

中海上证380指数证券投资基金

[2012]第四季度报告

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1月22日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 中海上证380指数
基金主代码 399011
交易代码 399011
基金运作方式 货币型开放式
基金合同生效日 2012年3月7日
报告期末基金份额总额 87,068,082.65份

投资目标 本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险控制手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于0.35%，年跟踪误差力争在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指数中的组成及权重构建股票投资组合，以尽可能地跟踪上证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的调整。当期成份股发生变化、成份股出现停牌等情况时，本基金将根据中国证监会允许的范围内，采取合理措施，如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内。

1. 股票投资策略：本基金将完全复制指数的方法，根据上证380指数成份股及其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市场变化，并利用债券性价比、进行个券选择、同时考虑债券的流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

业绩比较基准 上证380指数收益率×95%+商业银行同期存款利率(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 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -2,860,358.31

2.本期利润 1,085,626.18

3.加权平均基金份额本期利润 0.0117

4.期末基金份额净值 78,009,240.10

5.期末基金份额净值 0.896

注1:本期指2012年10月1日至2012年12月31日，上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，例如：开放式基金的申购、赎回费，计入费用后实际收益水平将有所降低。

注2:本期利润为本期实现收益加上本期利润。

注3:本基金合同生效日2012年3月7日起至被评估点不满足。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

陈明星 金融工程总监、本基金、中海上证380指数证券投资基金基金经理 2012年3月7日 - 陈明星先生，中国科学技术大学金融管理学硕士，历任安徽省政府公路建设投资有限公司、中科院上海高等研究院、平安资产管理有限公司分析师、研究员、项目经理、金融产品分析师、金融助理经理，现任金融工程总监。2010年3月至今任中海上证380指数增强型证券投资基金基金经理，2012年3月至今任中海上证380指数证券投资基金基金经理。

注1:上述任职日期、离任日期根据本基金经理人对外披露的任免日期填写。

注2:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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取利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法操纵、内幕交易、利益输送等违法违规行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易执行的情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理后分析环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易及投资管理活动的公平交易制度进行定期评估和分析，对不同投资组合的公平交易执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.2 下至交易所的公平交易制度

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.3 公司投资决策制度

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.31 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.32 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.33 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.34 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.35 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.36 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.37 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.38 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.39 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.40 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.41 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.42 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.43 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.44 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.45 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.46 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.47 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.48 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.49 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.50 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.51 公平交易制度的执行情况

对不同投资组合的公平交易制度执行情况进行定期报告，对异常交易行为进行专项分析。

4.3.52 公平交易制度的执行情况