

中海上证380指数证券投资基金

2013 第二季度报告

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年7月18日

重要提示
基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金过往业绩并不预示其未来表现,投资者有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务资料未经审计。
本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

基金产品概况
基金名称:中海上证380指数
基金代码:390011

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年3月7日
报告期末基金份额总额:67,074,872.62份

投资目标
本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险控制手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于0.35%,半年跟踪误差力求控制在4%以内,以实现与上证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。

业绩比较基准
上证380指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%

风险收益特征
本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益:56,490.89
2.本期利润:-4,540,695.02
3.加权平均基金份额本期利润:-0.0591
4.期末基金份额净值:58,140,493.47

3.2 基金净值表现
阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④

过去三个月 -8.35% 1.28% -9.04% 1.30% 0.69% -0.02%
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按相关法规规定,本基金自基金合同2012年3月7日生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 在本基金的基金经理任期

陈明强先生,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、中科院合肥研究院项目主管、平安资产管理公司项目经理、2007年10月进入本公司工作,曾任基金经理、基金工程总监,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,自2012年3月7日起任中海上证380指数证券投资基金基金经理。

4.2 基金管理人及基金托管人对外披露的任期内履行职责情况
注:本基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

4.3 公平交易专项说明
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易进行了全面检查。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4月,市场一路震荡,随后展开反弹。3月,市场震荡上行,中盘大盘蓝筹,尤其是创业板表现抢眼。6月,在流动性宽松预期的推动下,市场出现明显的修复行情,大盘蓝筹个股表现突出。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.867元,累计净值0.867元。报告期内本基金净值增长率为-8.35%,高于业绩比较基准0.69个百分点。

4.5 投资组合报告
4.5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 54,606,586.46 93.40
其中:股票 54,606,586.46 93.40
2 固定收益投资 -- --
其中:债券 -- --
资产支持证券 -- --
3 金融衍生品投资 -- --
4 买入返售金融资产 -- --
其中:买断式回购的买入返售金融资产 -- --
5 银行存款和结算备付金合计 3,542,448.00 6.06
6 其他资产 316,248.31 0.54
7 合计 58,465,282.77 100.00

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.1.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林牧渔 -- --
B 医药生物 12,500,530.22 7.20
C 信息技术 30,889,483.00 17.78
D 电力、热力、燃气及生产供应 -- --
E 建筑业 4,773,434.85 2.75
F 批发和零售业 -- --
G 交通运输、仓储和邮政业 1,960,627.68 1.13
H 住宿和餐饮业 -- --
I 信息传输、软件和信息技术服务业 2,063,440.08 1.19
J 金融业 98,928,352.22 56.96
K 房地产业 3,277,494.66 1.89
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 文化、体育和娱乐业 -- --
Q 卫生和社会工作 -- --
R 教育 -- --
S 综合 3,282,716.16 1.89
合计 157,676,078.87 90.78

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600016 兴业银行 636,633 9,403,069.41 5.41
2 600000 浦发银行 942,171 7,801,175.88 4.49
3 601128 交通银行 1,653,026 6,727,815.82 3.87
4 600037 海通证券 671,087 6,202,487.66 3.63
5 600018 中国平安 282,235 9,810,488.60 7.43
6 601166 兴业银行 636,633 9,403,069.41 5.41
7 600000 浦发银行 942,171 7,801,175.88 4.49
8 601128 交通银行 1,653,026 6,727,815.82 3.87
9 600037 海通证券 671,087 6,202,487.66 3.63
10 600018 中国平安 282,235 9,810,488.60 7.43

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110003 11国债零二 200,000 20,704,551.20 14.45
2 126019 09央行票据 120,520 10,974,551.20 7.66
3 128263 12国债非转 100,000 10,369,000.00 7.24
4 118100 11国债非转 100,000 10,149,000.00 7.09
5 112101 12安泰债 100,000 10,060,000.00 7.02

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 96,256.27
2 应收证券清算款 597,684.28
3 应收股利 660,660.04
4 应收利息 1,069.21
5 其他应收款 57,009.49
6 其他 7,495.00
7 待处理资产 -- --
8 其他 -- --
9 合计 1,355,579.29

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.33 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.40 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.42 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.43 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.46 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.48 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.49 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.50 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.51 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.52 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.54 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.55 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.56 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.57 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.58 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.59 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.60 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.61 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.62 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.63 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.64 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.66 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.67 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.69 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.70 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.71 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.72 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.73 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.74 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.75 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.76 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.78 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.79 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.80 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.81 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.82 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.83 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.84 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.85 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.86 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.87 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.88 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.89 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.90 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.91 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.92 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.93 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.94 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.95 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.96 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.97 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.98 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.99 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.100 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.101 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.102 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.103 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.104 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.105 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.106 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.107 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.108 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.109 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.110 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.111 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.112 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.113 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.114 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.115 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.116 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.117 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.118 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.119 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.120 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.121 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.122 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.123 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.124 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.125 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.126 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.127 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.128 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.129 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.130 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.131 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.132 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.133 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.134 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.135 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.136 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。