

中海上证50指数增强型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年 12 月 31 日

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	-	-
B	采掘业	-	-

C	制造业	26,082,245.25	8.70
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-

G4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	3,078,876.00	1.03
C7	机械、设备、仪表	1,280,950.00	0.43
C8	医药、生物制品	21,722,419.25	7.24
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,060,750.00	1.02
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	22,264,044.00	7.42
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	51,407,039.25	17.14
5.2.2 指数按行业分类的披露投资组合			
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	640,281.20	0.21
B	采掘业	38,531,249.23	12.85
C	制造业	39,152,878.84	13.05
CD	食品、饮料	9,635,231.80	3.21
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
G4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	14,411,277.28	4.80
C7	机械、设备、仪表	15,106,369.76	5.04
C8	医药、生物制品	-	-

C99	其他制造业	--	--
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,110,868.68	1.37
E	建筑业	5,300,137.23	1.77
F	交通运输、仓储业	6,995,836.63	2.33
G	信息技术业	5,562,935.96	1.85
H	批发和零售业	--	--
I	金融、保险业	125,148,995.63	41.73
J	房地产业	7,224,107.45	2.41
K	社会服务业	--	--
L	传播与文化产业	--	--
M	综合类	--	--
	合计	232,667,290.85	77.57

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	600036	招商银行	1,534,103	18,209,802.61	6.07
2	600016	民生银行	2,743,676	16,160,251.64	5.39
3	601318	中国平安	406,537	14,001,134.28	4.65
4	601038	交通银行	2,781,462	12,461,756.16	4.17



本基金本报告期末未持有资产支持证券。 5.4 报告期末公允价值低于成本基金资产净值比例大于5%的前五名权证投资说明 本基金本报告期末未持有权证。 5.5 投资组合合规情况 本基金本报告期末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。 5.6 报告期内与本基金投资的前十名股票中是否有基金合同明确规定限制股票之外的股票。 5.7 其他各项资产构成		
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	301,350.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,407.63
5	应收中购款	4,025.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	308,783.17
5.8 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。 5.8.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。 5.8.2 期末和指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末和指数投资前五名股票中不存在流通受限情况。 5.8.3 报告组合报告附注的其他重要事项说明 本基金由于投资于五个人的人因,分散之利与合利之间可能存在误差。		
§6 开放式基金份额变动		
报告期末期初基金份额总额	单位:份	
报告期间基金已申购份额	440,452,177.70	
减:报告期间基金已赎回份额	6,580,182.17	
报告期末基金份额总额	11,899,719.86	
报告期间基金拆分变动份额(份额减以“-”填列)		
报告期末基金份额总额	435,432,639.84	
§7 备查文件目录 7.1 备查文件目录 1、中国证监会核准募集中海上证50指数增强型证券投资基金份额的文件 2、中海上证50指数增强型证券投资基金份额合同 3、中海上证50指数增强型证券投资基金份额托管协议 4、中海上证50指数增强型证券投资基金份额发售及招募附注 5、报告期内在指定网站上披露的各项公告 7.2 存放地点 上海市浦东新区张杨路68号2005-2008室及30层 7.3 查阅方式 投资者若对本报告书有任何疑问,可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。 咨询电话: 021-38797888/0400-888-9788 公司网址: http://www.zhfund.com		
中海基金管理有限公司		

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	002349	精华制药	2,346,753	50,807,202.45	9.77
2	000061	农产品	4,375,957	48,791,920.55	9.38

3	600639	浦东金桥	4,340,395	29,384,474.15	5.65
4	600648	外高桥	2,785,331	25,931,431.61	4.98
5	600736	苏州高新	4,683,428	20,560,248.92	3.95
6	000759	中百集团	2,213,230	18,701,793.50	3.59
7	600376	首开股份	1,473,511	14,130,970.49	2.72

8	601601	中国水务	733,492	18,090,381.32	2.71
9	600502	广发银行	932,372	12,521,755.96	2.41
10	600048	保利地产	1,238,680	12,386,800.00	2.38

5.4 报告期末按投资组合品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有基金合同明确规定投资股票之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	2,002,197.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,636.41
5	应收申购款	7,312.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,026,146.32

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 投资组合报告附注的其他重要事项是部分

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。

§6 开放式基金份额变动

	单位:份
报告期初基金份额总额	695,141,639.01
报告期内基金总申购份额	106,137,917.48
减:报告期内基金总赎回份额	191,703,425.37
报告期内基金净变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	609,576,131.12

7.1 备查文件目录

§7 备查文件目录

1. 中国证券投资基金业协会《基金中基金信息披露指引》学校基金的文件
2. 中化集团《中化集团证券投资基金章程》
3. 中化集团《中化集团证券投资基金托管协议》
4. 中化集团《中化集团证券投资基金财务报表及报表附注》
5. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告
7.2 办公地点
上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
7.3 联系方式
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中化基金管理有限公司。
咨询电话: 021 38789788或400-888-9788
公司网址: <http://www.zhfund.com>