

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:中邮创业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月21日

5.1 重要提示
基金管理人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责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年07月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容的真实性、准确性和完整性,但不保证本基金收益目标,不保证本基金在任何时候的投资回报或将来净值的增长,也不保证基金收益绝对不受损失,基金管理人不对任何第三方承担基金亏损或兑付保证责任。投资者应认真阅读本报告全文。
本季度报告的财务资料未经审计。
本报告日期2014年04月01日起至2014年6月30日止。

基金名称	中邮上证380指数增强
交易代码	590007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月22日
报告期末基金份额总额	30,325,295.03份

投资目标
本基金为股票指数增强型基金,以指数分散投资为主动,通过增强型主动管理为策略,严格控制跟踪偏离度和跟踪误差,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,分享中国经济增长带来的收益。在正常市场条件下,本基金力争控制基金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不超过0.5%,年化跟踪误差不超过1.75%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超出上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

投资策略
本基金采用完全复制法进行组合构建,按照成分股在上证380指数中的权重进行分散化投资,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。本基金在正常市场条件下,力争控制基金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不超过0.5%,年化跟踪误差不超过1.75%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超出上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

5.2 报告期末投资组合情况
本基金本报告期末投资组合符合基金合同的约定,投资组合符合基金合同的约定,投资组合符合基金合同的约定。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	29,401,531.00	92.89
2	其中:股票	29,401,531.00	92.89
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	2,151,663.51	6.82
9	其他资产	99,828.60	0.30
10	合计	31,653,023.11	100.00

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末按行业分类的股票投资组合如下:

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农林、牧、渔业	613,320.00	1.97
B	采矿业	14,377,301.66	46.28
C	制造业	1,985,450.00	6.39
D	电力、热力、燃气及生产供应业	977,540.00	3.15
E	建筑业	3,612,860.20	11.63
F	批发和零售业	2,021,294.14	6.51
G	交通运输、仓储和邮政业	164,100.00	0.53
H	住宿和餐饮业	634,800.00	2.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	413,960.00	1.33
J	金融业	552,610.00	1.78
K	房地产业	26,336,126.00	84.77
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	-	-
T	合计	26,336,126.00	84.77

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股票投资明细
本基金本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如下:

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	600522	中天科技	33,250	435,242.50	1.40
2	600557	康缘药业	12,058	364,064.60	1.11
3	600511	国药股份	15,000	304,500.00	1.10
4	601222	林洋电子	15,000	338,850.00	1.09
5	600563	法拉电子	10,000	332,500.00	1.07
6	600594	益佰药业	7,781	320,023.53	1.03
7	600056	中国医药	30,000	318,900.00	1.03
8	600422	昆明机床	15,000	315,150.00	1.01
9	600335	国机汽车	20,000	314,200.00	1.01
10	600153	建发股份	57,456	313,135.20	1.01

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债券投资明细
本基金本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债券投资明细如下:

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	000241	歌尔声学	16,000	426,560.00	1.37
2	300331	苏大维格	9,500	302,570.00	0.97
3	601099	太平洋	40,000	254,800.00	0.82
4	000625	长安汽车	20,000	244,200.00	0.79
5	600240	华业地产	50,000	244,000.00	0.79

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五名资产支持证券投资明细
本基金本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资产支持证券投资明细如下:

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	600522	中天科技	33,250	435,242.50	1.40
2	600557	康缘药业	12,058	364,064.60	1.11
3	600511	国药股份	15,000	304,500.00	1.10
4	601222	林洋电子	15,000	338,850.00	1.09
5	600563	法拉电子	10,000	332,500.00	1.07

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
本基金本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如下:

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	000241	歌尔声学	16,000	426,560.00	1.37
2	300331	苏大维格	9,500	302,570.00	0.97
3	601099	太平洋	40,000	254,800.00	0.82
4	000625	长安汽车	20,000	244,200.00	0.79
5	600240	华业地产	50,000	244,000.00	0.79

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五名股指期货投资明细
本基金本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股指期货投资明细如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.9 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.10 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.11 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.12 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.13 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.14 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.15 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.16 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.17 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.18 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.19 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.20 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.21 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.22 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
本基金本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如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,766.79
2	应收证券清算款	84,176.02
3	应收利息	-
4	应收股利	479.58
5	应收申购款	4,906.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,828.60

5.23 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
本基金本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