

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 29 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 2017 年 3 月 28 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
8.6 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.....	61

8.7 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.....	61
8.8 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贵金属投资明细.....	61
8.9 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.....	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 投资组合报告附注.....	62
§9 基金份额持有人信息.....	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	64
§10 开放式基金份额变动.....	64
§11 重大事件揭示.....	64
11.1 基金份额持有人大会决议.....	64
11.2 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.....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
11.4 基金投资策略的改变.....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
11.8 其他重大事件.....	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§13 备查文件目录.....	67
13.1 备查文件目录.....	67
13.2 存放地点.....	67
13.3 查阅方式.....	67

§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	6,229,161.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011-3-28

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		贾波	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-2,997,568.49	32,985,095.73	3,349,675.34
本期利润	-5,744,645.03	16,465,485.92	26,274,011.44
加权平均基金份额本期利润	-0.8149	1.6365	1.0947
本期加权平均净值利润率	-21.41%	34.32%	39.88%
本期基金份额净值增长率	-17.12%	22.38%	48.65%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	1,337,852.99	7,661,261.37	-16,759,889.55
期末可供分配基金份额利润	0.2148	1.0598	-1.0327
期末基金资产净值	24,129,303.00	34,111,542.80	62,584,991.48
期末基金份额净值	3.874	4.719	3.856
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	6.92%	28.98%	5.40%

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。

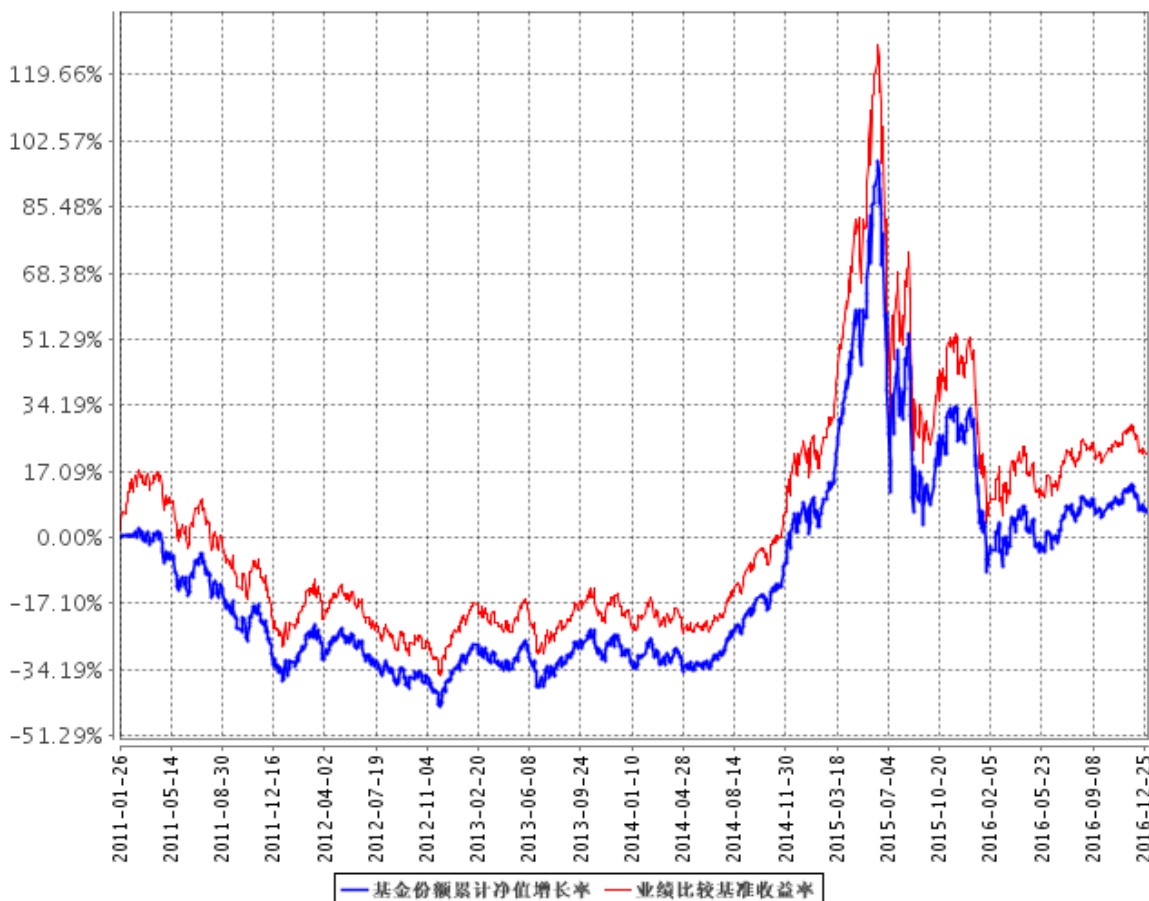
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	0.81%	0.75%	1.22%	0.75%	-0.41%	0.00%
过去六个月	5.07%	0.82%	5.29%	0.83%	-0.22%	-0.01%
过去一年	-17.12%	1.72%	-17.00%	1.71%	-0.12%	0.01%
过去三年	50.81%	2.05%	49.97%	2.02%	0.84%	0.03%
过去五年	61.51%	1.81%	60.58%	1.80%	0.93%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.92%	1.74%	21.73%	1.74%	-14.81%	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

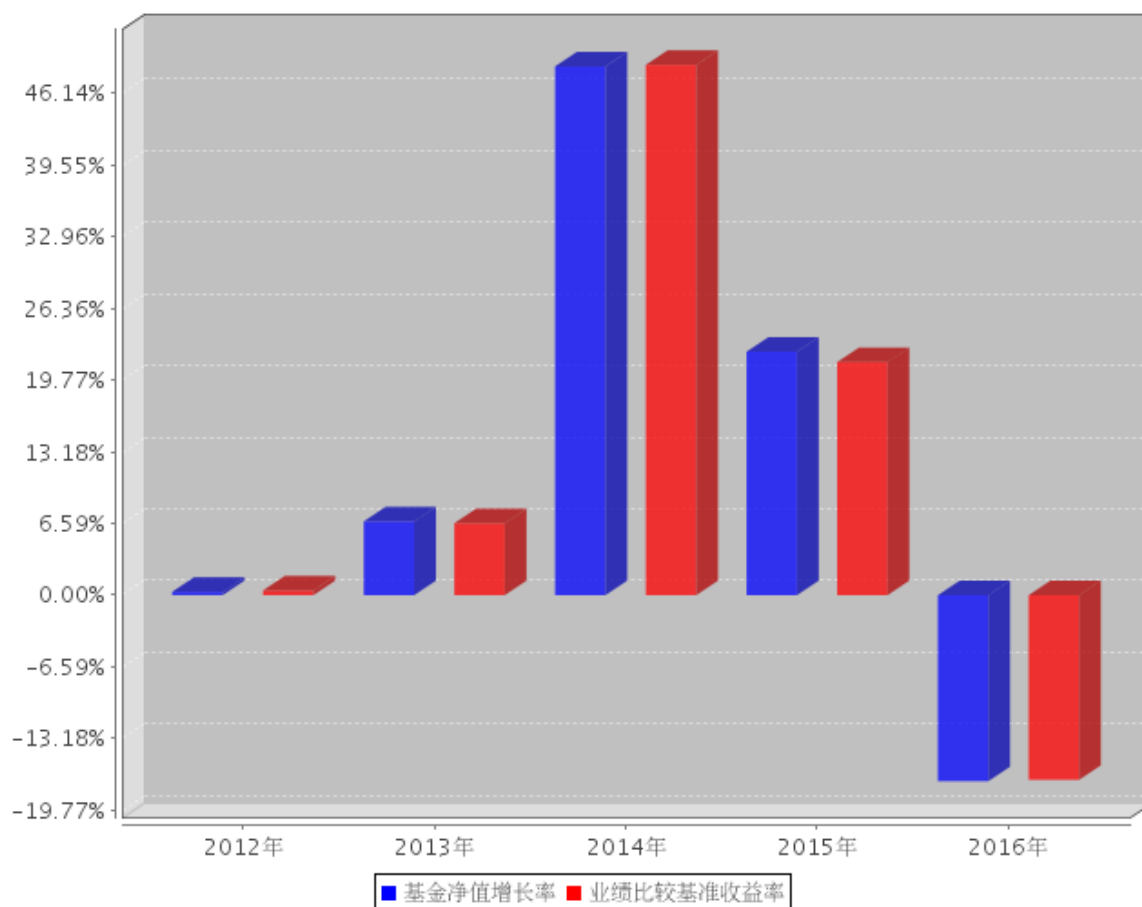


注：1、图示日期为 2011 年 1 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日。

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%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2016	0.39	320,937.38	-	320,937.38	注：-
2015	-	-	-	-	注：-
2014	-	-	-	-	注：-
合计	0.39	320,937.38	-	320,937.38	注：-

§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、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活

配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金。截至 2016 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 974.88 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。 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。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。

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。任职日期和
离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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。同时潜在利益输送金额比较小，因此不构成利益输送。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

4.3.3 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

2016 年海内外资本市场均可谓多事之秋。年初，受“熔断”和汇率政策不确定性的影响，A 股大幅下挫。上半年市场并无明确方向，但受到一季度房地产和汽车超预期、商品价格上涨和国际政治环境震动等因素影响，市场结构性机会频现。下半年市场的核心驱动力是供给侧改革推动下的商品周期复苏，而特朗普美国大选获胜后，市场对于其后期财政和基建政策的乐观预期，带动市场对于经济复苏的信心，相关板块表现亮眼。全年看，2016 是“价值”因子回归的一年。主要指数中，上证 50 和上证红利相对表现最佳，年涨跌幅为-2.72%和-4.04%，而创业板跌幅最深，为-27.71%。

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-0.079%，日均绝对跟踪偏离度为 0.018%，期间日跟踪误差为 0.026%，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

至本报告期末，本基金份额净值为 3.874 元，还原后基金份额累计净值为 1.069 元，本报告期内基金份额净值下降 17.12%，本基金的业绩比较基准下降 17.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2017 年投资我们谨慎乐观。考虑商品周期性复苏和房地产调控影响之后反映等因素以及十九大情绪推动，A 股上半年投资机会较为确定。但“盈利增速”和“利率上行”两者的相对走势仍需观察。相对而言，对于下半年投资我们倾向于更具有确定性因素的国企混改、新型基建（如环保）、军工等板块，以及可能超预期的一带一路主题。

从风格来看，预期 17 年价值因子将继续有效。叠加本轮增量资金以保险、银行为主，从其投资偏好来看，高股息率、低估值组合可能有超额收益。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资业务、交易合规、市场宣传、客户服务、信息技术安全、交易佣金分配等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日净值低于 5000 万。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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21082 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“上证中小盘 ETF”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是上证中小盘 ETF 的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>

<p>审计意见段</p>	<p>我们认为，上述上证中小盘 ETF 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了上证中小盘 ETF 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>单峰</p>	<p>傅琛慧</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所有限公司</p>	
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼</p>	
<p>审计报告日期</p>	<p>2017 年 3 月 28 日</p>	

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	478,516.28	959,265.83
结算备付金		-	8,216.85
存出保证金		1.28	1,974.80
交易性金融资产	7.4.7.2	23,926,994.40	33,630,466.97
其中：股票投资		23,926,994.40	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	104.86	209.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		24,405,616.82	34,600,134.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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		10,419.02	14,459.69
应付托管费		2,083.82	2,891.92
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	3,810.98	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	7.4.7.8	260,000.00	410,000.00
负债合计		276,313.82	488,591.21
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	22,791,450.01	26,450,281.43
未分配利润	7.4.7.10	1,337,852.99	7,661,261.37
所有者权益合计		24,129,303.00	34,111,542.80
负债和所有者权益总计		24,405,616.82	34,600,134.01

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.874 元，基金份额总额 6,229,161.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-5,096,231.26	17,294,663.85
1.利息收入		2,909.72	12,411.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,904.43	12,397.34
债券利息收入		5.29	13.94
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）		-2,349,734.95	33,568,722.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,696,272.13	33,161,454.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,079.71	31,751.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	341,457.47	375,516.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,747,076.54	-16,519,609.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-2,329.49	233,140.03

列)			
减：二、费用		648,413.77	829,177.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	134,367.80	239,087.63
2. 托管费	7.4.10.2.2	26,873.54	47,817.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	15,294.62	69,935.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	471,877.81	472,337.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,744,645.03	16,465,485.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,744,645.03	16,465,485.92

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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）	-	-5,744,645.03	-5,744,645.03
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）	-3,658,831.42	-257,825.97	-3,916,657.39
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	-7,317,662.84	-490,765.77	-7,808,428.61
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）	22,791,450.01	1,337,852.99	24,129,303.00

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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)	-	16,465,485.92	16,465,485.92
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)	-32,929,482.85	-12,009,451.75	-44,938,934.60
其中：1.基金申购款	336,612,491.05	151,699,988.48	488,312,479.53
2.基金赎回款	-369,541,973.90	-163,709,440.23	-533,251,414.13
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)	26,450,281.43	7,661,261.37	34,111,542.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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 2017 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：(i)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。(ii)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。(iii)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金包含对外发行的基金份额总额和基金份额折算调整。基金份额折算调整的初始金额为于基金份额折算日根据基金份额折算公式折算后的基金份额与对外发行的基金份额之间的差额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动和基金份额折算变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益

的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金管理人每季度定期对本基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，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。基于本基金的性质和特点，本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配，基金收益分配每年至多 4 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

注：无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	478,516.28	959,265.83
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	478,516.28	959,265.83

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	28,128,018.28	23,926,994.40	-4,201,023.88
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	28,128,018.28	23,926,994.40	-4,201,023.88
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	35,084,414.31	33,630,466.97	-1,453,947.34
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	35,084,414.31	33,630,466.97	-1,453,947.34

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。

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	104.86	204.50
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	-	5.06
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	104.86	209.56

7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,810.98	61,239.60
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,810.98	61,239.60

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	210,000.00	210,000.00
应付指数使用费	50,000.00	200,000.00
合计	260,000.00	410,000.00

7.4.7.9 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12月31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)	-2,000,000.00	-7,317,662.84
- 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	6,229,161.00	22,791,450.01

注：1、本基金自2010年12月20日至2011年1月18日止期间公开发售，共募集有效净认购资金348,418,327.00元。根据《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入9,120.00元在本基金成立后，折算为9,120.00份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、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》及《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年3月27日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购和赎回业务自2011年3月28日起开始办理。

3、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。

7.4.7.10 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	-2,997,568.49	-2,747,076.54	-5,744,645.03
本期基金份额交易产生的变动数	-1,710,026.96	1,452,200.99	-257,825.97
其中：基金申购款	2,066,305.71	-1,833,365.91	232,939.80
基金赎回款	-3,776,332.67	3,285,566.90	-490,765.77
本期已分配利润	-320,937.38	-	-320,937.38
本期末	9,932,900.47	-8,595,047.48	1,337,852.99

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	2,821.28	11,513.39
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	72.23	857.59
其他	10.92	26.36
合计	2,904.43	12,397.34

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,146,852.74	1,310,077.17
股票投资收益——赎回差价收入	-1,549,419.39	31,851,377.03
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-2,696,272.13	33,161,454.20

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
卖出股票成交总额	5,136,011.83	16,127,913.43
减：卖出股票成本总额	6,282,864.57	14,817,836.26
买卖股票差价收入	-1,146,852.74	1,310,077.17

7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
赎回基金份额对价总额	7,808,428.61	533,251,414.13
减：现金支付赎回款总额	64,683.61	26,246,048.13
减：赎回股票成本总额	9,293,164.39	475,153,988.97
赎回差价收入	-1,549,419.39	31,851,377.03

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票申购差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31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	31,751.56
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	31,751.56

7.4.7.13.2 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	45,085.00	104,765.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	40,000.00	73,000.00
减：应收利息总额	5.29	13.94
买卖债券差价收入	5,079.71	31,751.56

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期末无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 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贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2015年1月1日至2015年12月 31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	-

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
股票投资产生的股利收益	341,457.47	375,516.59
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	341,457.47	375,516.59

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-2,747,076.54	-16,519,609.81
——股票投资	-2,747,076.54	-16,519,609.81
——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	-2,747,076.54	-16,519,609.81

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-2,329.49	233,140.03
合计	-2,329.49	233,140.03

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
交易所市场交易费用	15,294.62	69,935.57
银行间市场交易费用	-	-
合计	15,294.62	69,935.57

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	150,000.00	150,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	715.00	2,337.22
指数使用费	200,000.00	200,000.00
其他费用	200.00	-
分红手续费	962.81	-
合计	471,877.81	472,337.22

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币50,000元。

7.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期无分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

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(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
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(“上证中小盘 ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	134,367.80	239,087.63
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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	26,873.54	47,817.51

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31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	41.7292%	2,522,795.00	34.8975%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	478,516.28	2,821.28	959,265.83	11,513.39

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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	0.3900	320,937.38	-	320,937.38	

合计	-	-	0.3900	320,937.38	-	320,937.38	
----	---	---	--------	------------	---	------------	--

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	2,724	10,896.00	10,896.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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
600649	城投控股	2016 年 12 月 6 日	重大资产重组	20.34	-	-	7,736	104,119.07	157,350.24	-
600406	国电南瑞	2016 年 12 月 29 日	重大资产重组	16.63	-	-	7,300	108,395.35	121,399.00	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大资产重组	7.83	-	-	9,528	71,909.46	74,604.24	-
600654	中安消	2016 年 12 月 14 日	重大资产重组	17.43	-	-	3,937	130,546.36	68,621.91	-

600797	浙大网 新	2016 年 10 月 27 日	重大资 产重组	18.00	2017 年 1 月 6 日	16.20	3,762	50,211.82	67,716.00	-
600673	东阳光 科	2016 年 11 月 15 日	重大资 产重组	7.29	-	-	8,954	77,655.36	65,274.66	-
600655	豫园商 城	2016 年 12 月 20 日	重大资 产重组	11.42	-	-	5,053	81,197.45	57,705.26	-
600161	天坛生 物	2016 年 12 月 6 日	重大资 产重组	39.40	-	-	1,425	43,035.25	56,145.00	-
600687	刚泰控 股	2016 年 7 月 25 日	重大资 产重组	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	3,100	51,282.73	50,902.00	-
600151	航天机 电	2016 年 11 月 11 日	重大资 产重组	10.97	-	-	4,600	61,012.60	50,462.00	-
600711	盛屯矿 业	2016 年 12 月 19 日	非公开 发行股 票	7.02	-	7.38	6,031	48,779.22	42,337.62	-
600171	上海贝 岭	2016 年 12 月 14 日	发行股 份购买 资产	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	2,900	53,308.70	40,745.00	-
600645	中源协 和	2016 年 12 月 13 日	重大资 产重组	26.80	-	-	1,490	74,768.32	39,932.00	-
600855	航天长 峰	2016 年 11 月 8 日	重大资 产重组	28.89	-	-	1,234	39,188.42	35,650.26	-
600626	申达股 份	2016 年 12 月 15 日	重大资 产重组	13.69	2017 年 1 月 12 日	-	2,589	37,979.21	35,443.41	-
600875	东方电 气	2016 年 12 月 9 日	发行股 份购买 资产	10.79	-	-	3,171	50,284.75	34,215.09	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	重大资 产重组	16.28	-	-	1,856	34,741.37	30,215.68	-

600807	天业股份	2016年11月21日	重大资产重组	13.73	-	-	2,200	25,586.00	30,206.00	-
600537	亿晶光电	2016年12月27日	筹划重大事项	7.43	2017年1月13日	8.17	4,020	27,602.70	29,868.60	-
601005	重庆钢铁	2016年6月2日	重大资产重组	2.52	-	-	9,800	38,264.23	24,696.00	-
600551	时代出版	2016年11月28日	重大资产重组	20.32	-	-	1,200	22,794.44	24,384.00	-
603308	应流股份	2016年11月24日	重大资产重组	21.92	2017年2月14日	21.92	995	24,184.90	21,810.40	-
600636	三爱富	2016年5月9日	重大资产重组	13.86	-	-	1,498	23,061.13	20,762.28	-
603169	兰石重装	2016年11月24日	重大资产重组	13.36	2017年3月21日	14.32	1,400	23,521.05	18,704.00	-
603986	兆易创新	2016年9月19日	重大资产重组	177.97	-	-	83	1,930.58	14,771.51	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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约责任，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 12 月 31 日，本基金未持有债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	478,516.28	-	-	-	-	-	478,516.28
存出保证金	1.28	-	-	-	-	-	1.28
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-23,926,994.40	23,926,994.40
应收利息	-	-	-	-	-	104.86	104.86
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	478,517.56	-	-	-	-	-23,927,099.26	24,405,616.82
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,419.02	10,419.02
应付托管费	-	-	-	-	-	2,083.82	2,083.82
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,810.98	3,810.98
其他负债	-	-	-	-	-	260,000.00	260,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	276,313.82	276,313.82
利率敏感度缺口	478,517.56	-	-	-	-	-23,650,785.44	24,129,303.00
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)，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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	23,926,994.40	99.16	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	23,926,994.40	99.16	33,630,466.97	98.59

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“上证中小盘指数”以外的其他市场变量保持不变		
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：人民币万元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	上证中小盘指数上涨 5	120.00	174.00
	上证中小盘指数下跌 5	-120.00	-174.00

7.4.13.4.4 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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2016 年，本基金申购基金份额的对价总额为 3,891,771.22 元，其中包括以股票支付的申购款 3,653,916.00 元和以现金支付的申购款 237,855.22 元（2015 年，本基金申购基金份额的对价总额为 488,312,479.53 元，其中包括以股票支付的申购款 441,105,259.50 元和以现金支付的申购款 47,207,220.03 元）。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 22,702,176 元，属于第二层次的余额为 1,224,818.16 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 30,912,203.39 元，第二层次 2,718,263.58，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	23,926,994.40	98.04
	其中：股票	23,926,994.40	98.04
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	478,516.28	1.96
7	其他各项资产	106.14	0.00
8	合计	24,405,616.82	100.00

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	85,990.44	0.36
B	采矿业	1,366,633.19	5.66
C	制造业	11,099,595.37	46.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,751,048.88	7.26
E	建筑业	901,600.29	3.74
F	批发和零售业	1,458,995.34	6.05
G	交通运输、仓储和邮政业	1,639,258.62	6.79
H	住宿和餐饮业	26,514.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,253,296.79	5.19
J	金融业	1,538,912.52	6.38

K	房地产业	1,579,263.27	6.55
L	租赁和商务服务业	386,523.45	1.60
M	科学研究和技术服务业	103,120.85	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	32,895.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,111.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	378,750.78	1.57
S	综合	312,484.61	1.30
	合计	23,926,994.40	99.16

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

8.3 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	33,042	418,311.72	1.73
2	600276	恒瑞医药	7,118	323,869.00	1.34
3	600015	华夏银行	26,700	289,695.00	1.20
4	601009	南京银行	18,721	202,935.64	0.84
5	600795	国电电力	58,900	186,713.00	0.77
6	601939	建设银行	33,629	182,941.76	0.76
7	601899	紫金矿业	53,232	177,794.88	0.74
8	601099	太平洋	34,112	175,676.80	0.73
9	600585	海螺水泥	10,000	169,600.00	0.70
10	600019	宝钢股份	25,420	161,417.00	0.67
11	600649	城投控股	7,736	157,350.24	0.65
12	600690	青岛海尔	15,300	151,164.00	0.63
13	601669	中国电建	20,600	149,556.00	0.62
14	600383	金地集团	11,291	146,331.36	0.61
15	601555	东吴证券	10,566	140,210.82	0.58
16	600705	中航资本	22,424	137,234.88	0.57
17	600703	三安光电	10,205	136,644.95	0.57

18	600010	包钢股份	48,800	136,152.00	0.56
19	600535	天士力	3,257	135,132.93	0.56
20	600089	特变电工	14,800	135,124.00	0.56
21	601600	中国铝业	31,360	132,339.20	0.55
22	600066	宇通客车	6,700	131,253.00	0.54
23	600660	福耀玻璃	7,000	130,410.00	0.54
24	600009	上海机场	4,886	129,576.72	0.54
25	600886	国投电力	19,381	129,271.27	0.54
26	600068	葛洲坝	13,893	127,676.67	0.53
27	600804	鹏博士	5,662	124,167.66	0.51
28	600406	国电南瑞	7,300	121,399.00	0.50
29	600415	小商品城	13,629	117,890.85	0.49
30	600570	恒生电子	2,487	117,237.18	0.49
31	600309	万华化学	5,432	116,950.96	0.48
32	600196	复星医药	5,044	116,718.16	0.48
33	600031	三一重工	19,025	116,052.50	0.48
34	601618	中国中冶	24,385	113,634.10	0.47
35	601607	上海医药	5,785	113,154.60	0.47
36	600271	航天信息	5,606	111,839.70	0.46
37	600739	辽宁成大	6,133	110,148.68	0.46
38	601888	中国国旅	2,500	108,500.00	0.45
39	600489	中金黄金	8,962	108,350.58	0.45
40	600867	通化东宝	4,925	108,005.25	0.45
41	600340	华夏幸福	4,515	107,908.50	0.45
42	600177	雅戈尔	7,674	107,282.52	0.44
43	600816	安信信托	4,467	105,510.54	0.44
44	600606	绿地控股	12,100	105,391.00	0.44
45	600352	浙江龙盛	11,417	105,150.57	0.44
46	600115	东方航空	14,791	104,572.37	0.43
47	600023	浙能电力	19,120	103,821.60	0.43
48	600369	西南证券	14,136	100,789.68	0.42
49	600741	华域汽车	6,317	100,756.15	0.42
50	601018	宁波港	19,747	99,919.82	0.41
51	601919	中远海控	19,000	99,560.00	0.41
52	600718	东软集团	5,000	98,300.00	0.41
53	600221	海南航空	29,817	97,203.42	0.40
54	600201	生物股份	3,068	96,918.12	0.40
55	600118	中国卫星	3,086	96,406.64	0.40
56	600522	中天科技	9,130	96,138.90	0.40

57	600674	川投能源	11,043	96,074.10	0.40
58	600820	隧道股份	8,584	94,509.84	0.39
59	601933	永辉超市	19,202	94,281.82	0.39
60	600150	中国船舶	3,400	93,874.00	0.39
61	600682	南京新百	2,500	93,175.00	0.39
62	601111	中国国航	12,796	92,131.20	0.38
63	600584	长电科技	5,211	91,974.15	0.38
64	600079	人福医药	4,565	91,071.75	0.38
65	600085	同仁堂	2,798	87,801.24	0.36
66	600663	陆家嘴	3,900	86,307.00	0.36
67	601333	广深铁路	16,954	85,956.78	0.36
68	600398	海澜之家	7,931	85,575.49	0.35
69	600219	南山铝业	27,242	84,177.78	0.35
70	600018	上港集团	16,300	83,456.00	0.35
71	600487	亨通光电	4,400	82,104.00	0.34
72	600583	海油工程	11,069	81,689.22	0.34
73	600005	武钢股份	23,813	81,202.33	0.34
74	600061	国投安信	5,200	81,172.00	0.34
75	600643	爱建集团	6,540	81,161.40	0.34
76	600158	中体产业	3,422	80,656.54	0.33
77	600839	四川长虹	18,536	77,480.48	0.32
78	601012	隆基股份	5,718	76,564.02	0.32
79	600588	用友网络	3,644	75,868.08	0.31
80	600315	上海家化	2,788	75,582.68	0.31
81	600157	永泰能源	18,822	75,476.22	0.31
82	600525	长园集团	5,377	75,009.15	0.31
83	601168	西部矿业	9,528	74,604.24	0.31
84	600256	广汇能源	15,690	73,272.30	0.30
85	600436	片仔癀	1,594	72,989.26	0.30
86	600166	福田汽车	23,392	72,281.28	0.30
87	603993	洛阳钼业	19,411	72,208.92	0.30
88	600208	新湖中宝	17,289	71,922.24	0.30
89	601718	际华集团	7,800	71,838.00	0.30
90	600027	华电国际	14,428	71,418.60	0.30
91	600362	江西铜业	4,217	70,550.41	0.29
92	600688	上海石化	10,948	70,505.12	0.29
93	600297	广汇汽车	8,200	70,192.00	0.29
94	600895	张江高科	3,959	70,153.48	0.29
95	600521	华海药业	3,168	69,791.04	0.29

96	600143	金发科技	8,936	69,522.08	0.29
97	600170	上海建工	14,524	68,698.52	0.28
98	600654	中安消	3,937	68,621.91	0.28
99	600642	申能股份	11,681	68,567.47	0.28
100	600498	烽火通信	2,688	67,764.48	0.28
101	600797	浙大网新	3,762	67,716.00	0.28
102	600153	建发股份	6,300	67,410.00	0.28
103	601117	中国化学	9,936	67,266.72	0.28
104	600060	海信电器	3,927	67,230.24	0.28
105	600503	华丽家族	8,090	67,066.10	0.28
106	601633	长城汽车	6,033	66,724.98	0.28
107	600959	江苏有线	5,880	66,444.00	0.28
108	600664	哈药股份	7,694	66,014.52	0.27
109	600266	北京城建	4,900	65,317.00	0.27
110	600673	东阳光科	8,954	65,274.66	0.27
111	600332	白云山	2,713	65,057.74	0.27
112	601866	中远海发	15,933	65,006.64	0.27
113	600737	中粮屯河	5,181	64,555.26	0.27
114	600446	金证股份	2,553	64,156.89	0.27
115	600879	航天电子	4,200	64,008.00	0.27
116	600252	中恒集团	13,967	63,968.86	0.27
117	600074	保千里	4,800	63,552.00	0.26
118	600138	中青旅	3,000	62,910.00	0.26
119	600110	诺德股份	5,839	62,243.74	0.26
120	600978	宜华生活	5,832	62,110.80	0.26
121	600873	梅花生物	9,397	61,268.44	0.25
122	600376	首开股份	5,179	61,163.99	0.25
123	600038	中直股份	1,261	61,057.62	0.25
124	600497	驰宏锌锗	8,636	60,711.08	0.25
125	600500	中化国际	5,180	60,398.80	0.25
126	601098	中南传媒	3,602	60,009.32	0.25
127	600704	物产中大	5,804	59,955.32	0.25
128	600666	奥瑞德	2,200	59,290.00	0.25
129	601216	君正集团	12,688	58,999.20	0.24
130	600635	大众公用	9,761	58,663.61	0.24
131	600827	百联股份	4,048	58,129.28	0.24
132	600490	鹏欣资源	7,448	58,094.40	0.24
133	600868	梅雁吉祥	9,600	57,888.00	0.24
134	600426	华鲁恒升	4,367	57,862.75	0.24

135	600655	豫园商城	5,053	57,705.26	0.24
136	601991	大唐发电	15,033	57,426.06	0.24
137	601258	庞大集团	20,683	57,291.91	0.24
138	600373	中文传媒	2,800	56,560.00	0.23
139	600699	均胜电子	1,700	56,253.00	0.23
140	600161	天坛生物	1,425	56,145.00	0.23
141	600037	歌华有线	3,656	56,009.92	0.23
142	601992	金隅股份	12,518	55,830.28	0.23
143	600482	中国动力	1,824	55,704.96	0.23
144	600759	洲际油气	5,600	54,992.00	0.23
145	600401	海润光伏	23,600	54,752.00	0.23
146	600240	华业资本	5,000	53,700.00	0.22
147	600312	平高电气	3,427	53,529.74	0.22
148	600122	宏图高科	4,371	53,413.62	0.22
149	600594	益佰制药	3,200	53,280.00	0.22
150	601898	中煤能源	9,166	53,254.46	0.22
151	600388	龙净环保	4,304	53,240.48	0.22
152	600633	浙报传媒	3,011	53,174.26	0.22
153	601155	新城控股	4,500	52,875.00	0.22
154	601872	招商轮船	10,591	52,319.54	0.22
155	600021	上海电力	4,308	52,299.12	0.22
156	600418	江淮汽车	4,500	52,020.00	0.22
157	600565	迪马股份	7,000	51,940.00	0.22
158	600687	刚泰控股	3,100	50,902.00	0.21
159	600601	方正科技	10,979	50,503.40	0.21
160	600151	航天机电	4,600	50,462.00	0.21
161	600056	中国医药	2,642	50,277.26	0.21
162	600528	中铁二局	3,650	50,224.00	0.21
163	600200	江苏吴中	2,600	50,206.00	0.21
164	600372	中航电子	2,700	50,112.00	0.21
165	600787	中储股份	5,525	50,111.75	0.21
166	600811	东方集团	7,008	50,107.20	0.21
167	600881	亚泰集团	9,155	50,077.85	0.21
168	600172	黄河旋风	2,800	50,064.00	0.21
169	600008	首创股份	12,180	50,059.80	0.21
170	600094	大名城	5,600	49,840.00	0.21
171	603000	人民网	2,800	49,448.00	0.20
172	600435	北方导航	3,774	49,212.96	0.20
173	600478	科力远	4,896	48,960.00	0.20

174	600549	厦门钨业	2,223	48,950.46	0.20
175	600851	海欣股份	3,776	48,823.68	0.20
176	601699	潞安环能	6,061	48,791.05	0.20
177	600410	华胜天成	4,480	48,697.60	0.20
178	600176	中国巨石	4,912	48,334.08	0.20
179	600614	鼎立股份	4,120	48,204.00	0.20
180	600516	方大炭素	5,205	48,198.30	0.20
181	600755	厦门国贸	5,873	48,158.60	0.20
182	601225	陕西煤业	9,900	48,015.00	0.20
183	600098	广州发展	4,246	47,640.12	0.20
184	601021	春秋航空	1,292	47,468.08	0.20
185	600325	华发股份	3,662	46,873.60	0.19
186	600026	中远海能	6,845	46,614.45	0.19
187	600120	浙江东方	1,608	46,503.36	0.19
188	600198	大唐电信	2,904	46,086.48	0.19
189	601929	吉视传媒	10,962	45,930.78	0.19
190	603766	隆鑫通用	2,200	45,716.00	0.19
191	600160	巨化股份	4,298	45,472.84	0.19
192	600967	北方创业	3,340	45,323.80	0.19
193	600064	南京高科	2,700	45,225.00	0.19
194	603589	口子窖	1,400	44,982.00	0.19
195	600863	内蒙华电	14,527	44,743.16	0.19
196	601611	中国核建	2,600	44,694.00	0.19
197	600572	康恩贝	6,112	44,678.72	0.19
198	600108	亚盛集团	7,791	44,564.52	0.18
199	600717	天津港	4,371	44,059.68	0.18
200	600600	青岛啤酒	1,485	43,718.40	0.18
201	600316	洪都航空	2,216	43,566.56	0.18
202	601880	大连港	15,543	43,520.40	0.18
203	600409	三友化工	4,634	43,513.26	0.18
204	600808	马钢股份	15,340	43,412.20	0.18
205	600511	国药股份	1,442	43,404.20	0.18
206	600039	四川路桥	9,104	43,152.96	0.18
207	600499	科达洁能	5,702	43,107.12	0.18
208	600307	酒钢宏兴	15,688	42,828.24	0.18
209	600685	中船防务	1,441	42,797.70	0.18
210	600320	振华重工	8,337	42,518.70	0.18
211	600711	盛屯矿业	6,031	42,337.62	0.18
212	600567	山鹰纸业	11,567	41,872.54	0.17

213	603019	中科曙光	1,500	41,730.00	0.17
214	603288	海天味业	1,414	41,472.62	0.17
215	601877	正泰电器	2,073	41,460.00	0.17
216	601118	海南橡胶	5,952	41,425.92	0.17
217	600062	华润双鹤	1,863	41,414.49	0.17
218	600597	光明乳业	3,169	41,387.14	0.17
219	600582	天地科技	8,264	41,072.08	0.17
220	600611	大众交通	6,250	41,062.50	0.17
221	600348	阳泉煤业	6,098	41,039.54	0.17
222	600343	航天动力	1,952	41,031.04	0.17
223	601928	凤凰传媒	3,896	40,791.12	0.17
224	600171	上海贝岭	2,900	40,745.00	0.17
225	600745	中茵股份	1,900	40,660.00	0.17
226	600872	中炬高新	2,876	40,494.08	0.17
227	600770	综艺股份	3,903	40,396.05	0.17
228	600267	海正药业	3,053	40,146.95	0.17
229	600751	天海投资	4,800	40,128.00	0.17
230	600884	杉杉股份	2,838	39,959.04	0.17
231	600645	中源协和	1,490	39,932.00	0.17
232	600086	东方金钰	3,665	39,875.20	0.17
233	600391	成发科技	1,131	39,867.75	0.17
234	601808	中海油服	3,098	39,747.34	0.16
235	600380	健康元	4,000	39,720.00	0.16
236	600183	生益科技	3,609	39,699.00	0.16
237	600187	国中水务	7,337	39,546.43	0.16
238	600652	游久游戏	3,067	39,410.95	0.16
239	601238	广汽集团	1,700	39,389.00	0.16
240	600566	济川药业	1,251	39,106.26	0.16
241	600366	宁波韵升	1,966	38,710.54	0.16
242	600557	康缘药业	2,247	38,041.71	0.16
243	600392	盛和资源	2,850	37,990.50	0.16
244	600260	凯乐科技	2,449	37,910.52	0.16
245	600871	石化油服	9,200	37,720.00	0.16
246	600587	新华医疗	1,501	37,690.11	0.16
247	600125	铁龙物流	4,662	37,668.96	0.16
248	601958	金钼股份	4,916	37,607.40	0.16
249	600486	扬农化工	993	37,604.91	0.16
250	600422	昆药集团	2,782	37,584.82	0.16
251	600017	日照港	9,263	37,515.15	0.16

252	600648	外高桥	1,900	37,506.00	0.16
253	600298	安琪酵母	2,100	37,422.00	0.16
254	600970	中材国际	5,276	37,406.84	0.16
255	601000	唐山港	9,222	36,980.22	0.15
256	600284	浦东建设	2,803	36,971.57	0.15
257	600073	上海梅林	3,202	36,662.90	0.15
258	600216	浙江医药	2,889	36,632.52	0.15
259	601608	中信重工	6,509	36,515.49	0.15
260	600416	湘电股份	2,480	36,480.80	0.15
261	600536	中国软件	1,502	36,138.12	0.15
262	601311	骆驼股份	2,200	35,926.00	0.15
263	600651	飞乐音响	3,410	35,907.30	0.15
264	600175	美都能源	7,244	35,857.80	0.15
265	600765	中航重机	2,494	35,739.02	0.15
266	600855	航天长峰	1,234	35,650.26	0.15
267	600662	强生控股	3,200	35,488.00	0.15
268	600634	中技控股	2,000	35,480.00	0.15
269	600835	上海机电	1,817	35,467.84	0.15
270	600626	申达股份	2,589	35,443.41	0.15
271	600694	大商股份	883	35,258.19	0.15
272	600255	鑫科材料	7,243	35,056.12	0.15
273	600502	安徽水利	3,480	34,730.40	0.14
274	601231	环旭电子	3,242	34,721.82	0.14
275	601717	郑煤机	4,900	34,447.00	0.14
276	600875	东方电气	3,171	34,215.09	0.14
277	600169	太原重工	8,484	34,190.52	0.14
278	600880	博瑞传播	3,900	34,164.00	0.14
279	600783	鲁信创投	1,509	34,133.58	0.14
280	600004	白云机场	2,414	34,013.26	0.14
281	600517	置信电气	3,479	33,850.67	0.14
282	600317	营口港	9,711	33,697.17	0.14
283	600809	山西汾酒	1,340	33,526.80	0.14
284	600058	五矿发展	2,200	33,506.00	0.14
285	601801	皖新传媒	1,906	33,488.42	0.14
286	600562	国睿科技	1,100	33,462.00	0.14
287	601588	北辰实业	8,010	33,401.70	0.14
288	600728	佳都科技	3,928	33,270.16	0.14
289	600210	紫江企业	6,100	33,001.00	0.14
290	600826	兰生股份	1,200	32,784.00	0.14

291	600736	苏州高新	3,600	32,508.00	0.13
292	600667	太极实业	4,200	32,382.00	0.13
292	600988	赤峰黄金	2,100	32,382.00	0.13
293	600116	三峡水利	3,373	31,874.85	0.13
294	600399	抚顺特钢	4,634	31,835.58	0.13
295	600481	双良节能	4,220	31,734.40	0.13
296	603799	华友钴业	900	31,653.00	0.13
297	600261	阳光照明	4,384	31,652.48	0.13
298	600022	山东钢铁	12,642	31,605.00	0.13
299	600993	马应龙	1,581	31,572.57	0.13
300	600149	廊坊发展	1,338	31,335.96	0.13
301	600495	晋西车轴	4,316	31,334.16	0.13
302	600282	南钢股份	10,100	31,310.00	0.13
303	600270	外运发展	1,888	31,227.52	0.13
304	600289	亿阳信通	2,404	31,131.80	0.13
305	600323	瀚蓝环境	2,157	30,974.52	0.13
306	600653	申华控股	7,800	30,966.00	0.13
307	600220	江苏阳光	7,132	30,952.88	0.13
308	600677	航天通信	1,800	30,924.00	0.13
309	601777	力帆股份	3,217	30,754.52	0.13
310	600291	西水股份	1,600	30,688.00	0.13
311	600433	冠豪高新	3,800	30,476.00	0.13
312	600363	联创光电	1,841	30,376.50	0.13
313	603188	亚邦股份	1,700	30,362.00	0.13
314	601519	大智慧	4,000	30,320.00	0.13
315	600277	亿利洁能	4,262	30,302.82	0.13
316	600859	王府井	1,856	30,215.68	0.13
317	600807	天业股份	2,200	30,206.00	0.13
318	600963	岳阳林纸	3,684	30,098.28	0.12
319	600750	江中药业	975	30,049.50	0.12
320	600537	亿晶光电	4,020	29,868.60	0.12
321	600458	时代新材	2,100	29,715.00	0.12
322	600269	赣粤高速	5,892	29,636.76	0.12
323	600805	悦达投资	3,466	29,426.34	0.12
324	600578	京能电力	7,000	29,400.00	0.12
325	600568	中珠医疗	1,174	29,350.00	0.12
326	601011	宝泰隆	4,100	29,233.00	0.12
327	600580	卧龙电气	3,208	29,192.80	0.12
328	600729	重庆百货	1,232	28,865.76	0.12

329	601666	平煤股份	5,900	28,733.00	0.12
330	600330	天通股份	2,747	28,706.15	0.12
331	600756	浪潮软件	1,228	28,342.24	0.12
332	600351	亚宝药业	2,845	28,108.60	0.12
333	600596	新安股份	2,739	28,047.36	0.12
334	603077	和邦生物	5,463	27,970.56	0.12
335	600006	东风汽车	4,053	27,884.64	0.12
336	600053	九鼎投资	600	27,636.00	0.11
337	600123	兰花科创	3,431	27,585.24	0.11
338	603118	共进股份	700	27,545.00	0.11
339	600395	盘江股份	3,398	27,421.86	0.11
340	600563	法拉电子	746	27,355.82	0.11
341	600894	广日股份	2,000	27,340.00	0.11
342	600063	皖维高新	5,890	27,270.70	0.11
343	600288	大恒科技	1,807	27,123.07	0.11
344	600466	蓝光发展	2,800	27,076.00	0.11
345	600595	中孚实业	4,815	27,060.30	0.11
346	600206	有研新材	2,722	27,056.68	0.11
347	600571	信雅达	1,400	26,852.00	0.11
348	600428	中远海特	4,339	26,554.68	0.11
349	600754	锦江股份	900	26,514.00	0.11
350	600790	轻纺城	3,678	26,481.60	0.11
351	600812	华北制药	4,230	26,479.80	0.11
352	601689	拓普集团	900	26,478.00	0.11
353	600112	天成控股	2,400	26,352.00	0.11
354	600057	象屿股份	2,290	26,335.00	0.11
355	601886	江河集团	2,461	26,209.65	0.11
356	601001	大同煤业	4,288	26,199.68	0.11
357	600639	浦东金桥	1,403	26,039.68	0.11
358	600059	古越龙山	2,511	25,712.64	0.11
359	600862	中航高科	2,100	25,704.00	0.11
360	600757	长江传媒	3,086	25,644.66	0.11
361	600096	云天化	2,700	25,623.00	0.11
362	603369	今世缘	1,950	25,584.00	0.11
363	600195	中牧股份	1,200	25,500.00	0.11
364	601890	亚星锚链	2,900	25,491.00	0.11
365	603899	晨光文具	1,400	25,480.00	0.11
366	600775	南京熊猫	1,810	25,159.00	0.10
367	600292	远达环保	2,000	24,740.00	0.10

368	601005	重庆钢铁	9,800	24,696.00	0.10
369	600869	智慧能源	3,180	24,613.20	0.10
370	600773	西藏城投	2,060	24,575.80	0.10
371	600551	时代出版	1,200	24,384.00	0.10
372	600460	士兰微	3,900	24,258.00	0.10
373	600280	中央商场	2,800	24,108.00	0.10
374	600640	号百控股	1,200	23,976.00	0.10
375	600119	长江投资	1,200	23,892.00	0.10
376	600831	广电网络	1,825	23,834.50	0.10
377	600586	金晶科技	5,141	23,802.83	0.10
378	600377	宁沪高速	2,781	23,777.55	0.10
379	603198	迎驾贡酒	1,100	23,705.00	0.10
380	600846	同济科技	2,552	23,503.92	0.10
381	600825	新华传媒	2,700	23,463.00	0.10
382	601002	晋亿实业	2,450	23,324.00	0.10
383	603885	吉祥航空	1,000	23,300.00	0.10
384	601222	林洋能源	2,875	23,201.25	0.10
385	600630	龙头股份	1,500	23,160.00	0.10
386	601158	重庆水务	3,039	22,579.77	0.09
387	601369	陕鼓动力	3,280	22,468.00	0.09
388	603328	依顿电子	700	22,386.00	0.09
389	600236	桂冠电力	3,667	22,368.70	0.09
390	600526	菲达环保	1,800	22,122.00	0.09
391	600350	山东高速	3,400	22,032.00	0.09
392	600329	中新药业	1,257	21,922.08	0.09
393	600501	航天晨光	1,200	21,888.00	0.09
394	603308	应流股份	995	21,810.40	0.09
395	601139	深圳燃气	2,393	21,752.37	0.09
396	601908	京运通	3,029	21,566.48	0.09
397	600188	兖州煤业	1,976	21,459.36	0.09
398	601126	四方股份	2,200	21,406.00	0.09
399	600864	哈投股份	1,846	21,081.32	0.09
400	600624	复旦复华	2,439	20,975.40	0.09
401	600180	瑞茂通	1,548	20,959.92	0.09
402	603699	纽威股份	1,243	20,932.12	0.09
403	600650	锦江投资	900	20,808.00	0.09
404	600133	东湖高新	2,527	20,771.94	0.09
405	600636	三爱富	1,498	20,762.28	0.09
406	600604	市北高新	1,000	20,670.00	0.09

407	603508	思维列控	300	20,556.00	0.09
408	600830	香溢融通	1,800	20,430.00	0.08
409	601069	西部黄金	900	20,124.00	0.08
410	600405	动力源	1,800	20,106.00	0.08
411	600251	冠农股份	2,420	19,626.20	0.08
412	603528	多伦科技	300	19,605.00	0.08
413	600726	华电能源	3,900	19,305.00	0.08
414	601515	东风股份	1,611	19,283.67	0.08
415	600776	东方通信	2,252	19,277.12	0.08
416	600429	三元股份	2,446	19,201.10	0.08
417	603169	兰石重装	1,400	18,704.00	0.08
418	603883	老百姓	400	18,660.00	0.08
419	600425	青松建化	3,915	18,204.75	0.08
420	600874	创业环保	2,233	18,154.29	0.08
421	603567	珍宝岛	900	17,784.00	0.07
422	600338	西藏珠峰	600	17,388.00	0.07
423	600335	国机汽车	1,400	17,010.00	0.07
424	603698	航天工程	600	16,554.00	0.07
425	600397	安源煤业	3,000	15,480.00	0.06
426	601226	华电重工	1,881	15,443.01	0.06
427	600088	中视传媒	700	15,344.00	0.06
428	600515	海航基础	1,300	15,080.00	0.06
429	603005	晶方科技	500	15,020.00	0.06
430	603986	兆易创新	83	14,771.51	0.06
431	601969	海南矿业	1,200	14,688.00	0.06
432	600744	华银电力	2,700	14,202.00	0.06
433	601016	节能风电	1,600	14,160.00	0.06
434	603868	飞科电器	300	14,058.00	0.06
435	603126	中材节能	1,135	13,620.00	0.06
436	601968	宝钢包装	1,400	13,398.00	0.06
437	603979	金诚信	740	13,194.20	0.05
438	603866	桃李面包	300	13,170.00	0.05
439	600278	东方创业	803	13,104.96	0.05
440	603377	东方时尚	300	12,111.00	0.05
441	600917	重庆燃气	900	11,871.00	0.05
442	601020	华钰矿业	300	11,754.00	0.05
443	603999	读者传媒	400	11,728.00	0.05
444	603025	大豪科技	300	11,709.00	0.05
445	603859	能科股份	217	11,594.31	0.05

446	603339	四方冷链	300	11,184.00	0.05
447	601375	中原证券	2,724	10,896.00	0.05
448	601368	绿城水务	900	10,881.00	0.05
449	601127	小康股份	400	10,696.00	0.04
450	601038	一拖股份	900	10,170.00	0.04
451	603861	白云电器	300	9,474.00	0.04
452	603116	红蜻蜓	400	8,824.00	0.04
453	603568	伟明环保	350	8,155.00	0.03
454	600623	华谊集团	500	6,720.00	0.03
455	603060	国检集团	169	5,977.53	0.02

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600795	国电电力	188,480.00	0.55
3	601901	方正证券	178,057.00	0.52
4	600585	海螺水泥	175,938.00	0.52
5	600690	青岛海尔	166,340.00	0.49
6	601669	中国电建	150,586.00	0.44
7	600010	包钢股份	144,448.00	0.42
8	600660	福耀玻璃	129,850.00	0.38
9	600606	绿地控股	121,079.00	0.35
10	601919	中远海控	108,741.00	0.32
11	600900	长江电力	107,852.00	0.32
12	600061	国投安信	103,143.00	0.30
13	600018	上港集团	98,063.00	0.29
14	600150	中国船舶	88,911.00	0.26
15	600153	建发股份	78,057.00	0.23
16	600682	南京新百	76,792.00	0.23
17	600666	奥瑞德	76,326.00	0.22
18	600978	宜华生活	72,439.00	0.21
19	600297	广汇汽车	71,258.00	0.21

20	600879	航天电子	69,286.00	0.20
----	--------	------	-----------	------

8.4.2 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

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	600011	华能国际	173,291.65	0.51
3	601901	方正证券	169,568.60	0.50
4	600029	南方航空	161,760.05	0.47
5	600100	同方股份	147,415.10	0.43
6	600547	山东黄金	146,883.24	0.43
7	601727	上海电气	145,254.76	0.43
8	600660	福耀玻璃	133,046.41	0.39
9	601788	光大证券	125,170.70	0.37
10	600485	信威集团	110,653.71	0.32
11	601198	东兴证券	109,585.00	0.32
12	601919	中远海控	105,513.30	0.31
13	601106	中国一重	85,505.12	0.25
14	601179	中国西电	65,005.85	0.19
15	600545	新疆城建	44,257.96	0.13
16	600067	冠城大通	43,393.19	0.13
17	601099	太平洋	43,059.93	0.13
18	600875	东方电气	38,734.66	0.11
19	600185	格力地产	37,367.40	0.11
20	600340	华夏幸福	36,364.92	0.11

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。

8.4.3 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	4,900,262.45
卖出股票收入（成交）总额	5,201,466.31

注：不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除太平洋证券股份有限公司（601099）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。

太平洋证券股份有限公司 2016 年 10 月 24 日发布关于收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）的调查通知书（沪证专调查字 2016485 号）的公告，对其保荐的 IPO 申报

企业龙宝参茸股份有限公司，中国证监会决定对龙宝参茸立案调查。作为龙宝参茸的保荐机构，公司将全面配合中国证监会的调查工作，同时严格按照监管要求履行信息披露义务。目前公司的经营情况正常。

对该股票投资决策程序的说明：

根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

8.12.2

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。

8.12.3 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	1.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	104.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106.14

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
578	10,777.10	4,373.00	0.07%	3,625,411.00	58.20%

9.1.2 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
本基金联接基金	2,599,377.00	41.73%

9.2 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	徐钧	108,134.00	1.74%
2	陈密	107,800.00	1.73%
3	钟鸣	100,000.00	1.61%
4	郭秀琴	100,000.00	1.61%
5	张家泰	100,000.00	1.61%
6	薛成奇	96,700.00	1.55%
7	沈曙明	96,295.00	1.55%
8	郝晋华	82,000.00	1.32%
9	刘飞跃	67,900.00	1.09%
10	王秀芬	65,240.00	1.05%

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。

9.3 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。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

§10 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	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	6,229,161.00

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2016年11月24日，经公司股东会批准贾波先生、翟军先生、文光伟先生、沈志群先生、李亦宜女士为公司董事。

2016年11月24日，经公司董事会选举贾波先生为公司董事长，任职时间自2016年12月14日起。

2016年11月24日，经公司股东会批准何雅茵女士、刘晓冰先生为公司监事。

2016年12月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 60,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 7 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	9,958,922.71	100.00%	9,275.03	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，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，基金未新增专用交易单元。

11.7.2 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%	-	-	-	-

11.8 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	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 10 月 25 日
2	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 增加一级交易商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 10 月 21 日
3	上证中小盘 ETF 更新招募说明书正文 2016 第 2 次	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 9 月 7 日
4	上证中小盘 ETF 更新招募说明书摘要 2016 年第 2 次	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 9 月 7 日
5	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 27 日
6	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 27 日
7	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 21 日
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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

§12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

托管人住所

12.3 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

华泰柏瑞基金管理有限公司
2017年3月29日