

# 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、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更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 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.....	48
7.7 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贵金属投资明细.....	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.9 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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§11 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
11.1 备查文件目录 .....	53
11.2 存放地点 .....	53
11.3 查阅方式 .....	53

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF
基金主代码	510220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,229,161.00 份
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	上证中小盘指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	齐亮	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,968,965.93
本期利润	-7,195,771.38
加权平均基金份额本期利润	-0.9908
本期加权平均净值利润率	-26.86%
本期基金份额净值增长率	-21.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	206,330.98
期末可供分配基金份额利润	0.0285
期末基金资产净值	26,656,612.41
期末基金份额净值	3.687
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.76%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平

要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

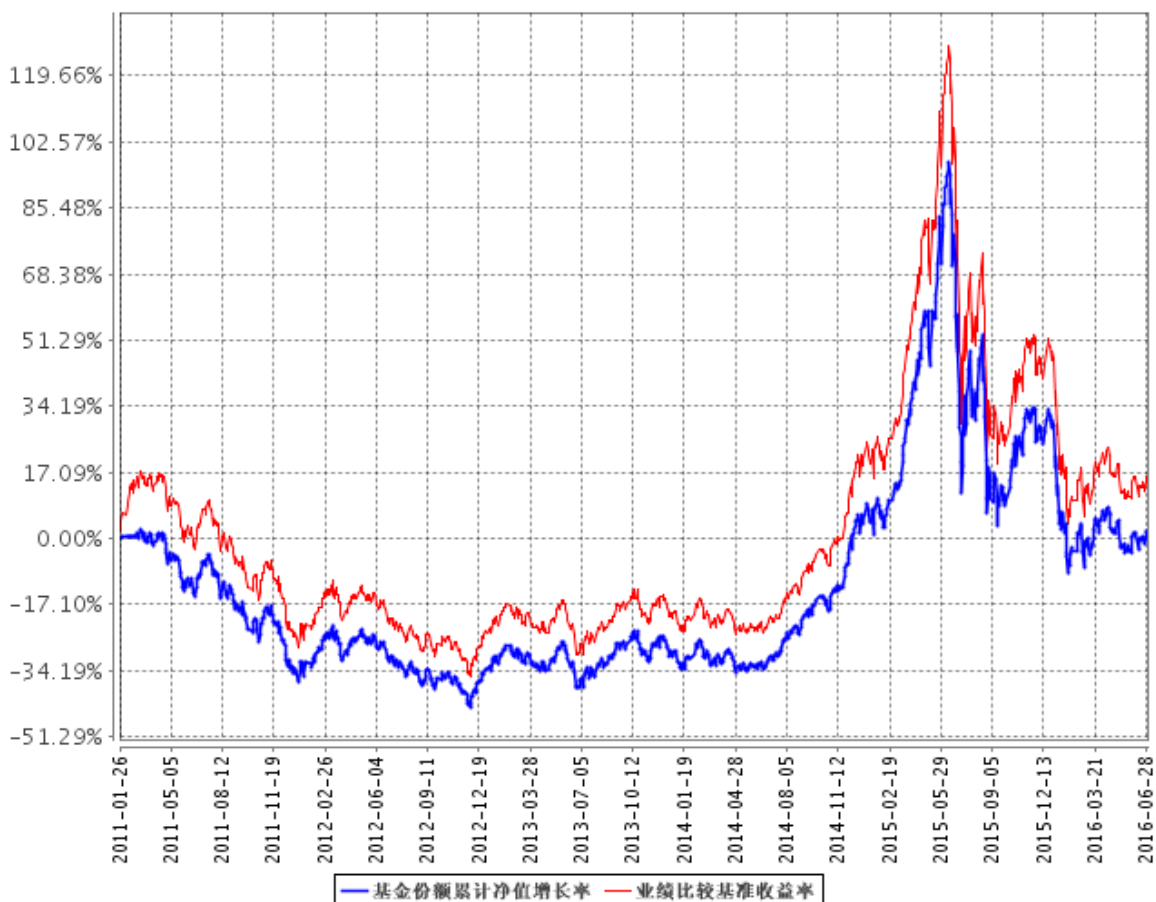
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

阶段	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	1.46%	1.26%	0.89%	1.25%	0.57%	0.01%
过去三个月	-3.00%	1.38%	-3.43%	1.37%	0.43%	0.01%
过去六个月	-21.08%	2.30%	-21.17%	2.30%	0.09%	0.00%
过去一年	-35.50%	2.87%	-36.55%	2.83%	1.05%	0.04%
过去三年	64.86%	2.09%	64.03%	2.07%	0.83%	0.02%
自基金合同生效起至今	1.76%	1.80%	15.62%	1.80%	-13.86%	0.00%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2011 年 1 月 26 日至 2016 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十七条（二）投资范围中规定的比例，即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%。

## §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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资



基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金和华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金。截至 2016 年 6 月 30 日，公司的公募基金管理规模为 876.50 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳军	本基金的基金经理、指数投资部总监	2011 年 1 月 26 日	-	15 年	柳军，15 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月起加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月 1 日起任华泰柏瑞指数

					<p>投资部副总监。2011 年 1 月起担任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。</p> <p>2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。</p> <p>2015 年 2 月起任华泰柏瑞指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：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。任职日期指基金管理公司作出决定之日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报

告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期公司旗下基金所管理的投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

16 年“开门黑”后，国内“稳增长”政策加码，以及人民币波动趋稳，A 股市场得到修复，结构性机会频现。其中直接受益于“稳增长”的资源、周期类板块，以及符合改革方向、业绩有亮点的食品饮料、教育、医疗保健等行业表现突出。

全球来看，市场对于滞胀风险的担忧和诸如英国脱欧“黑天鹅”事件加剧市场避险情绪，助推大宗商品爆发增长。充足流动性和难寻优质投资标的之间的矛盾仍是投资主要驱动因素。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的累计跟踪偏离为 **0.086%**，日均绝对跟踪偏离度为 **0.021%**，期间日跟踪误差为 **0.029%**，较好地实现了本基金的投资目标。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 3.687 元，还原后基金份额累计净值为 1.018 元，本报告期内基金份额净值下降 21.08%，本基金的业绩比较基准下降 21.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经济总体低迷和流动性充足仍是主要投资驱动因素的大背景下，三季度 A 股“吃饭行情”可期：1、从国际上看，美联储推迟加息，英国和欧元区采取措施应对可能的冲击，国际政局基本稳定。G20 召开之前各国政策协调性应能得到保障。2、经济增长问题不大。房地产销售的滞后影响叠加政府基建投资发力，预计三季度经济增长仍将保持在 6.7% 左右。3、人民币正式成为 SDR 货币之前，人民币国际化力度会加大，深港通、QDII2 等政策有望落地。一方面，风险释放充分的大盘蓝筹；另一方面，符合转型、业绩有亮点的行业值得持续关注。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将

估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。截至本报告期末，本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内连续六十个工作日出现基金净值低于五千万元。我司已根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的要求，于 2014 年 11 月 17 日向证监会报告并提交了上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的转型方案，目前正逐步推进转型的后续事宜。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	302,763.65	959,265.83
结算备付金		-	8,216.85
存出保证金		68.74	1,974.80
交易性金融资产	6.4.7.2	26,555,788.83	33,630,466.97
其中：股票投资		26,555,788.83	33,630,466.97
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	52.11	209.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		26,858,673.33	34,600,134.01
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,765.47	14,459.69
应付托管费		2,153.08	2,891.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,882.79	61,239.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	184,259.58	410,000.00
负债合计		202,060.92	488,591.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	26,450,281.43	26,450,281.43
未分配利润	6.4.7.10	206,330.98	7,661,261.37
所有者权益合计		26,656,612.41	34,111,542.80
负债和所有者权益总计		26,858,673.33	34,600,134.01

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.687 元，基金份额总额 7,229,161.000 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-6,871,017.44	25,682,896.32
1.利息收入		1,694.66	3,228.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,689.37	3,214.78
债券利息收入		5.29	13.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,643,577.16	41,962,972.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,858,052.76	41,732,105.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,079.71	28,022.02
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	209,395.89	202,844.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,226,805.45	-16,632,721.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,329.49	349,417.00
<b>减：二、费用</b>		324,753.94	428,764.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	66,668.55	137,948.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,333.69	27,589.59

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	8,899.31	28,375.81
5. 利息支出		-	
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	235,852.39	234,851.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,195,771.38	25,254,131.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,195,771.38	25,254,131.63

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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（基金净值）	26,450,281.43	7,661,261.37	34,111,542.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,195,771.38	-7,195,771.38
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）	-	61,778.37	61,778.37
其中：1. 基金申购款	3,658,831.42	232,939.80	3,891,771.22
2. 基金赎回款	-3,658,831.42	-171,161.43	-3,829,992.85
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）	-	-320,937.38	-320,937.38
五、期末所有者权益（基金净值）	26,450,281.43	206,330.98	26,656,612.41
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 (基金净值)	59,379,764.28	3,205,227.20	62,584,991.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,254,131.63	25,254,131.63
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)	-32,929,482.84	-13,166,874.76	-46,096,357.60
其中：1. 基金申购款	182,941,571.21	98,705,386.52	281,646,957.73
2. 基金赎回款	-215,871,054.05	-111,872,261.28	-327,743,315.33
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)	26,450,281.44	15,292,484.07	41,742,765.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
韩勇

\_\_\_\_\_  
房伟力

\_\_\_\_\_  
赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]第 1535 号《关于核准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 348,418,327.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 022 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 348,427,447.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,120.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《上证中小盘交



易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2011 年 3 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.27331199，并于 2011 年 3 月 14 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]第 55 号文审核同意，本基金 95,229,161.00 份基金份额于 2011 年 3 月 28 日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的业绩基准为上证中小盘指数。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2016 年 8 月 27 日批准报出。

#### **6.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计策变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (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。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	302,763.65
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	302,763.65

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	33,236,541.62	26,555,788.83	-6,680,752.79
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券		-	-
基金		-	-
其他		-	-
合计	33,236,541.62	26,555,788.83	-6,680,752.79

注：股票投资的公允价值和公允价值变动包含可退替代款的公允价值和公允价值变动。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金买入返售金融资产余额为 0。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	52.11
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	52.11

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,882.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,882.79

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	134,259.58
应付指数使用费	50,000.00
合计	184,259.58

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,229,161.00	26,450,281.43
本期申购	1,000,000.00	3,658,831.42
本期赎回(以“-”号填列)	-1,000,000.00	-3,658,831.42
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	7,229,161.00	26,450,281.43

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,961,433.30	-7,300,171.93	7,661,261.37
本期利润	-1,968,965.93	-5,226,805.45	-7,195,771.38
本期基金份额交易产生的变动数	41,460.70	20,317.67	61,778.37
其中：基金申购款	2,066,305.71	-1,833,365.91	232,939.80
基金赎回款	-2,024,845.01	1,853,683.58	-171,161.43

本期已分配利润	-320,937.38	-	-320,937.38
本期末	12,712,990.69	-12,506,659.71	206,330.98

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	1,642.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	36.84
其他	10.18
合计	1,689.37

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-949,052.20
股票投资收益——赎回差价收入	-909,000.56
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,858,052.76

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	2,928,046.61
减：卖出股票成本总额	3,877,098.81
买卖股票差价收入	-949,052.20

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	3,829,992.85

减：现金支付赎回款总额	80,039.85
减：赎回股票成本总额	4,658,953.56
赎回差价收入	-909,000.56

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,079.71
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,079.71

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	45,085.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	40,000.00
减：应收利息总额	5.29
买卖债券差价收入	5,079.71

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	80,039.85
减：现金支付赎回款总额	80,039.85
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应收利息总额	-
赎回差价收入	-

#### 6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	209,395.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	209,395.89

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,226,805.45
——股票投资	-5,226,805.45
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-5,226,805.45

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

#### 6.4.7.18 其他收入

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
替代损益	-2329.49
合计	-2329.49

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	8,899.31
银行间市场交易费用	-
合计	8,899.31

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	74,589.06
上市费	29,835.26
银行划款手续费	430.00
指数使用费	100,000.00
其他费用	200.00
分红手续费	962.81
合计	235,852.39



## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本报告期本基金与关联方未进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本报告期本基金与关联方未进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	66,668.55	137,948.01
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应支付的管理人报酬 E 为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,333.69	27,589.59

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应支付的托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期末未支付关联方销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
上证中小盘 ETF 联接基金	2,599,377.00	38.06%	2,522,795.00	34.8975%

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方 名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	302,763.65	1,642.35	1,704,618.34	3,050.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
1	-	2016年 1月20日	2016年 1月 20日	0.39	320,937.38	-	320,937.38	
合计	-	-	-	0.39	320,937.38	-	320,937.38	

注：无。

### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大资产重组	4.90	-	-	29,520	206,239.25	144,648.00	-
600649	城投控股	2016年6月20日	重大资产重组	14.36	-	-	8,936	120,269.91	128,320.96	-
600654	中安消	2016年5月19日	重大资产收购	18.54	2016年8月8日	20.39	4,537	150,441.67	84,115.98	-
600166	福田汽车	2016年6月30日	重大事项	5.52	2016年7月1日	2.80	13,796	87,997.13	76,153.92	-
601168	西部矿业	2016年2月1日	重大资产重组	5.93	2016年7月22日	6.52	12,228	92,286.83	72,512.04	-
600005	武钢股份	2016年6月27日	重大资产重组	2.76	-	-	24,113	117,941.59	66,551.88	-
600497	驰宏锌锗	2016年6月13日	筹划非公开发行股票事项	9.97	2016年7月11日	10.97	6,418	66,548.29	63,987.46	-
600511	国药股份	2016年2月18日	重大资产重组	27.42	2016年8月4日	30.16	1,842	71,793.18	50,507.64	-

600330	天通股份	2016年5月23日	重大资产重组	13.93	-	-	3,147	40,344.32	43,837.71	-
600653	中华控股	2016年5月5日	重大资产重组	3.93	-	-	11,100	57,702.20	43,623.00	-
600149	廊坊发展	2016年4月13日	重大事项	16.64	2016年7月21日	14.98	2,438	36,770.65	40,568.32	-
600773	西藏城投	2016年6月30日	重大资产重组	15.67	-	-	2,460	36,129.67	38,548.20	-
600634	中技控股	2016年6月22日	重大资产重组	14.41	-	-	2,300	32,637.00	33,143.00	-
600139	西部资源	2016年4月11日	重大资产重组	12.31	2016年8月15日	12.99	2,600	42,286.76	32,006.00	-
600614	鼎立股份	2016年4月26日	发行股份购买资产	8.14	-	-	3,820	56,466.17	31,094.80	-
601005	重庆钢铁	2016年6月2日	重大资产重组	2.52	-	-	11,400	44,511.45	28,728.00	-
600545	新疆城建	2016年5月31日	重大资产重组	6.91	-	-	3,514	38,701.69	24,281.74	-
600636	三爱富	2016年5月9日	重大资产重组	13.86	-	-	1,698	26,140.05	23,534.28	-
600640	号百控股	2016年4月18日	重大资产重组	16.79	2016年8月22日	18.44	1,400	29,922.93	23,506.00	-

600751	天海 投资	2016 年 2月 15日	重大 资产 重组	6.11	2016 年 7月 26日	6.72	1,900	17,514.55	11,609.00	-
--------	----------	------------------------	----------------	------	------------------------	------	-------	-----------	-----------	---

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型股票基金，采用完全复制策略，跟踪上证中小盘指数。本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。同时，本基金相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0%（2015 年 12 月 31 日：0%）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，适用于本基金的市场风险包括利率风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款及结算备付金，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月- 1年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	302,763.65	-	-	-	-	-	302,763.65
存出保证金	68.74	-	-	-	-	-	68.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-26,555,788.83	26,555,788.83
应收利息	-	-	-	-	-	52.11	52.11
资产总计	302,832.39	-	-	-	-	-26,555,840.94	26,858,673.33
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,765.47	10,765.47
应付托管费	-	-	-	-	-	2,153.08	2,153.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,882.79	4,882.79
其他负债	-	-	-	-	-	184,259.58	184,259.58
负债总计	-	-	-	-	-	202,060.92	202,060.92
利率敏感度缺口	302,832.39	-	-	-	-	-26,353,780.02	26,656,612.41
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月- 1年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	959,265.83	-	-	-	-	-	959,265.83
结算备付金	8,216.85	-	-	-	-	-	8,216.85
存出保证金	1,974.80	-	-	-	-	-	1,974.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-33,630,466.97	33,630,466.97
应收利息	-	-	-	-	-	209.56	209.56
资产总计	969,457.48	-	-	-	-	-33,630,676.53	34,600,134.01
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,459.69	14,459.69
应付托管费	-	-	-	-	-	2,891.92	2,891.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	61,239.60	61,239.60
其他负债	-	-	-	-	-	410,000.00	410,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	488,591.21	488,591.21
利率敏感度缺口	969,457.48	-	-	-	-	-33,142,085.32	34,111,542.80

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。于



2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2016 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资占基金资产净值比例为 0%（2015 年 12 月 31 日：0%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括跟踪误差等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

本基金投资组合中股票投资比例为不低于基金资产的 95%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)

交易性金融资产-股票投资	26,555,788.83	99.62	33,630,466.97	98.59
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	26,555,788.83	99.62	33,630,466.97	98.59

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“上证中小盘指数”以为的其它市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	上证中小盘指数上涨 5%	1,268,947.01	1,740,000.00
	上证中小盘指数下跌 5%	-1,268,947.01	-1,740,000.00

#### 6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

注：本基金运用跟踪误差法管理风险，未采用风险价值法。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	26,555,788.83	98.87
	其中：股票	26,555,788.83	98.87
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	302,763.65	1.13
7	其他各项资产	120.85	0.00
8	合计	26,858,673.33	100.00

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值

## 7.2 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	86,340.23	0.32
B	采矿业	1,516,571.62	5.69
C	制造业	12,281,343.07	46.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,938,782.60	7.27
E	建筑业	678,429.98	2.55
F	批发和零售业	1,605,872.80	6.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,774,456.08	6.66
H	住宿和餐饮业	40,152.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,509,769.66	5.66
J	金融业	1,933,720.66	7.25
K	房地产业	1,730,046.89	6.49
L	租赁和商务服务业	372,315.28	1.40
M	科学研究和技术服务业	114,069.07	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	39,536.00	0.15
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	421,461.06	1.58
S	综合	512,921.83	1.92
	合计	26,555,788.83	99.62

注：上述股票投资组合不包含可退替代款估值增（减）值。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	39,242	490,132.58	1.84
2	600276	恒瑞医药	8,418	337,645.98	1.27
3	600015	华夏银行	31,700	313,513.00	1.18
4	601939	建设银行	44,029	209,137.75	0.78
5	601009	南京银行	21,721	203,960.19	0.77

6	600570	恒生电子	2,987	199,441.99	0.75
7	601899	紫金矿业	56,532	190,512.84	0.71
8	600011	华能国际	25,107	188,804.64	0.71
9	601901	方正证券	24,400	186,904.00	0.70
10	600585	海螺水泥	11,900	173,026.00	0.65
11	601555	东吴证券	12,566	168,384.40	0.63
12	601099	太平洋	27,075	165,969.75	0.62
13	600547	山东黄金	4,256	165,600.96	0.62
14	600690	青岛海尔	18,200	161,616.00	0.61
15	600100	同方股份	10,637	159,129.52	0.60
16	600066	宇通客车	8,000	158,400.00	0.59
17	600705	中航资本	26,824	157,725.12	0.59
18	600271	航天信息	6,506	154,842.80	0.58
19	600703	三安光电	7,753	154,827.41	0.58
20	600009	上海机场	5,786	150,725.30	0.57
21	600019	宝钢股份	29,520	144,648.00	0.54
22	601198	东兴证券	5,900	144,196.00	0.54
23	600535	天士力	3,957	141,502.32	0.53
24	600383	金地集团	13,491	139,766.76	0.52
25	600115	东方航空	20,291	134,123.51	0.50
26	600886	国投电力	20,281	133,854.60	0.50
27	600089	特变电工	15,500	132,060.00	0.50
28	600196	复星医药	6,844	130,172.88	0.49
29	600340	华夏幸福	5,315	129,579.70	0.49
30	600649	城投控股	8,936	128,320.96	0.48
31	601607	上海医药	7,085	127,884.25	0.48
32	601888	中国国旅	2,900	127,542.00	0.48
33	600177	雅戈尔	9,174	126,509.46	0.47
34	600485	信威集团	7,087	126,432.08	0.47
35	600584	长电科技	6,111	123,992.19	0.47
36	600804	鹏博士	6,762	123,271.26	0.46
37	601600	中国铝业	32,660	123,128.20	0.46
38	600369	西南证券	16,836	122,229.36	0.46
39	600118	中国卫星	3,586	120,489.60	0.45
40	600867	通化东宝	5,725	118,450.25	0.44
41	600352	浙江龙盛	13,617	117,378.54	0.44
42	600489	中金黄金	10,362	116,468.88	0.44
43	600406	国电南瑞	8,700	116,319.00	0.44
44	600739	辽宁成大	7,333	114,174.81	0.43

45	600208	新湖中宝	26,989	114,163.47	0.43
46	600031	三一重工	22,725	114,079.50	0.43
47	601018	宁波港	22,947	113,587.65	0.43
48	600309	万华化学	6,532	113,003.60	0.42
49	600221	海南航空	35,217	111,637.89	0.42
50	600446	金证股份	3,053	109,755.35	0.41
51	600023	浙能电力	21,420	109,027.80	0.41
52	600674	川投能源	13,143	108,561.18	0.41
53	600522	中天科技	11,030	108,094.00	0.41
54	601618	中国中冶	29,085	107,323.65	0.40
55	600718	东软集团	5,800	106,256.00	0.40
56	600741	华域汽车	7,417	103,912.17	0.39
57	601111	中国国航	15,296	103,400.96	0.39
58	600061	国投安信	5,800	103,356.00	0.39
59	600663	陆家嘴	4,500	102,375.00	0.38
60	601933	永辉超市	24,302	100,367.26	0.38
61	600415	小商品城	16,229	100,295.22	0.38
62	600085	同仁堂	3,298	98,247.42	0.37
63	600201	生物股份	3,568	97,513.44	0.37
64	600018	上港集团	19,100	97,410.00	0.37
65	600839	四川长虹	22,036	97,399.12	0.37
66	600068	葛洲坝	16,493	95,989.26	0.36
67	603993	洛阳钼业	23,111	95,910.65	0.36
68	600315	上海家化	3,288	94,825.92	0.36
69	600219	南山铝业	12,537	92,773.80	0.35
70	600583	海油工程	13,269	91,688.79	0.34
71	600521	华海药业	3,768	91,637.76	0.34
72	600398	海澜之家	8,031	90,750.30	0.34
73	600816	安信信托	5,367	90,541.29	0.34
74	600079	人福医药	5,365	89,971.05	0.34
75	600150	中国船舶	4,000	89,040.00	0.33
76	600525	长园集团	6,277	86,936.45	0.33
77	600157	永泰能源	21,922	86,372.68	0.32
78	600503	华丽家族	9,390	86,106.30	0.32
79	600436	片仔癀	1,894	85,248.94	0.32
80	600895	张江高科	4,659	84,234.72	0.32
81	600654	中安消	4,537	84,115.98	0.32
82	600549	厦门钨业	2,823	83,871.33	0.31
83	601012	隆基股份	6,418	83,754.90	0.31

84	600060	海信电器	4,727	83,573.36	0.31
85	600074	保千里	5,600	83,552.00	0.31
86	600588	用友网络	4,244	83,097.52	0.31
87	600682	南京新百	2,900	82,563.00	0.31
88	601238	广汽集团	3,500	82,215.00	0.31
89	601106	中国一重	15,626	81,411.46	0.31
90	600688	上海石化	13,048	79,592.80	0.30
91	601333	广深铁路	20,254	79,193.14	0.30
92	600332	白云山	3,213	79,168.32	0.30
93	600820	隧道股份	9,384	78,731.76	0.30
94	600642	申能股份	13,581	77,954.94	0.29
95	601098	中南传媒	4,302	77,909.22	0.29
96	600498	烽火通信	3,188	77,404.64	0.29
97	600256	广汇能源	18,690	76,629.00	0.29
98	600879	航天电子	4,900	76,342.00	0.29
99	600166	福田汽车	13,796	76,153.92	0.29
100	600978	宜华生活	6,832	76,108.48	0.29
101	601866	中海集运	18,933	74,974.68	0.28
102	600158	中体产业	4,222	74,940.50	0.28
103	600664	哈药股份	8,994	74,560.26	0.28
104	600376	首开股份	6,679	74,270.48	0.28
105	600482	中国动力	2,224	72,880.48	0.27
106	600373	中文传媒	3,500	72,625.00	0.27
107	601168	西部矿业	12,228	72,512.04	0.27
108	600027	华电国际	14,628	72,408.60	0.27
109	600252	中恒集团	16,567	71,900.78	0.27
110	601021	春秋航空	1,492	71,526.48	0.27
111	600737	中粮屯河	6,181	71,390.55	0.27
112	600266	北京城建	5,700	71,193.00	0.27
113	600478	科力远	5,896	71,164.72	0.27
114	600635	大众公用	11,761	70,918.83	0.27
115	600875	东方电气	7,171	70,419.22	0.26
116	601718	际华集团	9,200	70,288.00	0.26
117	601991	大唐发电	17,933	69,759.37	0.26
118	600122	宏图高科	5,171	69,187.98	0.26
119	600490	鹏欣资源	8,648	69,097.52	0.26
120	600873	梅花生物	10,997	68,291.37	0.26
121	600110	诺德股份	6,939	68,279.76	0.26
122	600643	爱建集团	6,940	67,803.80	0.25

123	603019	中科曙光	1,700	67,694.00	0.25
124	600362	江西铜业	5,017	67,629.16	0.25
125	600138	中青旅	3,500	67,620.00	0.25
126	601258	庞大集团	24,483	67,328.25	0.25
127	600143	金发科技	10,436	67,207.84	0.25
128	600418	江淮汽车	5,300	67,204.00	0.25
129	600005	武钢股份	24,113	66,551.88	0.25
130	600655	豫园商城	6,053	65,614.52	0.25
131	601117	中国化学	11,836	65,453.08	0.25
132	600487	亨通光电	5,200	65,416.00	0.25
133	600170	上海建工	16,924	64,818.92	0.24
134	600037	歌华有线	4,256	64,733.76	0.24
135	600673	东阳光科	10,354	64,712.50	0.24
136	600388	龙净环保	5,104	64,106.24	0.24
137	600497	驰宏锌锗	6,418	63,987.46	0.24
138	600198	大唐电信	3,204	63,695.52	0.24
139	600312	平高电气	4,027	63,062.82	0.24
140	600645	中源协和	1,790	62,900.60	0.24
141	600704	物产中大	6,704	62,749.44	0.24
142	600372	中航电子	3,200	62,304.00	0.23
143	601179	中国西电	12,235	62,031.45	0.23
144	600200	江苏吴中	3,200	61,984.00	0.23
145	600094	大名城	6,500	61,750.00	0.23
146	601633	长城汽车	7,233	61,046.52	0.23
147	600435	北方导航	4,574	60,879.94	0.23
148	600172	黄河旋风	3,300	60,819.00	0.23
149	600594	益佰制药	3,800	60,724.00	0.23
150	600038	中直股份	1,461	60,602.28	0.23
151	600410	华胜天成	5,380	60,363.60	0.23
152	600151	航天机电	5,300	59,890.00	0.22
153	600851	海欣股份	4,476	59,575.56	0.22
154	601872	招商轮船	12,691	59,393.88	0.22
155	600884	杉杉股份	3,438	59,167.98	0.22
156	600770	综艺股份	4,703	58,599.38	0.22
157	601992	金隅股份	7,559	58,582.25	0.22
158	600687	刚泰控股	3,600	58,536.00	0.22
159	603000	人民网	3,500	58,135.00	0.22
160	600240	华业资本	5,800	58,116.00	0.22
161	600868	梅雁吉祥	11,200	57,680.00	0.22

162	600160	巨化股份	5,398	57,380.74	0.22
163	600171	上海贝岭	3,300	57,321.00	0.22
164	600516	方大炭素	6,205	56,713.70	0.21
165	600499	科达洁能	3,351	56,665.41	0.21
166	601898	中煤能源	10,966	56,584.56	0.21
167	600366	宁波韵升	2,366	56,476.42	0.21
168	600601	方正科技	13,079	56,239.70	0.21
169	600755	厦门国贸	7,073	56,230.35	0.21
170	600827	百联股份	4,648	56,147.84	0.21
171	600343	航天动力	2,352	55,930.56	0.21
172	600176	中国巨石	5,812	55,620.84	0.21
173	601311	骆驼股份	2,800	55,580.00	0.21
174	601216	君正集团	7,394	55,233.18	0.21
175	600008	首创股份	14,180	55,160.20	0.21
176	600500	中化国际	6,080	54,963.20	0.21
177	600316	洪都航空	2,816	54,940.16	0.21
178	600392	盛和资源	3,350	54,873.00	0.21
179	600811	东方集团	8,208	54,665.28	0.21
180	600633	浙报传媒	3,611	54,309.44	0.20
181	600711	盛屯矿业	7,331	54,249.40	0.20
182	600699	均胜电子	1,400	53,620.00	0.20
183	600565	迪马股份	8,200	52,972.00	0.20
184	600728	佳都科技	5,428	52,760.16	0.20
185	601929	吉视传媒	13,062	52,639.86	0.20
186	600216	浙江医药	3,989	52,614.91	0.20
187	600058	五矿发展	2,800	52,556.00	0.20
188	600021	上海电力	5,108	52,459.16	0.20
189	600863	内蒙华电	17,327	52,327.54	0.20
190	600881	亚泰集团	10,855	52,321.10	0.20
191	600652	游久游戏	3,567	51,792.84	0.19
192	600391	成发科技	1,331	51,176.95	0.19
193	600651	飞乐音响	4,010	50,766.60	0.19
194	600611	大众交通	7,450	50,734.50	0.19
195	603766	隆鑫通用	2,500	50,550.00	0.19
196	600511	国药股份	1,842	50,507.64	0.19
197	600528	中铁二局	4,350	50,503.50	0.19
198	600153	建发股份	4,200	50,400.00	0.19
199	600959	江苏有线	3,600	50,256.00	0.19
200	600064	南京高科	3,300	49,335.00	0.19



201	600787	中储股份	6,625	49,223.75	0.18
202	600797	浙大网新	4,362	49,159.74	0.18
203	603288	海天味业	1,614	49,065.60	0.18
204	600426	华鲁恒升	5,567	49,045.27	0.18
205	600600	青岛啤酒	1,685	48,982.95	0.18
206	600422	昆药集团	3,582	48,858.48	0.18
207	600026	中海发展	8,245	48,645.50	0.18
208	601928	凤凰传媒	4,596	48,441.84	0.18
209	600056	中国医药	3,042	48,246.12	0.18
210	601155	新城控股	5,200	48,152.00	0.18
211	600120	浙江东方	2,208	47,935.68	0.18
212	601880	大连港	8,062	47,646.42	0.18
213	601958	金钼股份	5,816	47,400.40	0.18
214	600325	华发股份	4,262	47,180.34	0.18
215	600108	亚盛集团	9,291	46,919.55	0.18
216	601699	潞安环能	7,161	46,832.94	0.18
217	600988	赤峰黄金	2,500	46,625.00	0.17
218	600260	凯乐科技	2,849	46,609.64	0.17
219	600597	光明乳业	3,669	46,522.92	0.17
220	600572	康恩贝	7,112	46,085.76	0.17
221	600348	阳泉煤业	7,198	45,851.26	0.17
222	600067	冠城大通	6,358	45,841.18	0.17
223	600307	酒钢宏兴	18,688	45,785.60	0.17
224	600666	奥瑞德	1,300	45,188.00	0.17
225	600161	天坛生物	1,625	45,158.75	0.17
226	601519	大智慧	4,900	45,031.00	0.17
227	600536	中国软件	1,802	44,905.84	0.17
228	600855	航天长峰	1,434	44,884.20	0.17
229	600017	日照港	11,063	44,805.15	0.17
230	601877	正泰电器	2,373	44,731.05	0.17
231	600298	安琪酵母	2,500	44,600.00	0.17
232	600872	中炬高新	3,576	44,127.84	0.17
233	600571	信雅达	800	44,096.00	0.17
234	600717	天津港	5,071	44,066.99	0.17
235	600380	健康元	4,800	44,064.00	0.17
236	600006	东风汽车	4,953	43,933.11	0.16
237	600330	天通股份	3,147	43,837.71	0.16
238	601777	力帆股份	3,717	43,749.09	0.16
239	601808	中海油服	3,598	43,715.70	0.16

240	600653	申华控股	11,100	43,623.00	0.16
241	600582	天地科技	9,664	43,488.00	0.16
242	600648	外高桥	2,200	43,362.00	0.16
243	600206	有研新材	3,222	43,335.90	0.16
244	600557	康缘药业	2,647	43,225.51	0.16
245	600267	海正药业	3,553	43,168.95	0.16
246	600808	马钢股份	17,840	42,994.40	0.16
247	600756	浪潮软件	1,428	42,982.80	0.16
248	600039	四川路桥	10,904	42,961.76	0.16
249	600073	上海梅林	3,702	42,387.90	0.16
250	600320	振华重工	9,937	42,232.25	0.16
251	600765	中航重机	2,894	42,194.52	0.16
252	600210	紫江企业	7,300	42,048.00	0.16
253	601608	中信重工	7,809	41,934.33	0.16
254	600967	北方创业	3,940	41,882.20	0.16
255	600694	大商股份	1,083	41,717.16	0.16
256	600580	卧龙电气	3,708	41,566.68	0.16
257	600086	东方金钰	4,265	41,285.20	0.15
258	600871	石化油服	10,700	41,088.00	0.15
259	600517	置信电气	4,279	40,693.29	0.15
260	600835	上海机电	2,117	40,625.23	0.15
261	601588	北辰实业	9,510	40,607.70	0.15
262	600149	廊坊发展	2,438	40,568.32	0.15
263	600754	锦江股份	1,200	40,152.00	0.15
264	600639	浦东金桥	1,603	40,042.94	0.15
265	601231	环旭电子	3,742	40,039.40	0.15
266	600183	生益科技	4,309	39,944.43	0.15
267	600662	强生控股	3,800	39,786.00	0.15
268	600169	太原重工	10,184	39,717.60	0.15
269	600175	美都能源	8,444	39,686.80	0.15
270	600970	中材国际	6,276	39,538.80	0.15
271	601118	海南橡胶	7,052	39,420.68	0.15
272	600062	华润双鹤	2,163	39,409.86	0.15
273	600587	新华医疗	1,701	39,276.09	0.15
274	600289	亿阳信通	2,804	39,227.96	0.15
275	600993	马应龙	1,881	39,181.23	0.15
276	600880	博瑞传播	4,600	39,146.00	0.15
277	600783	鲁信创投	1,809	39,092.49	0.15
278	600685	中船防务	1,541	39,079.76	0.15

279	600317	营口港	11,611	39,012.96	0.15
280	600187	国中水务	8,737	38,967.02	0.15
281	600869	智慧能源	3,780	38,934.00	0.15
282	600220	江苏阳光	8,532	38,905.92	0.15
283	600677	航天通信	2,100	38,745.00	0.15
284	601010	文峰股份	7,453	38,681.07	0.15
285	600098	广州发展	4,946	38,677.72	0.15
286	600773	西藏城投	2,460	38,548.20	0.14
287	600563	法拉电子	846	38,509.92	0.14
288	600736	苏州高新	4,200	38,346.00	0.14
289	600270	外运发展	2,188	38,268.12	0.14
290	603369	今世缘	2,850	38,247.00	0.14
291	600567	山鹰纸业	13,467	38,246.28	0.14
292	600486	扬农化工	1,393	38,168.20	0.14
293	600363	联创光电	2,141	38,131.21	0.14
294	600433	冠豪高新	4,400	38,016.00	0.14
295	600409	三友化工	5,634	37,973.16	0.14
296	600277	亿利洁能	6,362	37,853.90	0.14
297	601000	唐山港	9,722	37,721.36	0.14
298	600495	晋西车轴	5,116	37,500.28	0.14
299	600458	时代新材	2,400	37,392.00	0.14
300	600566	济川药业	1,451	37,348.74	0.14
301	600261	阳光照明	5,284	37,305.04	0.14
302	600805	悦达投资	4,266	37,028.88	0.14
303	600998	九州通	2,109	36,928.59	0.14
304	600826	兰生股份	1,400	36,652.00	0.14
305	600255	鑫科材料	8,443	36,642.62	0.14
306	600284	浦东建设	3,503	36,571.32	0.14
307	600537	亿晶光电	4,720	36,391.20	0.14
308	600809	山西汾酒	1,640	36,375.20	0.14
309	601689	拓普集团	1,100	36,245.00	0.14
310	600125	铁龙物流	5,662	36,066.94	0.14
311	603188	亚邦股份	2,000	35,920.00	0.13
312	600460	士兰微	4,500	35,685.00	0.13
313	600351	亚宝药业	3,545	35,556.35	0.13
314	600578	京能电力	8,300	35,524.00	0.13
315	600729	重庆百货	1,432	35,513.60	0.13
316	600399	抚顺特钢	5,434	35,157.98	0.13
317	600004	白云机场	2,814	34,499.64	0.13

318	600750	江中药业	1,075	34,185.00	0.13
319	600862	中航高科	2,400	34,032.00	0.13
320	600416	湘电股份	2,680	33,419.60	0.13
321	600650	锦江投资	1,100	33,275.00	0.12
322	601222	林洋能源	793	33,187.05	0.12
323	600634	中技控股	2,300	33,143.00	0.12
324	601717	郑煤机	5,800	33,060.00	0.12
325	600395	盘江股份	3,998	33,023.48	0.12
326	600859	王府井	2,156	32,857.44	0.12
327	600323	瀚蓝环境	2,557	32,448.33	0.12
328	600139	西部资源	2,600	32,006.00	0.12
329	600894	广日股份	2,400	31,992.00	0.12
330	600775	南京熊猫	2,110	31,544.50	0.12
331	600807	天业股份	2,600	31,512.00	0.12
332	600831	广电网络	2,425	31,428.00	0.12
333	600112	天成控股	2,800	31,248.00	0.12
334	600614	鼎立股份	3,820	31,094.80	0.12
335	600106	重庆路桥	4,388	31,067.04	0.12
336	600757	长江传媒	3,686	30,925.54	0.12
337	600116	三峡水利	3,973	30,909.94	0.12
338	601890	亚星锚链	3,400	30,906.00	0.12
339	600269	赣粤高速	7,092	30,850.20	0.12
340	600626	申达股份	2,989	30,846.48	0.12
341	600096	云天化	3,300	30,690.00	0.12
342	600812	华北制药	4,930	30,615.30	0.11
343	600063	皖维高新	6,890	30,522.70	0.11
344	600123	兰花科创	4,231	30,378.58	0.11
345	600846	同济科技	3,052	30,214.80	0.11
346	600502	安徽水利	4,080	30,069.60	0.11
347	600059	古越龙山	2,911	29,954.19	0.11
348	603508	思维列控	300	29,823.00	0.11
349	600595	中孚实业	5,215	29,412.60	0.11
350	601886	江河集团	2,861	29,382.47	0.11
351	600236	桂冠电力	4,367	29,346.24	0.11
352	603077	和邦生物	5,963	29,337.96	0.11
353	600292	远达环保	2,300	29,141.00	0.11
354	601666	平煤股份	7,100	29,039.00	0.11
355	600428	中远航运	5,139	28,829.79	0.11
356	601005	重庆钢铁	11,400	28,728.00	0.11

357	600761	安徽合力	2,824	28,494.16	0.11
358	600624	复旦复华	2,261	28,488.60	0.11
359	603899	晨光文具	1,600	28,320.00	0.11
360	600405	动力源	2,100	28,224.00	0.11
361	600481	双良节能	4,920	28,191.60	0.11
362	600456	宝钛股份	1,400	28,168.00	0.11
363	600551	时代出版	1,400	27,944.00	0.10
364	600180	瑞茂通	1,848	27,923.28	0.10
365	600630	龙头股份	1,700	27,897.00	0.10
366	601908	京运通	3,629	27,834.43	0.10
367	600057	象屿股份	2,690	27,653.20	0.10
368	603308	应流股份	1,095	27,528.30	0.10
369	600282	南钢股份	11,700	27,495.00	0.10
370	600288	大恒科技	2,107	27,264.58	0.10
371	600526	菲达环保	2,100	27,048.00	0.10
372	600963	岳阳林纸	4,384	26,830.08	0.10
373	601001	大同煤业	4,988	26,785.56	0.10
374	600377	宁沪高速	3,181	26,529.54	0.10
375	600586	金晶科技	6,141	26,406.30	0.10
376	601126	四方股份	2,500	26,325.00	0.10
377	600509	天富能源	3,549	26,085.15	0.10
378	600033	福建高速	8,227	26,079.59	0.10
379	600188	兖州煤业	2,376	25,993.44	0.10
380	600501	航天晨光	1,400	25,760.00	0.10
381	601801	皖新传媒	2,206	25,744.02	0.10
382	600790	轻纺城	4,378	25,698.86	0.10
383	600195	中牧股份	1,400	25,620.00	0.10
384	603699	纽威股份	1,443	25,598.82	0.10
385	601069	西部黄金	1,100	25,531.00	0.10
386	600825	新华传媒	3,200	25,440.00	0.10
387	601369	陕鼓动力	3,980	25,392.40	0.10
388	600329	中新药业	1,457	25,162.39	0.09
389	600720	祁连山	3,724	24,988.04	0.09
390	603883	老百姓	500	24,870.00	0.09
391	601002	晋亿实业	2,850	24,795.00	0.09
392	600545	新疆城建	3,514	24,281.74	0.09
393	600053	九鼎投资	700	24,241.00	0.09
394	600864	哈投股份	2,146	24,099.58	0.09
395	600568	中珠控股	1,374	23,907.60	0.09

396	600022	山东钢铁	10,042	23,799.54	0.09
397	603328	依顿电子	800	23,632.00	0.09
398	600596	新安股份	3,239	23,612.31	0.09
399	600636	三爱富	1,698	23,534.28	0.09
400	600132	重庆啤酒	1,549	23,529.31	0.09
401	600640	号百控股	1,400	23,506.00	0.09
402	600726	华电能源	4,600	22,862.00	0.09
403	601158	重庆水务	3,539	22,755.77	0.09
404	600606	绿地控股	2,100	22,722.00	0.09
404	603005	晶方科技	600	22,722.00	0.09
405	600251	冠农股份	2,820	22,560.00	0.08
406	601139	深圳燃气	2,793	22,344.00	0.08
407	603799	华友钴业	600	22,320.00	0.08
408	600280	中央商场	3,300	22,308.00	0.08
409	600429	三元股份	2,846	22,284.18	0.08
410	600350	山东高速	4,200	22,260.00	0.08
411	600776	东方通信	2,652	22,250.28	0.08
412	600133	东湖高新	2,927	22,128.12	0.08
413	600874	创业环保	2,833	22,012.41	0.08
414	603567	珍宝岛	1,000	21,850.00	0.08
415	601515	东风股份	1,911	21,594.30	0.08
416	600119	长江投资	1,400	21,266.00	0.08
417	603169	兰石重装	1,700	21,182.00	0.08
418	603885	吉祥航空	800	21,000.00	0.08
419	600466	蓝光发展	2,400	20,544.00	0.08
420	603555	贵人鸟	800	19,944.00	0.07
421	600830	香溢融通	2,100	19,698.00	0.07
422	600425	青松建化	4,615	19,613.75	0.07
423	603698	航天工程	700	19,208.00	0.07
424	600335	国机汽车	1,700	19,057.00	0.07
425	600088	中视传媒	800	18,976.00	0.07
426	600801	华新水泥	2,795	17,636.45	0.07
427	601226	华电重工	1,881	17,248.77	0.06
428	600744	华银电力	3,100	17,019.00	0.06
429	601566	九牧王	1,100	16,984.00	0.06
430	603979	金诚信	700	16,793.00	0.06
431	600268	国电南自	2,100	15,918.00	0.06
432	600397	安源煤业	3,600	15,912.00	0.06
433	601969	海南矿业	1,400	15,708.00	0.06

434	600278	东方创业	1,003	15,596.65	0.06
435	601968	宝钢包装	1,500	15,390.00	0.06
436	601008	连云港	3,215	15,239.10	0.06
437	603126	中材节能	1,335	14,711.70	0.06
438	600724	宁波富达	2,839	14,478.90	0.05
439	600604	市北高新	600	14,400.00	0.05
440	601016	节能风电	1,400	13,902.00	0.05
441	603198	迎驾贡酒	500	11,955.00	0.04
442	601368	绿城水务	900	11,835.00	0.04
443	600751	天海投资	1,900	11,609.00	0.04
444	600917	重庆燃气	1,100	10,945.00	0.04
445	603589	口子窖	300	10,863.00	0.04
446	601038	一拖股份	1,100	10,417.00	0.04
447	603568	伟明环保	450	10,395.00	0.04
448	603025	大豪科技	300	10,071.00	0.04
449	603116	红蜻蜓	300	7,104.00	0.03

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600015	华夏银行	320,704.00	0.94
2	601901	方正证券	178,057.00	0.52
3	600585	海螺水泥	175,938.00	0.52
4	600690	青岛海尔	166,340.00	0.49
5	600900	长江电力	107,852.00	0.32
6	600061	国投安信	98,475.00	0.29
7	600018	上港集团	98,063.00	0.29
8	600150	中国船舶	88,911.00	0.26
9	600682	南京新百	76,792.00	0.23
10	600978	宜华生活	72,439.00	0.21
11	600879	航天电子	69,286.00	0.20
12	601377	兴业证券	65,454.48	0.19
13	601198	东兴证券	63,572.00	0.19

14	600172	黄河旋风	57,314.00	0.17
15	600565	迪马股份	53,789.00	0.16
16	600868	梅雁吉祥	51,279.00	0.15
17	601155	新城控股	47,953.00	0.14
18	600666	奥瑞德	45,240.00	0.13
19	600871	石化油服	42,693.00	0.13
20	600988	赤峰黄金	42,175.00	0.12

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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	601377	兴业证券	276,535.20	0.81
2	600029	南方航空	161,760.05	0.47
3	601727	上海电气	145,254.76	0.43
4	600660	福耀玻璃	133,046.41	0.39
5	601788	光大证券	125,170.70	0.37
6	601919	中国远洋	105,513.30	0.31
7	601099	太平洋	38,334.93	0.11
8	600185	格力地产	37,367.40	0.11
9	600638	新黄浦	34,907.90	0.10
10	600823	世茂股份	34,755.00	0.10
11	600612	老凤祥	34,602.00	0.10
12	600340	华夏幸福	33,809.92	0.10
13	601388	怡球资源	32,742.78	0.10
14	600742	一汽富维	31,961.60	0.09
15	600694	大商股份	31,360.00	0.09
16	600085	同仁堂	30,371.00	0.09
17	600748	上实发展	27,816.43	0.08
18	601678	滨化股份	27,326.40	0.08
19	600387	海越股份	26,628.00	0.08
20	600616	金枫酒业	23,077.00	0.07

注：不考虑相关交易费用。本基金基金合同于报告期内生效，占比计算采用期末基金资产净值。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元



买入股票成本（成交）总额	2,968,809.20
卖出股票收入（成交）总额	2,928,046.61

注：不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除恒生电子（600570）、方正证券（601901）外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2015年9月2日下午，恒生电子股份有限公司从中国证券监督管理委员会官网新闻发布栏目了解到，证监会对公司控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司涉嫌非法经营证券业务案调查、审理完毕，已进入告知听证程序。依据《证券法》第一百九十七条的规定，证监会拟决定对恒生网络及相关责任人员依法作出如下行政处罚：没收恒生网络违法所得 132,852,384.06 元，并处以 398,557,152.18 元罚款；对恒生网络董事长刘曙峰、总经理官晓岚给予警告，并分别处以 30 万元罚款。

2015年8月25日方正证券股份有限公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站刊登《关于收到中国证监会调查通知书的公告》（公告编号：2015-100），因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，公司被中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）立案调查。9月10日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]74号），中国证监会拟对公司及相关员工做出相关行政处罚，具体内容如下：对公司责令改正，给予警告，没收违法所得 8,717,089.13 元，并处以 17,434,178.26 元罚款；对刘少明给予警告，并处以 10 万元罚款；对陆帆给予警告，并处以 10 万元罚款；对夏军给予警告，并处以 5 万元罚款；对杨晟给予警告，并处以 5 万元罚款。

本基金的投资管理将遵循指数化投资理念，以综合反映沪市中小盘公司整体状况的上证中小盘指数作为标的指数，采用完全复制的被动式投资管理实现跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。方正证券（601901）和恒生电子（600570）属于指数成分股，故而本基金根据指数权重比例投资于两只股票。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	68.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	52.11

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120.85

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

##### 8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
646	111,90.65	291,227.00	4.03%	4,186,757.00	57.91%

##### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
本基金的联接基金	2,751,177.00	38.06%

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	平安证券有限责任公司客户信用交易担保证券账户	218,400.00	3.02%
2	何凤珍	109,238.00	1.51%
3	徐钧	108,134.00	1.50%
4	陈密	107,800.00	1.49%
5	张家泰	100,000.00	1.38%
6	钟鸣	100,000.00	1.38%
7	郭秀琴	100,000.00	1.38%

8	薛成奇	96,700.00	1.34%
9	沈曙明	96,295.00	1.33%
10	刘飞跃	70,000.00	0.97%

注：前十名持有人为除华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年1月26日）基金份额总额	348,427,447.00
本报告期期初基金份额总额	7,229,161.00
本报告期基金总申购份额	1,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	7,229,161.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。  
本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	5,853,799.49	100.00%	5,451.62	100.00%	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：1) 具有相应的业务经营资格；2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服；5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。3、本报告期内，本基金未新增租用专用交易单元。

#### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	45,085.00	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞中小盘 etf2016 年 1 季报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
2	华泰柏瑞中小盘证券投资基金 2015 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 29 日
3	华泰柏瑞上证中小 ETF2015 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 29 日
4	上证中小盘 ETF 招募说明书正文 2016 第 1 次	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 9 日
5	上证中小盘 ETF 招募说明书摘要 2016 年第 1 次	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 9 日
6	华泰柏瑞中小 ETF2015 年第四季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 21 日
7	华泰柏瑞基金上证中小 ETF 分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 14 日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金的公告

### 11.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及托管人住所

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2016年8月27日