

送出日期:2013年8月28日 \$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建数记载、误导性陈述或重大遗漏、并对其内容的真实性、推 和完整性来租付别及差常的法律部位。本年年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长委安 基金托管人中国正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2013年8月221 复核了本报告 财务指称、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 活重大遗漏。 /者軍大運欄。 基金管理人承诺以诚实信用,勤勉尽费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

。 本半年度报告擴製摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自203年1月日起至6月30日止。

中級自列目2015 1711日國王07150日正。	§ 2 基金简介
2.1 基金基本情况	-=
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	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	67,074,872.62分
基金合同存续期	不定期
22 基全产品道明	•

2.2 基金产品说明				
投资目标	控制本基金	被动式指数化投资,通过严格 的净值增长率与业绩比较基础 争控制在4%以内,以实现对」	的投资纪律约束和数量化的风险控制手段,力争 胜之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于0.35%,年 立证380指数的有效跟踪。	
投资策略	组合,以拟络 行贿和证调整 申购名财政。 1、股票 基准权重 2、债面 折、资金 析、资金	、	证30病数中的超级发生基准权重构建度限投资 现,并根据标的常数价格及发生等行为,以及具基金的 效果可能等来影响,导致无法有效复制和锻验标 2.采取合理措施。在合理期限内进行适当的处理 花园之内。 1.将取合理措施。在合理期限内进行适当的处理 花园之内。 2.将取合理措施。在合理期限内进行适当的处理 花园之内。 2.将取合理措施。在合理期限内进行适当的处理 方法,是是一个人。 2.将取合理措施。在一个旁边棒。同时考虑 生以内的应价值旁进行位置。 2.以内的应价值旁进行位置。	
业绩比较基准	上证380指数	上证380指数收益率×95%+商业银行活期存款利率 帨后 >>5%		
风险收益特征		全复制指数的股票型基金,具 高于货币市场基金、债券型基	4有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险 金和混合型基金。	
2.3 基金管理人和	基金托管人			
700 to	1	44: A Memoral I	48 A 47 Mt 1	

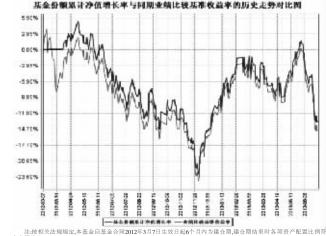
风险收益特征	和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。				
2.3 基金管理人和	口基金托管人				
项	Ħ	基金管理人	基金托管人		
名称		中海基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司		
	姓名	王莉	赵会军		
信息披露负责人	联系电话	021-38429808	010-66105799		
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	custody@icbc.com.cn		
客户服务电话		400-888-9788 021-38789788	95588		
传真		021-68419525	010-66105798		
2.4 信息披露方式	t				

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 基金半年度报告备置地点 § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1.1 期间数据和指标	报告期 2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	-1,123,915.32
本期利润	-158,775.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0020
本期基金份額净值增长率	-3.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份額利润	-0.1332
期末基金资产净值	58,140,493.47
期末基金份額净值	0.867

注之以上所述基金业绩指标不包括特有人认购或交易基金的各项费用例如,并放式基金的申购。赎回费等,计人费用 括实际收益水学能任于何效全期利息收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本 期利润为本期已关现收益加上本期公允价值变动收益。

	16金净值							
3.2.1	3.2.1 基金份額净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较							
阶	没	份额净值增长 率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	2-4	
过去一	-个月	-14.33%	1.59%	-14.82%	1.63%	0.49%	-0.04%	
过去三	个月	-8.35%	1.28%	-9.04%	1.30%	0.69%	-0.02%	
过去六	个月	-3.24%	1.27%	-3.84%	1.28%	0.60%	-0.01%	
过去	一年	-9.50%	1.25%	-8.86%	1.28%	-0.64%	-0.03%	
自基金: 效日起		-13.30%	1.16%	-14.93%	1.27%	1.63%	-0.11%	
注2:4	本基金的	业绩比较基准为	上证380指数收	文益率×95%+商		30日。 引率(税后)×5%,由于ス 生指数的基础指数。		



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 管理人报告

\$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 基金管理人及其管理基金的经验 基金管理人是2004年31 月8日成立以来始终坚持"诚实信用"勤勉尽费"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 纳格本纯管理服务。每次每年2月31年,就专项部本并均存基本

Ŋ			6月30日,共管理业务 [小组)及基金经理助			
	姓名	职务	任本基金的基金组	经理 (助理)期限	证券从业年限	说明
	X±石	R7.93*	任职日期	离任日期	11に分子が入业と十一ドス	15097
	陈明星	金融工程总监、本基金基金经理		-	8	陈玥星先生。中国科学技术大学金融学专业硕士。历任安徽省公园、历任安徽省公园、民安徽省空园职员、中科大上海研究发展中心有限公司负目安徽等企业,并不是一个企业。 中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国中国
			期根据本基金管理。			
	注2:证券从	业的含义遵从行	f业协会《证券从业》	人员资格管理办法	去》的相关规定。	

5.1 报告期內本基金托管人遭難守信情况声明 103年上半年本基金托管人在对中海上证38的指数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 法律法规矩差金台间的有关规定,不存在任何据害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽贵地履行了基金托管人应尽 法律法规矩差金台间的有关规定,不存在任何报告基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽贵地履行了基金托管人应尽

利润分配。 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实,准确和完整发表意见 本托管人校注款中海基金管理有限公司编制和披露的中港上证30的报证券投资基金2013年半年度报告中财务指 核,净值表现,利润分配情况,财务会计报告,投资组合指告等内容进行了准查以上内容真实,准确和完整。 \$6 半年度财务会计报告(未经审计) 6.1 资产负债表 会计主体:中海上证380指数证券投资基金

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		3,542,448.00	4,223,024.38
结算备付金		_	12,186.89
存出保证金		5,251.78	333,333.36
交易性金融资产		54,606,586.46	73,624,767.63
其中:股票投资		54,606,586.46	73,624,767.63
基金投资		_	
债券投资		-	
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产		-	
买人返售金融资产		-	
应收证券清算款		283,062.42	
应收利息		665.49	800.5
应收股利		25,094.24	
应收申购款		2,174.38	592.8

中海上证380指数证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

递延所得税资产		-	_
其他资产		-	-
资产总计		58,465,282.77	78,194,705.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负债:			
短期借款		_	
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		_	_
应付证券清算款		_	-
应付赎回款		25,956.19	872.98
应付管理人报酬		40,131.99	46,311.60
应付托管费		8,026.38	9,262.32
应付销售服务费		_	
应付交易费用		28,330.21	66,981.60
应交税费		-	
应付利息		_	
应付利润		_	
递延所得税负债		_	
其他负债		222,344.53	62,037.06
负债合计		324,789.30	185,465.62
所有者权益:			
实收基金		67,074,872.62	87,068,082.65
未分配利润		-8,934,379.15	-9,058,842.55
所有者权益合计		58,140,493.47	78,009,240.10
负债和所有者权益总计		58,465,282.77	78,194,705.72

6.2 利润表 会计主体:中海上证380指数证券投资基金

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	单位:人民币 上年度可比期间 2012年3月7日至2012年6月30日
一、收入		436,496.14	-2,444,216.8
1.利息收入		15,957.10	661,482.0
其中:存款利息收入		15,957.10	75,448.4
债券利息收入		_	
资产支持证券利息收入		-	
买人返售金融资产收入		-	586,033.6
其他利息收入		-	
2.投资收益 假失以 ""填列)		-560,061.93	1,742,073.10
其中:股票投资收益		-1,195,023.27	1,065,734.95
基金投资收益		-	
债券投资收益		-	
资产支持证券投资收益		_	
衍生工具收益		_	
股利收益		634,961.34	676,338.2
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填 列)		965,139.43	-5,042,663.2
4.汇兑收益 假失以 ""号填列)		-	
5.其他收入 假失以 ""号填列)		15,461.54	194,891.2
减:二、费用		595,272.03	858,230.9
1.管理人报酬		283,699.75	402,978.1
2.托管费		56,739.89	80,595.6
3.销售服务费		-	
4.交易费用		86,337.81	237,623.3
5.利息支出		-	
其中:卖出回购金融资产支出		-	
6.其他费用		168,494.58	137,033.7
三、利润总额 医损总额以 ""号填列)		-158,775.89	-3,302,447.7
减:所得税费用		-	
四、净利润(净亏损以""号填列)		-158,775.89	-3,302,447.7

(三二)中時、中/) (2022年3月7日上年度可比期间为2012年3月7日至2012年6月30日,下回。 在本基金合用主教日为2012年3月7日上年度可比期间为2012年3月7日至2012年6月30日,下回。 63. 所有者权益(基金净值)支动表 会计主体中局上证380日数证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年			单位:人民币:		
项目	2013	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计		
一、期初所有者权益 偡金净值)	87,068,082.65	-9,058,842.55	78,009,240.10		
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数 (本期利润)	-	-158,775.89	-158,775.89		
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)	-19,993,210.03	283,239.29	-19,709,970.74		
其中:1.基金申购款	596,331.10	-36,865.10	559,466.00		
2.基金赎回款	-20,589,541.13	320,104.39	-20,269,436.74		
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)	67,074,872.62	-8,934,379.15	58,140,493.47		
项目	2012	上年度可比期间 年3月7日至2012年6月30日			
- AL	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)	267,225,353.91	-	267,225,353.91		
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数 (本期利润)	-	-3,302,447.74	-3,302,447.74		
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)	-153,313,799.24	-1,455,500.29	-154,769,299.53		
其中:1.基金申购款	1,109,063.70	31,865.19	1,140,928.89		
2.基金赎回款	-154,422,862.94	-1,487,365.48	-155,910,228.42		
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 儘金净值)	113,911,554.67	-4,757,948.03	109,153,606.64		

6-41 基金基本情况 中海上证380市敦康省股份,在1860年的,由于1860市政府,在1860市政府,1860市,

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。
6.42 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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则,其后颁布的
企业会计准则应用指南。企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则"、中国证券业协会于2007年5月
15日颁布的企业会计准则及其他有关规定的申明。
6.43 遵循企业会计准则及其他有关规定的申明。
本基金在本报告别内的会计报资递看打。企业会计准则及其他有关规定。
6.44 本报告别所采用的会计政策。会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本报告职所采用的会计政策。会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本报告职所采用的会计政策(会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本报告本报告期内和平存在重大会计差错。
6.46 税项
根据财政部、国家税务总局财税字 [2002]128号(关于开放式证券投资基金有关税收回题的通知)。财税字 [2004]78号(关于证券投资基金使政政策的通知)。财税2005]10号(关于"关于调整证券投资通过点定率有关税收取预用的通知)。财税?[2004]78号(关于证券投资基金使政政策的通知)。财税2005]10号(关于"关于调整证券投资通过点定率有关税收取预用的通知)。财税?[2004]78号(关于调整证券投资基金的发政策的通知)。财税2005]10号(关于"关于调整证券投资通过点定率有关税收取预用通知)。财税2005]10号(关于"关于调整证券投资基金有关税收取预用通知)。财税2005]10号(关于"关于调整证券投资基金有关税收取预用通知)。财税2005]10号(关于"关于调整证券投资基金有关税收取货用通知通知),财税2005]10号(关于调整证券投资基金有关税收取货用通知通知),财税2005]10号(关于调整证券投资第分通知,财税2005]10号(关于调整证券投收取分用通知通知),财税2005]10号(关于调整证券投资第分。

6.4.6.1 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。 6.4.6.2 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

0.3 金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金最发利息时代扣代徵20%的个人所得税,暂不征收企业 对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(合1个月的,其股盘红利所得金额 按股所得额,接股期限在1个月以上至1年(合1年)的"数域发的统计人应始报行额据,按股期限超过1年的,暂减按 、应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计位个人所得税,暂不征收企业所得税。

类股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税。自2008年4月24日起至2008年9月18日止 4率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买人股票不征收股票交易印花

6.44.5 基金作为连通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所 现个人所得税。 股代日、八万1寸0元。 64.7 关联方关系 64.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况 本郑生期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

与本基金的关系 基金管理人、直销机构

金额单位:人民币元 上年度可比期间 2012年3月7日 健金合同生效日)至2012年6月 30日 本期 2013年1月1日至2013年6月30日

161,510.82 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

债券回购交易			€	额单位:人民币元
	本期 2013年1月1日至2013年	F6月30日	上年度可比期间 2012年3月7日 協金合同生效 30日	
关联方名称	回购成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例	回购成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例
I I I I I I I I I I I I I	_	_	520,000,000.00	50,00%

100.00%

单位:人民币元

6.48.12 权证交易 注:本报告朋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。 6.48.13 应支付关联方的佣金 金额单位:人民币元

			本期			
关联方名称	2013年1月1日至2013年6月30日					
大联万石桥	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	147.01	0.32%	-	-		
关联方名称	2012	上年 年3月7日(基金合	度可比期间 同生效日)至2012年6月30日			
大帆刀石桥	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	158,091.62	100.00%	158,091.62	100.00%		
注:上述佣金	注:上述佣金按市场佣金率计算,已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后					

的母额例如示。 沪市共新交易佣金=股票成交金额x(0.1%)—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金。 深市实际交易佣金=股票成交金额x(0.1%)—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金。 国联证券符分贯司基体证券经据税,根用其容位作为基金专用及房房位标准。与其签订的赔位租用合同是在正常业务中按据—船舶业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和市场信息服务。

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年3月7日 (基金合同生效日)至2012年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理 费	283,699.75	402,978.18
其中:支付销售机构的客户维护费	62,272.39	73,636.67
	金资产净值的0.75%的年费率计提,计算力 日应计提的基金管理费 E为前一日的基金 计至每月月底,按月支付。	

		单位:人民币元
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年3月7日(基金合同生效日)至2012年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管 费	56,739.89	80,595.67
	金资产净值的0.15%的年费率计提。计算 日应计提的基金托管费E为前一日的基金	

H-Exo.15%/当年天教(旧为每日应计据仍集全括管费,E·为前一日的基金资产净值) 基金托管费每日计算,连日里计至每月月底,按月支付。 6.48.3 与关键方进行银行间同业市场的信务(合回购)交易。 6.48.4 令关键方进行银行间同业市场的信务(合回购)交易。 6.48.4 令关键方建分基金的情况。 6.48.4 令关键方建资基金管理,泛原用固有资金投资本基金的情况。 任本报任商则上牛度可比期间基金管理人来周围有资金投资本基金的情况。 注本报任商则上牛度可比期间基金管理人大的其他关联方投资本基金的情况。 注本报任商规定上年度可比期间基金管理人大的其他关联方投资本基金的情况。 注本报任商规定上年度可比期后基金管理人个的其他关联方投资本基金。 6.48.4 报告期末除基金管理人个的其他关联方投资本基金。 6.48.5 由关键方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

					单位:人民市元			
关联方 名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日 2		上年度可比期间 2012年3月7日 儘金合同生效日)至2012年6月30日					
	4010	期末余額	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	3,542,448.00	15,730.01	6,735,687.52	67,337.90			
	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。							
	6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况							
	注:本基金在本柱	役告期及上年度可比期间	未诵讨关联方购买其承	销的证券.				

									金額甲位	
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 般)	期末 成本总額	期末估值总 額	备注
600433	冠豪 高新	2013 年6月 13日	重大 事项 停牌	15.77	-	-	33,093	122,307.84	521,876.61	-
601918	国投新集	2013 年5月 16日	重大 事项 停牌	7.55	2013 年8月 23日	5.05	45,773	618,486.81	345,586.15	-
600983	合肥 三洋	2013 年5月 14日	重大 事项 停牌	9.96	2013 年8月 14日	10.90	21,728	170,440.62	216,410.88	-
600284	浦东建设	2013 年6月 24日	重大 事 停牌	9.50	-	-	20,207	182,964.04	191,966.50	-
601886	江河创建	2013 年6月 20日	重大 事 停牌	13.22	2013 年7月 16日	13.78	9,576	88,781.93	126,594.72	-
600088	中视传媒	2013 年5月 30日	重大 事項牌	14.29	-	-	8,773	125,443.15	125,366.17	-
600335	国机汽车	2013 年3月 25日	重大 事项 停牌	13.43	2013 年7月 1日	13.99	9,128	109,367.56	122,589.04	-
600175	美都 控股	2013 年5月 29日	重大 事项 停牌	2.78	2013 年7月 12日	3.06	36,619	103,463.38	101,800.82	-
600368	五洲交通	2013 年6月 19日	重大 事项 停牌	5.00	2013 年7月 3日	4.50	19,075	82,160.50	95,375.00	-
600328	兰太 实业	2013 年5月 8日	重大 事项 停牌	7.30	2013 年7月 31日	6.57	9,042	91,076.32	66,006.60	-
600292	九龙电力	2013 年6月 5日	重大 事项 停牌	16.90	2013 年7月 1日	17.50	10,695	128,716.21	180,745.50	-

9.3 期末債券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购 本基金本程管期末无银行间市场债券正回购会额。因此无抵押债券。 6.4.9.3.2 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金额。因此无抵押债券。 5.7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

			金額単位:人民币テ
序号	项目	金额	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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,542,448.00	6.06
6	其他各项资产	316,248.31	0.54

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 66)
A	农、林、牧、渔业	219,168.11	0.38
В	采矿业	986,190.96	1.70
C	制造业	27,531,887.02	47.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,417,899.79	5.88
E	建筑业	1,338,873.28	2.30
F	批发和零售业	5,479,965.77	9.43
G	交通运输、仓储和邮政业	4,474,638.86	7.70
Н	住宿和餐饮业	118,107.72	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,233,855.44	2.12
J	金融业	-	
K	房地产业	1,375,099.11	2.37
L	租赁和商务服务业	617,411.04	1.06
M	科学研究和技术服务业	-	
N	水利、环境和公共设施管理业	417,513.31	0.72
0	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	1,210,173.25	2.08
S	综合	686,049.46	1.18
	合计	49,106,833.12	84.46

代码	行业类别	公允价值 玩)	金額单位:人民币 占基金资产净值比例 (%)
		公儿川直 007	口签並贝/ 中国比例 (60)
A	农、林、牧、渔业	-	
В	采掘业	670,730.00	1.
C	制造业	2,320,695.34	3.
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,234,734.00	2.
E	建筑业	-	
F	批发和零售业	198,044.00	0.
G	交通运输、仓储和邮政业	343,085.00	0.
Н	住宿和餐饮业	-	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	469,869.00	0
J	金融业	-	
K	房地产业	199,511.00	0
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	-	
0	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	63,085.00	0.
S	综合	-	
	合计	5,499,753.34	9.

日1 5.499,753.34 注本基金分完全每個複数的股票型基金不进行稅稅投資。为有效股課指裁,同時稅稅中证指数有限公司的程律本股 實施規則。本基金提前买人将于7月1日计人指数的样本股,所以稅稅投資组合的股票均为"将于7月1日计人指数的样本 调整。"

。 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 般)	公允价值	占基金资产净值 比例 %)			
1	601991	大唐发电	146,581	753,426.34	1.30			
2	600688	上海石化	76,677	627,984.63	1.08			
3	600433	冠豪高新	33,093	521,876.61	0.90			
4	600079	人福医药	19,373	505,247.84	0.87			
5	600660	福耀玻璃	68,966	495,865.54	0.85			
6	600867	通化东宝	32,664	486,366.96	0.84			
7	600886	国投电力	140,433	474,663.54	0.82			
8	600200	江苏吴中	30,260	473,266.40	0.81			
9	600879	航天电子	68,727	461,158.17	0.79			
10	600352	浙江龙盛	47,634	446,806.92	0.77			
	注:投资者欲了解本报告期末本基金指数投资的所有股票明细。应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。							

金额单位:人民币元

股票名称 2 600642 119,750 455,050.00 74,300

7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金贷产净值 比例 %)
1	600005	武钢股份	741,403.00	0.95
2	601158	重庆水务	692,908.00	0.89
3	600655	豫园商城	473,264.00	0.61
4	600642	申能股份	455,379.00	0.58
5	600219	南山铝业	453,430.01	0.58
6	600811	东方集团	415,358.00	0.53
7	601666	平煤股份	393,156.00	0.50
8	600804	鹏博士	389,650.00	0.50
9	600125	铁龙物流	376,515.23	0.48
10	601106	中国一重	375,095.00	0.48
11	601179	中国西电	374,808.92	0.48
12	600352	浙江龙盛	358,707.83	0.46

13	601001	大同煤业	353,512.94	0.45
14	600418	江淮汽车	353,290.00	0.45
15	600863	内蒙华电	333,405.25	0.43
16	600009	上海机场	287,355.00	0.37
17	600873	梅花集团	251,829.86	0.32
18	601991	大唐发电	243,344.00	0.31
19	600971	恒源煤电	229,840.12	0.29
20	600664	哈药股份	173,391.00	0.22

注:本报告期内累计买人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 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

			並柳平Ⅲ:八八川				
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	600315	上海家化	1,263,164.49	1.62			
2	600066	宇通客车	843,351.36	1.08			
3	600702	沱牌舍得	540,879.56	0.69			
4	600637	百视通	516,111.34	0.66			
5	600779	水井坊	491,613.53	0.63			
6	601888	中国国旅	490,408.93	0.63			
7	600199	金种子酒	477,438.78	0.61			
8	600601	方正科技	437,573.10	0.56			
9	600027	华电国际	437,563.93	0.56			
10	600765	中航重机	416,459.19	0.53			
11	600008	首创股份	404,666.40	0.52			
12	600062	华润双鹤	403,111.70	0.52			
13	600200	江苏吴中	367,896.07	0.47			
14	600418	江淮汽车	365,849.56	0.47			
15	600388	龙净环保	338,908.75	0.43			
16	600157	永泰能源	328,743.35	0.42			
17	600022	山东钢铁	326,524.62	0.42			
18	600332	广州药业	325,669.44	0.42			
19	600312	平高电气	297,726.95	0.38			
20	600153	建发股份	284,692.15	0.36			

20 600153 建交配份 注:本报告期內,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。 7-43 买人股票的旅车总额及卖出股票的收入总额 买入股票成本 (成交)总额

卖出股票收入 戗交)总额 注本报告期內,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(破交单价乘以成交数量)列 相关交易费用。 2.5 期末股份多品种分类的债券投资组合 法本基本各对股份用本单数价格。

会额单位,人民币元

7.10.2 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。 7.10.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元 283,062.42 25,094.24 665.49 2,174.38

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值 流通受限情况说明

316,248.31

金额单位:人民币元

0.1 991/10/26/32	DBITH A DEX	14 11 / 12 / 11 / 11				份额单位:6		
		持有人结构						
持有人户数	户均持有的基金	机构投资者		个人投资者				
(户)	份额	持有份额	占总份额比 例		持有份额	占总份额比 例		
1,216	55,160.26	30,761,462.24	45.86%		36,313,410.38	54.14%		
8.2 期末基金	管理人的从业人员:	持有本基金的情况				•		
Ij	題	持有份额总数 (分)			占基金总份额比例			
基金管理人所有从业人员持有本 基金			2,9	71.56		0.0044%		

本报告期期初基金份额总额 87,068,082.6

减:本报告期基金总赎回伤 20,589,541.1 本报告期期末基金份额总额 67,074,872.62 § 10 重大事件揭示 10.1 基金份额持有人大会决议 本报告期內未召开基金份額持有人大会。 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 本报告期內,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。 本报告期內,托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务 本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金打 10.4 基金投资策略的改变 本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

券商名称 备注 成交金额 佣金 16,946,127.4 15,427.6 海通证券 13,881,500.6 12,637.85 10,239,822.6 3,293,413. 6.63% 国泰君安 2,978,463.0 中金证券 233,149.9 0.47% 0.47% 国金证券 招商证券 齐鲁证券 东方证券 华泰证券 中建银投证券 华林证券 国海证券

注2.本报告期內退租了安信证券的上海交易单元。 注3.上述佣金接市场佣金率计算,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

注4:以上数据由于四舍五人的原因分项之和与合计项之间可能存在尾差。 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

	贝芬 义勿		顶牙凹购义勿		权 IIEX 勿	
券商名称	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	成交金額	占当期权证 成交总额的比 例
海通证券	-	-	-	-	-	
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	_	-	-	-	-	-
申银万国	_	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
建银投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-		-
国海证券	-	-	-	-	_	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-