

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

2018年年度报告

2018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：2019年3月27日

§ 1重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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2019年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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2018年1月1日起至2018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	6
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	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 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	14
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	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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.....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	62
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.....	62
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.....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
8.12 投资组合报告附注.....	63
§9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	64
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	64
§10 开放式基金份额变动.....	66
§ 11 重大事件揭示.....	67
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67

11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§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	18,729,161.00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	2011-3-28

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200135	100818
法定代表人		贾波	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	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场22-23层

§ 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	882,428.21	1,300,568.06	-2,997,568.49
本期利润	-18,388,334.49	4,881,888.06	-5,744,645.03
加权平均基金份额本期利润	-1.0449	0.3231	-0.8149
本期加权平均净值利润率	-27.47%	7.84%	-21.41%
本期基金份额净值增长率	-24.63%	10.14%	-17.12%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	-8,298,175.36	10,168,932.04	1,337,852.99
期末可供分配基金份额利润	-0.4431	0.6079	0.2148
期末基金资产净值	60,228,667.48	71,378,112.01	24,129,303.00
期末基金份额净值	3.2158	4.2667	3.8740
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	-11.20%	17.76%	6.92%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

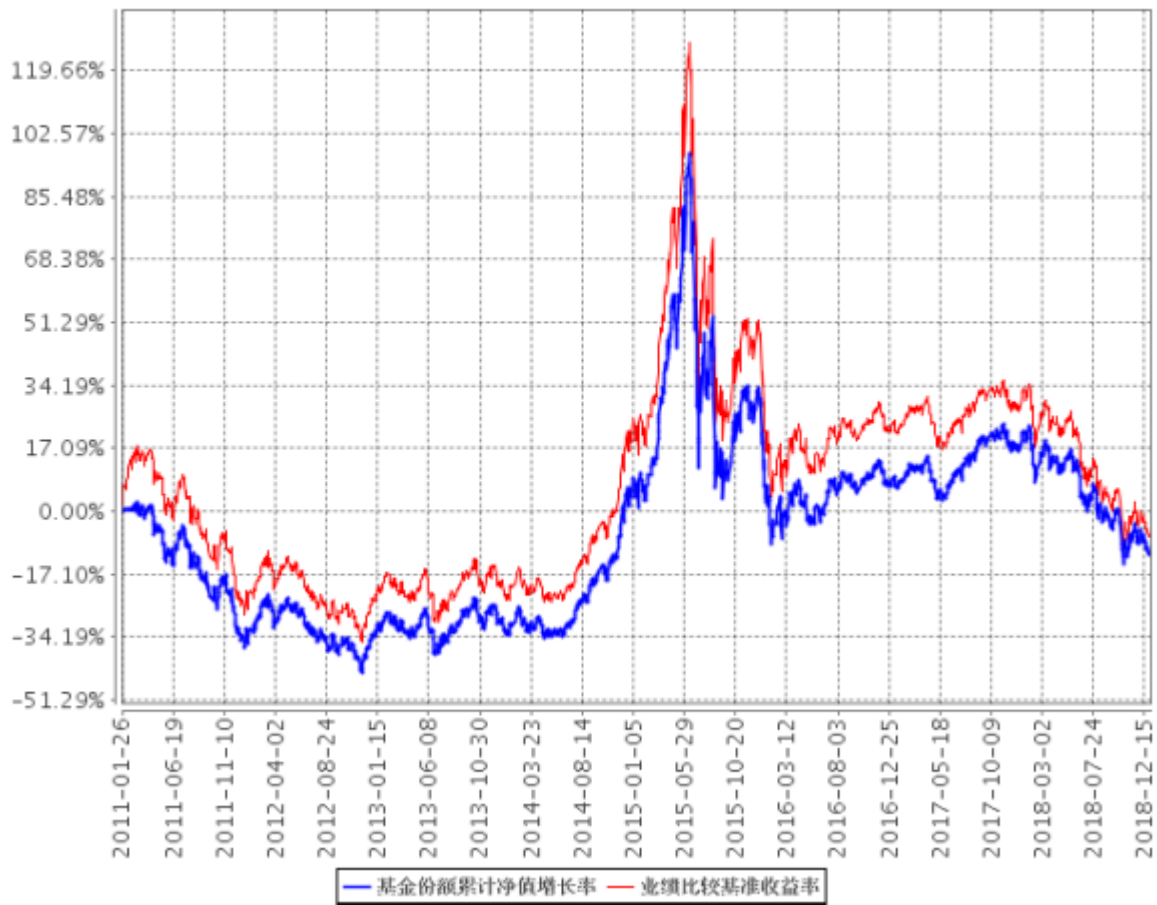
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-11.68%	1.66%	-11.77%	1.68%	0.09%	-0.02%
过去六个月	-14.82%	1.44%	-16.19%	1.46%	1.37%	-0.02%
过去一年	-24.63%	1.33%	-27.27%	1.34%	2.64%	-0.01%
过去三年	-31.17%	1.32%	-36.14%	1.32%	4.97%	0.00%
过去五年	25.22%	1.72%	15.38%	1.71%	9.84%	0.01%
自基金合同生效起至今	-11.20%	1.60%	-6.34%	1.60%	-4.86%	0.00%

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

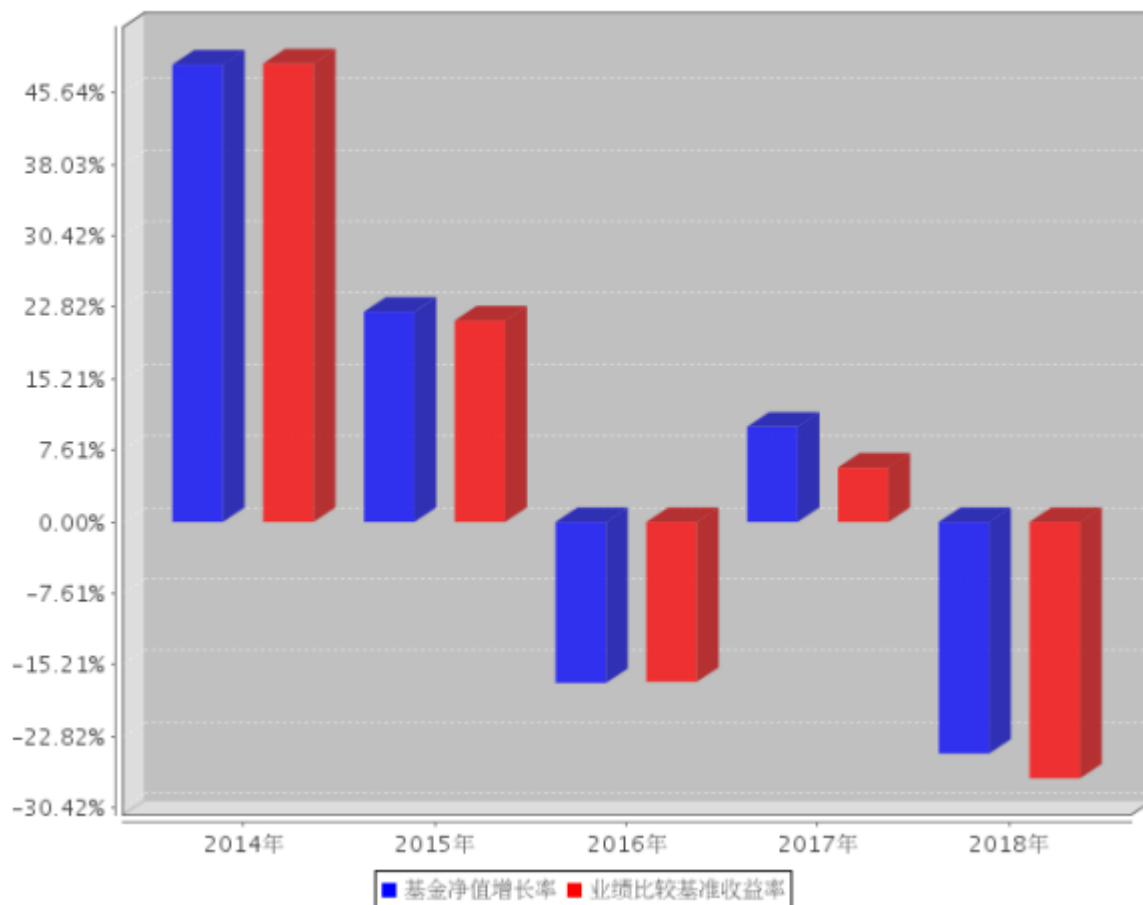
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为2011年1月26日至2018年12月31日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
2016	0.3900	320,937.38	-	320,937.38	
合计	0.3900	320,937.38	-	320,937.38	

§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发起式证券投资基金、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、华泰柏瑞价值精选30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、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金。

截至2018年12月31日，公司基金管理规模为980.05亿元。

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	-	17年	17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500ETF及华泰柏瑞中证500ETF联接基金的基金经理。2018年3月至2018年11月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年3月至2018年10月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起任华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018年10月起任华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金

					的基金经理。2018年12月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
李孝华	本基金的基金经理助理	2017年11月9日	-	6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。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

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

2018年全年市场整体不佳，除年初市场有所表现外，其余时间市场整体呈现出单边下跌走势，在国内金融去杠杆以及中美贸易战阴影的笼罩下，全年上证红利、沪深300、中证500、中证1000和创业板指分别下跌16.96%、25.31%、33.32%、36.87%和28.65%。从市场整体风格来看，具有高分红的低估值股票表现较为抗跌，大盘风格优于小盘。分各行业来看，28个申万一级行业无一录得正收益，其中休闲服务和银行板块表现相对较优。

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2.647%，日均绝对跟踪偏离度为0.028%，期间日跟踪误差为0.036%，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3.2158元；本报告期基金份额净值增长率为-24.63%，业绩比较基准收益率为-27.27%。

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2019年，A股市场在经历2018年的大幅调整以后，PE和PB等估值指标已处于多年以来的历史低位，市场已经处于底部区域，我们认为当下市场已充分计入外部贸易环境恶化、国内经济下行导致的上市公司业绩下滑等不利因素，投资者可以对当前股票市场保持适当乐观，可择机加大对权益类资产的配置。目前A股市场国际化进程仍在持续，MSCI即将公布是否将A股纳入因子从5%提高到20%的决定，不论结果如何，我们认为A股市场国际化的趋势不会改变。根据以往经验，外资更为偏好业绩良好且具有高分红的大盘蓝筹，这一偏好有望继续影响着市场的风格选择，在目前市场风险偏好仍相对较低的背景下，这类具有高分红的大盘蓝筹股或将继续获得超越市场的收益。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2018年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、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，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上，方可进行收益分配。截至本报告期末，本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第21800号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人:
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“上证中小盘ETF”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018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ETF2018年12月31日的财务状况以及2018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,我们独立于上证中小盘ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>上证中小盘ETF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的</p>

	<p>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、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>

	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。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
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	2019年3月26日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	974,351.20	1,556,280.76
结算备付金		810.03	2,026.61
存出保证金		70.56	746.44
交易性金融资产	7.4.7.2	59,430,546.06	69,900,277.29
其中：股票投资		59,430,546.06	69,900,277.29
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		13,180.94	115,685.65
应收利息	7.4.7.5	182.84	247.06
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		60,419,141.63	71,575,263.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,082.56	30,245.19
应付托管费		5,216.51	6,049.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	9,175.08	10,857.58
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	150,000.00	150,000.00
负债合计		190,474.15	197,151.80

所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	68,526,842.84	61,209,179.97
未分配利润	7.4.7.10	-8,298,175.36	10,168,932.04
所有者权益合计		60,228,667.48	71,378,112.01
负债和所有者权益总计		60,419,141.63	71,575,263.81

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值3.2158元，基金份额总额18,729,161.00份。

7.2 利润表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
一、收入		-17,576,589.47	5,662,582.65
1.利息收入		7,849.57	9,589.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,847.39	9,581.42
债券利息收入		2.18	8.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,684,401.76	2,046,072.62
其中：股票投资收益	7.4.7.12	508,376.05	1,136,440.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	470.62	10,601.09
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,175,555.09	899,030.60

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-19,270,762.70	3,581,320.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,921.90	25,600.10
减：二、费用		811,745.02	780,694.59
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	334,701.50	308,392.94
2. 托管费	7.4.10.2.2	66,940.29	61,678.58
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	48,443.23	48,453.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	361,660.00	362,169.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,388,334.49	4,881,888.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,388,334.49	4,881,888.06

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	61,209,179.97	10,168,932.04	71,378,112.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,388,334.49	-18,388,334.49
三、本期基金份额交易	7,317,662.87	-78,772.91	7,238,889.96

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	12,805,910.00	-26,243.84	12,779,666.16
2.基金赎回款	-5,488,247.13	-52,529.07	-5,540,776.20
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)	68,526,842.84	-8,298,175.36	60,228,667.48
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	4,881,888.06	4,881,888.06
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)	38,417,729.96	3,949,190.99	42,366,920.95
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	-3,658,831.42	-507,271.56	-4,166,102.98
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)	61,209,179.97	10,168,932.04	71,378,112.01

注：报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 韩勇
 房伟力
 赵景云

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]第1535号《关于核准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募

集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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(特殊普通合伙)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，本基金的标的指数为中证指数有限公司编制并发布的上证中小盘指数，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、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，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为上证中小盘指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标ETF，于2011年1月26日募集成立了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“上证中小盘ETF联接基金”)。上证中小盘ETF联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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2019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》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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2018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2018年12月31日的财务状况以及2018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

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	974,351.20	1,556,280.76
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	974,351.20	1,556,280.76

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	79,321,012.64	59,430,546.06	-19,890,466.58
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	79,321,012.64	59,430,546.06	-19,890,466.58
项目	上年度末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	70,519,981.17	69,900,277.29	-619,703.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	70,519,981.17	69,900,277.29	-619,703.88

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日

应收活期存款利息	182.40	245.74
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	0.44	0.99
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
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	-	0.33
合计	182.84	247.06

7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	9,175.08	10,857.58
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	9,175.08	10,857.58

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	100,000.00	100,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	150,000.00	150,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,729,161.00	61,209,179.97
本期申购	3,500,000.00	12,805,910.00

本期赎回(以“-”号填列)	-1,500,000.00	-5,488,247.13
- 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	18,729,161.00	68,526,842.84

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。

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	27,766,048.84	-17,597,116.80	10,168,932.04
本期利润	882,428.21	-19,270,762.70	-18,388,334.49
本期基金份额交易产生的变动数	3,567,840.62	-3,646,613.53	-78,772.91
其中：基金申购款	6,201,570.38	-6,227,814.22	-26,243.84
基金赎回款	-2,633,729.76	2,581,200.69	-52,529.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,216,317.67	-40,514,493.03	-8,298,175.36

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	7,606.86	9,341.25
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	228.30	213.00
其他	12.23	27.17
合计	7,847.39	9,581.42

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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,530,210.89	1,248,284.03
股票投资收益——赎回差价收入	-1,021,834.84	-111,843.10
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	508,376.05	1,136,440.93

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 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
卖出股票成交总额	15,607,155.66	13,555,625.38
减：卖出股票成本总额	14,076,944.77	12,307,341.35
买卖股票差价收入	1,530,210.89	1,248,284.03

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
赎回基金份额对价总额	5,540,776.20	4,166,102.98
减：现金支付赎回款总额	-52,714.80	-25,234.02
减：赎回股票成本总额	6,615,325.84	4,303,180.10
赎回差价收入	-1,021,834.84	-111,843.10

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票申购差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	470.62	10,601.09
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	470.62	10,601.09

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

	年12月31日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	13,472.80	73,609.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,000.00	63,000.00
减：应收利息总额	2.18	8.51
买卖债券差价收入	470.62	10,601.09

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,175,555.09	899,030.60
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,175,555.09	899,030.60

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-19,270,762.70	3,581,320.00
——股票投资	-19,270,762.70	3,581,320.00
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-19,270,762.70	3,581,320.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	1,921.90	25,600.10
合计	1,921.90	25,600.10

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)

被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)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(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	48,443.23	48,453.71
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	48,443.23	48,453.71

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00

信息披露费	40,000.00	40,000.00
银行划款手续费	1,660.00	2,169.36
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	361,660.00	362,169.36

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：截至财务报表报出日，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、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
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridgeInvestmentLLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
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
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：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：本报告期及上一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 权证交易

注：本报告期及上一年度可比期间本基金与关联方未进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	334,701.50	308,392.94
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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0.50%的年费率计提，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 X 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	66,940.29	61,678.58

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，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 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：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017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
中国银行股份有限公司—华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证	14,500,000.00	77.4194%	13,525,977.00	80.8527%

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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	974,351.20	7,606.86	1,556,280.76	9,341.25

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：无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018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
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	11,978	37,610.92	37,610.92	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600270	外运发展	2018年12月13日	重大资产重组	20.99	-	-	5,188	104,808.81	108,896.12	-

注：根据中外运空运发展股份有限公司（以下简称“外运发展”）于2018年11月3日公布的《中国外运股份有限公司换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司暨关联交易报告书》和中国外运股份有限公司（以下简称“中国外运”）于2019年1月15日公布的《中国外运发行A股股份换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司上市公告书暨2018年第三季度财务报表》，中国外运向中国外运以外的股东发行A股股票，以换股比例1:3.8225取得外运发展股东持有的外运发展全部股票，吸收合并外运发展；外运发展自2018年12月13日起连续停牌。换股合并后新增的中国外运股票于2019年1月18日上市流通，当日开盘单价为5.30元。外运发展自2018年12月28日起终止上市并摘牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元，无债券作为质押。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元，无债券作为质押。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。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，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

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人中国银行，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。

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2018年12月31日，本基金无债券投资(2017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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2018年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 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时间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%。于2018年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.24%。

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。于2018年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为60,271,571.16元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	974,351.20	-	-	-	-	-	974,351.20
结算备付金	810.03	-	-	-	-	-	810.03
存出保证金	70.56	-	-	-	-	-	70.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	59,430,546.06	59,430,546.06

应收证券清算款	-	-	-	-	-	13,180.94	13,180.94
应收利息	-	-	-	-	-	182.84	182.84
资产总计	975,231.79	-	-	-	-	-59,443,909.84	60,419,141.63
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,082.56	26,082.56
应付托管费	-	-	-	-	-	5,216.51	5,216.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,175.08	9,175.08
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	190,474.15	190,474.15
利率敏感度缺口	975,231.79	-	-	-	-	-59,253,435.69	60,228,667.48
上年度末 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	1,556,280.76	-	-	-	-	-	1,556,280.76
结算备付金	2,026.61	-	-	-	-	-	2,026.61
存出保证金	746.44	-	-	-	-	-	746.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-69,900,277.29	69,900,277.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-	115,685.65	115,685.65
应收利息	-	-	-	-	-	247.06	247.06
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,559,053.81	-	-	-	-	-70,016,210.00	71,575,263.81
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,245.19	30,245.19
应付托管费	-	-	-	-	-	6,049.03	6,049.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,857.58	10,857.58
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	197,151.80	197,151.80
利率敏感度缺口	1,559,053.81	-	-	-	-	-69,819,058.20	71,378,112.01

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 利率风险的敏感性分析

注：于2018年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2017年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2017年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的95%。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 2018年12月31日		上年度末 2017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	59,430,546.06	98.67	69,900,277.29	97.93
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	59,430,546.06	98.67	69,900,277.29	97.93

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（2018年12月31日）	上年度末（2017年12月31日）
	上证中小盘指数上升5%	240.73	250.00
	上证中小盘指数下降5%	-240.73	-250.00

7.4.13.1.4 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) 基金申购款

于2018年度，本基金申购基金份额的对价总额为12,779,666.16元(2017年度：46,533,023.93元)，其中包括以股票支付的申购款11,792,833.54元和以现金支付的申购款986,832.62元(2017年度：其中包括以股票支付的申购款36,207,334.00元和以现金支付的申购款10,325,689.93元)。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018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59,284,039.02元，属于第二层次的余额为146,507.04元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次66,426,868.39元，第二层次3,473,408.90元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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2018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(2017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。

(3)除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	59,430,546.06	98.36
	其中：股票	59,430,546.06	98.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	975,161.23	1.61
8	其他各项资产	13,434.34	0.02
9	合计	60,419,141.63	100.00

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	150,048.24	0.25
B	采矿业	3,189,718.37	5.30
C	制造业	26,474,818.07	43.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,587,399.27	9.28
E	建筑业	2,022,148.53	3.36
F	批发和零售业	2,780,323.80	4.62
G	交通运输、仓储和邮政业	4,358,387.78	7.24
H	住宿和餐饮业	160,710.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,712,121.98	4.50
J	金融业	8,408,621.02	13.96
K	房地产业	1,957,820.56	3.25
L	租赁和商务服务业	412,427.05	0.68
M	科学研究和技术服务业	20,265.25	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	170,987.50	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	39,128.00	0.06
Q	卫生和社会工作	132,916.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	599,304.72	1.00
S	综合	253,399.92	0.42

合计	59,430,546.06	98.67
----	---------------	-------

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港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	96,842	1,537,850.96	2.55
2	600837	海通证券	118,700	1,044,560.00	1.73
3	603288	海天味业	11,914	819,683.20	1.36
4	600009	上海机场	14,386	730,233.36	1.21
5	600015	华夏银行	94,060	695,103.40	1.15
6	600919	江苏银行	100,200	598,194.00	0.99
7	600031	三一重工	68,525	571,498.50	0.95
8	601009	南京银行	88,029	568,667.34	0.94
9	600999	招商证券	41,900	561,460.00	0.93
10	601899	紫金矿业	152,732	510,124.88	0.85
11	601012	隆基股份	29,065	506,893.60	0.84
12	600406	国电南瑞	26,800	496,604.00	0.82
13	600886	国投电力	59,781	481,237.05	0.80
14	600660	福耀玻璃	20,600	469,268.00	0.78
15	600011	华能国际	61,900	456,822.00	0.76
16	600795	国电电力	173,600	444,416.00	0.74
17	601933	永辉超市	56,302	443,096.74	0.74
18	601225	陕西煤业	58,900	438,216.00	0.73
19	601669	中国电建	89,700	435,942.00	0.72
20	600741	华域汽车	23,117	425,352.80	0.71
21	600958	东方证券	52,400	417,628.00	0.69
22	600518	康美药业	44,400	408,924.00	0.68
23	600436	片仔癀	4,394	380,740.10	0.63
24	600570	恒生电子	7,287	378,778.26	0.63
25	600271	航天信息	16,406	375,533.34	0.62
26	600089	特变电工	54,373	369,192.67	0.61
27	600352	浙江龙盛	38,217	368,794.05	0.61
28	601985	中国核电	68,500	360,995.00	0.60
29	601600	中国铝业	96,460	342,433.00	0.57
30	601111	中国国航	44,396	339,185.44	0.56

31	600487	亨通光电	19,620	334,521.00	0.56
32	601618	中国中冶	104,585	325,259.35	0.54
33	601155	新城控股	13,500	319,815.00	0.53
34	601901	方正证券	60,100	319,131.00	0.53
35	600383	金地集团	33,091	318,335.42	0.53
36	600221	海航控股	168,700	317,156.00	0.53
37	601377	兴业证券	68,000	315,520.00	0.52
38	601877	正泰电器	12,573	304,769.52	0.51
39	600176	中国巨石	30,893	298,735.31	0.50
40	600588	用友网络	14,017	298,562.10	0.50
41	600010	包钢股份	200,180	296,266.40	0.49
42	600867	通化东宝	21,204	294,735.60	0.49
43	600332	白云山	8,213	293,696.88	0.49
44	600522	中天科技	36,030	293,644.50	0.49
45	601607	上海医药	17,185	292,145.00	0.49
46	600893	航发动力	13,400	291,048.00	0.48
47	600498	烽火通信	10,188	290,052.36	0.48
48	600201	生物股份	17,427	289,288.20	0.48
49	600023	浙能电力	59,620	282,002.60	0.47
50	600111	北方稀土	31,900	279,763.00	0.46
51	600482	中国动力	12,524	278,909.48	0.46
52	600705	中航资本	65,624	278,245.76	0.46
53	600115	东方航空	57,491	273,082.25	0.45
54	600637	东方明珠	26,060	266,854.40	0.44
55	600516	方大炭素	15,805	264,101.55	0.44
56	600177	雅戈尔	36,724	264,045.56	0.44
57	600535	天士力	13,500	259,200.00	0.43
58	601727	上海电气	51,800	255,892.00	0.42
59	600068	葛洲坝	40,393	255,283.76	0.42
60	601788	光大证券	28,700	251,699.00	0.42
61	601099	太平洋	99,712	248,282.88	0.41
62	601998	中信银行	44,700	243,615.00	0.40
63	603019	中科曙光	6,700	240,396.00	0.40
64	600872	中炬高新	8,076	237,918.96	0.40
65	601555	东吴证券	35,266	236,282.20	0.39
66	600438	通威股份	28,100	232,668.00	0.39
67	600018	上港集团	44,700	231,546.00	0.38
68	600066	宇通客车	19,400	229,890.00	0.38
69	600027	华电国际	48,128	228,608.00	0.38

70	600109	国金证券	31,800	227,688.00	0.38
71	601919	中远海控	55,800	225,432.00	0.37
72	600674	川投能源	25,943	224,925.81	0.37
73	600398	海澜之家	26,431	224,134.88	0.37
74	600926	杭州银行	30,160	223,184.00	0.37
75	600085	同仁堂	8,098	222,695.00	0.37
76	600219	南山铝业	105,445	222,488.95	0.37
77	600256	广汇能源	59,107	222,242.32	0.37
78	603799	华友钴业	7,320	220,405.20	0.37
79	601997	贵阳银行	20,500	218,940.00	0.36
80	600489	中金黄金	25,262	216,747.96	0.36
81	600426	华鲁恒升	16,777	202,498.39	0.34
82	600362	江西铜业	15,017	197,623.72	0.33
83	600699	均胜电子	8,400	196,224.00	0.33
84	600170	上海建工	64,311	194,862.33	0.32
85	601198	东兴证券	20,300	194,068.00	0.32
86	601018	宁波港	57,947	193,542.98	0.32
87	600642	申能股份	39,381	192,179.28	0.32
88	600739	辽宁成大	17,933	187,579.18	0.31
89	600298	安琪酵母	7,200	181,656.00	0.30
90	600208	新潮中宝	61,989	179,768.10	0.30
91	600760	中航沈飞	6,300	174,573.00	0.29
92	600600	青岛啤酒	4,985	173,777.10	0.29
93	600820	隧道股份	27,684	173,301.84	0.29
94	600879	航天电子	31,700	171,497.00	0.28
95	601992	金隅集团	48,918	171,213.00	0.28
96	600528	中铁工业	15,850	166,425.00	0.28
97	603858	步长制药	6,510	164,572.80	0.27
98	601168	西部矿业	28,028	163,122.96	0.27
99	600153	建发股份	23,000	162,150.00	0.27
100	600811	东方集团	44,140	161,552.40	0.27
101	603833	欧派家居	2,000	159,440.00	0.26
102	600038	中直股份	4,261	159,190.96	0.26
103	600583	海油工程	32,469	159,098.10	0.26
104	600673	东阳光科	21,754	158,369.12	0.26
105	600977	中国电影	11,000	157,520.00	0.26
106	601333	广深铁路	49,754	157,222.64	0.26
107	600183	生益科技	15,468	155,608.08	0.26
108	600779	水井坊	4,900	155,183.00	0.26

109	601117	中国化学	28,936	155,096.96	0.26
110	603589	口子窖	4,400	154,308.00	0.26
111	600022	山东钢铁	97,605	153,239.85	0.25
112	600497	驰宏锌锗	37,236	152,667.60	0.25
113	600325	华发股份	24,572	152,346.40	0.25
114	600004	白云机场	15,110	151,855.50	0.25
115	600808	马钢股份	43,640	150,994.40	0.25
116	600885	宏发股份	6,640	149,798.40	0.25
117	600236	桂冠电力	26,567	149,306.54	0.25
118	600118	中国卫星	8,586	148,709.52	0.25
119	600346	恒力股份	11,200	148,400.00	0.25
120	600804	鹏博士	21,062	148,065.86	0.25
121	600549	厦门钨业	12,240	147,859.20	0.25
122	600688	上海石化	29,448	146,945.52	0.24
123	600297	广汇汽车	35,860	145,591.60	0.24
124	600718	东软集团	12,600	145,530.00	0.24
125	600567	山鹰纸业	46,167	144,041.04	0.24
126	600643	爱建集团	16,940	143,820.60	0.24
127	600369	西南证券	41,300	143,724.00	0.24
128	600079	人福医药	14,065	142,619.10	0.24
129	601878	浙商证券	19,500	141,570.00	0.24
130	600816	安信信托	32,024	139,944.88	0.23
131	600415	小商品城	39,929	139,352.21	0.23
132	601238	广汽集团	13,520	139,120.80	0.23
133	600143	金发科技	27,936	138,283.20	0.23
134	600161	天坛生物	6,467	137,423.75	0.23
135	600809	山西汾酒	3,840	134,592.00	0.22
136	600160	巨化股份	20,177	133,773.51	0.22
137	600763	通策医疗	2,800	132,916.00	0.22
138	600392	盛和资源	15,435	132,895.35	0.22
139	601233	桐昆股份	13,580	132,540.80	0.22
140	601098	中南传媒	10,602	132,525.00	0.22
141	600635	大众公用	28,061	131,606.09	0.22
142	600315	上海家化	4,800	131,040.00	0.22
143	600755	厦门国贸	18,573	129,639.54	0.22
144	601216	君正集团	49,288	129,134.56	0.21
145	600566	济川药业	3,851	129,124.03	0.21
146	601881	中国银河	18,900	128,898.00	0.21
147	600875	东方电气	16,200	127,818.00	0.21

148	600655	豫园股份	17,253	127,672.20	0.21
149	603077	和邦生物	78,059	126,455.58	0.21
150	600881	亚泰集团	37,955	125,631.05	0.21
151	600967	内蒙一机	12,040	125,216.00	0.21
152	600839	四川长虹	54,036	124,823.16	0.21
153	603986	兆易创新	2,000	124,640.00	0.21
154	601898	中煤能源	26,766	124,461.90	0.21
155	600166	福田汽车	68,292	124,291.44	0.21
156	601021	春秋航空	3,892	123,804.52	0.21
157	600521	华海药业	11,062	122,345.72	0.20
158	600909	华安证券	25,700	121,304.00	0.20
159	601866	中远海发	52,133	118,863.24	0.20
160	603899	晨光文具	3,900	117,975.00	0.20
161	601699	潞安环能	17,661	117,622.26	0.20
162	600801	华新水泥	7,000	117,040.00	0.19
163	600584	长电科技	14,011	115,450.64	0.19
164	600282	南钢股份	33,600	114,912.00	0.19
165	600188	兖州煤业	13,076	114,807.28	0.19
166	600008	首创股份	33,380	114,493.40	0.19
167	601991	大唐发电	36,333	114,448.95	0.19
168	600277	亿利洁能	20,162	114,116.92	0.19
169	600572	康恩贝	19,112	113,334.16	0.19
170	600273	嘉化能源	12,600	113,274.00	0.19
171	600258	首旅酒店	7,000	111,720.00	0.19
172	600388	龙净环保	11,004	111,690.60	0.19
173	600266	北京城建	14,000	110,880.00	0.18
174	600061	国投资本	12,300	110,577.00	0.18
175	603160	汇顶科技	1,400	110,180.00	0.18
176	600260	凯乐科技	6,449	109,439.53	0.18
177	600270	外运发展	5,188	108,896.12	0.18
178	600466	蓝光发展	20,180	108,568.40	0.18
179	600515	海航基础	23,000	108,330.00	0.18
180	600138	中青旅	8,400	108,276.00	0.18
181	601228	广州港	27,300	108,108.00	0.18
182	600737	中粮糖业	14,681	108,052.16	0.18
183	600507	方大特钢	10,700	106,893.00	0.18
184	603369	今世缘	7,350	106,501.50	0.18
185	600486	扬农化工	2,793	105,184.38	0.17
186	600884	杉杉股份	8,138	105,142.96	0.17

187	600039	四川路桥	31,704	103,989.12	0.17
188	600771	广誉远	3,600	103,932.00	0.17
189	600500	中化国际	15,180	103,831.20	0.17
190	600511	国药股份	4,442	103,276.50	0.17
191	600373	中文传媒	7,800	101,478.00	0.17
192	600728	佳都科技	14,728	101,475.92	0.17
193	601000	唐山港	42,369	100,838.22	0.17
194	600729	重庆百货	3,532	99,955.60	0.17
195	600372	中航电子	7,700	99,946.00	0.17
196	601633	长城汽车	17,733	99,304.80	0.16
197	603885	吉祥航空	7,920	99,237.60	0.16
198	600060	海信电器	11,427	99,186.36	0.16
199	600863	内蒙华电	42,627	98,468.37	0.16
200	600435	北方导航	13,174	97,619.34	0.16
201	601966	玲珑轮胎	7,100	96,915.00	0.16
202	601128	常熟银行	15,700	96,398.00	0.16
203	600323	瀚蓝环境	6,857	96,203.71	0.16
204	600782	新钢股份	18,700	95,183.00	0.16
205	600745	闻泰科技	4,500	95,085.00	0.16
206	600125	铁龙物流	13,562	94,934.00	0.16
207	600056	中国医药	7,542	94,802.94	0.16
208	601258	庞大集团	66,783	93,496.20	0.16
209	600320	振华重工	29,444	93,337.48	0.15
210	600380	健康元	13,888	92,632.96	0.15
211	600410	华胜天成	15,780	92,470.80	0.15
212	600062	华润双鹤	7,627	92,210.43	0.15
213	600460	士兰微	11,300	91,756.00	0.15
214	600563	法拉电子	2,146	90,432.44	0.15
215	600536	中国软件	4,302	90,040.86	0.15
216	603816	顾家家居	2,000	90,000.00	0.15
217	600158	中体产业	10,122	89,984.58	0.15
218	600312	平高电气	11,127	89,906.16	0.15
219	600598	北大荒	10,500	89,880.00	0.15
220	600418	江淮汽车	18,600	89,466.00	0.15
221	600348	阳泉煤业	17,698	89,197.92	0.15
222	600702	舍得酒业	3,900	88,998.00	0.15
223	600339	中油工程	24,500	88,935.00	0.15
224	600848	上海临港	4,300	88,924.00	0.15
225	601636	旗滨集团	23,400	88,920.00	0.15

226	600803	新奥股份	8,875	88,217.50	0.15
227	600026	中远海能	19,845	88,111.80	0.15
228	600664	哈药股份	22,294	88,061.30	0.15
229	600409	三友化工	15,334	87,710.48	0.15
230	601231	环旭电子	9,742	87,678.00	0.15
231	600307	酒钢宏兴	45,788	87,455.08	0.15
232	600578	京能电力	29,500	86,435.00	0.14
233	600711	盛屯矿业	18,831	86,057.67	0.14
234	600717	天津港	12,171	86,048.97	0.14
235	600596	新安股份	8,039	85,936.91	0.14
236	600490	鹏欣资源	18,648	84,848.40	0.14
237	600525	长园集团	19,277	84,433.26	0.14
238	601958	金钼股份	14,216	84,158.72	0.14
239	601880	大连港	45,343	83,884.55	0.14
240	600291	西水股份	8,100	83,349.00	0.14
241	600582	天地科技	24,364	83,324.88	0.14
242	600682	南京新百	9,400	82,532.00	0.14
243	600823	世茂股份	21,800	81,968.00	0.14
244	600970	中材国际	14,976	81,918.72	0.14
245	600025	华能水电	26,000	81,900.00	0.14
246	600120	浙江东方	6,471	81,275.76	0.13
247	600216	浙江医药	9,289	80,628.52	0.13
248	600868	梅雁吉祥	27,900	79,515.00	0.13
249	600845	宝信软件	3,800	79,230.00	0.13
250	600633	浙数文化	9,711	79,144.65	0.13
251	600797	浙大网新	10,962	79,036.02	0.13
252	600901	江苏租赁	13,100	77,421.00	0.13
253	600648	外高桥	5,500	75,570.00	0.13
254	603883	老百姓	1,600	75,536.00	0.13
255	601100	恒立液压	3,800	75,278.00	0.12
256	600017	日照港	26,963	74,417.88	0.12
257	600597	光明乳业	8,869	74,144.84	0.12
258	600171	上海贝岭	7,900	73,786.00	0.12
259	601717	郑煤机	13,300	73,549.00	0.12
260	601808	中海油服	8,598	73,426.92	0.12
261	600073	上海梅林	9,802	73,024.90	0.12
262	600499	科达洁能	17,902	72,324.08	0.12
263	600756	浪潮软件	4,728	72,291.12	0.12
264	600908	无锡银行	13,700	71,788.00	0.12

265	600185	格力地产	17,700	71,685.00	0.12
266	600267	海正药业	8,453	70,920.67	0.12
267	600179	安通控股	10,600	70,490.00	0.12
268	600377	宁沪高速	7,181	70,373.80	0.12
269	600175	美都能源	31,944	70,276.80	0.12
270	601222	林洋能源	14,475	70,059.00	0.12
271	600446	金证股份	7,353	69,853.50	0.12
272	601011	宝泰隆	12,700	69,850.00	0.12
273	600110	诺德股份	17,139	69,584.34	0.12
274	600835	上海机电	4,717	68,632.35	0.11
275	600269	赣粤高速	17,392	67,828.80	0.11
276	600123	兰花科创	10,231	66,706.12	0.11
277	600740	山西焦化	8,300	66,483.00	0.11
278	601200	上海环境	5,000	66,350.00	0.11
279	603515	欧普照明	2,380	66,330.60	0.11
280	600557	康缘药业	6,447	66,275.16	0.11
281	601608	中信重工	25,409	66,063.40	0.11
282	601326	秦港股份	20,900	65,626.00	0.11
283	600057	厦门象屿	15,682	65,550.76	0.11
284	603323	吴江银行	10,700	65,377.00	0.11
285	603228	景旺电子	1,300	64,987.00	0.11
286	600210	紫江企业	17,800	64,792.00	0.11
287	600787	中储股份	12,925	64,625.00	0.11
288	600317	营口港	28,511	64,434.86	0.11
289	600330	天通股份	11,637	64,119.87	0.11
290	600750	江中药业	3,765	63,741.45	0.11
291	600562	国睿科技	4,950	63,706.50	0.11
292	600611	大众交通	15,950	63,640.50	0.11
293	600116	三峡水利	8,673	63,486.36	0.11
294	600316	洪都航空	6,416	63,454.24	0.11
295	600200	江苏吴中	10,700	63,344.00	0.11
296	601588	北辰实业	23,310	63,170.10	0.10
297	600783	鲁信创投	4,009	62,861.12	0.10
298	600667	太极实业	12,300	62,853.00	0.10
299	601375	中原证券	14,724	62,724.24	0.10
300	600623	华谊集团	7,700	62,216.00	0.10
301	600751	海航科技	22,900	62,059.00	0.10
302	601666	平煤股份	17,500	61,600.00	0.10
303	603766	隆鑫通用	15,050	61,554.50	0.10

304	600580	卧龙电气	9,708	61,160.40	0.10
305	600108	亚盛集团	22,791	60,168.24	0.10
306	600230	沧州大化	3,660	59,109.00	0.10
307	603658	安图生物	1,200	58,668.00	0.10
308	600151	航天机电	14,700	58,212.00	0.10
309	600559	老白干酒	4,700	58,092.00	0.10
310	600859	王府井	4,256	57,711.36	0.10
311	600694	大商股份	2,383	57,644.77	0.10
312	601016	节能风电	24,600	57,072.00	0.09
313	603000	人民网	7,800	56,940.00	0.09
314	600777	新潮能源	29,800	56,918.00	0.09
315	603708	家家悦	2,820	56,653.80	0.09
316	600757	长江传媒	8,686	56,632.72	0.09
317	601066	中信建投	6,500	56,615.00	0.09
318	600478	科力远	14,496	56,534.40	0.09
319	600477	杭萧钢构	15,660	56,376.00	0.09
320	600338	西藏珠峰	2,900	56,347.00	0.09
321	600993	马应龙	4,181	56,109.02	0.09
322	600765	中航重机	7,494	55,755.36	0.09
323	600206	有研新材	8,522	55,648.66	0.09
324	601311	骆驼股份	6,300	55,629.00	0.09
325	600621	华鑫股份	6,200	54,436.00	0.09
326	600874	创业环保	6,533	53,897.25	0.09
327	600502	安徽水利	15,096	53,741.76	0.09
328	600614	鹏起科技	14,820	53,203.80	0.09
329	600846	同济科技	7,352	52,566.80	0.09
330	600366	宁波韵升	10,459	52,399.59	0.09
331	600390	五矿资本	7,500	52,200.00	0.09
332	600856	中天能源	14,000	52,080.00	0.09
333	601069	西部黄金	3,500	52,045.00	0.09
334	601001	大同煤业	12,188	52,042.76	0.09
335	600259	广晟有色	2,300	51,428.00	0.09
336	601886	江河集团	6,861	51,388.89	0.09
337	600594	益佰制药	9,300	51,336.00	0.09
338	600988	赤峰黄金	12,800	51,072.00	0.08
339	600416	湘电股份	9,880	50,980.80	0.08
340	600495	晋西车轴	12,316	50,618.76	0.08
341	601689	拓普集团	3,400	50,252.00	0.08
342	600677	航天通信	5,300	50,191.00	0.08

343	600864	哈投股份	11,246	50,044.70	0.08
344	601828	美凯龙	4,527	49,978.08	0.08
345	603198	迎驾贡酒	3,500	49,385.00	0.08
346	600093	易见股份	6,500	49,270.00	0.08
347	603568	伟明环保	2,150	49,127.50	0.08
348	600754	锦江股份	2,300	48,990.00	0.08
349	601003	柳钢股份	7,400	48,618.00	0.08
350	600715	文投控股	10,800	48,600.00	0.08
351	603260	合盛硅业	1,100	48,180.00	0.08
352	600422	昆药集团	7,782	48,092.76	0.08
353	600233	圆通速递	4,800	48,000.00	0.08
354	600329	中新药业	3,857	47,981.08	0.08
355	601838	成都银行	5,922	47,672.10	0.08
356	600187	国中水务	18,837	46,527.39	0.08
357	601158	重庆水务	8,339	46,364.84	0.08
358	600122	宏图高科	12,771	46,358.73	0.08
359	600072	中船科技	6,600	46,002.00	0.08
360	600350	山东高速	10,000	45,600.00	0.08
361	600685	中船防务	4,741	45,323.96	0.08
362	600255	梦舟股份	25,143	45,257.40	0.08
363	600640	号百控股	4,600	45,126.00	0.07
364	601139	深圳燃气	8,391	45,059.67	0.07
365	601908	京运通	14,129	44,506.35	0.07
366	603444	吉比特	300	44,400.00	0.07
367	600172	黄河旋风	14,420	43,981.00	0.07
368	603328	依顿电子	4,400	43,560.00	0.07
369	600343	航天动力	5,652	42,955.20	0.07
370	601108	财通证券	5,900	42,598.00	0.07
371	600569	安阳钢铁	14,000	42,420.00	0.07
372	600058	五矿发展	6,400	41,664.00	0.07
373	600963	岳阳林纸	10,384	41,639.84	0.07
374	600006	东风汽车	11,553	41,590.80	0.07
375	601952	苏垦农发	6,190	41,039.70	0.07
376	600550	保变电气	11,100	40,848.00	0.07
377	600458	时代新材	6,000	40,680.00	0.07
378	600568	中珠医疗	17,767	40,508.76	0.07
379	600971	恒源煤电	7,100	39,973.00	0.07
380	600086	东方金钰	8,665	39,945.65	0.07
381	603888	新华网	3,100	39,804.00	0.07

382	600428	中远海特	12,239	39,776.75	0.07
383	600759	洲际油气	16,800	39,648.00	0.07
384	600581	八一钢铁	11,000	39,160.00	0.07
385	603377	东方时尚	2,680	39,128.00	0.06
386	603556	海兴电力	3,000	39,000.00	0.06
387	600096	云天化	7,700	38,577.00	0.06
388	601990	南京证券	4,400	38,280.00	0.06
389	603659	璞泰来	800	37,920.00	0.06
390	601002	晋亿实业	7,050	37,717.50	0.06
391	601860	紫金银行	11,978	37,610.92	0.06
392	600391	航发科技	3,431	37,500.83	0.06
393	603113	金能科技	3,400	37,298.00	0.06
394	601777	力帆股份	9,717	37,021.77	0.06
395	600939	重庆建工	7,900	36,419.00	0.06
396	600862	中航高科	6,300	35,280.00	0.06
397	601949	中国出版	7,900	34,681.00	0.06
398	600335	国机汽车	5,500	34,320.00	0.06
399	603980	吉华集团	2,900	34,133.00	0.06
400	603225	新凤鸣	1,780	33,375.00	0.06
401	600651	飞乐音响	10,310	33,301.30	0.06
402	603156	养元饮品	800	33,264.00	0.06
403	603298	杭叉集团	2,800	33,096.00	0.05
404	603650	彤程新材	1,663	32,977.29	0.05
405	600652	游久游戏	7,367	32,930.49	0.05
406	600666	奥瑞德	10,860	32,905.80	0.05
407	603881	数据港	1,300	32,162.00	0.05
408	600517	置信电气	10,079	32,051.22	0.05
409	600231	凌钢股份	11,900	31,773.00	0.05
410	603629	利通电子	814	31,509.94	0.05
411	601019	山东出版	3,900	30,498.00	0.05
412	601890	亚星锚链	8,400	29,568.00	0.05
413	600180	瑞茂通	4,148	29,243.40	0.05
414	600855	航天长峰	3,234	29,203.02	0.05
415	603308	应流股份	3,595	28,831.90	0.05
416	600996	贵广网络	4,500	28,620.00	0.05
417	603056	德邦股份	1,700	28,135.00	0.05
418	603603	博天环境	1,900	28,120.00	0.05
419	600595	中孚实业	14,415	27,965.10	0.05
420	600630	龙头股份	4,000	27,640.00	0.05

421	603486	科沃斯	600	27,618.00	0.05
422	600687	刚泰控股	6,600	27,390.00	0.05
422	601330	绿色动力	2,200	27,390.00	0.05
423	600280	中央商场	8,400	27,300.00	0.05
424	600571	信雅达	4,300	27,090.00	0.04
425	603868	飞科电器	700	26,726.00	0.04
426	601969	海南矿业	5,900	26,432.00	0.04
427	601858	中国科传	3,000	26,220.00	0.04
428	600758	红阳能源	7,700	25,025.00	0.04
429	603712	七一二	1,400	24,934.00	0.04
430	603693	江苏新能	1,800	24,822.00	0.04
431	603730	岱美股份	1,171	24,462.19	0.04
432	603587	地素时尚	1,100	24,189.00	0.04
433	603612	索通发展	2,060	23,978.40	0.04
434	600119	长江投资	3,200	23,456.00	0.04
435	603876	鼎胜新材	1,200	22,248.00	0.04
436	600929	湖南盐业	2,600	21,398.00	0.04
437	601020	华钰矿业	2,400	20,304.00	0.03
438	603126	中材节能	3,935	20,265.25	0.03
439	600917	重庆燃气	2,800	19,936.00	0.03
440	603218	日月股份	1,200	19,824.00	0.03
441	603013	亚普股份	1,100	19,404.00	0.03
442	603025	大豪科技	1,721	19,189.15	0.03
443	603105	芯能科技	1,400	18,312.00	0.03
444	603733	仙鹤股份	1,100	16,962.00	0.03
445	601619	嘉泽新能	3,600	16,740.00	0.03
446	603596	伯特利	600	13,722.00	0.02
447	603877	太平鸟	700	13,153.00	0.02
448	603103	横店影视	500	11,150.00	0.02
449	603533	掌阅科技	400	7,112.00	0.01
450	603619	中曼石油	400	6,208.00	0.01

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600837	海通证券	1,167,864.00	1.64

2	600518	康美药业	1,003,653.00	1.41
3	600919	江苏银行	657,168.00	0.92
4	600999	招商证券	585,211.00	0.82
5	600958	东方证券	463,192.00	0.65
6	601669	中国电建	454,529.00	0.64
7	601985	中国核电	366,841.00	0.51
8	600221	海航控股	342,461.00	0.48
9	603288	海天味业	328,629.64	0.46
10	600111	北方稀土	306,559.00	0.43
11	600779	水井坊	235,842.00	0.33
12	600760	中航沈飞	215,718.00	0.30
13	600315	上海家化	200,163.00	0.28
14	600926	杭州银行	185,126.60	0.26
15	600885	宏发股份	183,822.00	0.26
16	600258	首旅酒店	180,980.00	0.25
17	603833	欧派家居	168,636.00	0.24
18	603858	步长制药	166,622.00	0.23
19	600346	恒力股份	166,582.00	0.23
20	600369	西南证券	160,657.00	0.23

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	2,460,092.35	3.45
2	600585	海螺水泥	969,521.00	1.36
3	601888	中国国旅	908,035.00	1.27
4	600690	青岛海尔	847,455.00	1.19
5	600309	万华化学	788,312.40	1.10
6	601939	建设银行	764,930.88	1.07
7	600703	三安光电	717,006.80	1.00
8	600196	复星医药	390,927.64	0.55
9	600100	同方股份	272,680.00	0.38
10	600221	海航控股	253,216.99	0.35
11	600150	*ST船舶	169,167.00	0.24

12	600663	陆家嘴	168,352.00	0.24
13	600895	张江高科	156,263.67	0.22
14	600369	西南证券	154,398.80	0.22
15	600376	首开股份	146,427.70	0.21
16	600157	永泰能源	141,169.28	0.20
17	601606	长城军工	127,246.98	0.18
18	600704	物产中大	122,533.96	0.17
19	600873	梅花生物	116,485.05	0.16
20	600021	上海电力	110,753.68	0.16

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	17,700,468.54
卖出股票收入（成交）总额	15,634,695.66

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	70.56
2	应收证券清算款	13,180.94
3	应收股利	-
4	应收利息	182.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,434.34

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
643	29,127.78	14,507,173.00	77.46%	4,221,988.00	22.54%

9.2 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
联接基金	14,500,000.00	77.42%

9.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	徐志平	139,600.00	0.75%
2	陈建锋	125,300.00	0.67%
3	欧阳华鸣	124,747.00	0.67%
4	徐钧	108,134.00	0.58%
5	郭秀琴	100,000.00	0.53%
6	钟鸣	100,000.00	0.53%
7	沈曙明	96,295.00	0.51%
8	徐子良	88,800.00	0.47%
9	蒋桂素	87,315.00	0.47%
10	韩庆明	70,500.00	0.38%
11	中国银行股份有限公司—华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证	14,500,000.00	77.42%

注：前十名持有人为除华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金之外的前十名持有人。

9.4 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。

9.5 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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年1月26日）基金份额总额	348,427,447.00
本报告期期初基金份额总额	16,729,161.00
本报告期期间基金总申购份额	3,500,000.00
减:本报告期期间基金总赎回份额	1,500,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	18,729,161.00

§ 11重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

报告期内，2018年8月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2018年8月20日，公司任命李晓西先生为公司副总经理，李晓西先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。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60,000.00元人民币，该事务所已向本基金提供了8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
------	--------	------	-----------

		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	32,191,251.05	100.00%	29,979.88	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为，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	
	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	13,472.80	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下54只证券投资基金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	2018年3月23日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年4月2日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年8月21日
4	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(中国证券报、上海	2018年9月19日

	含移动终端)开通中国建设银行基金快捷支付业务并实施交易费率优惠活动		
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加基金直销账户的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年9月25日
6	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通中国银行基金快捷支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年10月9日
7	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通中国民生银行基金快捷支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年10月9日
8	华泰柏瑞基金关于网上直销平台(含移动终端)开通招商银行直付通支付业务并实施交易费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年12月25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	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-
联接基金	20180101-20181231	13,525,977.00	2,022,300.00	1,048,277.00	14,500,000.00	77.42%

产品特有风险

本基金报告期内联接基金持有基金份额超过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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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

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

2019年3月27日