中海上证 380 指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2012 年第 1 号)

本基金基金合同于2012年3月7日生效。

重要提示

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2012年9月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人为中海基金管理有限公司,基本信息如下:
名称:中海基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
邮政编码:200120
成立日期:2004年3月18日
法定代表人:黄鹏
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:证监基金字[2004]24号
组织形式:有限责任公司(中外合资)
注册资本:壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元人民币
存续期间:持续经营
联系人:兰嵘
联系电话:021-38429808
股东名称及其出资比例:

中海信托股份有限公司	41.591%
国联证券股份有限公司	33.409%
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司	25.000%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

陈浩鸣先生,董事长。中央财经大学硕士,高级经济师。现任中海信托股份有限公司总裁。历任海洋石油开发工程设计公司经济师,中国海洋石油总公司财务部保险处主管、资产处处长,中海石油投资控股有限公司总经理,中海信托股份有限公司副总裁、中海基金管理有限公司总经理。

成赤先生,董事。中国人民大学硕士。现任中国海洋石油总公司资金管理部总经理。历任中国海洋石油总公司计划资金部融资处处长、中国海洋石油有限公司资金融资部副总监。

胡旭鹏先生,董事。华东政法大学硕士。现任中海信托股份有限公司副总裁兼首席风险官。历任蚌埠市人民检察院助理检察员,上海浦东发展银行总行资产保全部法务专员,中海信托股份有限公司法务主管、风险管理部代经理、风险管理部经理、合规总监兼风险管理总部总经理、副总裁兼合规总监兼风险管理总部总经理、副总裁兼合规总监。

彭焰宝先生,董事。清华大学学士。现任国联证券股份有限公司副总裁。历任国联证券股份有限公司(原无锡证券)交易员、投资经理、投资部副总经理,国联投资管理有限公司投资部总经理,中海基金管理有限公司投资总监(期间曾兼任中海优质成长证券投资基金基金经理)、风险管理部总经理兼风控总监,国联证券股份有限公司总裁助理兼证券投资部总经理。

江志强先生,董事。东南大学硕士。现任国联证券股份有限公司副总裁兼资产管理部总经理。历任国联证券股份有限公司(原无锡证券)上海海伦路证券营业部交易员、证券投资部投资主管、上海邯郸路证券营业部副总经理、总经理、无锡县前东街证券营业部总经理、无锡人民东路证券营业部总经理、财富管理中心总经理、无锡华夏南路证券营业部总经理。

TAY SOO MENG(郑树明)先生,董事。新加坡国籍。新加坡国立大学学士。现任爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监。历任新加坡Coopers & Lybrand审计师,法国兴业资产管理集团行政及财务部门主管、董事兼营运总监(亚太区,日本除外)、董事总经理兼营运总监(亚太区,日本除外)、董事总经理兼新加坡执行长。

李维森先生,独立董事。澳大利亚悉尼大学博士。现任复旦大学经济学院经济学教授、博士生导师、副院长。历任山东社会科学院《东岳论丛》编辑部编辑、澳大利亚麦角理大学经济学讲师。

陈道富先生,独立董事。中国人民银行金融研究所硕士。现任国务院发展研究中心金融研究所综合研究室主任。曾任中关村证券公司总裁助理。

WEIDONG WANG(王卫东)先生,独立董事。美国国籍。芝加哥大学博士。现任美国德杰律师事务所合伙人。历任Sidley Austin(盛德律师事务所)芝加哥总部律师、北京大学国家发展研究院国际MBA项目访问教授、北京德恒律师事务所合伙人。

2、监事会成员

朱恩惠女士,监事长。本科,会计师。现任中海信托股份有限公司运营总监兼信托事务管理总部总经理、托管部部门经理。曾任职于中信上海信托投资公司财务部。

Denis LEFRANC(陆云飞)先生,监事。法国国籍。学士。现任爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司亚洲副执行总监。历任法国期货市场监管委员会审计师,法国兴业银行法律顾问、资本市场及资产管理法务部门副主管,法国兴业资产管理集团法遵主管及法律顾问,华宝兴业基金管理有限公司常务副总裁,法国兴业资产管理集团亚太区执行长,东方汇理资产管理香港有限公司北亚区副执行长。

王红女士,职工监事。研究生毕业。现任中海基金管理有限公司总经理助理兼北京分公司总经理。历任辽宁省针棉毛织品进出口公司储运科科员、北京中盛纸业有限公司总经理助理、北京大地投资有限公司总经理助理兼市场营销部经理、湘财证券有限责任公司北京办事处主任。2007年1月进入本公司工作,历任北京管理总部副总经理、北京分公司总经理。2009年1月至今任本公司总经理助理兼北京分公司总经理。

3、高级管理人员

黄鹏先生,总经理。复旦大学金融学专业硕士。历任上海市新长宁(集团)有限公司销售经理,上海浦东发展银行股份有限公司大连分行行长秘书,中海信托股份有限公司综合管理部经理助理、投资管理部经理、风控委员会委员。2007年10月进入本公司工作,曾任董事会秘书、总经理助理兼营销中心总经理,2011年10月至今任本公司总经理。

宋宇先生,副总经理。复旦大学数理统计专业学士,经济师。历任无锡市统计局秘书,国联证券股份有限公司营业部副经理、发行调研部副经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月进入本公司工作,曾任本公司督察长。2010年12月至今任本公司副总经理(期间2011年1月至2011年10月兼任本公司代理总经理)。

俞忠华先生,副总经理。华东师范大学世界经济专业硕士。历任申银万国证券股份有限公司(原上海万国证券公司)国际业务部经理,国泰君安证券股份有限公司(原君安证券公司)国际业务部总经理,瑞士联盟银行(UBS)上海代表处副代表、授权官员,美国培基证券公司上海代表处首席代表、副总裁,霸菱亚洲投资公司执行董事,今日资本集团合伙人,光大证券股份有限公司销售交易部总经理、研究所常务副所长、资产管理总部总经理、证券投资部董事总经理、研究所所长。2012年3月进入本公司工作,曾任公司总经理助理,现任公司副总经理兼投研中心总经理、投资总监。2012年7月至今任中海优质成长证券投资基金基金经理。

朱冰峰先生,督察长。华东政法学院国际经济法专业学士。历任长江律师事务所律师、华虹(集团)有限公司法律顾问、锦天城律师事务所律师、上海证监局副处级职务。2009年10月进入本公司工作,曾任总经理助理。2010年12月至今任本公司督察长。

4、基金经理

陈明星先生,中国科学技术大学金融学专业硕士。历任安徽省公路运输管理局职员、中科大上海研究发展中心有限公司项目经理、平安资产管理有限公司分析师。2007年10月进入本公司工作,曾任金融工程分析师兼基金经理助理,现任金融工程总监。2010年3月至今任中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理,2012年3月至今任中海上证380指数证券投资基金基金经理。

5、历任基金经理

本基金基金合同于2012年3月7日生效,历任基金经理如下表:

基金经理姓名	管理本基金时间
陈明星	2012年3月7日-至今

6、投资决策委员会成员

黄鹏先生,主任委员。现任中海基金管理有限公司总经理。
俞忠华先生,委员。现任中海基金管理有限公司副总经理兼投研中心总经理、投资总监、基金经理。
骆泽斌先生,委员。现任中海基金管理有限公司研究总监、基金经理。
陈明星先生,委员。现任中海基金管理有限公司金融工程总监、基金经理。
江小震先生,委员。现任中海基金管理有限公司固定收益小组负责人、基金经理。
许定晴女士,委员。现任中海基金管理有限公司基金经理。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币349,018,545,827元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

三、相关服务机构

(一)销售机构

1、直销机构:

(1)中海基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
法定代表人:黄鹏
电话:021-68419518
传真:021-68419328
联系人:曾智勇
客户服务电话:400-888-9788(免长途话费)或021-38789788
公司网址:www.zhfund.com

(2)中海基金管理有限公司北京分公司
住所:北京市西城区复兴门内大街158号远洋大厦F211B单元
办公地址:北京市西城区复兴门内大街158号远洋大厦F211B单元
负责人:王红
电话:010-66493583
传真:010-66425292
联系人:邹意
客户服务电话:400-888-9788(免长途话费)
公司网站:www.zhfund.com

2、代销机构:

(1)中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
传真:010-66107738
客户服务电话:95588
公司网址:www.icbc.com.cn

(2)中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:蒋超良
联系人:刘一宁
传真:010-85109219
客户服务电话:95599
公司网址:www.abchina.com

(3)中国银行股份有限公司
住所:北京西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
传真:(010)66594946
客户服务电话:95566
公司网站:www.boc.cn

(4)交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
公司网址:www.bankcomm.com

(5)中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
联系电话:010-67596093
联系人:何奕
客户服务电话:95533
公司网址:www.ccb.com

(6)招商银行股份有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:傅育宁
传真:0755-83195049
联系人:邓炯鹏
客户服务电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

(7)中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:田国立
客户服务电话:95558
公司网址:bank.ecitic.com

(8)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:010-58560666
传真:010-57092611
联系人:董云巍
客户服务电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn

(9)上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:021-61618888
传真:021-63604199
联系人:高天、于慧
客户服务电话:95528
公司网址:www.spdb.com.cn

(10)温州银行股份有限公司
住所:温州市车站大道196号
办公地址:温州市车站大道196号
法定代表人:邢增福
联系电话:0577-88990082
传真:0577-88995217
联系人:林波
客户服务电话:96699(浙江省内)、962699(上海地区)、0577-96699(其他地区)
公司网址:www.wzbank.cn

(11)华夏银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
联系人:郑鹏
电话:010-85238667
客户服务电话:95577
公司网站:www.hxb.com.cn

(12)上海农村商业银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区浦东大道981号
办公地址:上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15层
法定代表人:胡平西
联系人:吴海平
电话:(021)38576666
传真:(021)50105124
客户服务电话:(021)962999
公司网站:www.srcb.com

(13)国联证券股份有限公司
住所:无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市太湖新城金融一街8号
法定代表人:雷建辉
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
联系人:沈刚
客户服务电话:95570
公司网址:www.glsc.com.cn

(14)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
电话:027-65799999
传真:027-85481900
联系人:李良
客户服务电话:95579或4008-888-999
公司网址:www.95579.com

(15)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-23219100
联系人:金芸、李笑鸣
客户服务电话:95553
公司网址:www.htsec.com

(16)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
电话:010-66568430
传真:010-66568536
联系人:田薇
客户服务电话:4008-888-888
公司网址:www.chinastock.com.cn

(17)中信建投证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
联系人:权唐、许梦园
电话:400-8888-108
开放式基金咨询电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:010-65182261
公司网址:www.csc108.com

(18)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
电话:021-38676161
传真:021-38670161
联系人:芮敏祺
客户服务电话:400-888-8666
公司网址:www.gtja.com

(19)申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54033888
联系人:李清怡
客户服务电话:95523或4008895523
公司网址:www.sywg.com

(20)湘财证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:鲁雁先
客户服务电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com

(21)兴业证券股份有限公司
住所:福建省福州市湖东路268号
办公地址:上海浦东新区民生路1199弄证大·五道口广场1号楼21楼
法定代表人:兰荣
电话:021-38565785
传真:021-38565783
联系人:谢高得
客户服务电话:95562
公司网址:www.xyzq.com.cn

(22)华泰证券股份有限公司
住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025-83290979
传真:025-84579763
联系人:万鸣
客户服务电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn

(23)东吴证券股份有限公司
住所:江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
办公地址:江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
联系人:方晓丹
客户服务电话:0512-33396288
公司网址:www.dwzq.com.cn

(24)中信证券(浙江)有限责任公司
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层
法定代表人:刘军
电话:0571-87112510
传真:0571-86065161
联系人:丁思聪
客户服务电话:96598
公司网址:www.bigsun.com.cn

(25)金元证券股份有限公司
住所:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
电话:0755-83025666
传真:0755-83025625
联系人:马贤清
客户服务电话:4008-888-228
公司网址:www.jyzq.cn

(26)东海证券有限责任公司
住所:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:朱科敏
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
联系人:梁旭
客户服务电话:400-888-8588
公司网址:www.longone.com.cn

(27)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
联系人:林生迎
客户服务电话:95565
公司网址:www.newone.com.cn

(28)中银国际证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层
法定代表人:许刚
电话:021-68604866
传真:021-50372474
联系人:李丹
客户服务电话:400-620-8888
公司网址:www.bocichina.com

(29)平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
法定代表人:杨宇翔
电话:4008866338
传真:0755-82400862
联系人:郑舒丽
客户服务电话:95511-8
公司网址:www.pingan.com

(30)西南证券股份有限公司
住所:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦8楼
法定代表人:王珠林
联系人:陈诚
电话:023-63786464
传真:023-63786311
客户服务电话:400-8096-096
公司网址:www.swsc.com.cn

(31)安信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
法定代表人:牛冠兴
电话:021-68801217
传真:021-68801210
联系人:张勤
客户服务电话:4008-001-001
公司网址:www.essence.com.cn

(32)光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:刘晨
客户服务电话:400-888-8788或10108998
公司网址:www.ebscn.com

(33)华龙证券有限责任公司
住所:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
电话:0931-8784656、4890208
传真:0931-4890515
联系人:李昕田
客户服务电话:400-689-8888
公司网址:www.hlzqgs.com

(34)国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
联系人:齐晓燕
客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

(35)齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市经七路86号23层经纪业务总部@法定代表人:李玮
电话:0531-68889115
传真:0531-68889752
联系人:吴阳
客户服务电话:? 95538
公司网址:www.qlzq.com.cn

(36)第一创业证券股份有限公司
住所:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人:刘学民
联系人:崔国良
电话:0755-25832852
传真:0755-82485081
客户服务电话:400-888-1888
公司网址:www.firstcapital.com.cn

(37)万联证券有限责任公司
住所:广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
办公地址:广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
法定代表人:张建军
电话:020-37865070
联系人:罗创斌
开放式基金咨询电话:400-8888-133
开放式基金接收传真:020-22373718-1013
公司网址:www.wlzq.com.cn

(38)宏源证券股份有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
联系人:李巍
电话:010-88085201
传真:010-88085195
客户服务电话:4008-000-562
公司网址:www.hysec.com

(39)中国中投证券有限责任公司
住所:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元?
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539?
客服电话400 600 8008
公司网址www.china-invs.cn

(40)国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
联系人:李飞
客户服务电话:400-8888-777
公司网址:www.gyzq.com.cn

(41)渤海证券股份有限公司
住所:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:杜庆平
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
客户服务电话:400-651-5988
公司网址:www.bhzq.com

(42)国金证券股份有限公司
住所:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号6、16、17楼
法定代表人:冉云
联系人:金喆
客户服务电话:400-660-0109
公司网址:www.gjzq.com.cn

(43)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:高冠江
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客户服务电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com

(44)中信证券股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系电话:010-60838888
传真:010-60833739
联系人:陈忠
公司网址:www.cs.ecitic.com

(45)方正证券股份有限公司
住所:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
联系电话:0731-85832343
传真:0731-85832214
客户服务电话:95571
公司网址:www.foundersc.com

(46)东北证券股份有限公司
住所:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号证券大厦1005室
法定代表人:矫正中
联系人:潘锴、王京京
电话:0431-85096709、0431-85096530
客户服务电话:4006000686
公司网址:www.nesc.cn

(47)华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
联系电话:0591-87383623
业务传真:0591-87383610
统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)
公司网址:www.hfzq.com.cn

(48)东兴证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤漫川
电话:010-66555316
传真:010-66555246
客户服务电话:400-8888-993
公司网址:www.dxzq.net.cn

(49)天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
电话:010-66045608
传真:010-66045500
联系人:林爽
客户服务电话:010-66045678
公司网址:www.txsec.com
天相基金网网址:http://jijin.txsec.com

(50)华宝证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人:陈林
联系人:宋歌
电话:021-68778010
传真:021-68778117
客服电话:400-820-9898、021-38929908
网址:www.cnhbstock.com

(51)厦门证券有限公司
住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
联系人:卢金文
客户服务电话:0592-5163588
公司网站:www.xmzq.cn

(52)中信万通证券有限责任公司
住所:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:张智河
联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326
客服电话:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn

(53)杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:周嬿旻
联系电话:0571-28829790
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构
名称:中海基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
法定代表人:黄鹏
总经理:黄鹏
成立日期:2004年3月18日
电话:021-38429808
传真:021-68419328
联系人:曹伟

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
法定代表人:韩炯
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:黎明
经办律师:吕红、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:江苏公证天业会计师事务所有限公司
住所:无锡市新区开发区旺庄路生活区
办公地址:无锡市梁溪路28号
法定代表人:张彩斌
电话:0510-85888988 85887801
传真:0510-85885275
联系人:华可天
经办注册会计师:夏正曙、华可天

四、基金的名称

中海上证380指数证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

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(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资于上证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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资理念

本基金认为,中国经济持续稳定的增长为中国证券市场的发展奠定了坚实的基础。本基金以复制、跟踪上证380指数为原则,进行指数化长期投资,指数化的投资方式可以获取本指数所代表市场的平均收益,并通过充分的分散化投资实现非系统风险的有效降低和流动性的提高,为投资者谋求利益最大化。

九、基金的投资策略

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

(1)组合构建原则

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)组合构建方法

本基金采用完全复制法,按照成份股在上证380指数中的基准权重构建股票投资组合。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。

(3)组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据上证380指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规和《基金合同》中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化,对股票投资组合进行实时调整,以力争实现基金净值增长率与上证380指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起6个月内使本基金的股票投资组合比例符合《基金合同》的约定。

①定期调整

根据上证380指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

②临时调整

A.当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B.根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪上证380指数;

C.根据法律、法规的规定,成份股在上证380指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

③限制性调整

投资比例限制调整

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定,当基金投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时,本基金将对其进行实时的被动性卖出调整,并相应地对其他资产类别或个股进行微调,以保证基金合法规范运行。

大额赎回调整

当发生大额赎回超过现金保有比例时,本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整,以保证基金正常运行。

4)投资绩效评估

在正常市场情况下,本基金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绝对值小于0.35%,力争控制本基金的年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

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。

十、基金的投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据:

(1)国家有关法律、法规和本基金《基金合同》等的相关规定;

(2)宏微观经济运行趋势和证券市场走势;

(3)标的指数的编制方法及其变更。

2、投资决策流程:

本基金投资决策流程主要包括:

●投资决策委员会决定大类资产配置比例范围:投资决策委员会依据研究部策略分析师和投资决策委员会成员讨论后形成的一致意见,决定大类资产配置的范围。

●基金经理依据投资决策委员会决议决定指数复制部分、成份股新增发部分以及债券投资部分的投资策略和投资计划:本基金基金经理根据其本人对宏微观经济和大势的判断,在投资决策委员会决定的资产配置范围内,决定本基金的资产配置比例。

●投资操作性方案的制定:基金经理依据金融工程部的数量化分析以及金融工程部提出的跟踪误差控制方案,决定指数复制部分和债券投资部分的具体操作性方案,确保本基金投资操作的符合投资要求。

●合规性检查:基金经理的投资操作在日常工作中接受实时的合规性检查。

●投资操作性方案的执行:基金经理在决定本基金的投资操作性方案后,在日常工作中进行下单交易。

●风险实时监控:交易过程受风险控制部实时监控。

●基金事务部清算:基金事务部负责基金的清算。

●绩效评估与跟踪误差控制:金融工程部定期对本基金进行绩效评估和跟踪误差计算,并分析跟踪误差产生的原因,当跟踪误差超过约定数值时,金融工程部提供降低跟踪误差的建议。

十一、基金的投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(1)承销证券;

(2)向他人贷款或提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;

(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

(7)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

(8)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金投资于上证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%;

(2)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(3)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

(4)现金或到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%;

(5)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(6)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(7)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(8)本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(9)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;

(10)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规或监管部门对上述约定的投资组合比例规定进行变更的,以变更后的规定为准。有关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,基金不受上述限制。如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

十二、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:上证380指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。

上证380指数为上海证券交易所和中证指数公司于2010年11月29日正式发布新兴蓝筹指数。该指数与上证180、上证50等蓝筹指数一起构成上海市场主要的蓝筹股指数。该指数以2003年12月31日为基日,基点为1000点。根据相关法规要求,本基金将最多95%的基金资产净值投资于上证380指数成份股和备选成分股,且本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%,选用以上业绩衡量基准可以有效评估本基金投资组合业绩,反映本基金的风格特点。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,则基金管理人将视情况经与基金托管人协商同意并经履行相关程序后调整本基金的业绩比较基准,及时公告并在更新的招募说明书中列示,而无需召开基金份额持有人大会。

十三、基金的风险收益特征

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。

十四、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合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基金合同规定,于2012年9月25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。

本投资组合报告所载数据为截至2012年6月30日报告期末的第二季度报告数据,其中所列财务数据未经审计。

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	102,325,557.82	93.37
	其中:股票	102,325,557.82	93.37
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	6,756,502.81	6.16
6	其他各项资产	514,892.80	0.47
7	合计	109,596,953.43	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	639,204.56	0.59
B	采掘业	4,910,960.77	4.50
C	制造业	51,471,998.86	47.16
C0	食品、饮料	4,630,613.82	4.24
C1	纺织、服装、皮毛	1,688,436.08	1.55
C2	木材、家具	244,091.65	0.22
C3	造纸、印刷	1,064,069.59	0.97
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,683,477.12	7.04
C5	电子	2,904,492.18	2.66
C6	金属、非金属	7,906,304.21	7.24
C7	机械、设备、仪表	15,434,268.07	14.14
C8	医药、生物制品	9,068,429.89	8.31
C99	其他制造业	847,816.25	0.78
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,756,096.34	7.11
E	建筑业	3,505,670.65	3.21
F	交通运输、仓储业	10,545,769.75	9.66
G	信息技术业	3,857,152.41	3.53
H	批发和零售贸易	10,344,038.66	9.48
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	2,687,768.60	2.46
K	社会服务业	1,663,474.16	1.52
L	传播与文化产业	1,939,078.09	1.78
M	综合类	3,004,344.97	2.75
	合计	102,325,557.82	93.74

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600011	华能国际	301,677	1,945,816.65	1.78
2	601727	上海电气	314,519	1,434,206.64	1.31
3	600315	上海家化	30,830	1,202,678.30	1.10
4	601991	大唐发电	203,574	1,146,121.62	1.05
5	600694	大商股份	33,487	1,120,140.15	1.03
6	600535	天士力	24,076	1,052,602.72	0.96
7	600066	宇通客车	45,092	1,012,766.32	0.93
8	601918	国投新集	79,931	975,957.51	0.89
9	600377	宁沪高速	160,110	939,845.70	0.86
10	600546	XD山煤国	42,924	897,970.08	0.82

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3)、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	450,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	62,339.57
4	应收利息	1,268.65
5	应收申购款	1,284.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	514,892.80

(4)、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)、投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十五、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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(截至2012年6月30日):

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去1个月	-6.81%	1.11%	-6.90%	1.14%	0.09%	-0.03%
过去3个月	-4.30%	0.97%	1.13%	1.12%	-5.43%	-0.15%
自基金合同生效起至今	-4.20%	0.84%	-6.66%	1.28%	2.46%	-0.44%

十六、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金的指数使用费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times 0.75\%\div$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,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times 0.15\%\div$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,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金,需根据基金管理人与指数所有人中证指数有限公司签署的上证指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提,且收取下限为每季度(包括基金成立当季)人民币5万元。该下限超出正常指数使用基点费的部分(即:每季指数许可使用基点费下限-该季指数许可使用基点费)由基金管理人自行承担,不得作为基金费用从基金财产中列支。

计算方法如下:

$H=E\times 0.02\%/$当年天数

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算,逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核于次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

本基金管理人与指数所有人中证指数有限公司签署的上证指数使用许可协议有效期1年。该上证指数使用许可协议到期前1个月,双方在共同协商的基础上重新确定续展期或下一个续展期(以下简称"下一期许可使用年度")的指数使用费费率,但下一期许可使用年度的指数使用费年费率的提高幅度不得高于上一期年费率的10%,届时双方应签订书面的补充协议。

如果指数使用许可协议约定的指数使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在《招募说明书》及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述一、基金费用的种类中第4-9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十七、对招募说明书更新部分的说明

(一)在"基金管理人"部分,对"主要人员情况"进行了更新。
(二)对"基金托管人"部分进行了更新。
(三)对"相关服务机构"部分进行了更新。
(四)在"基金份额的申购、赎回、转换和定期定额计划"部分,对"基金的转换"、"定期定额投资计划"进行了更新。
(五)在"基金的投资"部分,新增"基金投资组合报告"并按最新资料进行了更新。
(六)新增"基金的业绩"并按最新资料进行了更新。
(七)对"对基金份额持有人的服务"部分进行了更新。
(八)在"其他应披露的事项"部分,披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司
二〇一二年十月十九日