78	3,549	34,825.73	75,238.80	-
600777	新潮实业	2014 年 11 月 25 日	重大事项 未公告	26.59	2015 年 6 月 12 日	13.11	7,103	70,182.14	188,868.77	-
600967	北方创业	2015 年 4 月 13 日	重大事项 未公告	27.70	2015 年 11 月 16 日	18.83	9,410	145,348.73	260,657.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金投资决策委员会议事规则》、《中海基金投资业务流程》、《中海基金权限管理办法》、《中海基金研究管理办法》、《中海基金股票库管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行；因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 6 月 8 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2014 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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的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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 8 日，本基金所承担的其他/全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

下表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 8 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以 内	3 个月 -1 年	6 个月 -1 年	1 年以 内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	4,144,187.43	-	-	-	-	-	-	-	-	4,144,187.43
结算备付金	57,886.20	-	-	-	-	-	-	-	-	57,886.20
存出保证金	25,521.53	-	-	-	-	-	-	-	-	25,521.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	36,109,954.78	36,109,954.78
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	204,471.07	204,471.07
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,189,225.70	1,189,225.70
资产总计	4,227,595.16	-	-	-	-	-	-	-	37,503,651.55	41,731,246.71
负债										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	420,624.36	420,624.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	6,296.13	6,296.13
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	1,259.22	1,259.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	30,056.59	30,056.59
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	47,186.71	47,186.71
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	505,423.01	505,423.01
利率敏感度缺口	4,227,595.16	-	-	-	-	-	-	-	36,998,228.54	41,225,823.70
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以 内	3 个月 -1 年	6 个月 -1 年	1 年以 内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	1,232,673.56	-	-	-	-	-	-	-	-	1,232,673.56
结算备付金	9,917.94	-	-	-	-	-	-	-	-	9,917.94
存出保证金	3,807.97	-	-	-	-	-	-	-	-	3,807.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	21,571,532.19	21,571,532.19
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	63,199.43	63,199.43
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	341.13	341.13
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	38,048.02	38,048.02

资产总计	1,246,399.47	-	-	-	-	-	-	-	-21,673,120.77	22,919,520.24
负债										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	76,289.37	76,289.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	14,819.83	14,819.83
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	2,963.97	2,963.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	13,579.77	13,579.77
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	46,300.64	46,300.64
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	153,953.58	153,953.58
利率敏感度缺口	1,246,399.47	-	-	-	-	-	-	-	-21,519,167.19	22,765,566.66

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。6月8日（含）之前，本基金为中海上证380指数证券投资基金，基金投资于上证380指数成份股和备选成份股的资产为基金资产净值的90%-95%，权证投资为基金资产净值的0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的5%-10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 8 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	36,109,954.78	87.59	21,571,532.19	94.76
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	36,109,954.78	87.59	21,571,532.19	94.76

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	测算组合市场价格风险的数据为上证 380 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定上证 380 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	Beta 系数是根据报表日持仓资产在过去 100 个交易日收益率与其对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
	假定市场无风险利率为一年定期存款利率。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 8 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	0.05	1,600,985.39	1,018,520.12
	-0.05	-1,600,985.39	-1,018,520.12

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日), 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 32,846,290.87 元, 属于第二层次的余额为 3,263,663.91 元, 无第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日: 第一层次 20,576,248.98 元, 第二层次 995,283.21 元, 无第三层次余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 8 日(基金合同失效前日), 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表(转型后)

会计主体: 中海医疗保健主题股票型证券投资基金

报告截止日: 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	转型后至报告期末
资 产:		
银行存款	7.4.7.1	4,668,700.67
结算备付金		727,150.12
存出保证金		108,791.93

交易性金融资产	7.4.7.2	65,139,435.61
其中：股票投资		65,139,435.61
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		1,942,441.02
应收利息	7.4.7.5	1,555.00
应收股利		—
应收申购款		2,579,871.10
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		75,167,945.45
负债和所有者权益	附注号	转型后至报告期末
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		2,733,623.19
应付赎回款		443,804.82
应付管理人报酬		87,996.83
应付托管费		14,666.10
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	405,054.67
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	75,756.44
负债合计		3,760,902.05
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	47,376,235.33
未分配利润	7.4.7.10	24,030,808.07
所有者权益合计		71,407,043.40
负债和所有者权益总计		75,167,945.45

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.507 元，基金份额总额 47,376,235.33 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 9 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：中海医疗保健主题股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-12,220,162.47
1. 利息收入		51,441.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	51,441.96
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）		-3,352,983.72
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,383,442.88
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	30,459.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-9,777,188.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	858,567.70
减：二、费用		1,882,123.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	475,944.04
2. 托管费	7.4.10.2.2	79,352.25
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,185,470.74
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	141,356.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,102,285.87
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,102,285.87

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海医疗保健主题股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	21,314,619.49	19,911,204.21	41,225,823.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,102,285.87	-14,102,285.87
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)	26,061,615.84	18,221,889.73	44,283,505.57
其中：1. 基金申购款	102,659,584.36	53,665,587.33	156,325,171.69
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-76,597,968.52	-35,443,697.60	-112,041,666.12
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	47,376,235.33	24,030,808.07	71,407,043.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>黄鹏</u>	<u>宋宇</u>	<u>周琳</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中海医疗保健主题股票型证券投资基金是根据原中海上证 380 指数证券投资基金(以下简称“中海上证 380 指数基金”)基金份额持有人大会 2015 年 6 月 9 日决议通过的《关于中海上证 380 指数证券投资基金转型相关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可字[2014]1292 号《关于准予中海上证 380 指数证券投资基金变更注册的批复》核准，由原中海上证 380 指数基金转型而来。原中海上证 380 指数基金存续期限至 2015 年 6 月 8 日止。自 2015 年 6 月 9 日起，原中海上证 380 指数基金更名为中海医疗保健主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《中海上证 380 指数证券投资基金基金合同》失效的同时《中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金存续期限不定，原中海上证 380 指数基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 41,225,823.70 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为

本基金的基金资产净值。本基金的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股份有限公司。

根据《中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同》的规定，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（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）。本基金投资组合的配置比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中海医疗保健主题股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 6 月 9 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 9 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 9 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《关于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》及其他相关财税法规和实务操作，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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

（2）对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。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	4,668,700.67
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	4,668,700.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	60,947,839.16	65,139,435.61	4,191,596.45
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	60,947,839.16	65,139,435.61	4,191,596.45

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金在本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,178.80
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	327.20
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	49.00
合计	1,555.00

7.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	405,054.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	405,054.67

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	757.15

预提费用	70,000.00
其他	4,999.29
合计	75,756.44

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	21,314,619.49	21,314,619.49
- 基金份额折算调整	-	-
- 未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	-	-
- 基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	102,659,584.36	102,659,584.36
本期赎回（以“-”号填列）	-76,597,968.52	-76,597,968.52
本期末	47,376,235.33	47,376,235.33

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	9,928,956.60	9,982,247.61	19,911,204.21
本期利润	-4,325,097.46	-9,777,188.41	-14,102,285.87
本期基金份额交易产生的变动数	22,230,054.04	-4,008,164.31	18,221,889.73
其中：基金申购款	75,249,381.33	-21,583,794.00	53,665,587.33
基金赎回款	-53,019,327.29	17,575,629.69	-35,443,697.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,833,913.18	-3,803,105.11	24,030,808.07

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	45,434.24
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	4,391.79
其他	1,615.93
合计	51,441.96

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	384,411,514.56
卖出股票成本总额	387,794,957.44
买卖股票差价收入	-3,383,442.88

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益—买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益—赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益—申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	30,459.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	30,459.16

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-9,777,188.41
——股票投资	-9,777,188.41
——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	-9,777,188.41

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	680,140.07

转出基金补偿收入	178,427.63
合计	858,567.70

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,185,470.74
银行间市场交易费用	-
合计	1,185,470.74

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	52,575.19
信息披露费	28,218.59
持有人大会费	60,000.00
开户费	-
银行费用	340.00
指数使用费	222.59
合计	141,356.37

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司（“中海信托”）	基金管理人的股东
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司（“法国洛希尔银行”）	基金管理人的股东

中海恒信资产管理（上海）有限公司（以下简称“中海恒信”）	基金管理人的控股子公司
------------------------------	-------------

7.4.10 本报告期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国联证券	102,420,347.88	12.63%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月9日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国联证券	93,469.43	12.60%	10,062.22	2.48%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	475,944.04
其中：支付销售机构的客户维护费	188,145.74

注：支付基金管理人中海基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	79,352.25

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间市场交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本报告期内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。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日
-------	--

	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,668,700.67	45,434.24

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金在本报告期末未发生利润分配。

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金在本报告期末没有因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
002020	京新药业	2015 年 12 月 29 日	重大事项停牌	33.55	2016 年 1 月 20 日	30.20	156,344	4,517,810.29	5,245,341.20	—
600645	中源协和	2015 年 12 月 30 日	重大事项停牌	65.01	2016 年 1 月 4 日	63.90	31,211	1,778,193.01	2,029,027.11	—
002696	百洋股份	2015 年 12 月 2 日	重大事项停牌	26.36	—	—	76,400	1,864,916.65	2,013,904.00	—
300238	冠昊生物	2015 年 11 月 12 日	重大事项停牌	56.67	—	—	30,670	1,451,863.95	1,738,068.90	—
600420	现代制药	2015 年 10 月 21 日	重大事项停牌	41.76	2016 年 3 月 23 日	33.44	33,776	1,223,338.71	1,410,485.76	—
600771	广誉远	2015 年 11 月 17 日	重大事项停牌	31.98	—	—	30,300	971,990.00	968,994.00	—
300431	暴风科	2015 年 10 月 27 日	重大	104.61	—	—	9,000	884,636.00	941,490.00	—

	技		事项 停牌							
600729	重庆百货	2015 年 7 月 24 日	重大 事项 停牌	32.39	2016 年 1 月 4 日	29.90	17	465.35	550.63	-
600873	梅花生物	2015 年 12 月 17 日	重大 事项 停牌	9.14	-	-	58	459.77	530.12	-
600578	京能电力	2015 年 11 月 5 日	重大 事项 停牌	6.07	-	-	81	476.76	491.67	-
600502	安徽水利	2015 年 10 月 20 日	重大 事项 停牌	13.67	-	-	32	428.73	437.44	-
600990	四创电子	2015 年 8 月 31 日	重大 事项 停牌	62.75	-	-	3	245.24	188.25	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金投资决策委员会议事规则》、《中海基金投资业务流程》、《中海基金权限管理办法》、《中海基金研究管理办法》、《中海基金股票库管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行；因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 12 月 31 日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	-

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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的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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的其他/全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

下表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以 内	3 个月 -1 年	6 个月 -1 年	1 年以 内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	4,668,700.67	-	-	-	-	-	-	-	-	4,668,700.67
结算备付金	727,150.12	-	-	-	-	-	-	-	-	727,150.12
存出保证金	108,791.93	-	-	-	-	-	-	-	-	108,791.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	65,139,435.61	65,139,435.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,942,441.02	1,942,441.02
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,555.00	1,555.00
应收申购款	3,433.59	-	-	-	-	-	-	-	2,576,437.51	2,579,871.10
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,508,076.31	-	-	-	-	-	-	-	69,659,869.14	75,167,945.45
负债										
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,733,623.19	2,733,623.19
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	443,804.82	443,804.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	87,996.83	87,996.83
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	14,666.10	14,666.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	405,054.67	405,054.67
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	75,756.44	75,756.44
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	3,760,902.05	3,760,902.05
利率敏感度缺口	5,508,076.31	-	-	-	-	-	-	-	65,898,967.09	71,407,043.40

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。6 月 9 日之前，本基金为中海上证 380 指数证券投资基金，基金投资于上证 380 指数成份股和备选成份股的资产为基金资产净值的 90%-95%，权证投资为基金资产净值的 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5%-10%；6 月 9 日之后，本基金转型为中海医疗保健主题股票型证券投资基金，基金投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	65,139,435.61	91.22
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	65,139,435.61	91.22

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	测算组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。	
	假定沪深 300 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（2015 年 12 月 31 日）
	0.05	2,975,351.60
	-0.05	-2,975,351.60

注：上年度末基准指数为上证 380 指数。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 50,789,926.53 元，属于第二层次的余额为 14,349,509.08 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告(转型前)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	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

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	117,649.44	0.29
B	采矿业	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	—	—
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	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
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

8.2.2 报告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	采矿业	—	—
C	制造业	83,706.00	0.20
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	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	40,134.15	0.10
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	123,840.15	0.30

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 报告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

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	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
11	601991	大唐发电	29,725	269,605.75	0.65
12	600635	大众公用	17,559	268,301.52	0.65
13	600642	申能股份	20,207	266,934.47	0.65
14	600967	北方创业	9,410	260,657.00	0.63
15	601333	广深铁路	29,725	256,229.50	0.62
16	600978	宜华木业	11,793	255,554.31	0.62
17	600867	通化东宝	8,576	250,419.20	0.61
18	600410	华胜天成	5,191	248,337.44	0.60
19	600881	亚泰集团	16,945	246,041.40	0.60
20	600143	金发科技	15,046	243,143.36	0.59
21	600872	中炬高新	11,013	239,312.49	0.58
22	601168	西部矿业	17,260	237,842.80	0.58
23	600201	金宇集团	2,722	236,378.48	0.57
24	600655	豫园商城	10,038	227,762.22	0.55
25	600584	长电科技	7,867	226,726.94	0.55
26	600307	酒钢宏兴	29,545	221,292.05	0.54
27	600688	上海石化	22,285	219,730.10	0.53
28	600704	物产中大	5,688	218,988.00	0.53
29	600170	上海建工	16,449	218,607.21	0.53
30	601111	中国国航	16,212	218,537.76	0.53
31	600654	飞乐股份	5,564	216,383.96	0.52
32	600528	中铁二局	8,627	215,588.73	0.52
33	600388	龙净环保	8,120	209,658.40	0.51

34	600571	信雅达	1,251	208,329.03	0.51
35	600169	太原重工	15,765	203,526.15	0.49
36	600021	上海电力	6,625	202,062.50	0.49
37	601608	中信重工	8,158	199,544.68	0.48
38	600525	长园集团	6,610	199,027.10	0.48
39	600200	江苏吴中	5,438	197,834.44	0.48
40	600682	南京新百	2,698	196,333.46	0.48
41	600811	东方集团	12,069	192,500.55	0.47
42	600312	平高电气	7,268	192,238.60	0.47
43	600611	大众交通	7,248	191,999.52	0.47
44	600777	新潮实业	7,103	188,868.77	0.46
45	601012	隆基股份	8,972	188,860.60	0.46
46	601898	中煤能源	18,234	186,351.48	0.45
47	600122	宏图高科	9,345	178,209.15	0.43
48	600694	大商股份	2,571	172,282.71	0.42
49	600008	首创股份	9,028	170,538.92	0.41
50	600176	中国巨石	4,862	167,252.80	0.41
51	600594	益佰制药	2,430	167,086.80	0.41
52	601718	际华集团	12,835	165,699.85	0.40
53	600498	烽火通信	4,396	164,630.20	0.40
54	600458	时代新材	4,122	164,302.92	0.40
55	600755	厦门国贸	10,740	161,744.40	0.39
56	600863	内蒙华电	23,248	161,573.60	0.39
57	600478	科力远	6,782	160,597.76	0.39
58	600166	福田汽车	14,967	160,595.91	0.39
59	601258	庞大集团	11,815	159,738.80	0.39
60	600582	天地科技	6,474	157,641.90	0.38
61	600572	康恩贝	5,093	155,693.01	0.38
62	600873	梅花生物	12,258	154,083.06	0.37
63	600380	健康元	6,313	152,458.95	0.37
64	600436	片仔癀	1,813	151,566.80	0.37
65	600125	铁龙物流	8,409	151,530.18	0.37
66	600171	上海贝岭	5,034	151,322.04	0.37
67	600517	置信电气	7,469	150,575.04	0.37
68	600797	浙大网新	7,707	149,515.80	0.36
69	600391	成发科技	2,186	147,270.82	0.36
70	600175	美都能源	14,323	145,521.68	0.35
71	600161	天坛生物	2,694	144,910.26	0.35
72	600557	康缘药业	3,839	144,384.79	0.35

73	600180	瑞茂通	3,289	143,104.39	0.35
74	600098	广州发展	7,579	142,030.46	0.34
75	600805	悦达投资	5,944	141,110.56	0.34
76	600626	申达股份	5,473	137,974.33	0.33
77	601918	国投新集	9,945	137,638.80	0.33
78	600260	凯乐科技	6,531	137,020.38	0.33
79	600587	新华医疗	2,326	136,373.38	0.33
80	600120	浙江东方	2,812	132,417.08	0.32
81	600536	中国软件	2,357	131,449.89	0.32
82	600500	中化国际	6,350	130,365.50	0.32
83	603766	隆鑫通用	3,651	130,267.68	0.32
84	600495	晋西车轴	4,327	128,814.79	0.31
85	601000	唐山港	8,222	128,345.42	0.31
86	601717	郑煤机	8,070	127,667.40	0.31
87	600138	中青旅	4,487	127,385.93	0.31
88	600677	航天通信	3,301	127,055.49	0.31
89	600835	上海机电	3,008	126,636.80	0.31
90	600110	中科英华	10,601	126,363.92	0.31
91	601567	三星电气	2,358	125,964.36	0.31
92	600058	五矿发展	3,732	125,544.48	0.30
93	600255	鑫科材料	11,975	125,378.25	0.30
94	600651	飞乐音响	5,875	125,137.50	0.30
95	600366	宁波韵升	3,194	124,597.94	0.30
96	600664	哈药股份	9,183	124,521.48	0.30
97	600064	南京高科	4,690	123,722.20	0.30
98	600511	国药股份	2,511	123,541.20	0.30
99	600038	中直股份	1,642	122,870.86	0.30
100	600172	黄河旋风	5,370	122,758.20	0.30
101	600711	盛屯矿业	7,343	120,645.49	0.29
102	600545	新疆城建	5,471	119,377.22	0.29
103	600017	日照港	13,818	118,005.72	0.29
104	600210	紫江企业	10,475	115,539.25	0.28
105	600399	抚顺特钢	2,809	115,477.99	0.28
106	600343	航天动力	3,235	115,198.35	0.28
107	600062	华润双鹤	3,323	114,975.80	0.28
108	600426	华鲁恒升	6,131	114,956.25	0.28
109	600270	外运发展	3,204	112,492.44	0.27
110	600662	强生控股	5,503	112,371.26	0.27
111	600289	亿阳信通	4,056	110,688.24	0.27

112	600673	东阳光科	9,299	109,542.22	0.27
113	600112	天成控股	3,502	109,332.44	0.27
114	600216	浙江医药	6,384	107,251.20	0.26
115	600482	风帆股份	2,517	106,871.82	0.26
116	600428	中远航运	8,186	106,090.56	0.26
117	600420	现代制药	1,800	104,976.00	0.25
118	601588	北辰实业	12,810	104,145.30	0.25
119	600185	格力地产	2,600	102,518.00	0.25
120	600409	三友化工	8,778	101,298.12	0.25
121	600188	兖州煤业	5,709	101,163.48	0.25
122	600578	京能电力	11,381	100,949.47	0.24
123	600580	卧龙电气	4,467	99,480.09	0.24
124	600491	龙元建设	6,160	99,422.40	0.24
125	600300	维维股份	7,589	98,884.67	0.24
126	601002	晋亿实业	4,334	98,641.84	0.24
127	600269	赣粤高速	10,831	98,345.48	0.24
128	600783	鲁信创投	1,851	97,973.43	0.24
129	601666	平煤股份	10,978	97,484.64	0.24
130	600422	昆药集团	2,097	97,447.59	0.24
131	601311	骆驼股份	3,436	97,204.44	0.24
132	600481	双良节能	3,464	96,818.80	0.23
133	600577	精达股份	4,277	96,531.89	0.23
134	600546	山煤国际	9,399	96,057.78	0.23
135	601058	赛轮金宇	6,574	95,980.40	0.23
136	600261	阳光照明	8,745	95,233.05	0.23
137	600825	新华传媒	4,857	94,614.36	0.23
138	600628	新世界	6,561	93,625.47	0.23
139	600398	海澜之家	5,228	91,699.12	0.22
140	600596	新安股份	4,947	91,568.97	0.22
141	600884	杉杉股份	2,437	91,021.95	0.22
142	600761	安徽合力	3,968	90,867.20	0.22
143	600521	华海药业	3,224	90,465.44	0.22
144	600736	苏州高新	6,248	90,158.64	0.22
145	600277	亿利能源	6,163	90,103.06	0.22
146	600160	巨化股份	6,802	89,106.20	0.22
147	601001	大同煤业	7,466	88,696.08	0.22
148	600284	浦东建设	4,379	88,105.48	0.21
149	600106	重庆路桥	6,536	88,105.28	0.21
150	600614	鼎立股份	3,688	87,368.72	0.21

151	601010	文峰股份	5,342	86,860.92	0.21
152	600666	西南药业	1,719	85,451.49	0.21
153	600552	方兴科技	2,224	85,357.12	0.21
154	601886	江河创建	4,191	84,700.11	0.21
155	600487	亨通光电	2,034	84,370.32	0.20
156	600351	亚宝药业	4,828	83,524.40	0.20
157	600183	生益科技	6,402	83,482.08	0.20
158	600285	羚锐制药	4,780	83,219.80	0.20
159	600438	通威股份	3,665	82,975.60	0.20
160	600004	白云机场	4,103	82,675.45	0.20
161	600239	云南城投	5,375	82,130.00	0.20
162	600395	盘江股份	5,215	81,927.65	0.20
163	600236	桂冠电力	7,060	81,754.80	0.20
164	600321	国栋建设	8,226	81,437.40	0.20
165	600963	岳阳林纸	10,502	81,285.48	0.20
166	600990	四创电子	703	81,034.81	0.20
167	601139	深圳燃气	5,387	80,643.39	0.20
168	600684	珠江实业	4,277	80,322.06	0.19
169	600993	马应龙	1,803	80,215.47	0.19
170	600612	老凤祥	1,235	80,213.25	0.19
171	600033	福建高速	10,832	79,831.84	0.19
172	600020	中原高速	8,083	79,698.38	0.19
173	600720	祁连山	6,010	79,151.70	0.19
174	600831	广电网络	3,222	78,842.34	0.19
175	601880	大连港	8,115	78,796.65	0.19
176	600496	精工钢构	7,721	78,676.99	0.19
177	600363	联创光电	3,130	78,343.90	0.19
178	600527	江南高纤	6,339	78,223.26	0.19
179	600251	冠农股份	3,924	77,812.92	0.19
180	600790	轻纺城	5,786	77,416.68	0.19
181	601222	林洋电子	1,570	77,369.60	0.19
182	600624	复旦复华	2,831	77,201.37	0.19
183	601238	广汽集团	5,186	76,856.52	0.19
184	600621	华鑫股份	3,713	76,710.58	0.19
185	600502	安徽水利	3,832	75,873.60	0.18
186	600970	中材国际	3,683	75,538.33	0.18
187	600676	交运股份	3,549	75,238.80	0.18
188	601700	风范股份	4,565	74,866.00	0.18
189	600859	王府井	1,949	74,744.15	0.18

190	600559	老白干酒	1,103	74,673.10	0.18
191	600776	东方通信	3,469	74,618.19	0.18
192	603077	和邦股份	2,740	74,582.80	0.18
193	600460	士兰微	5,780	74,215.20	0.18
194	600096	云天化	3,755	74,086.15	0.18
195	601777	力帆股份	3,206	74,058.60	0.18
196	600826	兰生股份	1,850	74,000.00	0.18
197	600858	银座股份	4,324	73,767.44	0.18
198	600526	菲达环保	2,607	73,752.03	0.18
199	600846	同济科技	4,165	73,220.70	0.18
200	601369	陕鼓动力	4,866	72,600.72	0.18
201	600387	海越股份	2,549	72,289.64	0.18
202	600686	金龙汽车	2,447	72,039.68	0.17
203	600775	南京熊猫	2,630	71,930.50	0.17
204	601877	正泰电器	2,317	70,946.54	0.17
205	600056	中国医药	2,949	70,481.10	0.17
206	600039	四川路桥	8,562	70,379.64	0.17
207	600586	金晶科技	7,290	69,692.40	0.17
208	600416	湘电股份	3,059	69,255.76	0.17
209	600375	华菱星马	3,789	69,073.47	0.17
210	600864	哈投股份	2,961	69,020.91	0.17
211	600784	鲁银投资	4,140	68,517.00	0.17
212	600824	益民集团	5,512	68,514.16	0.17
213	600323	瀚蓝环境	2,873	68,291.21	0.17
214	600510	黑牡丹	3,250	67,990.00	0.16
215	600509	天富能源	4,037	67,983.08	0.16
216	600088	中视传媒	1,430	66,480.70	0.16
217	600350	山东高速	6,404	66,409.48	0.16
218	600405	动力源	3,367	65,589.16	0.16
219	600238	海南椰岛	3,022	65,275.20	0.16
220	600567	山鹰纸业	11,080	64,928.80	0.16
221	600874	创业环保	3,659	64,032.50	0.16
222	600318	巢东股份	1,705	63,903.40	0.16
223	600850	华东电脑	763	63,473.97	0.15
224	600141	兴发集团	3,029	63,245.52	0.15
225	600132	重庆啤酒	2,016	63,141.12	0.15
226	600073	上海梅林	3,713	63,083.87	0.15
227	600687	刚泰控股	1,470	62,901.30	0.15
228	601678	滨化股份	5,425	62,658.75	0.15

229	600708	海博股份	3,177	62,523.36	0.15
230	600290	华仪电气	3,400	62,390.00	0.15
231	600794	保税科技	4,617	62,052.48	0.15
232	600750	江中药业	1,343	61,066.21	0.15
233	600382	广东明珠	2,779	60,915.68	0.15
234	600754	锦江股份	1,592	60,909.92	0.15
235	600480	凌云股份	2,373	59,016.51	0.14
236	600668	尖峰集团	2,707	58,985.53	0.14
237	603993	洛阳钼业	3,238	58,607.80	0.14
238	600329	中新药业	1,899	58,413.24	0.14
239	601233	桐昆股份	2,512	58,404.00	0.14
240	600377	宁沪高速	5,712	58,319.52	0.14
241	600195	中牧股份	1,524	57,805.32	0.14
242	600292	中电远达	1,450	56,245.50	0.14
243	600059	古越龙山	3,318	56,007.84	0.14
244	600135	乐凯胶片	2,046	55,671.66	0.14
245	600486	扬农化工	1,200	55,488.00	0.13
246	600353	旭光股份	1,724	55,116.28	0.13
247	601908	京运通	2,321	55,100.54	0.13
248	600869	智慧能源	1,864	54,316.96	0.13
249	600976	健民集团	1,166	54,114.06	0.13
250	601515	东风股份	1,800	53,874.00	0.13
251	600439	瑞贝卡	5,209	53,861.06	0.13
252	600636	三爱富	2,190	53,436.00	0.13
253	600501	航天晨光	1,763	53,031.04	0.13
254	600830	香溢融通	2,591	52,778.67	0.13
255	601218	吉鑫科技	3,592	52,766.48	0.13
256	603366	日出东方	2,688	51,824.64	0.13
257	600335	国机汽车	1,479	51,617.10	0.13
258	600425	青松建化	4,474	51,451.00	0.12
259	600551	时代出版	1,810	51,132.50	0.12
260	600488	天药股份	4,494	50,737.26	0.12
261	600507	方大特钢	4,878	50,731.20	0.12
262	603555	贵人鸟	851	50,702.58	0.12
263	600562	国睿科技	713	50,494.66	0.12
264	600616	金枫酒业	2,466	50,281.74	0.12
265	601566	九牧王	1,484	50,085.00	0.12
266	600697	欧亚集团	1,297	49,999.35	0.12
267	600729	重庆百货	1,217	49,909.17	0.12

268	600397	安源煤业	3,479	49,367.01	0.12
269	600973	宝胜股份	2,275	49,344.75	0.12
270	601126	四方股份	1,383	49,331.61	0.12
271	600479	千金药业	1,740	49,311.60	0.12
272	600468	百利电气	1,578	49,296.72	0.12
273	600280	中央商场	1,296	49,273.92	0.12
274	600888	新疆众和	3,133	49,188.10	0.12
275	600742	一汽富维	1,171	49,135.16	0.12
276	600565	迪马股份	3,249	48,929.94	0.12
277	601231	环旭电子	1,008	48,817.44	0.12
278	600078	澄星股份	3,180	48,463.20	0.12
279	600327	大东方	2,520	48,409.20	0.12
280	601339	百隆东方	1,927	47,963.03	0.12
281	600257	大湖股份	2,640	47,757.60	0.12
282	600310	桂东电力	1,058	47,557.10	0.12
283	600650	锦江投资	1,593	47,423.61	0.12
284	601107	四川成渝	5,180	46,982.60	0.11
285	600162	香江控股	3,616	46,646.40	0.11
286	600716	凤凰股份	2,803	46,333.59	0.11
287	600537	亿晶光电	1,776	46,033.92	0.11
288	601101	昊华能源	3,269	45,406.41	0.11
289	600459	贵研铂业	1,378	45,088.16	0.11
290	600298	安琪酵母	1,340	44,890.00	0.11
291	600987	航民股份	2,404	44,570.16	0.11
292	600532	宏达矿业	1,780	44,500.00	0.11
293	600971	恒源煤电	3,853	44,039.79	0.11
294	600470	六国化工	3,121	43,943.68	0.11
295	601313	江南嘉捷	1,788	43,198.08	0.10
296	600667	太极实业	8,158	42,992.66	0.10
297	603128	华贸物流	1,225	42,593.25	0.10
298	603308	应流股份	1,284	41,973.96	0.10
299	600305	恒顺醋业	1,276	41,495.52	0.10
300	600513	联环药业	1,017	40,893.57	0.10
301	600268	国电南自	2,638	40,783.48	0.10
302	600756	浪潮软件	1,665	40,509.45	0.10
303	600575	皖江物流	9,765	40,134.15	0.10
304	600012	皖通高速	2,331	40,069.89	0.10
305	600119	长江投资	1,105	40,056.25	0.10
306	600995	文山电力	2,750	39,957.50	0.10

307	600467	好当家	3,139	38,798.04	0.09
308	600780	通宝能源	3,206	38,439.94	0.09
309	600566	济川药业	1,185	38,382.15	0.09
310	600657	信达地产	3,557	38,237.75	0.09
311	600997	开滦股份	3,770	38,039.30	0.09
312	600833	第一医药	1,121	38,035.53	0.09
313	600389	江山股份	900	37,737.00	0.09
314	600080	金花股份	1,847	37,604.92	0.09
315	601801	皖新传媒	1,103	37,248.31	0.09
316	600641	万业企业	3,370	37,137.40	0.09
317	600116	三峡水利	1,565	37,012.25	0.09
318	600168	武汉控股	1,968	36,781.92	0.09
319	600563	法拉电子	853	36,781.36	0.09
320	600396	金山股份	3,038	34,633.20	0.08
321	600449	宁夏建材	2,206	34,523.90	0.08
322	601965	中国汽研	2,123	34,328.91	0.08
323	600724	宁波富达	2,864	34,310.72	0.08
324	601789	宁波建工	2,025	34,060.50	0.08
325	600802	福建水泥	2,359	33,780.88	0.08
326	600618	氯碱化工	1,946	33,626.88	0.08
327	600295	鄂尔多斯	2,254	33,584.60	0.08
328	600081	东风科技	1,207	33,301.13	0.08
329	600101	明星电力	1,976	32,959.68	0.08
330	600386	北巴传媒	1,575	32,618.25	0.08
331	600523	贵航股份	1,123	32,522.08	0.08
332	600979	广安爱众	2,624	32,248.96	0.08
333	600743	华远地产	3,729	32,106.69	0.08
334	600054	黄山旅游	1,264	31,941.28	0.08
335	603699	纽威股份	1,004	31,917.16	0.08
336	600568	中珠控股	1,318	31,790.16	0.08
337	600114	东睦股份	1,436	31,592.00	0.08
338	603167	渤海轮渡	1,507	31,300.39	0.08
339	601208	东材科技	2,059	31,296.80	0.08
340	601100	恒立油缸	1,469	31,289.70	0.08
341	600965	福成五丰	1,740	31,093.80	0.08
342	600007	中国国贸	1,555	31,022.25	0.08
343	600785	新华百货	1,022	30,588.46	0.07
344	600983	惠而浦	1,589	30,477.02	0.07
345	600197	伊力特	1,705	30,451.30	0.07

346	600882	华联矿业	2,226	29,872.92	0.07
347	600190	锦州港	2,889	29,670.03	0.07
348	600333	长春燃气	2,464	29,494.08	0.07
349	600378	天科股份	978	28,401.12	0.07
350	600248	延长化建	1,488	28,019.04	0.07
351	601996	丰林集团	1,754	28,011.38	0.07
352	600561	江西长运	1,421	27,681.08	0.07
353	603168	莎普爱思	126	27,532.26	0.07
354	603328	依顿电子	712	27,155.68	0.07
355	600278	东方创业	994	27,136.20	0.07
356	603126	中材节能	1,255	27,108.00	0.07
357	600548	深高速	2,400	26,856.00	0.07
358	603005	晶方科技	415	26,696.95	0.06
359	600218	全柴动力	1,332	25,827.48	0.06
360	600778	友好集团	1,583	25,486.30	0.06
361	600167	联美控股	978	25,193.28	0.06
362	601038	一拖股份	1,359	25,005.60	0.06
363	600828	成商集团	2,763	23,844.69	0.06
364	601199	江南水务	538	22,778.92	0.06
365	603399	新华龙	989	22,529.42	0.05
366	600801	华新水泥	1,502	21,763.98	0.05
367	600897	厦门空港	586	21,482.76	0.05
368	603306	华懋科技	400	21,316.00	0.05
369	603369	今世缘	465	20,501.85	0.05
370	601798	蓝科高新	958	19,916.82	0.05
371	600845	宝信软件	236	19,878.28	0.05
372	601799	星宇股份	387	19,195.20	0.05
373	601636	旗滨集团	1,429	18,791.35	0.05
374	600230	沧州大化	888	16,809.84	0.04
375	600985	雷鸣科化	539	15,275.26	0.04
376	603006	联明股份	301	14,890.47	0.04
377	600403	大有能源	1,443	14,689.74	0.04
378	600258	首旅酒店	656	12,267.20	0.03
379	603009	北特科技	261	12,186.09	0.03
380	600623	双钱股份	162	5,684.58	0.01
381	601158	重庆水务	92	1,280.64	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600660	福耀玻璃	545,790.00	2.40
2	600153	建发股份	421,989.00	1.85
3	601168	西部矿业	409,310.00	1.80
4	600029	南方航空	403,408.00	1.77
5	600755	厦门国贸	398,229.00	1.75
6	601991	大唐发电	385,688.00	1.69
7	600219	南山铝业	373,088.00	1.64
8	600415	小商品城	357,995.00	1.57
9	600881	亚泰集团	350,602.00	1.54
10	600068	葛洲坝	342,643.00	1.51
11	601179	中国西电	339,007.00	1.49
12	600867	通化东宝	338,241.00	1.49
13	600399	抚顺特钢	326,829.00	1.44
14	600138	中青旅	325,734.17	1.43
15	600388	龙净环保	321,559.00	1.41
16	600410	华胜天成	315,818.00	1.39
17	600642	申能股份	309,180.00	1.36
18	600008	首创股份	302,117.00	1.33
19	601333	广深铁路	298,916.00	1.31
20	601106	中国一重	296,669.00	1.30

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	600660	福耀玻璃	810,339.52	3.56
2	600153	建发股份	756,656.01	3.32
3	600029	南方航空	499,638.94	2.19
4	601168	西部矿业	474,538.27	2.08
5	600755	厦门国贸	441,006.22	1.94
6	601991	大唐发电	433,459.65	1.90
7	600415	小商品城	426,049.04	1.87
8	600068	葛洲坝	411,955.32	1.81
9	601106	中国一重	401,605.59	1.76
10	600881	亚泰集团	378,583.09	1.66
11	600410	华胜天成	371,951.09	1.63
12	600008	首创股份	369,295.85	1.62
13	601179	中国西电	363,938.52	1.60
14	601333	广深铁路	357,604.20	1.57
15	601727	上海电气	351,417.97	1.54
16	600388	龙净环保	347,265.97	1.53
17	600005	武钢股份	346,513.51	1.52
18	600642	申能股份	346,150.00	1.52
19	600138	中青旅	335,128.07	1.47
20	600811	东方集团	325,925.26	1.43

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	42,836,577.70
卖出股票收入（成交）总额	48,964,841.46

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 其他资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
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	1,189,225.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,419,218.30
---	----	--------------

8.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.3.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.3.2 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	600575	皖江物流	40,134.15	0.10	重大事项停牌

8.12.4 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 投资组合报告(转型后)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	65,139,435.61	86.66
	其中：股票	65,139,435.61	86.66
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	5,395,850.79	7.18
7	其他资产	4,632,659.05	6.16
8	合计	75,167,945.45	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,013,904.00	2.82
B	采矿业	—	—
C	制造业	38,876,165.52	54.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	491.67	0.00
E	建筑业	437.44	0.00
F	批发和零售业	16,163,915.87	22.64
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,124,090.00	2.97
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	2,029,027.11	2.84
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	3,931,404.00	5.51
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	65,139,435.61	91.22

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)

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	002020	京新药业	156,344	5,245,341.20	7.35
2	002172	澳洋科技	306,528	4,561,136.64	6.39
3	000638	万方发展	142,100	4,341,155.00	6.08

4	600763	通策医疗	80,200	3,931,404.00	5.51
5	300147	香雪制药	144,800	3,621,448.00	5.07
6	002462	嘉事堂	70,200	3,553,524.00	4.98
7	600867	通化东宝	119,500	3,246,815.00	4.55
8	300109	新开源	28,706	2,986,859.30	4.18
9	000516	国际医学	131,870	2,901,140.00	4.06
10	300267	尔康制药	84,200	2,829,120.00	3.96
11	300078	思创医惠	57,400	2,801,120.00	3.92
12	300450	先导智能	24,900	2,474,811.00	3.47
13	002675	东诚药业	42,335	2,371,183.35	3.32
14	002007	华兰生物	49,700	2,186,800.00	3.06
15	603883	老百姓	30,292	2,149,823.24	3.01
16	600645	中源协和	31,211	2,029,027.11	2.84
17	002696	百洋股份	76,400	2,013,904.00	2.82
18	600576	万家文化	69,700	1,895,143.00	2.65
19	300238	冠昊生物	30,670	1,738,068.90	2.43
20	600420	现代制药	33,776	1,410,485.76	1.98
21	603268	松发股份	19,300	1,325,524.00	1.86
22	000705	浙江震元	70,500	1,322,580.00	1.85
23	002421	达实智能	54,000	1,182,600.00	1.66
24	300401	花园生物	38,800	1,107,740.00	1.55
25	600771	广誉远	30,300	968,994.00	1.36
26	300431	暴风科技	9,000	941,490.00	1.32
27	600729	重庆百货	17	550.63	0.00
28	600873	梅花生物	58	530.12	0.00
29	600578	京能电力	81	491.67	0.00
30	600502	安徽水利	32	437.44	0.00
31	600990	四创电子	3	188.25	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002462	嘉事堂	12,220,333.35	17.11
2	600276	恒瑞医药	9,810,613.20	13.74
3	300147	香雪制药	9,462,840.00	13.25

4	300347	泰格医药	8,625,205.44	12.08
5	300109	新开源	8,596,582.45	12.04
6	603883	老百姓	7,079,522.60	9.91
7	600645	中源协和	6,975,907.00	9.77
8	600422	昆药集团	6,532,300.44	9.15
9	600867	通化东宝	6,200,475.28	8.68
10	300244	迪安诊断	5,823,911.85	8.16
11	600420	现代制药	5,700,155.06	7.98
12	002020	京新药业	5,668,036.72	7.94
13	002007	华兰生物	5,632,333.44	7.89
14	002133	广宇集团	5,016,737.00	7.03
15	000705	浙江震元	4,881,218.15	6.84
16	600594	益佰制药	4,819,226.00	6.75
17	600055	华润万东	4,737,003.98	6.63
18	300016	北陆药业	4,569,595.00	6.40
19	002172	澳洋科技	4,540,002.00	6.36
20	002086	东方海洋	4,466,427.95	6.25
21	300078	思创医惠	4,434,903.82	6.21
22	000516	国际医学	4,302,680.96	6.03
23	600521	华海药业	4,234,960.20	5.93
24	300049	福瑞股份	4,120,495.66	5.77
25	300267	尔康制药	4,077,661.80	5.71
26	002262	恩华药业	3,879,779.19	5.43
27	600763	通策医疗	3,869,652.95	5.42
28	300450	先导智能	3,814,032.00	5.34
29	300015	爱尔眼科	3,775,306.52	5.29
30	300254	仟源医药	3,762,986.70	5.27
31	002675	东诚药业	3,611,053.00	5.06
32	600518	康美药业	3,578,739.00	5.01
33	300358	楚天科技	3,571,563.00	5.00
34	002030	达安基因	3,527,824.52	4.94
35	002433	太安堂	3,482,505.00	4.88
36	300238	冠昊生物	3,461,049.89	4.85
37	000638	万方发展	3,375,288.00	4.73
38	002137	麦达数字	3,207,190.98	4.49
39	000700	模塑科技	3,105,774.00	4.35

40	600587	新华医疗	3,028,128.00	4.24
41	000502	绿景控股	2,936,777.50	4.11
42	600436	片仔癀	2,835,405.69	3.97
43	300171	东富龙	2,753,868.72	3.86
44	000078	海王生物	2,751,876.00	3.85
45	603998	方盛制药	2,710,525.50	3.80
46	600122	宏图高科	2,697,686.68	3.78
47	300009	安科生物	2,635,863.02	3.69
48	000671	阳光城	2,606,994.25	3.65
49	600713	南京医药	2,572,149.00	3.60
50	002693	双成药业	2,522,852.20	3.53
51	603939	益丰药房	2,488,540.00	3.49
52	300401	花园生物	2,450,224.00	3.43
53	600818	中路股份	2,435,349.00	3.41
54	002173	千足珍珠	2,399,391.00	3.36
55	600519	贵州茅台	2,379,576.00	3.33
56	300206	理邦仪器	2,321,289.68	3.25
57	600836	界龙实业	2,320,860.00	3.25
58	601377	兴业证券	2,303,375.00	3.23
59	000423	东阿阿胶	2,292,196.00	3.21
60	002699	美盛文化	2,260,280.00	3.17
61	600976	健民集团	2,213,208.80	3.10
62	600479	千金药业	2,208,871.00	3.09
63	002022	科华生物	2,165,916.00	3.03
64	600630	龙头股份	2,161,716.00	3.03
65	600085	同仁堂	2,141,323.00	3.00
66	002626	金达威	2,129,111.00	2.98
67	600129	太极集团	2,064,892.00	2.89
68	600687	刚泰控股	2,063,559.00	2.89
69	601607	上海医药	2,047,533.50	2.87
70	000623	吉林敖东	2,040,775.00	2.86
71	002304	洋河股份	1,970,462.00	2.76
72	002680	黄海机械	1,970,005.00	2.76
73	300072	三聚环保	1,950,822.00	2.73
74	002450	康得新	1,936,738.51	2.71
75	300031	宝通科技	1,933,064.00	2.71

76	600576	万家文化	1,923,515.80	2.69
77	002696	百洋股份	1,864,916.65	2.61
78	002551	尚荣医疗	1,864,422.50	2.61
79	000333	美的集团	1,835,430.00	2.57
80	603989	艾华集团	1,828,103.66	2.56
81	600812	华北制药	1,801,254.00	2.52
82	000567	海德股份	1,783,653.00	2.50
83	300041	回天新材	1,740,776.94	2.44
84	600771	广誉远	1,717,474.00	2.41
85	002644	佛慈制药	1,693,187.00	2.37
86	002727	一心堂	1,691,564.00	2.37
87	002223	鱼跃医疗	1,691,251.70	2.37
88	600511	国药股份	1,687,416.09	2.36
89	300166	东方国信	1,668,844.90	2.34
90	002332	仙琚制药	1,668,664.00	2.34
91	300242	明家科技	1,644,273.00	2.30
92	601988	中国银行	1,629,880.00	2.28
93	000411	英特集团	1,607,457.00	2.25
94	002390	信邦制药	1,605,894.00	2.25
95	000963	华东医药	1,597,902.80	2.24
96	000722	湖南发展	1,542,200.00	2.16
97	000028	国药一致	1,533,301.80	2.15
98	300431	暴风科技	1,468,436.00	2.06
99	600048	保利地产	1,466,860.00	2.05
100	300233	金城医药	1,446,999.00	2.03
101	600833	第一医药	1,441,833.00	2.02
102	300298	三诺生物	1,435,539.00	2.01

注：本报告期内，累计买入股票成本总额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	9,727,223.70	13.62
2	300347	泰格医药	8,100,932.77	11.34

3	002462	嘉事堂	7,261,114.76	10.17
4	600422	昆药集团	6,187,182.19	8.66
5	300109	新开源	6,139,381.58	8.60
6	300244	迪安诊断	5,801,484.18	8.12
7	300147	香雪制药	5,342,942.15	7.48
8	600645	中源协和	5,140,957.40	7.20
9	300016	北陆药业	4,861,512.09	6.81
10	002133	广宇集团	4,803,778.00	6.73
11	002086	东方海洋	4,790,338.68	6.71
12	600055	华润万东	4,620,554.46	6.47
13	603883	老百姓	4,167,842.92	5.84
14	300015	爱尔眼科	3,856,008.09	5.40
15	300254	仟源医药	3,836,077.00	5.37
16	000705	浙江震元	3,833,257.98	5.37
17	002137	麦达数字	3,735,584.92	5.23
18	600867	通化东宝	3,688,802.77	5.17
19	600594	益佰制药	3,683,177.60	5.16
20	000502	绿景控股	3,660,953.66	5.13
21	002030	达安基因	3,640,211.20	5.10
22	600521	华海药业	3,562,731.16	4.99
23	002433	太安堂	3,458,828.41	4.84
24	600420	现代制药	3,375,341.00	4.73
25	300049	福瑞股份	3,360,655.30	4.71
26	002262	恩华药业	3,341,575.86	4.68
27	000700	模塑科技	3,245,077.44	4.54
28	002007	华兰生物	3,181,046.00	4.45
29	300171	东富龙	3,130,977.18	4.38
30	600587	新华医疗	3,082,393.20	4.32
31	600518	康美药业	2,927,563.28	4.10
32	603998	方盛制药	2,911,603.90	4.08
33	603939	益丰药房	2,803,974.45	3.93
34	000671	阳光城	2,728,597.37	3.82
35	300009	安科生物	2,678,172.00	3.75
36	002173	千足珍珠	2,653,443.00	3.72
37	300358	楚天科技	2,583,230.15	3.62
38	300206	理邦仪器	2,578,839.96	3.61
39	600713	南京医药	2,576,609.79	3.61
40	600436	片仔癀	2,559,848.12	3.58

41	000078	海王生物	2,559,643.40	3.58
42	600122	宏图高科	2,550,134.53	3.57
43	600630	龙头股份	2,355,915.12	3.30
44	002693	双成药业	2,349,871.00	3.29
45	300078	思创医惠	2,310,025.02	3.24
46	002699	美盛文化	2,257,654.65	3.16
47	600818	中路股份	2,248,959.00	3.15
48	601377	兴业证券	2,231,678.02	3.13
49	600519	贵州茅台	2,221,806.00	3.11
50	002551	尚荣医疗	2,214,666.92	3.10
51	002680	黄海机械	2,106,852.50	2.95
52	600976	健民集团	2,102,011.32	2.94
53	000623	吉林敖东	2,099,887.00	2.94
54	002626	金达威	2,065,792.00	2.89
55	300072	三聚环保	2,059,029.65	2.88
56	000423	东阿阿胶	2,018,119.00	2.83
57	300031	宝通科技	2,004,224.37	2.81
58	002450	康得新	1,958,098.27	2.74
59	600836	界龙实业	1,946,954.00	2.73
60	300238	冠昊生物	1,930,608.28	2.70
61	601607	上海医药	1,908,467.00	2.67
62	600085	同仁堂	1,887,932.14	2.64
63	300242	明家科技	1,873,058.00	2.62
64	002727	一心堂	1,837,145.00	2.57
65	002223	鱼跃医疗	1,832,254.23	2.57
66	000722	湖南发展	1,816,737.64	2.54
67	000333	美的集团	1,793,595.42	2.51
68	300450	先导智能	1,789,243.00	2.51
69	000567	海德股份	1,748,400.00	2.45
70	002304	洋河股份	1,740,602.00	2.44
71	603989	艾华集团	1,736,431.50	2.43
72	000516	国际医学	1,707,341.50	2.39
73	600511	国药股份	1,704,731.44	2.39
74	002332	仙琚制药	1,694,232.04	2.37
75	600687	刚泰控股	1,629,602.40	2.28
76	300166	东方国信	1,585,220.00	2.22
77	000963	华东医药	1,580,454.44	2.21
78	601988	中国银行	1,576,426.00	2.21

79	002022	科华生物	1,522,353.00	2.13
80	002390	信邦制药	1,522,095.00	2.13
81	300298	三诺生物	1,512,860.40	2.12
82	600129	太极集团	1,461,968.75	2.05

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	469,438,204.38
卖出股票收入（成交）总额	433,376,356.02

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	108,791.93
2	应收证券清算款	1,942,441.02
3	应收股利	—
4	应收利息	1,555.00
5	应收申购款	2,579,871.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,632,659.05

8.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.3 期末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	002020	京新药业	5,245,341.20	7.35	重大事项停牌

8.12.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,413	15,084.66	3,007,502.09	14.11%	18,307,117.40	85.89%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,398.96	0.0066%

9.3 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 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	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
10,485	4,518.48	3,729,296.81	7.87%	43,646,938.52	92.13%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	1,488.56	0.0031%

持有本基金		
-------	--	--

9.3 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

§ 10 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
报告期期初基金份额总额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	102,659,584.36
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	76,597,968.52
基金合同生效日起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	47,376,235.33

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金以通讯方式召开了中海上证 380 指数证券投资基金基金份额持有人大会，并表决通过了《关于中海上证 380 指数证券投资基金转型相关事项的议案》，该次基金份额持有人大会决议自 2015 年 6 月 9 日起生效。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人免去俞忠华先生副总经理职务。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期内已预提审计费 70,000.00 元，截至 2015 年 12 月 31 日暂未支付。该事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	2	105,937,855.12	13.06%	96,991.95	13.40%	-
招商证券	1	104,944,749.84	12.94%	97,735.40	13.50%	-
国联证券	1	102,420,347.88	12.63%	93,469.43	12.91%	-
海通证券	2	89,376,296.01	11.02%	65,360.80	9.03%	-
国金证券	1	86,757,992.48	10.70%	80,773.70	11.16%	-
东方证券	1	62,862,541.03	7.75%	58,489.66	8.08%	-
长江证券	1	52,035,524.51	6.42%	47,583.67	6.57%	-
方正证券	1	36,844,389.32	4.54%	26,528.70	3.66%	-
中泰证券	2	34,945,893.87	4.31%	32,526.76	4.49%	-
安信证券	2	32,994,227.68	4.07%	30,727.61	4.24%	-
广发证券	1	26,979,241.85	3.33%	24,928.82	3.44%	-
华泰证券	2	18,935,772.47	2.33%	17,634.95	2.44%	-
国泰君安	2	17,354,193.15	2.14%	16,161.90	2.23%	-

中信建投	2	14,505,427.69	1.79%	12,561.35	1.74%	-
东兴证券	1	10,587,014.41	1.31%	9,859.73	1.36%	-
平安证券	1	10,366,247.33	1.28%	9,654.09	1.33%	-
国信证券	1	3,165,426.60	0.39%	2,947.85	0.41%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中建银投证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演，联合调研和各类投资研讨会。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报风控稽核部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中建银投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金未租用证券公司交易单元进行除股票交易之外的其他证券投资。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	44,967,225.49	48.98%	40,939.06	48.98%	-
国金证券	1	22,529,953.22	24.54%	20,511.67	24.54%	-
国联证券	1	14,035,217.14	15.29%	12,778.16	15.29%	-
光大证券	1	5,019,020.34	5.47%	4,569.10	5.47%	-
申万宏源	1	2,979,316.98	3.25%	2,712.71	3.25%	-
海通证券	2	909,382.62	0.99%	828.31	0.99%	-
国泰君安	2	812,377.68	0.88%	739.67	0.89%	-
东北证券	2	548,925.69	0.60%	499.43	0.60%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

中银国际	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中建银投证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演，联合调研和各类投资研讨会。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报风控稽核部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

高华证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中建银投证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金未租用证券公司交易单元进行除股票交易之外的其他证券投资。

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 6 月 9 日
2	中海基金管理有限公司关于中海上证 380 指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报	2015 年 6 月 10 日
3	中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同	中海基金网站	2015 年 6 月 10 日
4	中海医疗保健主题股票型证券投资基金托管协议	中海基金网站	2015 年 6 月 10 日

5	中海医疗保健主题股票型证券投资基金招募说明书	中国证券报	2015 年 6 月 10 日
6	中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同内容摘要	中国证券报	2015 年 6 月 10 日
7	关于中海医疗保健主题股票型证券投资基金参与销售机构基金网上交易申购费率优惠及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 6 月 10 日
8	关于中海医疗保健主题股票型证券投资基金实行网上直销和官方淘宝店交易费率优惠的公告	中国证券报	2015 年 6 月 10 日
9	中海基金管理有限公司关于中海医疗保健主题股票型证券投资基金转换补差费率优惠的公告	中国证券报	2015 年 6 月 10 日
10	中海基金管理有限公司关于中海医疗保健主题股票型证券投资基金参与申万宏源证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 6 月 11 日
11	中海基金管理有限公司关于中海医疗保健主题股票型证券投资基金参与中国农业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	2015 年 6 月 13 日
12	中海基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的	中国证券报	2015 年 6 月 17 日

	公告		
13	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 6 月 26 日
14	中海基金管理有限公司澄清公告	中国证券报	2015 年 6 月 27 日
15	中海医疗保健主题证券投资基金半年度最后一日净值公告	中国证券报	2015 年 7 月 1 日
16	关于在中海基金官方京东店开展直销业务的公告	中国证券报	2015 年 7 月 3 日
17	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 7 月 7 日
18	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与京东基金费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 7 月 8 日
19	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 7 月 11 日
20	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 7 月 15 日
21	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增中信期货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	2015 年 7 月 15 日
22	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提	中国证券报	2015 年 7 月 16 日

	示性公告		
23	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 7 月 18 日
24	中海医疗保健主题证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	中国证券报	2015 年 7 月 20 日
25	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泰诚财富基金销售（大连）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	2015 年 7 月 28 日
26	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与上海浦东发展银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 7 月 30 日
27	中海基金管理有限公司关于旗下基金不再参与销售机构定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 8 月 1 日
28	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 8 月 4 日
29	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增平安银行股份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	2015 年 8 月 6 日
30	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司基金申购及定期定额	中国证券报	2015 年 8 月 6 日

	投资费率优惠活动的公告		
31	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与第一创业证券股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 8 月 11 日
32	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与京东基金费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 8 月 14 日
33	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西证券股份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	2015 年 8 月 19 日
34	中海基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	中国证券报	2015 年 8 月 25 日
35	中海医疗保健主题证券投资基金 2015 年半年度报告	中海基金网站	2015 年 8 月 26 日
36	中海医疗保健主题证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	中国证券报	2015 年 8 月 26 日
37	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆金所资产管理有限公司为销售机构的公告	中国证券报	2015 年 9 月 16 日
38	中海基金管理有限公司关于旗下基金参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 9 月 23 日
39	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增中国国际金融股份有限公司为销售机构并开通基	中国证券报	2015 年 9 月 25 日

	金转换业务的公告		
40	中海基金管理有限公司关于旗下基金参加华宝证券有限责任公司费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 9 月 26 日
41	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券有限责任公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 10 月 16 日
42	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京乐融多源投资咨询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	2015 年 10 月 19 日
43	中海基金管理有限公司关于旗下基金参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 10 月 20 日
44	中海基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报	2015 年 10 月 20 日
45	中海医疗保健主题证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	中国证券报	2015 年 10 月 24 日
46	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 10 月 31 日
47	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增大泰金石投资管理有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报	2015 年 11 月 3 日

48	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳富济财富管理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	2015 年 11 月 6 日
49	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 11 月 7 日
50	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报	2015 年 11 月 11 日
51	中海基金管理有限公司关于旗下基金参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 11 月 13 日
52	中海基金管理有限公司关于开通中信银行卡（借记卡）、大连银行卡（借记卡）、广发银行卡（借记卡）网上直销业务的公告	中国证券报	2015 年 11 月 13 日
53	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增珠海盈米财富管理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	2015 年 11 月 17 日
54	中海基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证券报	2015 年 11 月 27 日
55	中海基金管理有限公司关于旗	中国证券报	2015 年 11 月 30 日

	下基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告		
56	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与京东基金费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 12 月 4 日
57	关于新增基金参与中信银行卡（借记卡）、大连银行卡（借记卡）、广发银行卡（借记卡）网上交易费率优惠的公告	中国证券报	2015 年 12 月 7 日
58	中海基金管理有限公司关于旗下基金参加上海利得基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 12 月 7 日
59	中海基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报	2015 年 12 月 8 日
60	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 12 月 22 日
61	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 12 月 23 日
62	中海基金管理有限公司关于旗下基金参加浙江金观诚财富管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 12 月 24 日
63	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与中国农业银行基金组合申购及定投费率优惠活动	中国证券报	2015 年 12 月 30 日

	的公告		
64	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增联讯证券股份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	2015 年 12 月 30 日
65	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 12 月 31 日
66	中海基金管理有限公司关于旗下基金调整开放时间的公告	中国证券报	2015 年 12 月 31 日

11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中海基金管理有限公司旗下基金更换会计师事务所的公告	中国证券报	2015 年 1 月 5 日
2	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	2015 年 1 月 10 日
3	中海上证 380 指数证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报	2015 年 1 月 20 日
4	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	2015 年 1 月 28 日
5	中海基金管理有限公司 关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 3 月 4 日
6	中海基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金赎回、转换 及账户最低保留份额	中国证券报	2015 年 3 月 6 日

	限制等业务规则的公告		
7	中海上证 380 指数证券投资基金 2015 年分红公告	中国证券报	2015 年 3 月 18 日
8	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	2015 年 3 月 26 日
9	中海上证 380 指数证券投资基金 2014 年年度报告摘要	中国证券报	2015 年 3 月 27 日
10	中海上证 380 指数证券投资基金 2014 年年度报告	中海基金网站	2015 年 3 月 27 日
11	中海基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报	2015 年 3 月 27 日
12	中海上证 380 指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 1 号）	中国证券报	2015 年 4 月 20 日
13	中海上证 380 指数证券投资基金招募说明书(2015 年第 1 号)	中海基金网站	2015 年 4 月 20 日
14	中海上证 380 指数证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报	2015 年 4 月 22 日
15	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 4 月 23 日
16	中海基金管理有限公司关于以通讯方式召开中海上证 380 指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报	2015 年 4 月 25 日
17	中海基金管理有限公司关于以	中国证券报	2015 年 4 月 27 日

	通讯方式召开中海上证 380 指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告		
18	中海基金管理有限公司关于以通讯方式召开中海上证 381 指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报	2015 年 4 月 28 日
19	中海基金管理有限公司关于恢复对旗下基金持有的长期停牌股票“豫园商城”进行市价估值的公告	中国证券报	2015 年 4 月 30 日
20	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 5 月 6 日
21	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增中期资产管理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	2015 年 5 月 11 日
22	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 5 月 20 日
23	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 5 月 21 日
24	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江金观诚财富管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资	中国证券报	2015 年 5 月 22 日

	业务的公告		
25	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 5 月 23 日
26	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与中国农业银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 5 月 29 日
27	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	中国证券报	2015 年 6 月 1 日
28	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报	2015 年 6 月 2 日
29	中海基金管理有限公司关于开通工商银行卡（借记卡）、农业银行卡（借记卡）、浦发银行卡（借记卡）及兴业银行卡（借记卡）APP 直销业务的公告	中国证券报	2015 年 6 月 4 日
30	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海汇付金融服务有限公司为销售机构并开通基金转换投资业务的公告	中国证券报	2015 年 6 月 6 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海上证 380 指数证券投资基金的文件
- 2、中海上证 380 指数证券投资基金基金合同、中海医疗保健主题股票型证券投资基金合同

- 3、中海上证 380 指数证券投资基金托管协议、中海医疗保健主题股票型证券投资基金协议
- 4、中海上证 380 指数证券投资基金财务报表及报表附注、中海医疗保健主题股票型证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司
2016 年 3 月 25 日