

# 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

## 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 26 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 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
8.4 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.....	60
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>60</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>61</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62

---

10.8 其他重大事件.....	63
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>64</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	错误! 未定义书签。
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 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	17,729,161.00 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	2011-03-28

### 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 层及基金托管人住所

## 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-278,769.97
本期利润	212,896.15
加权平均基金份额本期利润	0.0165
本期加权平均净值利润率	0.42%
本期基金份额净值增长率	3.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	6,007,211.69
期末可供分配基金份额利润	0.3388
期末基金资产净值	70,875,223.08
期末基金份额净值	3.9977
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	10.33%

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

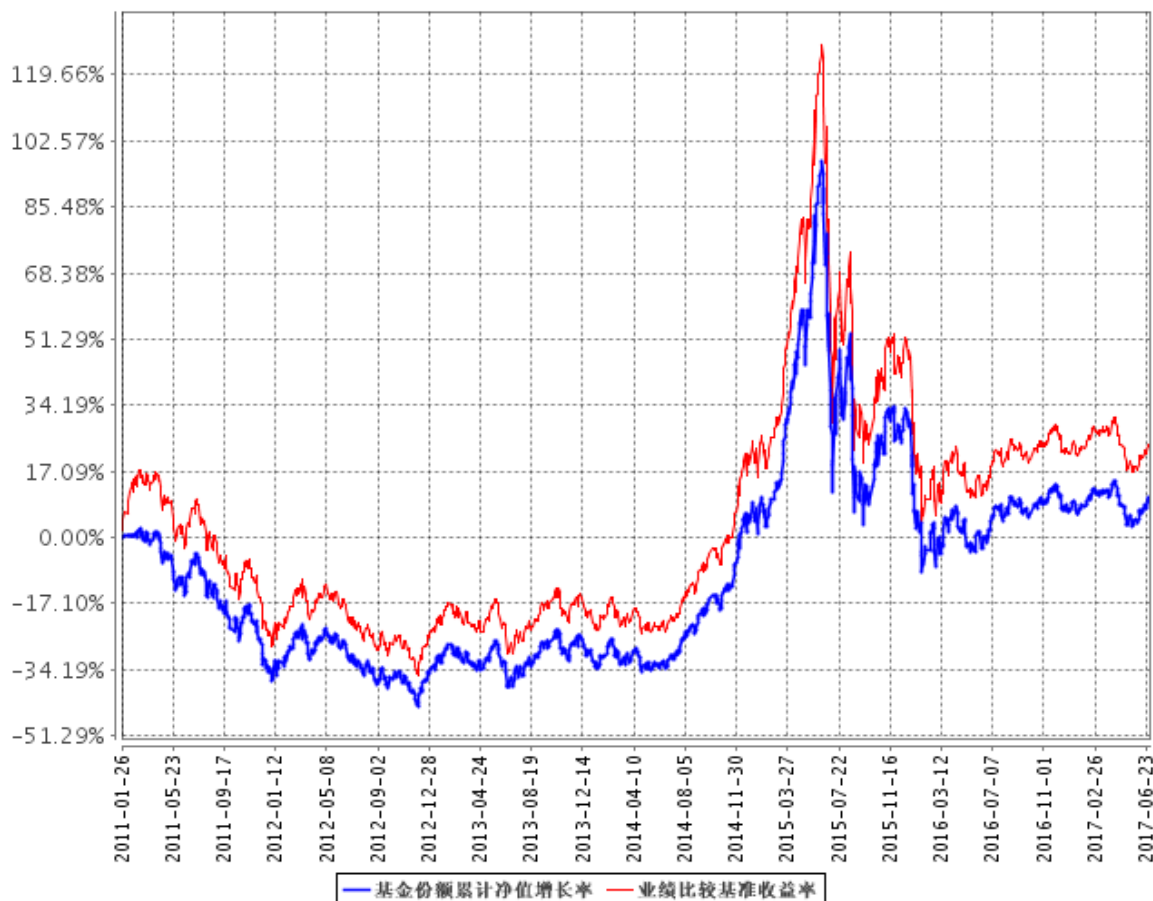
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.47%	0.65%	4.75%	0.65%	0.72%	0.00%
过去三个月	-0.42%	0.77%	-1.95%	0.77%	1.53%	0.00%
过去六个月	3.19%	0.67%	1.98%	0.67%	1.21%	0.00%
过去一年	8.43%	0.75%	7.37%	0.75%	1.06%	0.00%
过去三年	61.07%	2.02%	58.57%	1.99%	2.50%	0.03%
自基金合同生效起至今	10.33%	1.68%	24.15%	1.68%	-13.82%	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 2017 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、华泰柏瑞亨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、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 916.45 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	指数投资部总监、本基金的基金经理	2011 年 1 月 26 日	-	16 年	16 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 月起任指数投资部副总监。2011 年 1 月起担任上证中小盘 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

2017 上半年 A 股市场分化显著，大盘蓝筹稳步走强，中小盘股票则经历估值下调。截至 6 月底，沪深 300 指数累计涨幅 10.78%，中证 500 和中证 1000 指数分别下跌-2.00%和-12.07%。从投资线索来看，一方面，市场对于经济“周期复苏”的预期，驱动钢铁、有色金属、建筑建材等板块上涨；另一方面，得益于资金对具有低估值、稳定盈利、高分红类型股票的追捧，消费、医药生物、金融服务等板块表现亮眼。

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 1.210%，日均绝对跟踪偏离度为 0.021%，期间日跟踪误差为 0.030%，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 3.9977 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.19%，业绩比较基准收益率为 1.98%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年经济走势我们并不悲观。在政策打压房地产投机和金融降杠杆的大背景下，宏观经济展现出较好的韧性。下半年三、四线房地产数据有望超预期，而经过前期较为严格的金融降杠杆，经济和市场出现系统性风险的可能性大幅降低。但年内经济发生显著好转的概率也不大，加之当前市场情绪偏低，我们认为当前风格将得以延续。具有稳定业绩增长、估值合理、高分红等价值蓝筹仍是首选。需要特别指出的是，伴随股价上涨，当前龙头白马股的估值已处于历史相对高位，价值资金抱团现象显著。此外，随着本轮调整，小盘股估值趋于合理，后期有望超跌反弹。

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**

注：截止本报告期末，本基金自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 3 月 14 日连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情况。

## § 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,143,044.97	478,516.28
结算备付金		8,105.58	-
存出保证金		3,158.58	1.28
交易性金融资产	6.4.7.2	69,844,189.76	23,926,994.40
其中：股票投资		69,844,189.76	23,926,994.40
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		50,756.45	-
应收利息	6.4.7.5	162.50	104.86
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		71,049,417.84	24,405,616.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		28,239.69	10,419.02
应付托管费		5,647.92	2,083.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	10,965.80	3,810.98



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	129,341.35	260,000.00
负债合计		174,194.76	276,313.82
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	64,868,011.39	22,791,450.01
未分配利润	6.4.7.10	6,007,211.69	1,337,852.99
所有者权益合计		70,875,223.08	24,129,303.00
负债和所有者权益总计		71,049,417.84	24,405,616.82

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.9977 元，基金份额总额 17,729,161.00 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		568,761.65	-6,871,017.44
1.利息收入		4,890.91	1,694.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,889.70	1,689.37
债券利息收入		1.21	5.29
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）		46,604.52	-1,643,577.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-457,772.10	-1,858,052.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	273.59	5,079.71
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	504,103.03	209,395.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	491,666.12	-5,226,805.45
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	25,600.10	-2,329.49

<b>减：二、费用</b>		355,865.50	324,753.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	124,867.65	66,668.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,973.53	13,333.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	25,593.61	8,899.31
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	180,430.71	235,852.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		212,896.15	-7,195,771.38
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		212,896.15	-7,195,771.38

### 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	22,791,450.01	1,337,852.99	24,129,303.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	212,896.15	212,896.15
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）	42,076,561.38	4,456,462.55	46,533,023.93
其中：1. 基金申购款	42,076,561.38	4,456,462.55	46,533,023.93
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	64,868,011.39	6,007,211.69	70,875,223.08

项目	上年度可比期间 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

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。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 8 月 26 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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的说明

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变更。

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 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。

## 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 2017年6月30日
活期存款	1,143,044.97
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,143,044.97

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	73,553,547.52	69,844,189.76	-3,709,357.76
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	73,553,547.52	69,844,189.76	-3,709,357.76

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	157.50
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	3.60
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	1.40
合计	162.50

### 6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金无其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	10,965.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,965.80

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017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	79,341.35
应付指数使用费	50,000.00
合计	129,341.35

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,229,161.00	22,791,450.01
本期申购	11,500,000.00	42,076,561.38
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	17,729,161.00	64,868,011.39

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	9,932,900.47	-8,595,047.48	1,337,852.99
本期利润	-278,769.97	491,666.12	212,896.15
本期基金份额交易产生的变动数	18,147,691.51	-13,691,228.96	4,456,462.55
其中：基金申购款	18,147,691.51	-13,691,228.96	4,456,462.55
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,801,822.01	-21,794,610.32	6,007,211.69

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	4,747.26
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	127.94
其他	14.50
合计	4,889.70



### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-457,772.10
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-457,772.10

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	5,486,134.56
减：卖出股票成本总额	5,943,906.66
买卖股票差价收入	-457,772.10

### 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 2017年1月1日至2017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	273.59
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	273.59

### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,274.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,000.00
减：应收利息总额	1.21
买卖债券差价收入	273.59

### 6.4.7.13.3 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

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	504,103.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	504,103.03

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	491,666.12
——股票投资	491,666.12
——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	491,666.12

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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	25,600.10
合计	25,600.10

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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	25,593.61
银行间市场交易费用	-
合计	25,593.61

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	19,835.79
上市费	29,752.78
银行划款手续费	1,089.36
指数使用费	100,000.00
合计	180,430.71

### 6.4.7.21 分部报告

注：本基金无分部报告。

## 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

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

本基金并无须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

## 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 权证交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 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。

### 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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	124,867.65	66,668.55
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 3 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,973.53	13,333.69

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 3 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：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

### 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：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2017年6月30日		2016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	14,026,177.00	79.1100%	2,599,377.00	41.7300%

### 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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	1,143,044.97	4,747.26	302,763.65	1,642.35

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：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2017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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	874	8,416.62	8,416.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

## 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
600795	国电电力	2017年6月5日	重大资产重组	3.60	-	-	157,600	512,216.00	567,360.00	-
601727	上海电气	2017年6月22日	审核公司资产重组事项	7.57	2017年7月3日	7.54	41,300	329,662.00	312,641.00	-
600643	爱建集团	2017年4月17日	重大资产重组	14.98	2017年8月2日	16.48	20,340	290,233.01	304,693.20	-
601919	中远海控	2017年5月17日	重大资产重组	5.35	2017年7月27日	6.48	54,300	316,398.00	290,505.00	-
600666	奥瑞德	2017年5月31日	重大资产重组	17.40	-	-	10,560	192,626.00	183,744.00	-
601872	招商	2017	发	5.16	-	-	27,591	169,947.66	142,369.56	-



	轮船	年 5 月 2 日	行股份购买资产							
600172	黄河旋风	2017 年 6 月 30 日	重大事项	8.23	2017 年 7 月 14 日	8.00	13,420	133,361.06	110,446.60	-
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	重大资产重组	7.79	-	-	13,600	117,697.05	105,944.00	-
601608	中信重工	2017 年 4 月 19 日	发行股票购买资产	5.54	2017 年 7 月 26 日	5.26	17,509	120,186.82	96,999.86	-
600255	鑫科材料	2017 年 6 月 26 日	重大资产重组	4.04	-	-	23,543	114,986.07	95,113.72	-
600568	中珠医疗	2017 年 4 月 25 日	重大资产重组	19.16	2017 年 7 月 26 日	-	4,874	95,260.37	93,385.84	-
600634	富控互动	2017 年 4 月 19 日	重大资产重组	18.03	2017 年 7 月 17 日	17.21	5,000	91,050.00	90,150.00	-
601069	西部	2017	发	26.26	-	-	3,200	63,852.09	84,032.00	-

	黄金	年 5 月 26 日	行股票及支付现金购买资产								
600289	亿阳信通	2017 年 6 月 26 日	发行股票购买资产	10.94	2017 年 8 月 18 日	12.03	6,804	102,470.55	74,435.76		-
600057	象屿股份	2017 年 6 月 27 日	筹划配股事项	10.17	2017 年 7 月 4 日	10.07	7,190	79,384.28	73,122.30		-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事项	7.29	-	-	8,954	77,655.36	65,274.66		-
600653	申华控股	2017 年 5 月 8 日	重大资产重组	3.26	2017 年 8 月 24 日	3.59	19,800	86,699.49	64,548.00		-
601001	大同煤业	2017 年 6 月 22 日	重大事项	5.25	2017 年 7 月 21 日	5.78	11,588	75,860.10	60,837.00		-
600460	士兰微	2017 年 5 月 22 日	重大资产	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	9,900	68,737.05	60,093.00		-

			重组							
600490	鹏欣资源	2017年2月21日	重大资产重组	7.91	-	-	7,448	65,249.97	58,913.68	-
600655	豫园商城	2017年5月17日	重大资产重组	11.32	-	-	5,053	81,197.45	57,199.96	-
603126	中材节能	2017年6月27日	发行股份购买资产	16.46	-	-	3,435	45,698.16	56,540.10	-
600654	*ST中安	2017年6月7日	重大资产重组	13.48	-	-	3,937	130,546.36	53,070.76	-
603501	韦尔股份	2017年6月5日	重大资产重组	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-
600277	亿利洁能	2017年3月6日	重大资产重组	7.83	-	-	4,262	40,441.53	33,371.46	-
603861	白云电器	2017年6月15日	重大资产	24.27	-	-	1,200	35,221.41	29,124.00	-

			重 组							
600636	*ST 爱富	2016 年 5 月 9 日	重 大 资 产 重 组	13.86	2017 年 8 月 4 日	14.55	1,498	23,061.13	20,762.28	-

### 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，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，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 2017 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%（2016 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。

### 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 2017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	1,143,044.97	-	-	-	-	-	1,143,044.97
结算备付金	8,105.58	-	-	-	-	-	8,105.58
存出保证金	3,158.58	-	-	-	-	-	3,158.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	69,844,189.76	69,844,189.76
应收证券清算款	-	-	-	-	-	50,756.45	50,756.45
应收利息	-	-	-	-	-	162.50	162.50
资产总计	1,154,309.13	-	-	-	-	69,895,108.71	71,049,417.84
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,239.69	28,239.69
应付托管费	-	-	-	-	-	5,647.92	5,647.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,965.80	10,965.80
其他负债	-	-	-	-	-	129,341.35	129,341.35
负债总计	-	-	-	-	-	174,194.76	174,194.76
利率敏感度缺口	1,154,309.13	-	-	-	-	69,720,913.95	70,875,223.08
上年度末 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

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 2017 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 2017 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%（2016 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（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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%，也可少量投资于新股、债券、非成份股、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。于 2017 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	69,844,189.76	98.55	23,926,994.40	99.16
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	69,844,189.76	98.55	23,926,994.40	99.16

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

#### 6.4.13.4.3.2 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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	上证中小盘指数上涨 5%	253.83	120.00
上证中小盘指数下跌 5%	-253.83	-120.00	

#### 6.4.13.4.4 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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。



## § 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	69,844,189.76	98.30
	其中：股票	69,844,189.76	98.30
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	1,151,150.55	1.62
7	其他各项资产	54,077.53	0.08
8	合计	71,049,417.84	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

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	204,680.57	0.29
B	采矿业	3,971,274.72	5.60
C	制造业	33,266,964.28	46.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,309,252.24	7.49
E	建筑业	2,498,417.56	3.53
F	批发和零售业	4,196,087.13	5.92
G	交通运输、仓储和邮政业	4,946,271.49	6.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,243,458.61	4.58
J	金融业	5,971,897.38	8.43
K	房地产业	3,254,914.31	4.59
L	租赁和商务服务业	1,124,418.44	1.59

M	科学研究和技术服务业	178,833.80	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	101,449.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	63,903.00	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,011,479.14	1.43
S	综合	500,888.09	0.71
	合计	69,844,189.76	98.55

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期没有通过沪港通投资的股票。

### 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	89,842	1,381,769.96	1.95
2	600276	恒瑞医药	23,382	1,182,895.38	1.67
3	600015	华夏银行	88,560	816,523.20	1.15
4	600019	宝钢股份	120,355	807,582.05	1.14
5	600703	三安光电	33,105	652,168.50	0.92
6	600690	青岛海尔	42,200	635,110.00	0.90
7	600585	海螺水泥	27,700	629,621.00	0.89
8	601939	建设银行	92,829	570,898.35	0.81
9	600795	国电电力	157,600	567,360.00	0.80
10	601009	南京银行	49,421	554,009.41	0.78
11	600309	万华化学	18,898	541,238.72	0.76
12	600089	特变电工	51,773	534,815.09	0.75
13	600009	上海机场	13,686	510,624.66	0.72
14	600660	福耀玻璃	19,400	505,176.00	0.71
15	601899	紫金矿业	143,332	491,628.76	0.69
16	601669	中国电建	61,800	489,456.00	0.69
17	600741	华域汽车	20,117	487,636.08	0.69
18	601377	兴业证券	64,700	480,721.00	0.68

19	601607	上海医药	16,185	467,422.80	0.66
20	600886	国投电力	56,281	444,619.90	0.63
21	600196	复星医药	13,944	432,124.56	0.61
22	600031	三一重工	52,925	430,280.25	0.61
23	600068	葛洲坝	38,193	429,289.32	0.61
24	601600	中国铝业	90,860	410,687.20	0.58
25	601888	中国国旅	13,600	409,904.00	0.58
26	600066	宇通客车	18,400	404,248.00	0.57
27	600010	包钢股份	182,980	400,726.20	0.57
28	600637	东方明珠	18,200	394,394.00	0.56
29	601099	太平洋	94,412	379,536.24	0.54
30	601933	永辉超市	52,902	374,546.16	0.53
31	601618	中国中冶	73,785	369,662.85	0.52
32	600893	航发动力	13,400	365,820.00	0.52
33	601555	东吴证券	31,966	358,978.18	0.51
34	600383	金地集团	31,191	357,760.77	0.50
35	600535	天士力	8,557	355,457.78	0.50
36	600705	中航资本	62,024	350,435.60	0.49
37	600816	安信信托	25,187	342,291.33	0.48
38	600109	国金证券	29,200	342,224.00	0.48
39	600522	中天科技	27,430	330,531.50	0.47
40	600487	亨通光电	11,700	328,185.00	0.46
41	600570	恒生电子	6,887	321,485.16	0.45
42	600271	航天信息	15,506	320,043.84	0.45
43	600406	国电南瑞	18,100	319,465.00	0.45
44	601727	上海电气	41,300	312,641.00	0.44
45	601018	宁波港	54,747	309,320.55	0.44
46	600739	辽宁成大	16,933	305,301.99	0.43
47	600643	爱建集团	20,340	304,693.20	0.43
48	600201	生物股份	8,468	301,206.76	0.42
49	600352	浙江龙盛	31,517	300,357.01	0.42
50	600674	川投能源	30,443	298,950.26	0.42
51	600023	浙能电力	54,420	297,133.20	0.42
52	600177	雅戈尔	29,224	295,746.88	0.42
53	601919	中远海控	54,300	290,505.00	0.41
54	600867	通化东宝	15,870	289,468.80	0.41
55	601992	金隅股份	44,618	288,678.46	0.41
56	600018	上港集团	45,000	285,300.00	0.40
57	601012	隆基股份	16,618	284,167.80	0.40

58	600221	海航控股	88,017	283,414.74	0.40
59	600415	小商品城	38,729	280,397.96	0.40
60	600804	鹏博士	15,662	278,000.50	0.39
61	600115	东方航空	40,791	277,378.80	0.39
62	603993	洛阳钼业	53,711	271,777.66	0.38
63	601111	中国国航	27,596	269,061.00	0.38
64	601998	中信银行	42,300	266,067.00	0.38
65	601225	陕西煤业	37,500	265,125.00	0.37
66	600820	隧道股份	26,184	264,458.40	0.37
67	600085	同仁堂	7,398	258,634.08	0.36
68	600208	新湖中宝	56,989	256,450.50	0.36
69	600153	建发股份	19,600	253,428.00	0.36
70	603288	海天味业	6,214	253,406.92	0.36
71	600682	南京新百	6,800	250,920.00	0.35
72	603799	华友钴业	4,100	249,198.00	0.35
73	600219	南山铝业	73,442	248,968.38	0.35
74	600079	人福医药	12,665	248,487.30	0.35
75	600525	长园集团	18,277	248,384.43	0.35
76	600663	陆家嘴	10,200	241,128.00	0.34
77	600315	上海家化	7,388	239,740.60	0.34
78	600061	国投安信	15,400	239,470.00	0.34
79	600489	中金黄金	23,862	239,335.86	0.34
80	600436	片仔癀	3,894	237,689.76	0.34
81	600157	永泰能源	66,022	235,698.54	0.33
82	600176	中国巨石	21,394	234,906.12	0.33
83	601155	新城控股	12,600	233,604.00	0.33
84	600642	申能股份	36,781	231,720.30	0.33
85	600362	江西铜业	13,617	229,582.62	0.32
86	600118	中国卫星	8,186	227,898.24	0.32
87	600332	白云山	7,813	226,889.52	0.32
88	600150	中国船舶	9,900	226,413.00	0.32
89	600398	海澜之家	23,831	226,156.19	0.32
90	600110	诺德股份	15,939	224,580.51	0.32
91	600297	广汇汽车	29,660	223,339.80	0.32
92	601633	长城汽车	16,733	222,381.57	0.31
93	600170	上海建工	58,211	222,366.02	0.31
94	600008	首创股份	33,380	219,640.40	0.31
95	600369	西南证券	39,036	218,991.96	0.31
96	600584	长电科技	13,611	218,456.55	0.31

97	600027	华电国际	44,328	214,104.24	0.30
98	601333	广深铁路	46,854	211,780.08	0.30
99	600688	上海石化	30,648	202,583.28	0.29
100	600879	航天电子	22,600	198,654.00	0.28
101	600583	海油工程	31,469	196,366.56	0.28
102	600516	方大炭素	13,705	194,885.10	0.27
103	600004	白云机场	10,514	194,088.44	0.27
104	600266	北京城建	13,200	191,928.00	0.27
105	601117	中国化学	27,336	191,078.64	0.27
106	601168	西部矿业	24,828	190,927.32	0.27
107	600291	西水股份	8,600	189,200.00	0.27
108	601216	君正集团	38,688	189,184.32	0.27
109	600718	东软集团	12,100	188,155.00	0.27
110	600325	华发股份	22,472	187,641.20	0.26
111	601991	大唐发电	41,433	187,277.16	0.26
112	601098	中南传媒	10,002	186,437.28	0.26
113	600388	龙净环保	11,904	184,869.12	0.26
114	600839	四川长虹	51,036	184,750.32	0.26
115	600426	华鲁恒升	15,677	184,047.98	0.26
116	600666	奥瑞德	10,560	183,744.00	0.26
117	600166	福田汽车	64,492	183,157.28	0.26
118	600161	天坛生物	4,713	182,911.53	0.26
119	600056	中国医药	7,042	182,739.90	0.26
120	600521	华海药业	8,668	182,374.72	0.26
121	600256	广汇能源	43,490	180,048.60	0.25
122	600498	烽火通信	7,088	179,680.80	0.25
123	600649	城投控股	16,754	176,084.54	0.25
124	600588	用友网络	10,244	175,377.28	0.25
125	600074	保千里	13,600	174,216.00	0.25
126	601258	庞大集团	62,183	174,112.40	0.25
127	600373	中文传媒	7,400	173,974.00	0.25
128	600260	凯乐科技	6,849	173,553.66	0.24
129	600895	张江高科	10,259	173,171.92	0.24
130	600528	中铁工业	12,050	172,194.50	0.24
131	600827	百联股份	10,548	171,405.00	0.24
132	600704	物产中大	23,356	170,265.24	0.24
133	600435	北方导航	11,774	168,485.94	0.24
134	600138	中青旅	8,000	168,480.00	0.24
135	600699	均胜电子	5,200	166,868.00	0.24

136	600978	宜华生活	16,532	166,146.60	0.23
137	600060	海信电器	10,827	164,245.59	0.23
138	600376	首开股份	14,279	163,351.76	0.23
139	601718	际华集团	18,200	159,978.00	0.23
140	601000	唐山港	30,322	158,280.84	0.22
141	600158	中体产业	9,222	157,696.20	0.22
142	600497	驰宏锌锗	23,836	156,125.80	0.22
143	600503	华丽家族	22,190	153,332.90	0.22
144	600022	山东钢铁	74,205	152,862.30	0.22
145	601866	中远海发	42,233	152,038.80	0.21
146	600909	华安证券	15,000	151,350.00	0.21
147	601997	贵阳银行	9,500	150,195.00	0.21
148	600614	鹏起科技	13,620	149,820.00	0.21
149	600038	中直股份	3,261	149,255.97	0.21
150	601898	中煤能源	25,366	149,152.08	0.21
151	600755	厦门国贸	16,273	148,409.76	0.21
152	600298	安琪酵母	5,700	147,459.00	0.21
153	603019	中科曙光	5,200	146,328.00	0.21
154	600873	梅花生物	25,797	146,268.99	0.21
155	600808	马钢股份	41,240	145,989.60	0.21
156	600418	江淮汽车	13,700	144,535.00	0.20
157	600717	天津港	11,571	144,521.79	0.20
158	600635	大众公用	26,461	144,212.45	0.20
159	600977	中国电影	7,700	144,144.00	0.20
160	600021	上海电力	11,908	143,967.72	0.20
161	601872	招商轮船	27,591	142,369.56	0.20
162	601231	环旭电子	9,042	142,049.82	0.20
163	600160	巨化股份	11,698	140,726.94	0.20
164	600037	歌华有线	9,656	140,591.36	0.20
165	600600	青岛啤酒	3,985	139,873.50	0.20
166	603589	口子窖	3,600	139,644.00	0.20
167	600633	浙数文化	7,211	139,316.52	0.20
168	600062	华润双鹤	5,063	138,878.09	0.20
169	600500	中化国际	14,380	137,472.80	0.19
170	600122	宏图高科	12,371	137,318.10	0.19
171	601588	北辰实业	22,110	137,082.00	0.19
172	600872	中炬高新	7,476	136,810.80	0.19
173	600511	国药股份	3,742	135,610.08	0.19
174	600594	益佰制药	8,800	134,288.00	0.19

175	601699	潞安环能	17,061	133,417.02	0.19
176	601238	广汽集团	5,100	132,906.00	0.19
177	600566	济川药业	3,451	131,241.53	0.19
178	600392	盛和资源	9,950	131,240.50	0.19
179	601880	大连港	44,243	130,959.28	0.18
180	600549	厦门钨业	6,023	129,434.27	0.18
181	600143	金发科技	21,436	129,259.08	0.18
182	600737	中粮糖业	13,681	129,148.64	0.18
183	600884	杉杉股份	7,838	129,091.86	0.18
184	600811	东方集团	19,708	128,496.16	0.18
185	600868	梅雁吉祥	26,300	128,344.00	0.18
186	600409	三友化工	12,734	128,231.38	0.18
187	600881	亚泰集团	25,155	127,787.40	0.18
188	600372	中航电子	7,300	126,801.00	0.18
189	600312	平高电气	9,227	126,778.98	0.18
190	600809	山西汾酒	3,640	126,271.60	0.18
191	600183	生益科技	10,209	125,979.06	0.18
192	600026	中远海能	18,945	125,605.35	0.18
193	600797	浙大网新	10,062	124,668.18	0.18
194	600967	内蒙一机	9,140	124,578.20	0.18
195	600685	中船防务	4,541	124,332.58	0.18
196	600307	酒钢宏兴	43,388	123,655.80	0.17
197	600863	内蒙华电	41,027	123,491.27	0.17
198	600094	大名城	16,000	122,720.00	0.17
199	600664	哈药股份	21,094	122,556.14	0.17
200	600446	金证股份	6,953	122,233.74	0.17
201	600482	中国动力	4,824	121,998.96	0.17
202	600320	振华重工	23,337	120,885.66	0.17
203	600499	科达洁能	15,202	120,703.88	0.17
204	600970	中材国际	13,876	120,582.44	0.17
205	600787	中储股份	15,225	120,429.75	0.17
206	600567	山鹰纸业	33,567	120,169.86	0.17
207	600478	科力远	13,896	119,644.56	0.17
208	600572	康恩贝	17,112	118,415.04	0.17
209	600874	创业环保	6,033	118,065.81	0.17
210	601021	春秋航空	3,492	117,435.96	0.17
211	600348	阳泉煤业	17,098	115,924.44	0.16
212	600017	日照港	25,563	115,033.50	0.16
213	600125	铁龙物流	12,762	114,347.52	0.16

214	600601	方正科技	30,679	114,125.88	0.16
215	601877	正泰电器	5,673	113,970.57	0.16
216	600711	盛屯矿业	17,031	113,085.84	0.16
217	601118	海南橡胶	19,652	111,623.36	0.16
218	601375	中原证券	11,024	110,901.44	0.16
219	601689	拓普集团	3,300	110,517.00	0.16
220	600172	黄河旋风	13,420	110,446.60	0.16
221	600198	大唐电信	8,604	109,873.08	0.16
222	600597	光明乳业	8,569	109,254.75	0.15
223	600565	迪马股份	19,800	109,098.00	0.15
224	600410	华胜天成	12,280	108,800.80	0.15
225	600416	湘电股份	7,880	107,956.00	0.15
226	600687	刚泰控股	8,300	106,904.00	0.15
227	601717	郑煤机	13,600	105,944.00	0.15
228	600486	扬农化工	2,493	105,229.53	0.15
229	600120	浙江东方	3,908	105,047.04	0.15
230	600582	天地科技	22,864	104,945.76	0.15
231	600039	四川路桥	25,104	104,432.64	0.15
232	600210	紫江企业	17,000	104,380.00	0.15
233	603766	隆鑫通用	14,250	103,740.00	0.15
234	600086	东方金钰	9,465	102,316.65	0.14
235	600282	南钢股份	27,400	101,654.00	0.14
236	601929	吉视传媒	28,862	99,862.52	0.14
237	600466	蓝光发展	11,500	99,245.00	0.14
238	600502	安徽水利	12,780	98,278.20	0.14
239	600323	瀚蓝环境	6,757	98,044.07	0.14
240	600200	江苏吴中	7,400	97,680.00	0.14
241	601958	金钼股份	13,616	97,626.72	0.14
242	603000	人民网	7,400	97,458.00	0.14
243	601608	中信重工	17,509	96,999.86	0.14
244	600316	洪都航空	6,016	96,677.12	0.14
245	600317	营口港	28,111	96,420.73	0.14
246	600366	宁波韵升	5,466	96,420.24	0.14
247	600270	外运发展	5,088	96,315.84	0.14
248	600611	大众交通	17,350	95,772.00	0.14
249	600835	上海机电	4,517	95,489.38	0.13
250	600557	康缘药业	5,747	95,457.67	0.13
251	600759	洲际油气	15,700	95,142.00	0.13
252	600255	鑫科材料	23,543	95,113.72	0.13



253	600765	中航重机	6,894	94,999.32	0.13
254	600169	太原重工	24,584	94,894.24	0.13
255	600151	航天机电	11,500	94,645.00	0.13
256	600751	天海投资	16,600	94,454.00	0.13
257	600648	外高桥	5,100	94,452.00	0.13
258	600267	海正药业	8,053	94,059.04	0.13
259	600562	国睿科技	3,400	93,636.00	0.13
260	600380	健康元	10,300	93,524.00	0.13
261	600568	中珠医疗	4,874	93,385.84	0.13
262	600108	亚盛集团	21,591	93,057.21	0.13
263	600343	航天动力	5,352	92,803.68	0.13
264	600116	三峡水利	8,273	92,740.33	0.13
265	600187	国中水务	18,337	92,601.85	0.13
266	603077	和邦生物	18,163	92,449.67	0.13
267	600391	航发科技	3,431	91,847.87	0.13
268	600563	法拉电子	1,846	91,210.86	0.13
269	601808	中海油服	8,198	90,505.92	0.13
270	600634	富控互动	5,000	90,150.00	0.13
271	600233	圆通速递	4,600	90,114.00	0.13
272	600098	广州发展	11,346	89,746.86	0.13
273	600729	重庆百货	3,332	89,430.88	0.13
274	600639	浦东金桥	4,803	87,030.36	0.12
275	601163	三角轮胎	3,300	86,790.00	0.12
276	600651	飞乐音响	10,210	86,478.70	0.12
277	601611	中国核建	7,200	86,184.00	0.12
278	600073	上海梅林	9,002	85,969.10	0.12
279	601666	平煤股份	16,300	85,901.00	0.12
280	600993	马应龙	3,881	84,528.18	0.12
281	600175	美都能源	19,344	84,146.40	0.12
282	601069	西部黄金	3,200	84,032.00	0.12
283	600728	佳都科技	10,828	83,808.72	0.12
284	603188	亚邦股份	4,800	83,712.00	0.12
285	600422	昆药集团	7,382	83,711.88	0.12
286	600871	石化油服	25,000	83,500.00	0.12
287	600495	晋西车轴	11,716	82,597.80	0.12
288	600750	江中药业	2,375	82,531.25	0.12
289	600330	天通股份	9,347	82,066.66	0.12
290	600926	杭州银行	5,500	81,675.00	0.12
291	600667	太极实业	11,700	81,549.00	0.12

292	600694	大商股份	2,083	81,174.51	0.11
293	600770	综艺股份	10,803	81,022.50	0.11
294	600269	赣粤高速	15,492	80,713.32	0.11
295	601311	骆驼股份	5,700	80,712.00	0.11
296	600587	新华医疗	4,501	80,027.78	0.11
297	600399	抚顺特钢	12,734	79,460.16	0.11
298	600578	京能电力	18,500	79,365.00	0.11
299	600284	浦东建设	7,403	79,360.16	0.11
300	600216	浙江医药	7,989	79,170.99	0.11
301	601890	亚星锚链	9,100	79,079.00	0.11
302	600259	广晟有色	2,000	78,080.00	0.11
303	600963	岳阳林纸	10,284	77,438.52	0.11
304	600185	格力地产	11,400	77,406.00	0.11
305	600645	中源协和	3,590	76,933.70	0.11
306	600171	上海贝岭	7,500	76,275.00	0.11
307	600652	游久游戏	6,967	76,079.64	0.11
308	601801	皖新传媒	5,406	74,710.92	0.11
309	600289	亿阳信通	6,804	74,435.76	0.11
310	601222	林洋能源	9,975	74,114.25	0.10
311	601966	玲珑轮胎	3,300	74,019.00	0.10
312	600988	赤峰黄金	5,800	73,950.00	0.10
313	600756	浪潮软件	3,728	73,777.12	0.10
314	600773	西藏城投	6,660	73,726.20	0.10
315	601011	宝泰隆	11,400	73,302.00	0.10
316	601016	节能风电	19,900	73,232.00	0.10
317	600057	象屿股份	7,190	73,122.30	0.10
318	603883	老百姓	1,500	72,975.00	0.10
319	600745	中茵股份	3,900	72,969.00	0.10
320	600536	中国软件	3,802	72,846.32	0.10
321	600428	中远海特	11,639	72,394.58	0.10
322	600058	五矿发展	5,800	71,978.00	0.10
323	603858	步长制药	1,000	71,640.00	0.10
324	600662	强生控股	8,800	70,664.00	0.10
325	600855	航天长峰	3,334	70,614.12	0.10
326	600206	有研新材	8,122	70,498.96	0.10
327	600123	兰花科创	9,231	70,340.22	0.10
328	600517	置信电气	9,279	70,242.03	0.10
329	603885	吉祥航空	4,620	70,131.60	0.10
330	601777	力帆股份	8,717	70,084.68	0.10

331	600677	航天通信	5,100	70,023.00	0.10
332	600623	华谊集团	6,200	69,998.00	0.10
333	600458	时代新材	6,100	69,845.00	0.10
334	603369	今世缘	5,250	69,300.00	0.10
335	600363	联创光电	4,941	69,223.41	0.10
336	600084	中葡股份	9,300	69,099.00	0.10
337	600894	广日股份	5,800	68,672.00	0.10
338	601886	江河集团	6,661	68,275.25	0.10
339	600790	轻纺城	9,978	67,950.18	0.10
340	600736	苏州高新	9,600	67,872.00	0.10
341	600195	中牧股份	3,500	67,865.00	0.10
342	600595	中孚实业	14,015	67,552.30	0.10
343	600395	盘江股份	9,198	67,421.34	0.10
344	600188	兖州煤业	5,476	67,026.24	0.09
345	600880	博瑞传播	10,200	66,606.00	0.09
346	600377	宁沪高速	6,781	66,453.80	0.09
347	600807	天业股份	7,000	66,010.00	0.09
348	603556	海兴电力	1,500	65,835.00	0.09
349	600673	东阳光科	8,954	65,274.66	0.09
350	600758	红阳能源	7,300	65,262.00	0.09
351	600783	鲁信创投	3,809	64,867.27	0.09
352	603888	新华网	2,000	64,780.00	0.09
353	603816	顾家家居	1,100	64,658.00	0.09
354	600338	西藏珠峰	1,700	64,583.00	0.09
355	600653	申华控股	19,800	64,548.00	0.09
356	600329	中新药业	3,557	64,417.27	0.09
357	601126	四方股份	6,800	64,192.00	0.09
358	600006	东风汽车	10,953	64,075.05	0.09
359	600626	申达股份	6,789	64,020.27	0.09
360	603377	东方时尚	1,700	63,903.00	0.09
361	601878	浙商证券	3,747	63,736.47	0.09
362	600405	动力源	7,876	63,480.56	0.09
363	600280	中央商场	8,000	63,440.00	0.09
364	600059	古越龙山	6,811	63,001.75	0.09
365	603198	迎驾贡酒	3,300	62,799.00	0.09
366	603899	晨光文具	3,600	62,640.00	0.09
367	600596	新安股份	7,339	62,014.55	0.09
368	600757	长江传媒	8,286	61,896.42	0.09
369	600580	卧龙电气	9,008	61,434.56	0.09

370	601001	大同煤业	11,588	60,837.00	0.09
371	600869	智慧能源	8,980	60,435.40	0.09
372	603160	汇顶科技	600	60,180.00	0.08
373	600460	士兰微	9,900	60,093.00	0.08
374	600236	桂冠电力	10,467	59,661.90	0.08
375	600292	远达环保	5,500	59,290.00	0.08
376	601002	晋亿实业	6,850	59,252.50	0.08
377	600650	锦江投资	3,300	59,202.00	0.08
378	600640	号百控股	3,500	59,150.00	0.08
379	600490	鹏欣资源	7,448	58,913.68	0.08
380	601158	重庆水务	8,239	58,908.85	0.08
381	601139	深圳燃气	6,693	57,894.45	0.08
382	600859	王府井	3,556	57,429.40	0.08
383	601908	京运通	11,929	57,259.20	0.08
384	600655	豫园商城	5,053	57,199.96	0.08
385	600350	山东高速	9,200	57,040.00	0.08
386	603118	共进股份	4,180	56,973.40	0.08
387	600537	亿晶光电	11,420	56,871.60	0.08
388	600846	同济科技	6,952	56,797.84	0.08
389	603444	吉比特	200	56,666.00	0.08
390	603126	中材节能	3,435	56,540.10	0.08
391	600321	国栋建设	12,500	55,500.00	0.08
392	600826	兰生股份	3,000	54,300.00	0.08
393	600862	中航高科	5,600	54,264.00	0.08
394	600180	瑞茂通	3,848	54,025.92	0.08
395	600096	云天化	7,300	54,020.00	0.08
396	600481	双良节能	10,020	53,206.20	0.08
397	600654	*ST 中安	3,937	53,070.76	0.07
398	600571	信雅达	3,800	52,820.00	0.07
399	600501	航天晨光	3,500	52,325.00	0.07
400	601515	东风股份	4,611	52,104.30	0.07
401	600288	大恒科技	4,907	52,014.20	0.07
402	600996	贵广网络	4,300	51,471.00	0.07
403	603308	应流股份	3,395	49,091.70	0.07
404	600831	广电网络	4,925	49,003.75	0.07
405	603528	多伦科技	3,400	48,858.00	0.07
406	600744	华银电力	9,900	48,708.00	0.07
407	600775	南京熊猫	4,710	48,136.20	0.07
408	603005	晶方科技	1,700	47,583.00	0.07

409	600526	菲达环保	4,600	47,426.00	0.07
410	600776	东方通信	6,852	46,456.56	0.07
411	603169	兰石重装	3,800	46,170.00	0.07
412	601127	小康股份	2,300	45,885.00	0.06
413	603698	航天工程	1,800	45,360.00	0.06
414	600830	香溢融通	4,600	45,356.00	0.06
415	603979	金诚信	2,540	45,008.80	0.06
416	600429	三元股份	6,846	44,704.38	0.06
417	603801	志邦股份	1,311	44,311.80	0.06
418	600335	国机汽车	3,700	44,252.00	0.06
419	600119	长江投资	3,000	44,100.00	0.06
420	600630	龙头股份	3,800	44,004.00	0.06
421	603868	飞科电器	700	43,288.00	0.06
422	601500	通用股份	3,000	42,660.00	0.06
423	603568	伟明环保	1,950	42,159.00	0.06
424	600551	时代出版	2,600	41,054.00	0.06
425	603328	依顿电子	2,800	39,620.00	0.06
426	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.05
427	603999	读者传媒	1,700	37,944.00	0.05
428	601020	华钰矿业	1,700	37,451.00	0.05
429	601595	上海电影	1,500	37,320.00	0.05
430	600936	广西广电	4,600	37,122.00	0.05
431	603567	珍宝岛	2,200	37,026.00	0.05
432	603508	思维列控	700	37,016.00	0.05
433	600515	海航基础	3,600	36,972.00	0.05
434	601969	海南矿业	3,500	36,960.00	0.05
435	600864	哈投股份	4,446	36,946.26	0.05
436	603258	电魂网络	900	36,936.00	0.05
437	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.05
438	601968	宝钢包装	4,700	34,263.00	0.05
439	603777	来伊份	900	33,417.00	0.05
440	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.05
441	600277	亿利洁能	4,262	33,371.46	0.05
442	603116	红蜻蜓	1,700	31,246.00	0.04
443	603358	华达科技	600	30,396.00	0.04
444	603708	家家悦	1,820	29,939.00	0.04
445	603861	白云电器	1,200	29,124.00	0.04
446	603727	博迈科	900	29,034.00	0.04
447	603228	景旺电子	600	28,950.00	0.04

448	603515	欧普照明	800	28,896.00	0.04
449	600278	东方创业	2,003	26,359.48	0.04
450	601858	中国科传	2,100	26,292.00	0.04
451	601038	一拖股份	2,800	25,844.00	0.04
452	603298	杭叉集团	1,200	24,876.00	0.04
453	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.04
454	603339	四方冷链	900	23,274.00	0.03
455	603043	广州酒家	905	22,869.35	0.03
456	601811	新华文轩	1,400	21,784.00	0.03
457	603679	华体科技	809	21,438.50	0.03
458	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.03
459	600636	*ST 爱富	1,498	20,762.28	0.03
460	600917	重庆燃气	2,200	20,746.00	0.03
461	603326	我乐家居	726	20,306.22	0.03
462	603569	长久物流	600	20,058.00	0.03
463	603877	太平鸟	700	19,593.00	0.03
464	603025	大豪科技	700	18,480.00	0.03
465	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.02
466	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.02
467	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.02
468	603331	百达精工	874	8,416.62	0.01
469	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.01

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	601377	兴业证券	476,192.00	1.97
2	600637	东方明珠	375,830.00	1.56
3	600893	航发动力	349,879.00	1.45
4	600109	国金证券	344,180.00	1.43
5	601727	上海电气	320,250.00	1.33
6	600900	长江电力	296,636.00	1.23
7	600585	海螺水泥	279,296.00	1.16
8	601998	中信银行	257,607.00	1.07

9	600276	恒瑞医药	227,480.00	0.94
10	600886	国投电力	213,770.00	0.89
11	600406	国电南瑞	192,694.00	0.80
12	600271	航天信息	184,680.00	0.77
13	600867	通化东宝	165,518.00	0.69
14	600690	青岛海尔	164,424.00	0.68
15	600660	福耀玻璃	164,081.00	0.68
16	600977	中国电影	150,202.00	0.62
17	600208	新湖中宝	149,954.66	0.62
18	601997	贵阳银行	149,815.00	0.62
19	600649	城投控股	148,410.00	0.62
20	600909	华安证券	146,550.00	0.61

注：不考虑相关交易费用。

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

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	600340	华夏幸福	445,313.55	1.85
2	600606	绿地控股	274,720.00	1.14
3	600959	江苏有线	216,480.40	0.90
4	600252	中恒集团	158,638.01	0.66
5	600240	华业资本	129,646.00	0.54
6	600064	南京高科	110,887.00	0.46
7	601928	凤凰传媒	101,810.24	0.42
8	600401	*ST 海润	90,915.00	0.38
9	600851	海欣股份	86,846.72	0.36
10	600261	阳光照明	79,897.60	0.33
11	600812	华北制药	76,577.10	0.32
12	600805	悦达投资	67,918.46	0.28
13	600063	皖维高新	66,952.80	0.28
14	600220	江苏阳光	65,561.68	0.27
15	600586	金晶科技	65,393.32	0.27
16	600133	东湖高新	65,212.05	0.27
17	603866	桃李面包	62,562.00	0.26
18	600053	九鼎投资	61,380.00	0.25

19	601369	陕鼓动力	60,876.80	0.25
20	603868	飞科电器	60,150.00	0.25

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	15,162,101.90
卖出股票收入（成交）总额	5,486,134.56

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

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

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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，青岛海尔（600690）子公司重庆新日日顺家电销售有限公司上海分公司、重庆海尔家电销售有限公司上海分公司于 2016 年 8 月 15 日收到上海市物价局处罚决定。因前述公司对上海区域的经销商采取限定终端零售最低价格的管控措施，构成“限定向第三人转售商品最低价格”垄断协议的行为。对前述公司要求立即停止该行为，并处以共计 1,200 余万元的罚款。上述行政处罚事项未影响公司正常的生产经营活动，未对公司造成重大影响。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，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。

### 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	3,158.58
2	应收证券清算款	50,756.45
3	应收股利	-
4	应收利息	162.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,077.53

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600795	国电电力	567,360.00	0.80	停牌

## § 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

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
524	33,834.28	437,645.00	2.47%	3,265,339.00	18.42%

#### 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	14,026,177.00	79.11%

### 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	福建省嘉诚资产管理有限公司一嘉 诚 2 号私募证券投资基金	413,272.00	2.33%
2	徐钧	108,134.00	0.61%
3	陈密	107,800.00	0.61%
4	钟鸣	100,000.00	0.56%
5	郭秀琴	100,000.00	0.56%
6	沈曙明	96,295.00	0.54%
7	薛成奇	94,700.00	0.53%
8	刘飞跃	67,900.00	0.38%
9	王秀芬	65,240.00	0.37%
10	邝紫葡	64,351.00	0.36%

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：1、本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 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：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

## § 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	6,229,161.00
本报告期基金总申购份额	11,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	-
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	17,729,161.00

## § 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	19,833,085.94	100.00%	18,471.04	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爲，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 务；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	4,274.80	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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整上证中小盘ETF最小申购赎回单位的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年5月11日
2	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金2017年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年4月24日
3	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金2016年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月29日
4	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月29日
5	关于旗下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基金份额净值计算位数变更及修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年2月28日
6	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金2016年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年1月19日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
ETF 联接基金	1	2017/4/1-2017/6/30	2,599,377.00	23,010,200.00	11,583,400.00	14,026,177.00	79.11

#### 产品特有风险

本基金期内共有 1 家机构持有基金份额超过 20%，累计达 79.11%，本期共赎回 500,000.00 份，如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。



## § 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 层及托管人住所

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日