

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 2017 年年度报告

2017 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：2018 年 3 月 28 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 2018 年 3 月 27 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（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
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.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	16
4.10 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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67

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	67
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	68
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	68
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	68
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	68
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.13 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.3 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	70
§ 10 开放式基金份额变动	71
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息	79
12.1 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	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	错误! 未定义书签。
§13 备查文件目录	80
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	80
13.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接
基金主代码	460220
基金运作方式	契约型开放式
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	56,344,757.06 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年3月28日
基金管理人名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金。华泰柏瑞上证中小盘 ETF 是采用完全复制法实现对上证中小盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对华泰柏瑞上证中小盘 ETF 进行投资。
业绩比较基准	上证中小盘指数 × 95% + 银行活期存款税后收益率 × 5%
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金，采用主要投资于上证中小盘交易型开放式指数证券投资基

	金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与上证中小盘指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--	---

2.2.1 目标基金产品说明

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	陈四清

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	基金管理人及基金托管人住所

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（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	26,414.90	-250,072.71	12,873,959.67
本期利润	3,528,302.16	-2,218,805.70	7,750,519.70
加权平均基金份额本期利润	0.0735	-0.2080	0.4392
本期加权平均净值利润率	6.79%	-20.47%	34.98%
本期基金份额净值增长率	9.26%	-18.49%	21.37%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	6,632,153.34	239,315.09	2,574,585.02
期末可供分配基金份额利润	0.1177	0.0226	0.2551
期末基金资产净值	62,976,910.40	10,828,348.47	12,667,972.67
期末基金份额净值	1.1177	1.0230	1.2550
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	11.77%	2.30%	25.50%

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。

4、本基金成立日期为 2011 年 1 月 26 日

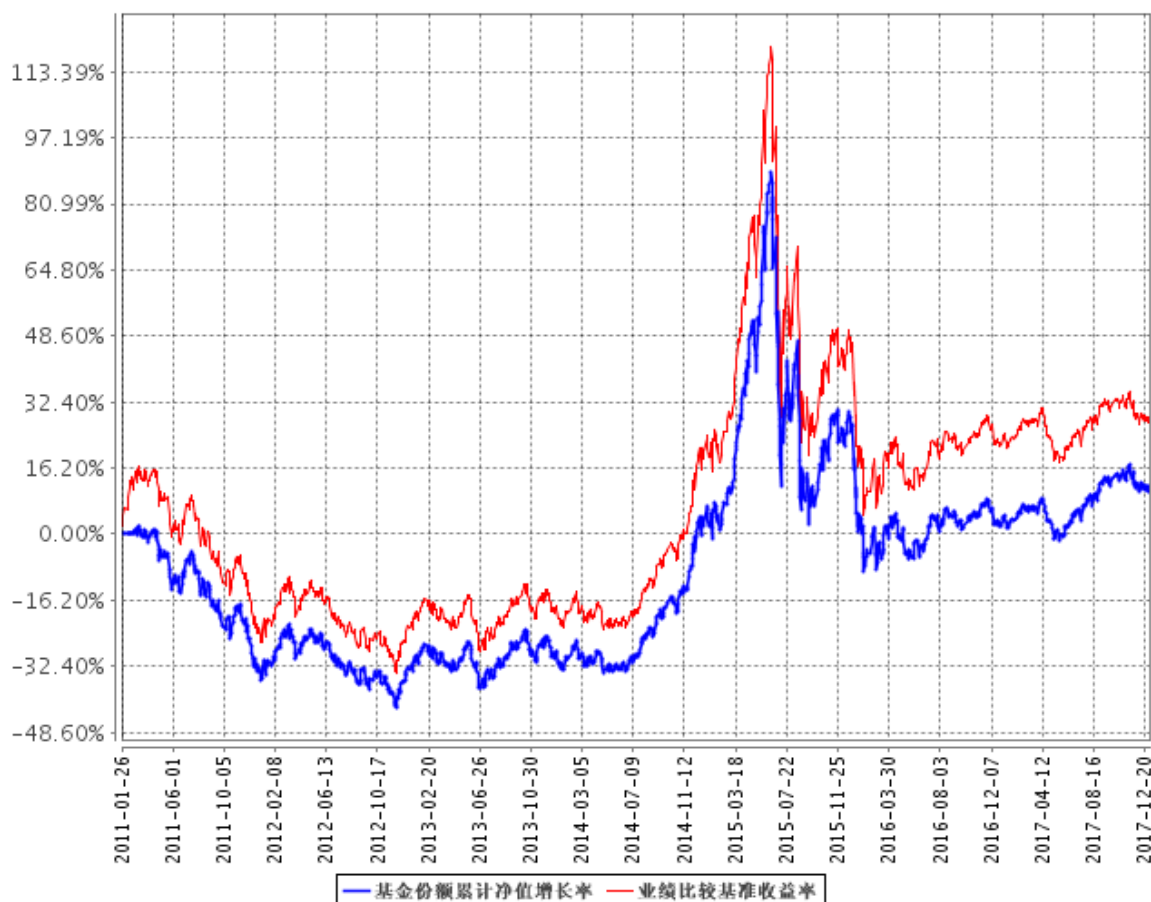
3.2 基金净值表现

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	-1.42%	0.72%	-2.25%	0.72%	0.83%	0.00%
过去六个月	6.35%	0.71%	3.57%	0.72%	2.78%	-0.01%
过去一年	9.26%	0.67%	5.54%	0.68%	3.72%	-0.01%
过去三年	8.09%	1.83%	7.07%	1.86%	1.02%	-0.03%
过去五年	66.57%	1.61%	66.33%	1.62%	0.24%	-0.01%
自基金合同生效起至今	11.77%	1.52%	28.72%	1.55%	-16.95%	-0.03%

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

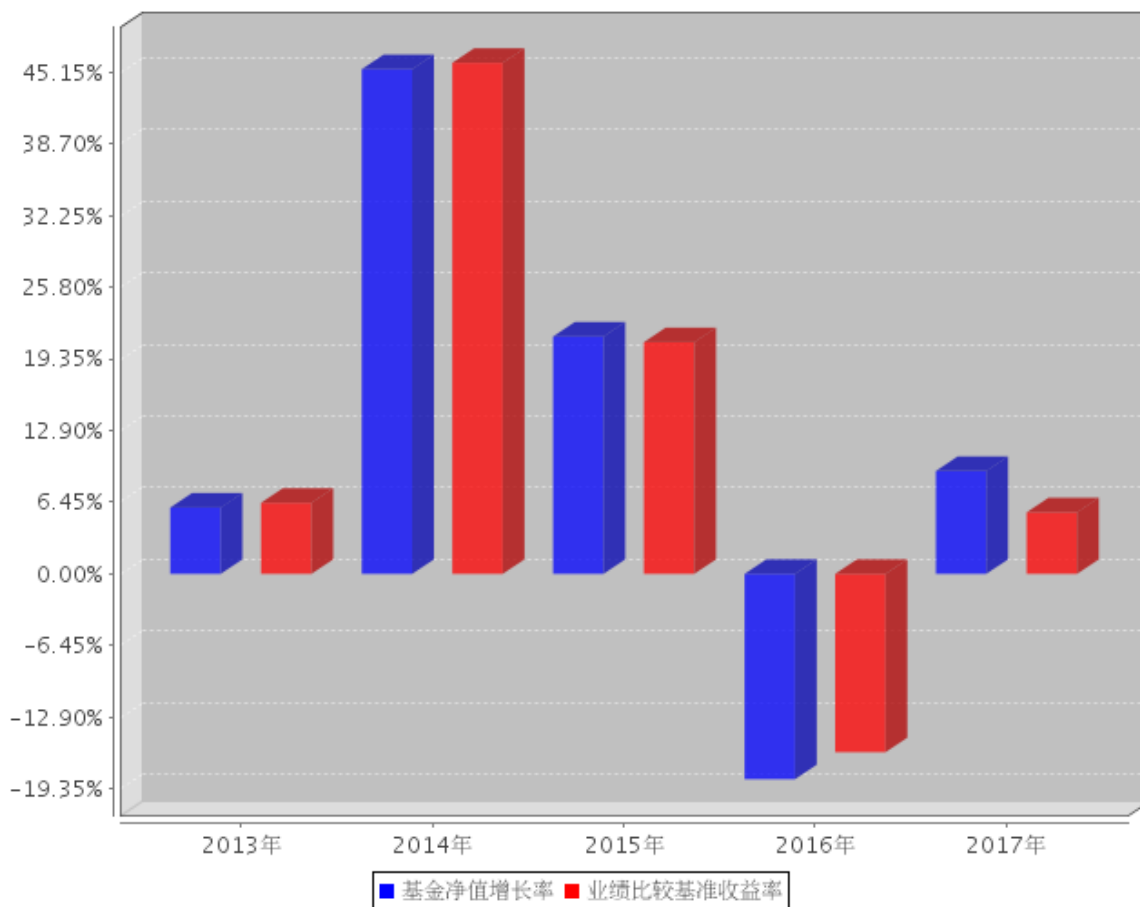


注：1、图示日期为 2011 年 1 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日

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十四条（二）投资范围中规定的比例，即投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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



注：基金合同生效日为 2011 年 1 月 26 日，2011 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 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、华泰柏瑞嘉利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、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 826.34 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。

李孝华	本基金的 基金经理 助理	2017 年 11 月 9 日	-	4 年	南开大学金融学硕士。2013 年 7 月至 2014 年 4 月任金瑞期货有限公司贵金属研究员，2014 年 4 月至 2015 年 4 月任国泰君安信息技术有限公司量化产品设计师。2015 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任指数投资部研究员。2017 年 11 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。
-----	--------------------	--------------------	---	-----	--

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。任职日期和离任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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《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，对于场内交易的非组合指令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）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。

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。

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。

本报告期本基金与公司所管理的其他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 年市场延续 16 年的走势和风格趋势，以上证 50 和沪深 300 为代表的大盘蓝筹股继续上行，涨幅均较为可观，这也是股票市场大幅波动以来，大盘价值风格连续第二年跑盈市场。随着《上市公司重大资产重组管理办法》的修订，以及去年以来的严监管措施，加上 17 年市场资金面总体偏紧，市场利率有所上升，市场投机气氛明显降温，市场总体呈现大小盘结构性行情，行业龙头股获得资金青睐，涨幅更为可观。我们认为，2017 年市场是在资金偏紧、不确定增加、外部风险开始显现、风险偏好下降的背景下，资金对于业绩相对确定资产的再配置主导的结构性行情。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪业绩基准、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 3.770%，日均绝对跟踪偏离度为 0.032%，期间日跟踪

误差为 0.039%，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 1.1177 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.26%，业绩比较基准收益率为 5.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018，根据中央经济工作会议精神，防范化解重大风险，重点是防控金融风险是 2018 年的三大攻坚战之一，政策方面将延续去年的严监管思路，维护市场稳定，慢牛行情可期。央行的定向降准改善了国内流动性预期，而 PMI 稳定将继续修复基本面预期，企业盈利增速平稳，支撑去年以来上涨行情的逻辑尚未发生变化，我们对于 2018 年上半年的走势相对乐观。从市场风格来看，我们认为大盘价值股仍具有一定的配置价值，同时以中证 500 为代表的二线蓝筹板块横向和历史对比已进入相对低估区间。

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业绩基准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

2017 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事先进行合规性设置，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、研究、销售、后台运营、反洗钱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，在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为 12 次；每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。截至本报告期末，本基金未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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（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(2018)第 21098 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	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全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞交易型货币市场基金(以下简称“华泰柏瑞交易型货币基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附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,公允反映了上证中小盘 ETF 联接基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>上证中小盘 ETF 联接基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、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>

	<p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估上证中小盘 ETF 联接基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算上证中小盘 ETF 联接基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督上证中小盘 ETF 联接基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对上证中小盘 ETF 联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致上证中小盘 ETF 联接基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</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(特殊普通合伙)</p>

注册会计师的姓名	单峰	曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,103,089.78	957,218.06
结算备付金		1,130.15	-
存出保证金		961.47	853.52
交易性金融资产	7.4.7.2	59,950,005.57	10,069,986.50
其中：股票投资		1,990,254.50	-
基金投资		57,711,286.07	10,069,986.50
债券投资		248,465.00	-
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	3,969.38	205.97
应收股利		-	-
应收申购款		3,771.55	374.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		63,062,927.90	11,028,638.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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		2,759.71	-
应付管理人报酬		2,233.24	241.69
应付托管费		446.65	48.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	567.50	-
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	80,010.40	200,000.00
负债合计		86,017.50	200,290.03
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	56,344,757.06	10,589,033.38
未分配利润	7.4.7.10	6,632,153.34	239,315.09
所有者权益合计		62,976,910.40	10,828,348.47
负债和所有者权益总计		63,062,927.90	11,028,638.50

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1177 元，基金份额总额 56,344,757.06 份。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		3,677,763.58	-2,012,313.78
1.利息收入		26,131.04	6,377.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	24,704.76	6,377.14
债券利息收入		1,426.28	-
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）		145,114.47	-53,396.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	117,016.92	-31,276.60
基金投资收益	7.4.7.13	18,731.48	-121,882.94
债券投资收益	7.4.7.14	97.00	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	9,269.07	99,762.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,501,887.26	-1,968,732.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	4,630.81	3,438.75
减：二、费用		149,461.42	206,491.92
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	18,949.72	4,019.68
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,789.99	803.90

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	44,829.06	593.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	81,892.65	201,075.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,528,302.16	-2,218,805.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,528,302.16	-2,218,805.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	10,589,033.38	239,315.09	10,828,348.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,528,302.16	3,528,302.16
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）	45,755,723.68	2,864,536.09	48,620,259.77
其中：1. 基金申购款	50,240,388.36	3,238,064.89	53,478,453.25
2. 基金赎回款	-4,484,664.68	-373,528.80	-4,858,193.48
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）	56,344,757.06	6,632,153.34	62,976,910.40
项目	上年度可比期间 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）	10,093,387.65	2,574,585.02	12,667,972.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,218,805.70	-2,218,805.70
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）	495,645.73	-116,464.23	379,181.50
其中：1.基金申购款	4,042,335.02	-14,623.57	4,027,711.45
2.基金赎回款	-3,546,689.29	-101,840.66	-3,648,529.95
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）	10,589,033.38	239,315.09	10,828,348.47

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

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(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《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基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 482,542,072.50 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2011)第 26 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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 482,562,901.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 20,829.00

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。

本基金为上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对上证中小盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括华泰柏瑞上证中小盘 ETF、上证中小盘指数成份股及备选成份股、非成份股、债券、新股（一级市场初次发行和增发）、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。正常情况下，本基金资产中投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为上证中小盘指数 \times 95% + 银行活期存款税后收益率 \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 3 月 26 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券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。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，包括银行存款和其他各类应收款项等。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其他各类应付款项等。

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，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的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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额, 计入当期损益。

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和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 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; 估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的, 按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的, 应对市场交易价格进行调整, 确定公允价值。与上述投资品种相同, 但具有不同特征的, 应以相同资产或负债的公允价值为基础, 并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等, 如果该限制是针对资产持有者的, 那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外, 基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场, 采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时, 优先使用可观察输入值, 只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下, 才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件, 应对估值进行调整并确定公允价值。

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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 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

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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或者发行价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；于处置时，其处置价格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则按直线法计算。

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则按直线法计算。

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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 26 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 26 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试

行)的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月26日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

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) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	3,103,089.78	957,218.06
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,103,089.78	957,218.06

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,988,137.00	1,990,254.50	2,117.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	248,485.00	248,465.00
	银行间市场	-	-
	合计	248,485.00	248,465.00
资产支持证券	-	-	-
基金	56,100,165.40	57,711,286.07	1,611,120.67
其他	-	-	-
合计	58,336,787.40	59,950,005.57	1,613,218.17
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	11,958,655.59	10,069,986.50	-1,888,669.09
其他	-	-	-
合计	11,958,655.59	10,069,986.50	-1,888,669.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末及上年度末，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：截至本报告期末及上年度末，本基金买入返售金融资产余额为0。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末及上年度末，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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	684.20	205.53
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	0.55	-
应收债券利息	3,284.19	-
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	0.44	0.44
合计	3,969.38	205.97

7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末及上年度末，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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	567.50	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	567.50	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	10.40	-
预提费用	80,000.00	200,000.00
合计	80,010.40	200,000.00

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,589,033.38	10,589,033.38
本期申购	50,240,388.36	50,240,388.36
本期赎回(以“-”号填列)	-4,484,664.68	-4,484,664.68
- 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	56,344,757.06	56,344,757.06

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	4,744,768.97	-4,505,453.88	239,315.09
本期利润	26,414.90	3,501,887.26	3,528,302.16
本期基金份额交易产生的变动数	20,190,728.04	-17,326,191.95	2,864,536.09
其中：基金申购款	22,174,879.12	-18,936,814.23	3,238,064.89
基金赎回款	-1,984,151.08	1,610,622.28	-373,528.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,961,911.91	-18,329,758.57	6,632,153.34

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
	活期存款利息收入	23,708.56
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	537.67	16.99
其他	458.53	55.76
合计	24,704.76	6,377.14

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 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	83,004.87	-31,276.60
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	34,012.05	-
合计	117,016.92	-31,276.60

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 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
卖出股票成交总额	2,062,514.52	261,581.40
减：卖出股票成本总额	1,979,509.65	292,858.00
买卖股票差价收入	83,004.87	-31,276.60

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
申购基金份额总额	46,532,850.00	-
减：现金支付申购款总额	10,325,689.93	-
减：申购股票成本总额	36,173,148.02	-
申购差价收入	34,012.05	-

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

卖出/赎回基金成交总额	2,477,043.27	591,328.40
减：卖出/赎回基金成本总额	2,458,311.79	713,211.34
基金投资收益	18,731.48	-121,882.94

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 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 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	97.00	-
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	97.00	-

7.4.7.14.2 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 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	355,550.00	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	348,285.00	-
减：应收利息总额	7,168.00	-
买卖债券差价收入	97.00	-

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	9,269.07	1,373.85
基金投资产生的股利收益	-	98,389.01
合计	9,269.07	99,762.86

7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	3,501,887.26	-1,968,732.99
——股票投资	2,117.50	4,297.00
——债券投资	-20.00	-
——基金投资	3,499,789.76	-1,973,029.99
——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	3,501,887.26	-1,968,732.99

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
基金赎回费收入	3,077.34	3,257.25
转换费收入	1,553.47	181.50
合计	4,630.81	3,438.75

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减。赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
交易所市场交易费用	44,829.06	593.34
银行间市场交易费用	-	-
合计	44,829.06	593.34

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	30,000.00	150,000.00
银行划款手续费	1,892.65	1,075.00
合计	81,892.65	201,075.00

7.4.7.22 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

注：本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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、基金销售机构
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司
上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（“目标ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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：本报告期及上年度可比期间本基金与关联方未进行股票交易。

7.4.10.1.2 基金交易

注：本报告期本基金与关联方未进行基金交易。

7.4.10.1.3 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金与关联方未进行权证交易。

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,949.72	4,019.68
其中：支付销售机构的客户维护费	25,105.08	25,358.52

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0)的 0.50%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) X 0.5% / 当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,789.99	803.90

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0)的 0.10%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = (前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) X 0.10% / 当年天数。

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：本基金本期及上年度可比期间未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：本报告期及 2016 年度，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注：本报告期及 2016 年度，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	3,103,089.78	23,708.56	957,218.06	6,304.39

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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 13,525,977.00 份目标 ETF 基金份额，占目标 ETF 基金总份额的比例为 80.85%。(2016 年 12 月 31 日：本基金持有 2,599,377.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 41.73%)

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 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
600057	象屿股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 8 日	新股流通受限	6.10	8.09	50	305.00	404.50	-

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
600309	万华化学	2017 年 12 月 5 日	重大资产重组	37.67	-	-	600	23,286.00	22,602.00	-
601600	中国铝业	2017 年 9 月 12 日	重大资产重组	8.09	2018 年 2 月 26 日	7.28	2,700	21,843.00	21,843.00	-
600525	长园集团	2017 年 12 月 25 日	重大事项	15.79	2018 年 1 月 10 日	17.30	500	8,500.00	7,895.00	-
600150	中国船舶	2017 年 9 月 27 日	重大资产重组	24.67	2018 年 3 月 21 日	22.20	300	7,401.00	7,401.00	-
600157	永泰能源	2017 年 11 月 21 日	重大资产重组	3.36	-	-	2,000	6,720.00	6,720.00	-
601216	君正集团	2017 年 12 月 15 日	重大资产重组	4.71	-	-	1,400	7,252.00	6,594.00	-
600332	白云山	2017 年 10 月 31 日	重大资产重组	32.14	2018 年 1 月 8 日	30.15	200	6,428.00	6,428.00	-

600666	奥瑞德	2017年4月27日	重大资产重组	17.40	-	-	300	5,220.00	5,220.00	-
600614	鹏起科技	2017年12月26日	重大资产重组	10.16	-	-	400	4,668.00	4,064.00	-
600634	富控互动	2017年11月16日	重大资产重组	19.42	2018年3月12日	17.48	200	3,884.00	3,884.00	-
600664	哈药股份	2017年9月28日	重大资产重组	6.11	2018年2月27日	6.00	600	3,486.00	3,666.00	-
600645	中源协和	2017年10月9日	重大资产重组	28.40	2018年1月19日	25.56	100	2,840.00	2,840.00	-
600685	中船防务	2017年9月27日	重大资产重组	26.66	2018年3月21日	24.05	100	2,666.00	2,666.00	-
600187	国中水务	2017年11月9日	重大资产重组	4.68	2018年3月20日	4.21	500	2,340.00	2,340.00	-
600084	中葡股份	2017年7月10日	重大资产重组	7.52	-	-	300	2,256.00	2,256.00	-

注：注：本基金截至 2017 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

注：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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：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。

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

本基金属于 ETF 联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的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。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和法律监察部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；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。

本基金的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。

本基金的基金管理人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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2016 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无

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。

于 2017 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%,本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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，包括利率风险、外汇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、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	3,103,089.78	-	-	-	-	-	3,103,089.78
结算备付金	1,130.15	-	-	-	-	-	1,130.15
存出保证金	961.47	-	-	-	-	-	961.47

交易性金融资产		-248,465.00				-59,701,540.57	59,950,005.57
应收利息		-				3,969.38	3,969.38
应收申购款		-				3,771.55	3,771.55
资产总计	3,105,181.40	248,465.00				-59,709,281.50	63,062,927.90
负债							
应付赎回款		-				2,759.71	2,759.71
应付管理人报酬		-				2,233.24	2,233.24
应付托管费		-				446.65	446.65
应付交易费用		-				567.50	567.50
其他负债		-				80,010.40	80,010.40
负债总计		-				86,017.50	86,017.50
利率敏感度缺口	3,105,181.40	248,465.00				-59,623,264.00	62,976,910.40
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	957,218.06	-	-	-	-	-	957,218.06
存出保证金	853.52	-	-	-	-	-	853.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-10,069,986.50	10,069,986.50
应收利息	-	-	-	-	-	205.97	205.97
应收申购款	-	-	-	-	-	374.45	374.45
资产总计	958,071.58	-	-	-	-	-10,070,566.92	11,028,638.50
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	241.69	241.69
应付托管费	-	-	-	-	-	48.34	48.34
其他负债	-	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	200,290.03	200,290.03
利率敏感度缺口	958,071.58	-	-	-	-	9,870,276.89	10,828,348.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.39% (2016 年 12 月 31 日：无)，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)。

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。本基金主要投资于目标 ETF，所面临的其他价格风险主要来源于上证中小盘指数波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以二级市场交易买卖为主。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中目标 ETF 资产占基金资产净值的比例不低于 90%，基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2017 年 12 月 31 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	1,990,254.50	3.16	-	-
交易性金融资产—基金投资	57,711,286.07	91.64	10,069,986.50	93.00

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	59,701,540.57	94.80	10,069,986.50	93.00

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（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 上证中小盘指数上升 5%	214.00	50.00
	2. 上证中小盘指数下降 5%	-214.00	-50.00

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

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) 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 2017 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 59,594,717.07 元，属于第二层次的余额为 355,288.50 元，无属于第三层

次的余额(2016 年 12 月 31 日: 第一层次 10,069,986.50 元, 无属于第二层次以及第三层次的余额)。

(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。

(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 2017 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(2016 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定, 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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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	1,990,254.50	3.16
	其中：股票	1,990,254.50	3.16
2	基金投资	57,711,286.07	91.51
3	固定收益投资	248,465.00	0.39
	其中：债券	248,465.00	0.39
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,104,219.93	4.92
8	其他各项资产	8,702.40	0.01
9	合计	63,062,927.90	100.00

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	5,796.00	0.01
B	采矿业	122,464.00	0.19
C	制造业	1,012,288.00	1.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	143,499.00	0.23
E	建筑业	52,134.00	0.08
F	批发和零售业	118,678.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	139,586.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,743.00	0.13
J	金融业	158,194.00	0.25
K	房地产业	80,627.00	0.13
L	租赁和商务服务业	33,160.50	0.05

M	科学研究和技术服务业	3,816.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	3,895.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,998.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	20,103.00	0.03
S	综合	11,273.00	0.02
	合计	1,990,254.50	3.16

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 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	600276	恒瑞医药	700	48,286.00	0.08
2	600900	长江电力	2,600	40,534.00	0.06
3	600703	三安光电	1,000	25,390.00	0.04
4	600585	海螺水泥	800	23,464.00	0.04
5	600690	青岛海尔	1,200	22,608.00	0.04
6	600309	万华化学	600	22,602.00	0.04
7	600015	华夏银行	2,500	22,500.00	0.04
8	601600	中国铝业	2,700	21,843.00	0.03
9	601939	建设银行	2,700	20,736.00	0.03
10	601899	紫金矿业	4,100	18,819.00	0.03
11	601012	隆基股份	500	18,220.00	0.03
12	600009	上海机场	400	18,004.00	0.03
13	600741	华域汽车	600	17,814.00	0.03
14	600196	复星医药	400	17,800.00	0.03
15	600660	福耀玻璃	600	17,400.00	0.03
16	601888	中国国旅	400	17,356.00	0.03
17	600487	亨通光电	400	16,168.00	0.03
18	601009	南京银行	2,000	15,480.00	0.02
19	601933	永辉超市	1,500	15,150.00	0.02
20	600089	特变电工	1,500	14,865.00	0.02
21	600795	国电电力	4,700	14,664.00	0.02

22	600031	三一重工	1,500	13,605.00	0.02
23	600010	宝钢股份	5,400	13,284.00	0.02
24	601377	兴业证券	1,800	13,104.00	0.02
25	600522	中天科技	900	12,546.00	0.02
26	601607	上海医药	500	12,095.00	0.02
27	600066	宇通客车	500	12,035.00	0.02
28	600886	国投电力	1,600	11,744.00	0.02
29	601155	新城控股	400	11,720.00	0.02
30	600516	方大炭素	400	11,552.00	0.02
31	600867	通化东宝	500	11,445.00	0.02
32	600176	中国巨石	700	11,403.00	0.02
33	600383	金地集团	900	11,367.00	0.02
34	600406	国电南瑞	600	10,968.00	0.02
35	600893	航发动力	400	10,764.00	0.02
36	603288	海天味业	200	10,760.00	0.02
37	600535	天士力	300	10,674.00	0.02
38	601618	中国中冶	2,200	10,648.00	0.02
39	600352	浙江龙盛	900	10,539.00	0.02
40	601919	中远海控	1,500	10,155.00	0.02
41	600705	中航资本	1,800	9,936.00	0.02
42	601111	中国国航	800	9,856.00	0.02
43	600115	东方航空	1,200	9,852.00	0.02
44	601225	陕西煤业	1,200	9,792.00	0.02
45	601099	太平洋	2,700	9,774.00	0.02
46	601555	东吴证券	1,000	9,720.00	0.02
47	600201	生物股份	300	9,522.00	0.02
48	601727	上海电气	1,400	9,366.00	0.01
49	600570	恒生电子	200	9,280.00	0.01
50	600674	川投能源	900	9,162.00	0.01
51	600816	安信信托	700	9,156.00	0.01
52	600068	葛洲坝	1,100	9,020.00	0.01
53	600208	新湖中宝	1,700	8,874.00	0.01
54	600739	辽宁成大	500	8,800.00	0.01
55	600271	航天信息	400	8,616.00	0.01
56	600221	海航控股	2,700	8,613.00	0.01
57	600584	长电科技	400	8,532.00	0.01
58	600023	浙能电力	1,600	8,528.00	0.01
59	600804	鹏博士	500	8,515.00	0.01
60	601018	宁波港	1,600	8,496.00	0.01

61	600637	东方明珠	500	8,330.00	0.01
62	600177	雅戈尔	900	8,253.00	0.01
63	600219	南山铝业	2,200	8,096.00	0.01
64	600362	江西铜业	400	8,068.00	0.01
65	603019	中科曙光	200	8,048.00	0.01
66	603799	华友钴业	100	8,023.00	0.01
67	600018	上港集团	1,200	7,980.00	0.01
68	600525	长园集团	500	7,895.00	0.01
69	600109	国金证券	800	7,632.00	0.01
70	600682	南京新百	200	7,558.00	0.01
71	601998	中信银行	1,200	7,440.00	0.01
72	600150	中国船舶	300	7,401.00	0.01
73	601333	广深铁路	1,300	7,241.00	0.01
74	600079	人福医药	400	7,136.00	0.01
75	601992	金隅股份	1,300	7,059.00	0.01
76	600291	西水股份	300	7,056.00	0.01
77	600489	中金黄金	700	6,923.00	0.01
78	600398	海澜之家	700	6,790.00	0.01
79	600157	永泰能源	2,000	6,720.00	0.01
80	600170	上海建工	1,800	6,696.00	0.01
81	600153	建发股份	600	6,672.00	0.01
82	601216	君正集团	1,400	6,594.00	0.01
83	600699	均胜电子	200	6,574.00	0.01
84	601168	西部矿业	800	6,560.00	0.01
85	600298	安琪酵母	200	6,544.00	0.01
86	600085	同仁堂	200	6,448.00	0.01
87	600642	申能股份	1,100	6,446.00	0.01
88	600332	白云山	200	6,428.00	0.01
89	600297	广汇汽车	800	6,416.00	0.01
90	600426	华鲁恒升	400	6,368.00	0.01
91	600415	小商品城	1,100	6,358.00	0.01
92	600588	用友网络	300	6,345.00	0.01
93	600436	片仔癀	100	6,320.00	0.01
94	603883	老百姓	100	6,299.00	0.01
95	600256	广汇能源	1,200	6,072.00	0.01
96	600521	华海药业	200	6,024.00	0.01
97	603816	顾家家居	100	5,897.00	0.01
98	600004	白云机场	400	5,880.00	0.01
99	600820	隧道股份	700	5,852.00	0.01

100	600260	凯乐科技	200	5,822.00	0.01
101	600498	烽火通信	200	5,766.00	0.01
102	601633	长城汽车	500	5,745.00	0.01
103	600663	陆家嘴	300	5,709.00	0.01
104	600392	盛和资源	300	5,700.00	0.01
105	600809	山西汾酒	100	5,699.00	0.01
106	601699	潞安环能	500	5,690.00	0.01
107	600497	驰宏锌锗	800	5,680.00	0.01
108	600022	山东钢铁	2,600	5,564.00	0.01
109	600499	科达洁能	500	5,545.00	0.01
110	600643	爱建集团	500	5,540.00	0.01
111	600583	海油工程	900	5,535.00	0.01
112	600879	航天电子	700	5,488.00	0.01
113	601117	中国化学	800	5,400.00	0.01
114	600266	北京城建	400	5,256.00	0.01
115	601877	正泰电器	200	5,230.00	0.01
116	600666	奥瑞德	300	5,220.00	0.01
116	600839	四川长虹	1,500	5,220.00	0.01
117	600388	龙净环保	300	5,190.00	0.01
118	600183	生益科技	300	5,178.00	0.01
119	600325	华发股份	700	5,152.00	0.01
120	600549	厦门钨业	200	5,148.00	0.01
121	600008	首创股份	1,000	5,140.00	0.01
122	600369	西南证券	1,100	5,093.00	0.01
123	600563	法拉电子	100	5,081.00	0.01
124	600166	福田汽车	1,800	5,058.00	0.01
125	600118	中国卫星	200	5,050.00	0.01
125	600755	厦门国贸	500	5,050.00	0.01
126	601991	大唐发电	1,200	4,980.00	0.01
127	600056	中国医药	200	4,978.00	0.01
128	600486	扬农化工	100	4,969.00	0.01
129	600808	马钢股份	1,200	4,956.00	0.01
130	600872	中炬高新	200	4,952.00	0.01
131	600062	华润双鹤	200	4,950.00	0.01
132	600435	北方导航	400	4,932.00	0.01
132	601238	广汽集团	200	4,932.00	0.01
133	600528	中铁工业	400	4,856.00	0.01
134	600027	华电国际	1,300	4,823.00	0.01
135	600567	山鹰纸业	1,100	4,774.00	0.01

135	600704	物产中大	700	4,774.00	0.01
136	601258	庞大集团	1,900	4,750.00	0.01
137	601231	环旭电子	300	4,731.00	0.01
138	600673	东阳光科	700	4,725.00	0.01
139	600110	诺德股份	500	4,720.00	0.01
140	600038	中直股份	100	4,653.00	0.01
141	600460	士兰微	300	4,629.00	0.01
142	603589	口子窖	100	4,605.00	0.01
143	600060	海信电器	300	4,506.00	0.01
144	601866	中远海发	1,300	4,433.00	0.01
145	600649	城投控股	500	4,400.00	0.01
145	600787	中储股份	400	4,400.00	0.01
146	600718	东软集团	300	4,398.00	0.01
147	600282	南钢股份	900	4,356.00	0.01
148	600125	铁龙物流	400	4,328.00	0.01
149	600655	豫园股份	400	4,296.00	0.01
150	600895	张江高科	300	4,290.00	0.01
151	600320	振华重工	700	4,270.00	0.01
152	600711	盛屯矿业	500	4,245.00	0.01
153	600490	鹏欣资源	500	4,240.00	0.01
154	601000	唐山港	900	4,239.00	0.01
155	600138	中青旅	200	4,174.00	0.01
156	601098	中南传媒	300	4,167.00	0.01
157	600338	西藏珠峰	100	4,165.00	0.01
158	600614	鹏起科技	400	4,064.00	0.01
159	600827	百联股份	300	4,047.00	0.01
160	601997	贵阳银行	300	4,008.00	0.01
161	601898	中煤能源	700	4,004.00	0.01
162	603377	东方时尚	100	3,998.00	0.01
163	600970	中材国际	400	3,956.00	0.01
164	600061	国投资本	300	3,954.00	0.01
165	600074	ST 保千里	400	3,948.00	0.01
166	600143	金发科技	600	3,942.00	0.01
167	600600	青岛啤酒	100	3,933.00	0.01
168	600503	华丽家族	600	3,930.00	0.01
169	600259	广晟有色	100	3,929.00	0.01
170	600634	富控互动	200	3,884.00	0.01
171	600884	杉杉股份	200	3,876.00	0.01
172	600409	三友化工	400	3,836.00	0.01

173	600635	大众公用	800	3,824.00	0.01
174	600566	济川药业	100	3,815.00	0.01
175	600688	上海石化	600	3,798.00	0.01
176	600418	江淮汽车	400	3,784.00	0.01
177	601021	春秋航空	100	3,727.00	0.01
178	600376	首开股份	400	3,716.00	0.01
179	600348	阳泉煤业	500	3,690.00	0.01
180	600664	哈药股份	600	3,666.00	0.01
181	600811	东方集团	800	3,664.00	0.01
182	603556	海兴电力	100	3,640.00	0.01
183	600967	内蒙一机	300	3,615.00	0.01
184	600873	梅花生物	700	3,612.00	0.01
185	600797	浙大网新	300	3,546.00	0.01
186	600572	康恩贝	500	3,535.00	0.01
187	600172	黄河旋风	400	3,508.00	0.01
188	600366	宁波韵升	200	3,504.00	0.01
189	601588	北辰实业	600	3,474.00	0.01
190	600307	酒钢宏兴	1,200	3,432.00	0.01
191	600373	中文传媒	200	3,386.00	0.01
192	600500	中化国际	400	3,384.00	0.01
193	600694	大商股份	100	3,373.00	0.01
193	600745	闻泰科技	100	3,373.00	0.01
194	601718	际华集团	500	3,365.00	0.01
195	600380	健康元	300	3,357.00	0.01
196	601880	大连港	1,200	3,348.00	0.01
197	601118	海南橡胶	600	3,330.00	0.01
198	600330	天通股份	300	3,315.00	0.01
199	600863	内蒙华电	1,100	3,267.00	0.01
200	600171	上海贝岭	200	3,254.00	0.01
201	600868	梅雁吉祥	800	3,208.00	0.01
202	600086	东方金钰	300	3,195.00	0.01
203	600323	瀚蓝环境	200	3,190.00	0.01
204	600160	巨化股份	300	3,189.00	0.01
205	600737	中粮糖业	400	3,180.00	0.01
206	600881	亚泰集团	600	3,168.00	0.01
207	600410	华胜天成	300	3,156.00	0.01
208	601666	平煤股份	500	3,150.00	0.01
209	600717	天津港	300	3,147.00	0.00
210	600175	美都能源	600	3,138.00	0.00

211	600568	中珠医疗	400	3,108.00	0.00
212	603369	今世缘	200	3,102.00	0.00
213	600158	中体产业	300	3,084.00	0.00
214	600977	中国电影	200	3,080.00	0.00
215	600594	益佰制药	300	3,066.00	0.00
216	600026	中远海能	500	3,060.00	0.00
217	600751	天海投资	500	3,055.00	0.00
218	601222	林洋能源	300	3,042.00	0.00
219	600633	浙数文化	200	3,040.00	0.00
220	600597	光明乳业	200	3,030.00	0.00
221	600267	海正药业	200	3,028.00	0.00
221	600446	金证股份	200	3,028.00	0.00
222	600312	平高电气	300	2,997.00	0.00
223	600478	科力远	400	2,952.00	0.00
224	600909	华安证券	400	2,908.00	0.00
225	600188	兖州煤业	200	2,904.00	0.00
226	601958	金钼股份	400	2,892.00	0.00
227	601608	中信重工	700	2,884.00	0.00
228	600161	天坛生物	100	2,879.00	0.00
229	600039	四川路桥	700	2,849.00	0.00
230	600645	中源协和	100	2,840.00	0.00
231	600316	洪都航空	200	2,832.00	0.00
232	603766	隆鑫通用	400	2,808.00	0.00
233	600466	蓝光发展	300	2,805.00	0.00
234	603077	和邦生物	1,400	2,800.00	0.00
235	600511	国药股份	100	2,780.00	0.00
236	600123	兰花科创	300	2,751.00	0.00
237	600651	飞乐音响	300	2,745.00	0.00
238	600021	上海电力	300	2,742.00	0.00
239	600372	中航电子	200	2,738.00	0.00
240	600017	日照港	700	2,716.00	0.00
241	600317	营口港	800	2,712.00	0.00
242	600557	康缘药业	200	2,696.00	0.00
243	600216	浙江医药	200	2,688.00	0.00
243	600667	太极实业	300	2,688.00	0.00
244	600255	梦舟股份	700	2,667.00	0.00
245	600685	中船防务	100	2,666.00	0.00
246	601011	宝泰隆	300	2,664.00	0.00
246	601929	吉视传媒	900	2,664.00	0.00

247	601311	骆驼股份	200	2,650.00	0.00
248	601717	郑煤机	400	2,632.00	0.00
249	600874	创业环保	200	2,602.00	0.00
250	600343	航天动力	200	2,586.00	0.00
251	600269	赣粤高速	500	2,560.00	0.00
252	600750	江中药业	100	2,548.00	0.00
253	600729	重庆百货	100	2,506.00	0.00
254	600416	湘电股份	200	2,498.00	0.00
255	600611	大众交通	500	2,490.00	0.00
256	600482	中国动力	100	2,481.00	0.00
257	600728	佳都科技	300	2,475.00	0.00
258	601689	拓普集团	100	2,474.00	0.00
259	600108	亚盛集团	600	2,466.00	0.00
259	603899	晨光文具	100	2,466.00	0.00
260	600120	浙江东方	100	2,461.00	0.00
261	600835	上海机电	100	2,450.00	0.00
262	600073	上海梅林	300	2,436.00	0.00
263	600169	太原重工	700	2,422.00	0.00
264	600058	五矿发展	200	2,416.00	0.00
265	600765	中航重机	200	2,404.00	0.00
266	600580	卧龙电气	300	2,403.00	0.00
267	600562	国睿科技	100	2,401.00	0.00
268	600206	有研新材	200	2,396.00	0.00
269	600210	紫江企业	500	2,380.00	0.00
270	603888	新华网	100	2,365.00	0.00
271	600687	刚泰控股	200	2,362.00	0.00
272	600187	国中水务	500	2,340.00	0.00
273	600582	天地科技	500	2,325.00	0.00
274	600200	江苏吴中	200	2,310.00	0.00
275	600926	杭州银行	200	2,306.00	0.00
276	601016	节能风电	700	2,303.00	0.00
277	600236	桂冠电力	400	2,300.00	0.00
278	600151	航天机电	300	2,277.00	0.00
279	600084	中葡股份	300	2,256.00	0.00
280	600399	抚顺特钢	400	2,240.00	0.00
281	601777	力帆股份	300	2,178.00	0.00
282	603000	人民网	200	2,166.00	0.00
283	601908	京运通	400	2,156.00	0.00
284	601002	晋亿实业	200	2,146.00	0.00

285	600759	洲际油气	500	2,130.00	0.00
286	600098	广州发展	300	2,121.00	0.00
287	601801	皖新传媒	200	2,116.00	0.00
288	601808	中海油服	200	2,112.00	0.00
289	603568	伟明环保	100	2,105.00	0.00
290	600502	安徽水利	300	2,067.00	0.00
291	600395	盘江股份	300	2,061.00	0.00
292	601611	中国核建	200	2,054.00	0.00
293	601020	华钰矿业	100	2,052.00	0.00
294	600993	马应龙	100	2,048.00	0.00
295	600859	王府井	100	2,040.00	0.00
296	601163	三角轮胎	100	2,038.00	0.00
297	600057	象屿股份	250	2,022.50	0.00
298	600458	时代新材	200	2,014.00	0.00
299	600495	晋西车轴	300	1,989.00	0.00
300	600289	ST 信通	200	1,988.00	0.00
301	600391	航发科技	100	1,971.00	0.00
302	600517	置信电气	300	1,941.00	0.00
303	600862	中航高科	200	1,936.00	0.00
304	601890	亚星锚链	300	1,935.00	0.00
305	600277	亿利洁能	300	1,932.00	0.00
305	600988	赤峰黄金	300	1,932.00	0.00
306	600963	岳阳林纸	300	1,929.00	0.00
307	600894	广日股份	200	1,870.00	0.00
308	600871	石化油服	700	1,869.00	0.00
309	600284	浦东建设	200	1,860.00	0.00
310	601375	中原证券	300	1,851.00	0.00
311	600578	京能电力	500	1,850.00	0.00
311	600648	外高桥	100	1,850.00	0.00
312	600596	新安股份	200	1,836.00	0.00
313	600422	昆药集团	200	1,830.00	0.00
314	601001	大同煤业	300	1,815.00	0.00
315	600350	山东高速	300	1,797.00	0.00
316	600292	远达环保	200	1,790.00	0.00
317	600790	轻纺城	300	1,788.00	0.00
318	600116	三峡水利	200	1,780.00	0.00
319	600756	浪潮软件	100	1,779.00	0.00
320	603198	迎驾贡酒	100	1,759.00	0.00
321	600006	东风汽车	300	1,755.00	0.00

322	601966	玲珑轮胎	100	1,746.00	0.00
323	601886	江河集团	200	1,732.00	0.00
324	600270	外运发展	100	1,728.00	0.00
325	600623	华谊集团	200	1,706.00	0.00
326	600185	格力地产	300	1,704.00	0.00
327	600428	中远海特	300	1,683.00	0.00
328	600587	新华医疗	100	1,679.00	0.00
328	603861	白云电器	100	1,679.00	0.00
329	600233	圆通速递	100	1,675.00	0.00
330	603188	亚邦股份	100	1,659.00	0.00
331	600536	中国软件	100	1,655.00	0.00
332	601139	深圳燃气	200	1,620.00	0.00
333	600595	中孚实业	300	1,605.00	0.00
334	603298	杭叉集团	100	1,599.00	0.00
335	603308	应流股份	100	1,589.00	0.00
336	600321	正源股份	400	1,588.00	0.00
337	601069	西部黄金	100	1,587.00	0.00
338	600880	博瑞传播	300	1,581.00	0.00
339	600280	中央商场	200	1,574.00	0.00
340	601126	四方股份	200	1,566.00	0.00
341	600626	申达股份	200	1,536.00	0.00
342	600783	鲁信创投	100	1,535.00	0.00
343	603885	吉祥航空	100	1,529.00	0.00
344	600329	中新药业	100	1,487.00	0.00
345	600855	航天长峰	100	1,483.00	0.00
346	600758	红阳能源	200	1,476.00	0.00
347	600640	号百控股	100	1,462.00	0.00
348	600652	游久游戏	200	1,456.00	0.00
349	600650	锦江投资	100	1,453.00	0.00
350	603328	依顿电子	100	1,435.00	0.00
351	600096	云天化	200	1,432.00	0.00
352	603567	珍宝岛	100	1,413.00	0.00
353	600757	长江传媒	200	1,390.00	0.00
354	600119	长江投资	100	1,368.00	0.00
355	601811	新华文轩	100	1,343.00	0.00
356	600826	兰生股份	100	1,317.00	0.00
357	601158	重庆水务	200	1,292.00	0.00
358	600363	联创光电	100	1,256.00	0.00
359	600501	航天晨光	100	1,221.00	0.00

360	600481	双良节能	300	1,203.00	0.00
361	600515	海航基础	100	1,183.00	0.00
362	600744	华银电力	300	1,131.00	0.00
363	600662	强生控股	200	1,116.00	0.00
364	600917	重庆燃气	100	1,114.00	0.00
365	600677	航天通信	100	1,109.00	0.00
366	600571	信雅达	100	1,069.00	0.00
367	600180	瑞茂通	100	1,042.00	0.00
368	600630	龙头股份	100	1,030.00	0.00
369	603979	金诚信	100	1,024.00	0.00
370	601500	通用股份	100	1,000.00	0.00
371	600996	贵广网络	100	990.00	0.00
372	603126	中材节能	100	976.00	0.00
373	601969	海南矿业	100	885.00	0.00
374	603528	多伦科技	100	883.00	0.00
375	603118	共进股份	100	877.00	0.00
376	600288	大恒科技	100	872.00	0.00
377	603169	兰石重装	100	839.00	0.00
378	600864	哈投股份	100	794.00	0.00
379	600936	广西广电	100	686.00	0.00
380	601968	宝钢包装	100	517.00	0.00

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	610,968.00	5.64
2	600019	宝钢股份	546,022.00	5.04
3	600900	长江电力	528,680.00	4.88
4	600276	恒瑞医药	491,622.00	4.54
5	601939	建设银行	401,220.00	3.71
6	601009	南京银行	324,526.00	3.00
7	601600	中国铝业	317,086.53	2.93
8	600089	特变电工	316,760.51	2.93
9	601669	中国电建	312,145.00	2.88

10	601099	太平洋	305,586.00	2.82
11	600703	三安光电	294,226.00	2.72
12	600705	中航资本	285,813.00	2.64
13	600068	葛洲坝	282,623.00	2.61
14	600031	三一重工	282,564.00	2.61
15	600383	金地集团	267,156.00	2.47
16	600066	宇通客车	263,638.00	2.43
17	601888	中国国旅	255,806.00	2.36
18	600340	华夏幸福	250,762.00	2.32
19	601607	上海医药	250,159.00	2.31
20	601899	紫金矿业	249,038.00	2.30
21	600196	复星医药	248,266.00	2.29
22	600739	辽宁成大	230,092.00	2.12
23	601618	中国中冶	222,852.00	2.06

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。

8.4.2 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	600900	长江电力	82,855.00	0.77
2	600276	恒瑞医药	77,875.00	0.72
3	600019	宝钢股份	70,565.00	0.65
4	601669	中国电建	47,286.00	0.44
5	600015	华夏银行	46,531.00	0.43
6	600703	三安光电	39,916.00	0.37
7	601939	建设银行	35,697.00	0.33
8	601009	南京银行	32,592.00	0.30
9	600009	上海机场	29,928.00	0.28
10	600089	特变电工	28,544.70	0.26
11	600660	福耀玻璃	28,526.00	0.26
12	600309	万华化学	27,724.00	0.26
13	600739	辽宁成大	27,544.00	0.25
14	600352	浙江龙盛	26,966.00	0.25
15	603380	易德龙	26,500.00	0.24
16	601600	中国铝业	24,932.00	0.23
17	600886	国投电力	24,080.00	0.22

18	600196	复星医药	23,944.00	0.22
19	600068	葛洲坝	23,397.00	0.22
20	600340	华夏幸福	23,086.00	0.21

注：不考虑相关交易费用。

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	37,981,028.67
卖出股票收入（成交）总额	2,062,514.52

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	248,465.00	0.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	248,465.00	0.39

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	020207	17 贴债 51	1,500	148,605.00	0.24
2	019557	17 国债 03	1,000	99,860.00	0.16

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投资。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	中小盘 ETF	指数型	交易型开 放式	华泰柏瑞 基金管理 有限公司	57,711,286.07	91.64

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

报告期内本基金及目标基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

8.13.2

本基金及目标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。

8.13.3 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	961.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,969.38
5	应收申购款	3,771.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,702.40

8.13.4 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。

8.13.5 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	600309	万华化学	22,602.00	0.04	重大资产重组停牌
2	601600	中国铝业	21,843.00	0.03	重大资产重组停牌

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

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
635	88,731.90	47,010,154.19	83.43%	9,334,602.87	16.57%

9.2 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。

9.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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	482,562,901.50
本报告期期初基金份额总额	10,589,033.38
本报告期基金总申购份额	50,240,388.36
减:本报告期基金总赎回份额	4,484,664.68
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	56,344,757.06

§ 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

2017 年 7 月 12 日，经公司股东会批准，吴海云女士成为公司监事会主席。

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。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

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(特殊普通合伙)的报酬为 60000 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	

中信建投	1	3,737,906.12	9.34%	3,481.43	9.35%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	36,262,726.56	90.66%	33,772.28	90.65%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 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。

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	基金交易
------	------	--------	------	------

	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	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比例
中信建投	604,208.93	100%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金实施增值税政策的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月30日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月30日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加凤凰金信（银川）基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月28日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加中国工商银行股份有限公司“2018 倾心回馈”基金定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月28日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加浙商银行股份有限公司申购	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月28日

	及定期定额投资费率优惠活动的公告		
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 26 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加天津万家财富资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及申购费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 6 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海好买基金销售有限公司转换业务费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 1 日
9	关于华泰柏瑞基金管理有限公司参加上海基煜基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 28 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及申购费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 22 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海挖财金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 3 日
12	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 证券投资基金联接基金 2017 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 10 月 25 日
13	华泰柏瑞基金管理公司关于旗下部分基金在上海大智慧财富管理有限公司开通基金定投业务及参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 9 月 9 日
14	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书（正文）2017 年第 2 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 9 月 7 日
15	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书（摘要）2017 年第 2 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 9 月 7 日
16	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 2017 年半年报摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 26 日
17	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 26 日

	2017 半年报		
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金定投业务及定投手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 18 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加华泰证券股份有限公司基金认购、申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 1 日
20	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 2017 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 20 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海汇付金融服务有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 14 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加佳泓（北京）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 14 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 1 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 1 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司定投及转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 6 月 22 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加联储证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 6 月 10 日
27	华泰柏瑞基金关于增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构同时开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 6 月 6 日
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加大有期货有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 5 月 25 日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2017 年 5 月 8 日

	增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	券报、证券时报	
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加金惠家保险代理有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 28 日
31	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 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
32	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 22 日
33	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 18 日
34	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加广发证券网上、手机委托系统申购（不含定投）手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 31 日
35	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
36	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 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
37	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 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
38	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更新的招募说明书 2017 年第 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 10 日
39	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更新的招募说明书 2017 年第 1 号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 10 日
40	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 8 日
41	华泰柏瑞基金关于增加上海朝阳永续基金销售有限公司为代销机	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 1 日

	构并开通基金转换和参加费率优惠的公告		
42	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加华西证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 1 日
43	华泰柏瑞基金管理有限公司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
44	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 23 日
45	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更旗下基金产品转换补差费计算方式的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 23 日
46	华泰柏瑞基金关于上海华信证券有限责任公司开通基金定投并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日
47	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 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
48	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 12 日
49	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 12 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	1	2017. 03. 15-2017. 12. 31	0.00	47,010,154.19	0.00	47,010,154.19	83.43%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 20%的情形。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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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联接基金募集的文件
- 2、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 3、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 4、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- 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联接基金的公告

13.2 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

13.3 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

2018 年 3 月 28 日