

上证中小盘交易型开放式指数证券投资 基金 2015 年年度报告

2015 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：2016 年 3 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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2016年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	56
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	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12 投资组合报告附注	56
§9 基金份额持有人信息	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2 期末上市基金前十名持有人	57

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
§10 开放式基金份额变动	58
§11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	60
§12 影响投资者决策的其他重要信息	61
§13 备查文件目录	61
13.1 备查文件目录	61
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF
基金主代码	510220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年1月26日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,229,161.00份
基金合同存续期	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	北京市复兴门内大街1号
邮政编码		200135	100818

法定代表人	齐亮	田国立
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	32,985,095.73	3,349,675.34	-17,536,958.21
本期利润	16,465,485.92	26,274,011.44	6,171,162.51
加权平均基金份额本期利润	1.6365	1.0947	0.1936
本期加权平均净值利润率	34.32%	39.88%	7.66%
本期基金份额净值增长率	22.38%	48.65%	6.75%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	7,661,261.37	-16,759,889.55	-38,306,541.67
期末可供分配基金份额利润	1.0598	-1.0327	-1.2672
期末基金资产净值	34,111,542.80	62,584,991.48	78,419,510.57
期末基金份额净值	4.719	3.856	2.594
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	28.98%	5.40%	-29.10%

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。

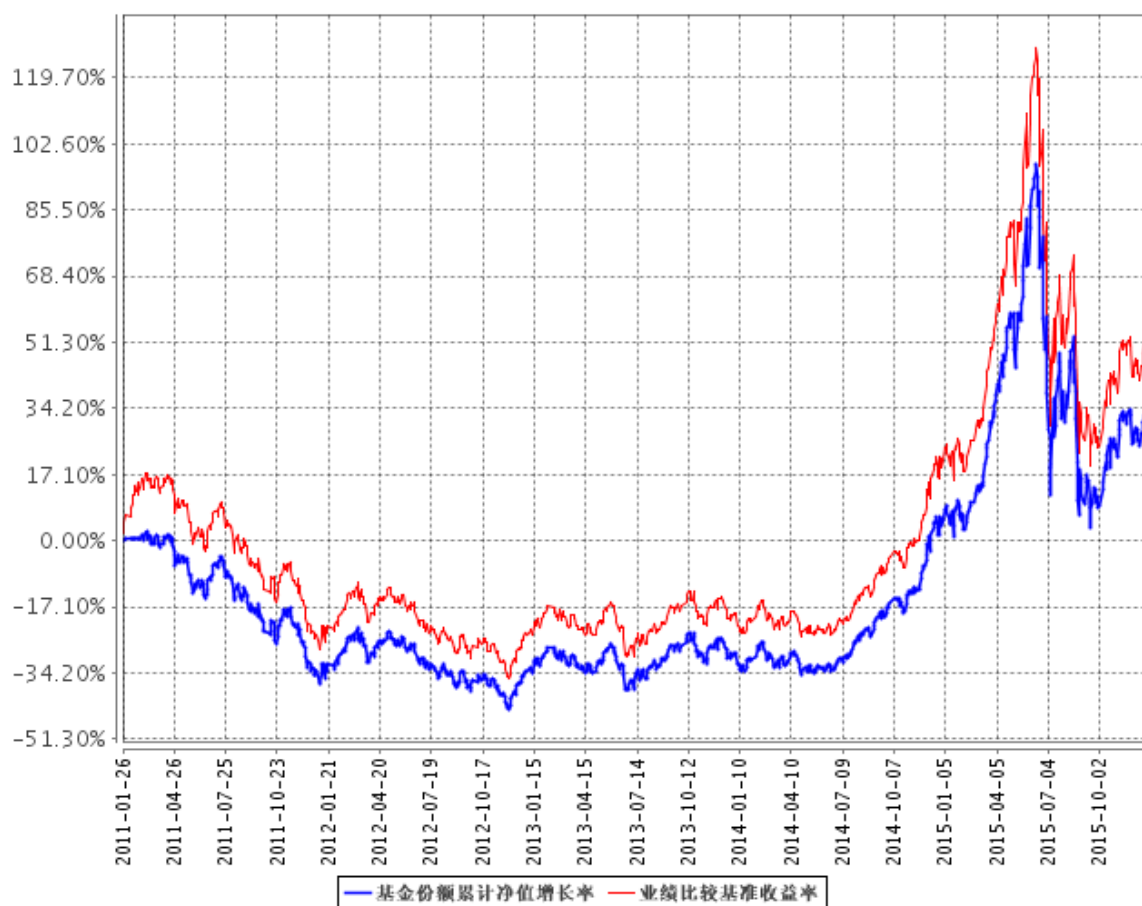
3.2 基金净值表现

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	18.18%	1.88%	17.75%	1.87%	0.43%	0.01%
过去六个月	-18.27%	3.34%	-19.51%	3.25%	1.24%	0.09%
过去一年	22.38%	2.89%	21.43%	2.84%	0.95%	0.05%
过去三年	94.20%	1.96%	92.63%	1.93%	1.57%	0.03%
自基金合同生效起至今	29.00%	1.75%	46.66%	1.75%	-17.66%	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

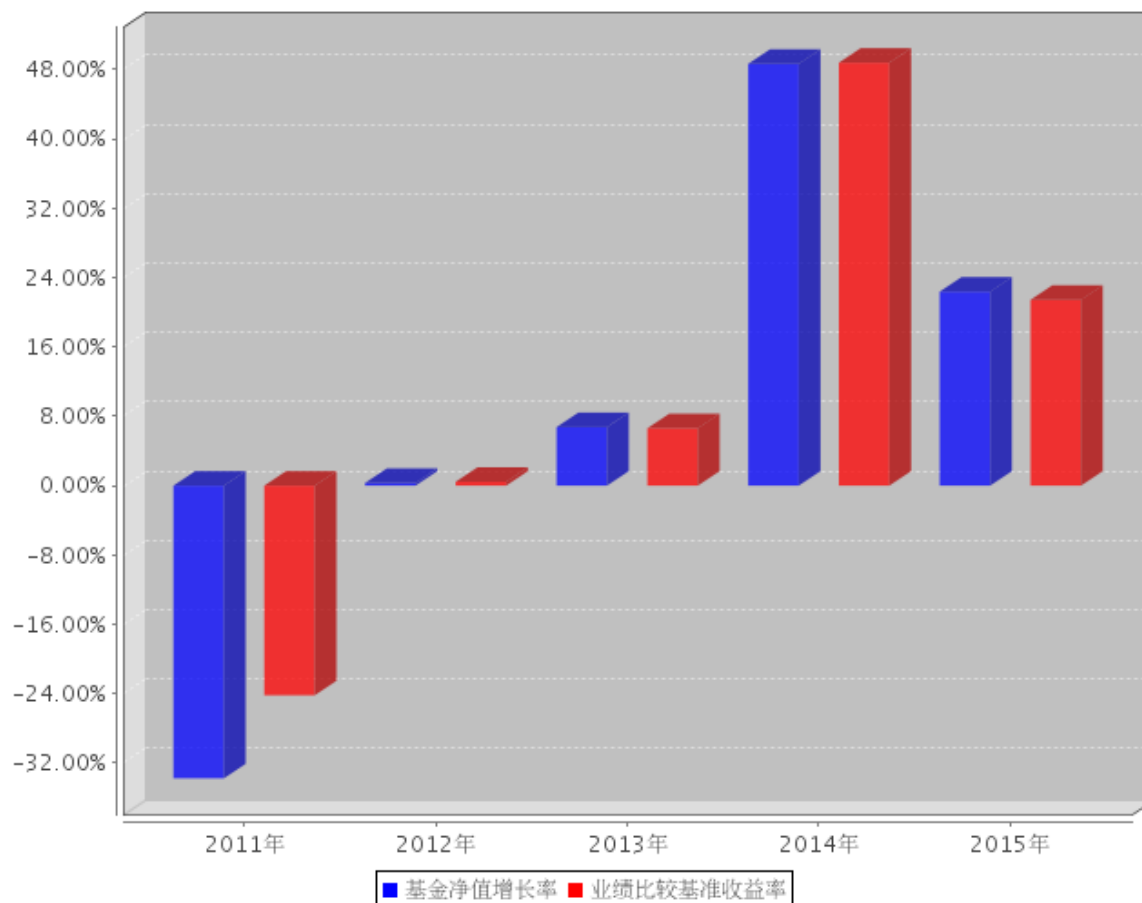


注：1、图示日期为2011年1月26日至2015年12月31日。

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

3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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

注：截至本报告期末，本基金未进行利润分配。

§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。截至 2015 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 1299.23 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳军	本基金的基金经理、指数投资部总监	2011 年 1 月 26 日	-	15 年	柳军，15 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月起加入本公司，历任基金事务部总监、基金

				<p>经理助理。</p> <p>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。</p> <p>2010年10月1日起任华泰柏瑞指数投资部副总监。</p> <p>2011年1月起担任华泰柏瑞上证中小盘ETF及华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。</p> <p>2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。</p> <p>2015年2月起任华泰柏瑞指数投资部总监。</p> <p>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。</p>
--	--	--	--	---

--	--	--	--	--	--

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为

进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年之于 A 股市场波澜壮阔的一年。2014 年底到 2015 年 6 月市场经历快速上涨，其核心驱动力是对于中国经济改革转型乐观预期带来的市场风险偏好提升。期间小盘股票大幅走强于大盘股，15 年初至 6 月 10 日，创业板累计涨幅超过 160%。而 6 月中下旬，在清理场外配资的背景下，强平导致的踩踏致使 A 股出现急速回撤，其速度和深度均让市场始料未及。受到 8 月份人民币贬值影响，国际市场出现大幅波动，A 股进一步受挫。9 月后，在全球股市上行大背景下，A 股暂别颓势出现反弹并持续至年底。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的累计跟踪偏离为 0.95%，日均绝对跟踪偏离度为 0.046%，期间日跟踪误差为 0.0878%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

至本报告期末，本基金份额净值为 4.719 元，还原后基金份额累计净值为 1.290 元，本报告期内基金份额净值上涨 22.38%，本基金的业绩比较基准上涨 21.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历跌宕起伏的 2015 年后，投资者情绪急剧下降。随着改革进入深水区，“供给侧改革”的推进将可能导致宏观经济的阶段性恶化（去产能、去库存、去杠杆等措施都会阶段性地削弱经济增长动力），在“稳增长”的目标基调下政策将出现两难，政策的不确定性，使得市场风险偏好难以提升。展望 2016，我们认为市场将进入相对收益者“存量博弈”的环境。

在全球经济萎缩的大背景下，市场投资兴趣整体悲观，加之对于汇率以及政策不确定性担忧，中期看弱势格局难以打破。鉴于此，我们认为估值将成为 2016 年重要投资逻辑。

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

2015年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与

人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至2015年12月31日，本基金出现连续60个工作日净值低于5000万。我司已根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的要求，于2014年11月17日向证监会报告并提交了上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的转型方案，目前正逐步推进转型的后续事宜。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第21935号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“上证中小盘ETF”)的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是上证中小盘ETF的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述上证中小盘ETF的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了上证中小盘ETF 2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	张勇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	
会计师事务所的地址	上海湖滨路202号普华永道中心11楼	
审计报告日期	2016年3月25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：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	959,265.83	417,575.92
结算备付金		8,216.85	-
存出保证金		1,974.80	205.31
交易性金融资产	7.4.7.2	33,630,466.97	62,487,344.28
其中：股票投资		33,630,466.97	62,487,344.28
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	209.56	91.37
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		34,600,134.01	62,905,216.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		-	9,133.06
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,459.69	30,453.22
应付托管费		2,891.92	6,090.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	61,239.60	13,105.69
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	410,000.00	261,442.80
负债合计		488,591.21	320,225.40
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	26,450,281.43	59,379,764.28
未分配利润	7.4.7.10	7,661,261.37	3,205,227.20

所有者权益合计		34,111,542.80	62,584,991.48
负债和所有者权益总计		34,600,134.01	62,905,216.88

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.719 元，基金份额总额

7,229,161.00 份。

7.2 利润表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		17,294,663.85	27,175,887.34
1.利息收入		12,411.28	3,057.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	12,397.34	3,031.45
债券利息收入		13.94	26.10
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）		33,568,722.35	4,241,082.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	33,161,454.20	3,186,515.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	31,751.56	7,391.50
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
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	375,516.59	1,047,175.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-16,519,609.81	22,924,336.10
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	233,140.03	7,411.37
减：二、费用		829,177.93	901,875.90
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	239,087.63	329,141.02
2.托管费	7.4.10.2.2	47,817.51	65,828.17
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	7.4.7.19	69,935.57	35,795.20
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	472,337.22	471,111.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,465,485.92	26,274,011.44

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,465,485.92	26,274,011.44

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：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	59,379,764.28	3,205,227.20	62,584,991.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,465,485.92	16,465,485.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-32,929,482.85	-12,009,451.75	-44,938,934.60
其中：1.基金申购款	336,612,491.05	151,699,988.48	488,312,479.53
2.基金赎回款	-369,541,973.90	-163,709,440.23	-533,251,414.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	26,450,281.43	7,661,261.37	34,111,542.80
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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）	110,603,404.28	-32,183,893.71	78,419,510.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,274,011.44	26,274,011.44
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）	-51,223,640.00	9,115,109.47	-42,108,530.53
其中：1.基金申购款	21,952,988.57	-5,959,183.63	15,993,804.94
2.基金赎回款	-73,176,628.57	15,074,293.10	-58,102,335.47
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)	59,379,764.28	3,205,227.20	62,584,991.48
---------------------	---------------	--------------	---------------

注：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：

<u>韩勇</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

根据《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2011 年 3 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.27331199，并于 2011 年 3 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]第 55 号文审核同意，本基金 95,229,161.00 份基金份额于 2011 年 3 月 28 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的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%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩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 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管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2016 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金管理人每季度定期对本基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上，方可进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的100%，自基金合同生效日起不满3个月可不进行收益分配，基金收益分配每年至多4次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	959,265.83	417,575.92
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	959,265.83	417,575.92

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	35,084,414.31	33,630,466.97	-1,453,947.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	35,084,414.31	33,630,466.97	-1,453,947.34
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	47,421,681.81	62,487,344.28	15,065,662.47
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	47,421,681.81	62,487,344.28	15,065,662.47
----	---------------	---------------	---------------

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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金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，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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	204.50	91.22
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5.06	0.04
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	0.11
合计	209.56	91.37

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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	61,239.60	13,105.69
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	61,239.60	13,105.69

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

预提费用	210,000.00	210,000.00
应付指数使用费	200,000.00	50,000.00
可退替代款	-	1,442.80
合计	410,000.00	261,442.80

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,229,161.00	59,379,764.28
本期申购	92,000,000.00	336,612,491.05
本期赎回(以“-”号填列)	-101,000,000.00	-369,541,973.90
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	7,229,161.00	26,450,281.43

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

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

3、投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-16,759,889.55	19,965,116.75	3,205,227.20
本期利润	32,985,095.73	-16,519,609.81	16,465,485.92
本期基金份额交易产生的变动数	-1,263,772.88	-10,745,678.87	-12,009,451.75
其中：基金申购款	168,038,681.46	-16,338,692.98	151,699,988.48
基金赎回款	-169,302,454.34	5,593,014.11	-163,709,440.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,961,433.30	-7,300,171.93	7,661,261.37

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	11,513.39	2,851.85
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	857.59	162.08
其他	26.36	17.52
合计	12,397.34	3,031.45

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,310,077.17	1,480,137.96
股票投资收益——赎回差价收入	31,851,377.03	1,706,377.21
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	33,161,454.20	3,186,515.17

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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	16,127,913.43	11,583,033.12
减：卖出股票成本总额	14,817,836.26	10,102,895.16
买卖股票差价收入	1,310,077.17	1,480,137.96

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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
赎回基金份额对价总额	533,251,414.13	58,102,335.47
减：现金支付赎回款总额	26,246,048.13	319,014.47
减：赎回股票成本总额	475,153,988.97	56,076,943.79
赎回差价收入	31,851,377.03	1,706,377.21

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

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 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	31,751.56	7,391.50
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	31,751.56	7,391.50

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 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	104,765.50	72,417.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	73,000.00	65,000.00
减：应收利息总额	13.94	26.10
买卖债券差价收入	31,751.56	7,391.50

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末未持有债券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

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 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
股票投资产生的股利收益	375,516.59	1,047,175.65
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	375,516.59	1,047,175.65

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
1. 交易性金融资产	-16,519,609.81	22,924,336.10
——股票投资	-16,519,609.81	22,924,336.10
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-16,519,609.81	22,924,336.10

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	233,140.03	7,411.37
合计	233,140.03	7,411.37

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

的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	69,935.57	35,795.20
银行间市场交易费用	-	-
合计	69,935.57	35,795.20

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	150,000.00	150,000.00
银行划款手续费	2,337.22	1,111.51
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	472,337.22	471,111.51

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

7.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期无分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

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

本基金的基金管理人于2016年1月14日宣告2015年度第一次分红，向截至2016年1月19日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.3900元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	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、一级交易商
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“上证中小盘ETF联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

债券交易

注：本报告期本基金与关联方未进行债券交易。

债券回购交易

注：本报告期本基金与关联方未进行债券回购交易。

7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	239,087.63	329,141.02
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	47,817.51	65,828.17

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

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
上证中小盘 ETF联接基金	2,522,795.00	34.8975%	9,182,639.00	56.5800%
华泰证券			3,433.00	0.0210%

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 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国银行股份有限公司	959,265.83	11,513.39	417,575.92	2,851.85

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

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015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

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
601377	兴业证券	2015年12月29日	配股	11.00	2016年1月7日	9.40	26,641	302,105.92	293,051.00	-
600649	城投控股	2015年12月30日	重大资产重组事项	23.16	2016年1月7日	20.84	9,566	124,730.84	221,548.56	-
601018	宁波港	2015年8月4日	重大资产重组事项	8.16	2016年2月22日	7.34	25,247	196,536.76	206,015.52	-
600271	航天信息	2015年10月12日	重大资产重组事项	55.91	-	-	3,653	233,284.07	204,239.23	-
600654	中安消	2015年12月14日	重大资产重组事项	28.84	-	-	4,537	153,464.86	130,847.08	-
600584	长电科技	2015年11月30日	重大资产重组事项	22.02	-	-	5,411	109,998.43	119,150.22	-
600645	中源协和	2015年12月31日	重要事项未公告	65.01	2016年1月4日	63.90	1,790	90,754.36	116,367.90	-
600122	宏图高科	2015年12月25日	筹划非公开发行股票	19.42	-	-	5,971	88,870.91	115,956.82	-
600873	梅花生物	2015年12月17日	发行股票购买资产	9.14	-	-	12,197	110,943.93	111,480.58	-
600200	江苏吴中	2015年11月26日	重大资产重组事项	27.89	2016年3月16日	25.10	3,500	81,898.72	97,615.00	-
600219	南山铝业	2015年9月29日	发行股份购买资产	6.58	2016年1月25日	7.00	13,008	106,570.45	85,592.64	-
600783	鲁信创投	2015年12月31日	重大事项诉讼	39.07	2016年1月4日	37.60	1,909	51,728.30	74,584.63	-
600851	海欣股份	2015年12月21日	重大资产重组事项	14.70	2016年1月19日	13.23	4,900	50,123.53	72,030.00	-
600572	康恩贝	2015年12月28日	筹划股权收购的重大事项	13.36	2016年1月4日	13.18	4,421	68,401.90	59,064.56	-
600578	京能电力	2015年11月5日	重大资产重组事项	6.07	2016年2月24日	5.49	9,100	60,898.92	55,237.00	-
600106	重庆路桥	2015年8月31日	重大资产重组事项	10.54	2016年1月11日	9.49	4,900	42,536.94	51,646.00	-
601000	唐山港	2015年10月29日	重大资产重组事项	8.25	2016年2月17日	7.98	5,957	60,455.18	49,145.25	-
600595	中孚实	2015年12月29日	重大事项	7.05	2016年1月19日	6.35	6,892	61,163.31	48,588.60	-

	业										
601717	郑煤机	2015年12月18日	非公开发行股票	7.52	-	-	6,300	52,861.30	47,376.00	-	
600859	王府井	2015年12月21日	非公开发行股票	27.22	2016年1月4日	27.22	1,735	42,780.59	47,226.70	-	
600120	浙江东方	2015年10月12日	重大资产重组事项	19.86	-	-	2,208	61,657.85	43,850.88	-	
600699	均胜电子	2015年11月4日	重大资产重组事项	31.25	2016年3月10日	29.00	1,400	46,531.57	43,750.00	-	
601388	怡球资源	2015年7月6日	重大资产重组事项	23.33	2016年2月15日	21.00	1,806	37,784.65	42,133.98	-	
600490	鹏欣资源	2015年9月14日	重大资产重组事项	6.61	2016年3月2日	7.27	5,848	55,800.47	38,655.28	-	
600502	安徽水利	2015年10月20日	重大资产重组事项	13.67	-	-	2,800	43,044.66	38,276.00	-	
600880	博瑞传播	2015年9月16日	重大资产重组事项	7.50	2016年1月18日	8.25	5,011	59,846.75	37,582.50	-	
601678	滨化股份	2015年12月31日	子公司财务风险	8.02	2016年1月5日	7.22	4,630	37,612.35	37,132.60	-	
600133	东湖高新	2015年12月28日	非公开发行股票	12.10	2016年1月12日	10.89	2,927	25,037.45	35,416.70	-	
600729	重庆百货	2015年7月31日	重大资产重组事项	32.39	2016年1月4日	29.90	1,032	31,669.06	33,426.48	-	
600282	南钢股份	2015年12月30日	非公开发行股票	3.17	2016年1月12日	3.24	10,100	31,126.00	32,017.00	-	
600568	中珠控股	2015年12月30日	重大资产重组事项	23.94	2016年1月8日	21.55	1,274	21,600.70	30,499.56	-	
600429	三元股份	2015年9月21日	重大资产重组事项	7.29	2016年1月27日	7.49	3,363	32,472.83	24,516.27	-	
600864	哈投股份	2015年10月9日	重大资产重组事项	10.88	2016年1月14日	11.97	2,146	30,465.83	23,348.48	-	
600375	华菱星马	2015年11月18日	重大资产重组事项	7.73	-	-	2,600	23,111.95	20,098.00	-	
601996	丰林集团	2015年12月10日	重大资产重组事项	9.12	-	-	1,725	15,765.86	15,732.00	-	
600153	建发股份	2015年6月29日	重大资产重组事项	17.31	-	-	700	12,619.73	12,117.00	-	
600978	宜华木业	2016年6月19日	重大资产购买预案	22.33	2016年1月21日	20.10	132	2,946.40	2,947.56	-	

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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2015年12月31日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额0元，无债券作为质押。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型股票基金，采用完全复制策略，跟踪上证中小盘指数。本基金在日常经营活动中面临的¹风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。同时，本基金相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

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

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制²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。本基金的活期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。

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 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

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

流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	959,265.83	-	-	-	-	-	959,265.83
结算备付金	8,216.85	-	-	-	-	-	8,216.85

存出保证金	1,974.80	-	-	-	-	-	1,974.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-33,630,466.97	33,630,466.97
应收利息	-	-	-	-	-	209.56	209.56
资产总计	969,457.48	-	-	-	-	-33,630,676.53	34,600,134.01
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,459.69	14,459.69
应付托管费	-	-	-	-	-	2,891.92	2,891.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	61,239.60	61,239.60
其他负债	-	-	-	-	-	410,000.00	410,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	488,591.21	488,591.21
利率敏感度缺口	969,457.48	-	-	-	-	-33,142,085.32	34,111,542.80
上年度末 2014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	417,575.92	-	-	-	-	-	417,575.92
存出保证金	205.31	-	-	-	-	-	205.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-62,487,344.28	62,487,344.28
应收利息	-	-	-	-	-	91.37	91.37
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	417,781.23	-	-	-	-	-62,487,435.65	62,905,216.88
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9,133.06	9,133.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,453.22	30,453.22
应付托管费	-	-	-	-	-	6,090.63	6,090.63
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,105.69	13,105.69
其他负债	-	-	-	-	-	261,442.80	261,442.80
负债总计	-	-	-	-	-	320,225.40	320,225.40
利率敏感度缺口	417,781.23	-	-	-	-	-62,167,210.25	62,584,991.48

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2015年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2014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(2014年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票

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

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

本基金投资组合中股票投资比例为不低于基金资产的95%。于2015年12月31日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014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	33,630,466.97	98.59	62,487,344.28	99.84
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	33,630,466.97	98.59	62,487,344.28	99.84

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“上证中小盘指数”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	上证中小盘指数上涨5%	1,740,000.00	3,110,000.00
上证中小盘指数下跌5%	-1,740,000.00	-3,110,000.00	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本基金运用跟踪误差法管理风险，未采用风险价值法。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2015 年，本基金申购基金份额的对价总额为 488,312,479.53 元，其中包括以股票支付的申购款 441,105,259.50 元和以现金支付的申购款 47,207,220.03 元(2014 年：对价总额为 15,993,804.94 元，其中包括以股票支付的申购款 15,346,177.00 元和以现金支付的申购款 647,627.94 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 2015 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 30,912,203.39 元，属于第二层次的余额为 2,718,263.58 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 60,370,019.70 元元，第二层次 2,117,324.58 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

所独立提供的估值结果确定公允价值（附注 7.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 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(2014 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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	33,630,466.97	97.20
	其中：股票	33,630,466.97	97.20
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	967,482.68	2.80
7	其他各项资产	2,184.36	0.01
8	合计	34,600,134.01	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

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	131,545.94	0.39
B	采矿业	1,780,378.76	5.22
C	制造业	15,379,561.64	45.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,314,084.14	6.78
E	建筑业	965,767.04	2.83
F	批发和零售业	2,013,965.64	5.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,800,962.39	8.21
H	住宿和餐饮业	56,452.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,044,416.00	5.99

J	金融业	2,113,183.23	6.19
K	房地产业	2,096,730.77	6.15
L	租赁和商务服务业	488,370.25	1.43
M	科学研究和技术服务业	171,557.85	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	62,774.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	567,070.77	1.66
S	综合	643,646.55	1.89
	合计	33,630,466.97	98.59

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	30,542	414,149.52	1.21
2	600276	恒瑞医药	7,517	369,235.04	1.08
3	601377	兴业证券	26,641	293,051.00	0.86
4	601939	建设银行	43,067	248,927.26	0.73
5	600011	华能国际	26,906	234,889.38	0.69
6	601009	南京银行	12,938	229,002.60	0.67
7	601099	太平洋	22,572	221,657.04	0.65
8	601555	东吴证券	13,790	221,605.30	0.65
9	600649	城投控股	9,566	221,548.56	0.65
10	601727	上海电气	18,932	218,475.28	0.64
11	600705	中航资本	13,814	215,222.12	0.63
12	601899	紫金矿业	60,747	213,829.44	0.63
13	600340	华夏幸福	6,777	208,189.44	0.61
14	601018	宁波港	25,247	206,015.52	0.60
15	600100	同方股份	11,388	205,895.04	0.60
16	600271	航天信息	3,653	204,239.23	0.60
17	600485	信威集团	7,495	200,491.25	0.59
18	600383	金地集团	14,408	198,830.40	0.58

19	600703	三安光电	8,175	198,489.00	0.58
20	600085	同仁堂	4,398	196,194.78	0.58
21	600089	特变电工	16,600	195,382.00	0.57
22	600570	恒生电子	3,187	194,311.39	0.57
23	600029	南方航空	22,523	193,022.11	0.57
24	600066	宇通客车	8,507	191,322.43	0.56
25	601618	中国中冶	31,209	187,878.18	0.55
26	600009	上海机场	6,319	186,536.88	0.55
27	600886	国投电力	21,694	181,144.90	0.53
28	601919	中国远洋	19,930	179,768.60	0.53
29	600369	西南证券	18,082	179,011.80	0.52
30	600739	辽宁成大	7,850	177,410.00	0.52
31	600019	宝钢股份	31,640	176,551.20	0.52
32	600535	天士力	4,257	174,196.44	0.51
33	600718	东软集团	5,600	173,880.00	0.51
34	600196	复星医药	7,344	172,510.56	0.51
35	601788	光大证券	7,508	172,233.52	0.50
36	600804	鹏博士	7,250	171,970.00	0.50
37	601600	中国铝业	34,160	169,775.20	0.50
38	600352	浙江龙盛	14,584	169,757.76	0.50
39	600115	东方航空	21,761	165,601.21	0.49
40	600177	雅戈尔	9,985	162,555.80	0.48
41	600118	中国卫星	3,786	161,056.44	0.47
42	600031	三一重工	24,397	160,532.26	0.47
43	600415	小商品城	17,429	160,172.51	0.47
44	600406	国电南瑞	9,300	155,124.00	0.45
45	600674	川投能源	14,100	151,716.00	0.44
46	600446	金证股份	3,053	150,177.07	0.44
47	601866	中海集运	21,218	149,374.72	0.44
48	601888	中国国旅	2,500	148,275.00	0.43
49	600221	海南航空	37,887	147,380.43	0.43
50	601607	上海医药	7,285	145,044.35	0.43
51	600895	张江高科	4,959	142,967.97	0.42
52	600315	上海家化	3,588	141,690.12	0.42
53	601111	中国国航	16,399	140,703.42	0.41
54	600663	陆家嘴	2,800	140,392.00	0.41
55	600867	通化东宝	5,162	140,251.54	0.41
56	600068	葛洲坝	17,693	139,243.91	0.41
57	600839	四川长虹	23,658	136,979.82	0.40

58	600660	福耀玻璃	8,993	136,603.67	0.40
59	600160	巨化股份	5,798	136,079.06	0.40
60	600201	生物股份	3,668	135,605.96	0.40
61	601106	中国一重	16,775	133,696.75	0.39
62	600256	广汇能源	20,000	133,400.00	0.39
63	601933	永辉超市	13,045	131,754.50	0.39
64	600654	中安消	4,537	130,847.08	0.38
65	600252	中恒集团	17,810	130,725.40	0.38
66	600023	浙能电力	17,420	130,475.80	0.38
67	600816	安信信托	5,667	129,037.59	0.38
68	600079	人福医药	5,765	128,328.90	0.38
69	600583	海油工程	14,100	126,195.00	0.37
70	600309	万华化学	7,000	124,950.00	0.37
71	600635	大众公用	12,661	124,837.46	0.37
72	600398	海澜之家	8,631	120,488.76	0.35
73	600584	长电科技	5,411	119,150.22	0.35
74	600588	用友网络	3,744	119,096.64	0.35
75	600645	中源协和	1,790	116,367.90	0.34
76	600122	宏图高科	5,971	115,956.82	0.34
77	601718	际华集团	9,883	113,358.01	0.33
78	600158	中体产业	4,322	112,717.76	0.33
79	600741	华域汽车	6,617	111,562.62	0.33
80	600873	梅花生物	12,197	111,480.58	0.33
81	600410	华胜天成	4,200	111,342.00	0.33
82	600642	申能股份	14,581	110,086.55	0.32
83	601098	中南传媒	4,602	109,987.80	0.32
84	601333	广深铁路	21,754	108,987.54	0.32
85	600673	东阳光科	10,654	108,564.26	0.32
86	600503	华丽家族	7,890	108,093.00	0.32
87	600643	爱建集团	7,340	107,531.00	0.32
88	600820	隧道股份	10,084	107,293.76	0.31
89	600332	白云山	3,513	106,338.51	0.31
90	600875	东方电气	7,700	104,951.00	0.31
91	600482	风帆股份	2,224	104,639.20	0.31
92	600655	豫园商城	6,453	104,280.48	0.31
93	600027	华电国际	15,128	102,870.40	0.30
94	600157	永泰能源	21,542	102,755.34	0.30
95	600498	烽火通信	3,588	102,293.88	0.30
96	600525	长园集团	5,431	102,265.73	0.30

97	600522	中天科技	4,412	101,034.80	0.30
98	600060	海信电器	5,027	98,881.09	0.29
99	601991	大唐发电	19,233	98,857.62	0.29
100	601872	招商轮船	13,817	97,962.53	0.29
101	600200	江苏吴中	3,500	97,615.00	0.29
102	600694	大商股份	1,883	97,219.29	0.29
103	601021	春秋航空	1,592	97,112.00	0.28
104	600489	中金黄金	9,755	96,867.15	0.28
105	600388	龙净环保	5,600	96,768.00	0.28
106	600074	保千里	5,867	96,629.49	0.28
107	600037	歌华有线	4,456	95,937.68	0.28
108	601198	东兴证券	3,200	95,904.00	0.28
109	600547	山东黄金	4,556	95,676.00	0.28
110	600737	中粮屯河	6,581	95,095.45	0.28
111	600478	科力远	4,264	93,466.88	0.27
112	600688	上海石化	14,398	93,299.04	0.27
113	601633	长城汽车	7,733	93,105.32	0.27
114	601012	隆基股份	6,818	93,065.70	0.27
115	600005	武钢股份	26,347	91,424.09	0.27
116	600770	综艺股份	5,003	91,404.81	0.27
117	601168	西部矿业	12,228	90,364.92	0.26
118	600376	首开股份	7,179	89,737.50	0.26
119	601179	中国西电	13,135	89,449.35	0.26
120	600487	亨通光电	5,600	89,264.00	0.26
121	600594	益佰制药	4,200	89,040.00	0.26
122	600827	百联股份	4,948	88,420.76	0.26
123	600664	哈药股份	7,380	88,043.40	0.26
124	600266	北京城建	6,000	87,840.00	0.26
125	601117	中国化学	12,636	87,062.04	0.26
126	600601	方正科技	14,079	87,008.22	0.26
127	600436	片仔癀	1,263	86,881.77	0.25
128	600138	中青旅	3,700	86,247.00	0.25
129	600372	中航电子	3,500	86,205.00	0.25
130	600219	南山铝业	13,008	85,592.64	0.25
131	600500	中化国际	6,680	85,570.80	0.25
132	600373	中文传媒	3,626	85,174.74	0.25
133	600026	中海发展	9,182	84,841.68	0.25
134	600143	金发科技	9,836	84,589.60	0.25
135	600881	亚泰集团	11,655	84,382.20	0.25

136	600240	华业资本	5,600	84,280.00	0.25
137	601929	吉视传媒	13,562	83,813.16	0.25
138	600362	江西铜业	5,317	83,689.58	0.25
139	600863	内蒙华电	18,627	83,262.69	0.24
140	600884	杉杉股份	2,119	83,149.56	0.24
141	603000	人民网	3,641	83,051.21	0.24
142	600516	方大炭素	6,605	82,628.55	0.24
143	600687	刚泰控股	3,500	82,530.00	0.24
144	600021	上海电力	5,600	82,432.00	0.24
145	600038	中直股份	1,561	82,311.53	0.24
146	601258	庞大集团	20,783	81,469.36	0.24
147	600611	大众交通	5,300	81,355.00	0.24
148	601238	广汽集团	3,604	81,342.28	0.24
149	601216	君正集团	7,094	81,226.30	0.24
150	600170	上海建工	11,437	80,973.96	0.24
151	600652	游久游戏	3,667	80,013.94	0.23
152	600208	新湖中宝	16,689	79,606.53	0.23
153	601928	凤凰传媒	4,996	79,586.28	0.23
154	600391	成发科技	1,531	79,397.66	0.23
155	600198	大唐电信	3,204	79,042.68	0.23
156	600418	江淮汽车	5,400	78,786.00	0.23
157	600312	平高电气	4,027	78,526.50	0.23
158	600959	江苏有线	3,800	78,128.00	0.23
159	600521	华海药业	3,052	77,490.28	0.23
160	600307	酒钢宏兴	20,088	76,937.04	0.23
161	600499	科达洁能	3,351	75,833.13	0.22
162	600797	浙大网新	5,262	75,667.56	0.22
163	600783	鲁信创投	1,909	74,584.63	0.22
164	600017	日照港	11,363	74,314.02	0.22
165	600171	上海贝岭	3,500	74,165.00	0.22
166	603993	洛阳钼业	16,611	74,085.06	0.22
167	600756	浪潮软件	1,428	73,442.04	0.22
168	600108	亚盛集团	9,991	73,333.94	0.21
169	600094	大名城	6,900	73,278.00	0.21
170	600176	中国巨石	2,869	72,901.29	0.21
171	600851	海欣股份	4,900	72,030.00	0.21
172	601898	中煤能源	11,900	71,995.00	0.21
173	600633	浙报传媒	3,811	71,761.13	0.21
174	600704	物产中大	4,057	71,484.34	0.21

175	600422	昆药集团	1,791	71,317.62	0.21
176	600811	东方集团	8,208	71,245.44	0.21
177	600497	驰宏锌锗	6,418	70,854.72	0.21
178	601992	金隅股份	7,559	70,827.83	0.21
179	600110	中科英华	7,339	70,821.35	0.21
180	600151	航天机电	5,717	70,662.12	0.21
181	600528	中铁二局	4,900	70,217.00	0.21
182	600967	北方创业	3,940	69,935.00	0.21
183	600511	国药股份	1,842	69,848.64	0.20
184	600755	厦门国贸	7,473	69,648.36	0.20
185	600325	华发股份	4,262	69,470.60	0.20
186	600662	强生控股	4,200	69,426.00	0.20
187	600728	佳都科技	1,857	69,228.96	0.20
188	600536	中国软件	1,902	68,624.16	0.20
189	600435	北方导航	2,387	68,506.90	0.20
190	600651	飞乐音响	4,610	67,997.50	0.20
191	600166	福田汽车	10,696	67,705.68	0.20
192	600787	中储股份	6,625	66,515.00	0.19
193	603766	隆鑫通用	2,800	66,444.00	0.19
194	600380	健康元	4,800	66,336.00	0.19
195	600587	新华医疗	1,824	66,265.92	0.19
196	600098	广州发展	5,246	66,256.98	0.19
197	600316	洪都航空	2,816	65,725.44	0.19
198	601519	大智慧	5,100	65,382.00	0.19
199	600685	中船防务	1,641	65,131.29	0.19
200	600270	外运发展	2,402	64,998.12	0.19
201	600064	南京高科	3,400	64,430.00	0.19
202	603288	海天味业	1,819	64,301.65	0.19
203	600008	首创股份	6,300	64,197.00	0.19
204	600835	上海机电	2,117	64,166.27	0.19
205	600058	五矿发展	2,800	63,560.00	0.19
206	600320	振华重工	10,637	63,502.89	0.19
207	600597	光明乳业	3,969	63,186.48	0.19
208	600343	航天动力	2,452	62,697.64	0.18
209	600169	太原重工	10,884	62,474.16	0.18
210	600210	紫江企业	7,954	62,041.20	0.18
211	600517	置信电气	4,900	62,034.00	0.18
212	600426	华鲁恒升	4,282	61,789.26	0.18
213	600277	亿利洁能	6,762	61,331.34	0.18

214	601877	正泰电器	2,373	61,199.67	0.18
215	601311	骆驼股份	2,800	61,124.00	0.18
216	600855	航天长峰	1,534	60,869.12	0.18
217	600717	天津港	5,371	60,531.17	0.18
218	600653	申华控股	11,100	60,273.00	0.18
219	600161	天坛生物	1,725	60,254.25	0.18
220	600317	营口港	12,611	59,902.25	0.18
221	600600	青岛啤酒	1,785	59,262.00	0.17
222	600572	康恩贝	4,421	59,064.56	0.17
223	601808	中海油服	3,798	58,944.96	0.17
224	600765	中航重机	2,994	58,802.16	0.17
225	600175	美都能源	8,088	58,476.24	0.17
226	601118	海南橡胶	7,700	58,212.00	0.17
227	600067	冠城大通	6,658	58,190.92	0.17
228	600187	国中水务	9,337	57,982.77	0.17
229	600267	海正药业	3,653	57,900.05	0.17
230	600648	外高桥	2,200	57,794.00	0.17
231	600557	康缘药业	2,306	57,696.12	0.17
232	600808	马钢股份	18,240	57,456.00	0.17
233	600428	中远航运	5,600	57,456.00	0.17
234	600289	亿阳信通	2,904	57,208.80	0.17
235	600495	晋西车轴	5,416	56,705.52	0.17
236	600754	锦江股份	1,100	56,452.00	0.17
237	601588	北辰实业	10,502	56,290.72	0.17
238	600580	卧龙电气	3,650	56,283.00	0.16
239	600872	中炬高新	3,576	55,964.40	0.16
240	600567	山鹰纸业	14,667	55,734.60	0.16
241	600039	四川路桥	10,904	55,610.40	0.16
242	600711	盛屯矿业	7,231	55,461.77	0.16
243	600351	亚宝药业	3,545	55,372.90	0.16
244	600805	悦达投资	4,366	55,273.56	0.16
245	600578	京能电力	9,100	55,237.00	0.16
246	600086	东方金钰	4,443	54,693.33	0.16
247	600366	宁波韵升	2,494	54,468.96	0.16
248	600582	天地科技	7,964	54,394.12	0.16
249	601608	中信重工	7,909	54,176.65	0.16
250	600056	中国医药	3,242	53,914.46	0.16
251	600125	铁龙物流	5,862	53,871.78	0.16
252	600220	江苏阳光	9,332	53,565.68	0.16

253	600549	厦门钨业	2,823	53,100.63	0.16
254	600216	浙江医药	4,289	53,054.93	0.16
255	600626	申达股份	3,189	52,746.06	0.15
256	601958	金铂股份	6,300	52,164.00	0.15
257	600106	重庆路桥	4,900	51,646.00	0.15
258	600062	华润双鹤	2,263	51,619.03	0.15
259	600206	有研新材	3,222	51,229.80	0.15
260	600348	阳泉煤业	7,853	50,730.38	0.15
261	601699	潞安环能	7,803	50,095.26	0.15
262	600255	鑫科材料	9,230	50,026.60	0.15
263	600970	中材国际	4,184	49,998.80	0.15
264	600399	抚顺特钢	5,334	49,979.58	0.15
265	600261	阳光照明	5,684	49,962.36	0.15
266	600063	皖维高新	7,390	49,882.50	0.15
267	600284	浦东建设	3,642	49,858.98	0.15
268	600458	时代新材	2,800	49,560.00	0.15
269	600416	湘电股份	2,380	49,337.40	0.14
270	601000	唐山港	5,957	49,145.25	0.14
271	600595	中孚实业	6,892	48,588.60	0.14
272	600481	双良节能	5,354	48,507.24	0.14
273	600330	天通股份	3,286	48,271.34	0.14
274	600826	兰生股份	1,400	48,216.00	0.14
275	600363	联创光电	2,351	48,077.95	0.14
276	601880	大连港	8,062	48,049.52	0.14
277	600292	中电远达	2,300	47,564.00	0.14
278	601717	郑煤机	6,300	47,376.00	0.14
279	600571	信雅达	800	47,264.00	0.14
280	600859	王府井	1,735	47,226.70	0.14
281	600006	东风汽车	5,320	47,135.20	0.14
282	600112	天成控股	2,800	46,928.00	0.14
283	600405	动力源	2,800	46,872.00	0.14
284	600260	凯乐科技	3,100	46,314.00	0.14
285	600185	格力地产	2,170	46,090.80	0.14
286	600409	三友化工	5,934	45,988.50	0.13
287	600139	西部资源	2,500	45,725.00	0.13
288	603019	中科曙光	500	45,585.00	0.13
289	600183	生益科技	4,609	45,583.01	0.13
290	600812	华北制药	5,230	45,030.30	0.13
291	600750	江中药业	1,275	44,994.75	0.13

292	603188	亚邦股份	2,000	44,760.00	0.13
293	600614	鼎立股份	3,820	44,426.60	0.13
294	600120	浙江东方	2,208	43,850.88	0.13
295	600699	均胜电子	1,400	43,750.00	0.13
296	600269	赣粤高速	7,700	43,736.00	0.13
297	600993	马应龙	1,981	43,621.62	0.13
298	600460	士兰微	4,900	43,365.00	0.13
299	600004	白云机场	3,037	43,216.51	0.13
300	600566	济川药业	1,551	42,900.66	0.13
301	603077	和邦生物	6,363	42,822.99	0.13
302	600823	世茂股份	3,500	42,805.00	0.13
303	600096	云天化	3,300	42,801.00	0.13
304	600757	长江传媒	3,886	42,668.28	0.13
305	600298	安琪酵母	1,400	42,588.00	0.12
306	601801	皖新传媒	1,303	42,582.04	0.12
307	600073	上海梅林	3,002	42,478.30	0.12
308	600775	南京熊猫	2,210	42,321.50	0.12
309	601388	怡球资源	1,806	42,133.98	0.12
310	601777	力帆股份	2,417	41,910.78	0.12
311	600825	新华传媒	3,500	41,790.00	0.12
312	600998	九州通	2,109	41,336.40	0.12
313	600486	扬农化工	1,393	40,870.62	0.12
314	600180	瑞茂通	1,848	40,803.84	0.12
315	600288	大恒科技	2,307	40,349.43	0.12
316	600586	金晶科技	6,541	39,965.51	0.12
317	600831	广电网络	2,525	39,920.25	0.12
318	600624	复旦复华	2,361	39,806.46	0.12
319	600323	瀚蓝环境	2,457	39,434.85	0.12
320	600563	法拉电子	946	39,363.06	0.12
321	601010	文峰股份	5,353	38,916.31	0.11
322	600545	新疆城建	3,514	38,899.98	0.11
323	600490	鹏欣资源	5,848	38,655.28	0.11
324	600963	岳阳林纸	4,684	38,549.32	0.11
325	600502	安徽水利	2,800	38,276.00	0.11
326	600639	浦东金桥	1,703	38,130.17	0.11
327	600790	轻纺城	4,678	38,032.14	0.11
328	600033	福建高速	8,927	38,029.02	0.11
329	600748	上实发展	2,833	38,018.86	0.11
330	600612	老凤祥	876	37,895.76	0.11

331	600761	安徽合力	2,824	37,700.40	0.11
332	600846	同济科技	3,152	37,697.92	0.11
333	600880	博瑞传播	5,011	37,582.50	0.11
334	601005	重庆钢铁	11,400	37,506.00	0.11
335	600773	西藏城投	2,060	37,492.00	0.11
336	600526	菲达环保	2,100	37,443.00	0.11
337	601369	陕鼓动力	4,280	37,407.20	0.11
338	601886	江河创建	2,961	37,338.21	0.11
339	600149	廊坊发展	2,438	37,203.88	0.11
340	601126	四方股份	2,800	37,184.00	0.11
341	601678	滨化股份	4,630	37,132.60	0.11
342	600720	祁连山	4,200	37,086.00	0.11
343	600501	航天晨光	1,400	36,960.00	0.11
344	603369	今世缘	1,100	36,883.00	0.11
345	600280	中央商场	3,300	36,861.00	0.11
346	600123	兰花科创	4,554	36,568.62	0.11
347	600869	智慧能源	3,780	36,099.00	0.11
348	600596	新安股份	3,539	36,097.80	0.11
349	601158	重庆水务	3,852	35,939.16	0.11
350	601666	平煤股份	7,700	35,882.00	0.11
351	600638	新黄浦	2,515	35,738.15	0.10
352	603883	老百姓	500	35,485.00	0.10
353	600387	海越股份	2,100	35,469.00	0.10
354	600133	东湖高新	2,927	35,416.70	0.10
355	601002	晋亿实业	3,050	35,166.50	0.10
356	600236	桂冠电力	4,667	34,909.16	0.10
357	600509	天富能源	3,549	34,815.69	0.10
358	600022	山东钢铁	11,138	34,639.18	0.10
359	603308	应流股份	1,095	34,295.40	0.10
360	600059	古越龙山	3,111	34,189.89	0.10
361	600726	华电能源	4,900	34,153.00	0.10
362	600251	冠农股份	3,020	34,126.00	0.10
363	600395	盘江股份	4,098	33,644.58	0.10
364	600809	山西汾酒	1,740	33,529.80	0.10
365	600729	重庆百货	1,032	33,426.48	0.10
366	600392	盛和资源	2,650	32,621.50	0.10
367	600537	亿晶光电	2,160	32,356.80	0.09
368	600282	南钢股份	10,100	32,017.00	0.09
369	600742	一汽富维	1,100	31,944.00	0.09

370	600551	时代出版	1,400	31,850.00	0.09
371	601515	东风股份	1,911	31,684.38	0.09
372	603699	纽威股份	1,443	31,486.26	0.09
373	601908	京运通	3,829	31,474.38	0.09
374	601001	大同煤业	5,600	31,080.00	0.09
375	600329	中新药业	1,457	30,859.26	0.09
376	600568	中珠控股	1,274	30,499.56	0.09
377	603005	晶方科技	600	30,180.00	0.09
378	600636	三爱富	1,803	29,965.86	0.09
379	600195	中牧股份	1,400	29,932.00	0.09
380	600874	创业环保	2,833	29,888.15	0.09
381	600350	山东高速	4,200	29,862.00	0.09
382	601566	九牧王	1,300	29,718.00	0.09
383	600640	号百控股	1,400	29,694.00	0.09
384	601222	林洋电子	793	29,126.89	0.09
385	600830	香溢融通	2,100	28,833.00	0.08
386	600616	金枫酒业	2,310	28,828.80	0.08
387	600546	山煤国际	6,493	28,763.99	0.08
388	600456	宝钛股份	1,400	28,420.00	0.08
389	603555	贵人鸟	800	28,344.00	0.08
390	600776	东方通信	2,452	28,050.88	0.08
391	600377	宁沪高速	3,181	27,833.75	0.08
392	600119	长江投资	1,400	27,692.00	0.08
393	603169	兰石重装	1,500	27,375.00	0.08
394	603885	吉祥航空	800	27,336.00	0.08
395	600425	青松建化	4,615	26,951.60	0.08
396	603167	渤海轮渡	2,158	26,802.36	0.08
397	600057	象屿股份	1,990	25,949.60	0.08
398	603567	珍宝岛	500	25,900.00	0.08
399	601139	深圳燃气	2,793	25,416.30	0.07
400	601101	昊华能源	3,229	25,379.94	0.07
401	601231	环旭电子	1,742	25,189.32	0.07
402	600132	重庆啤酒	1,549	24,768.51	0.07
403	600429	三元股份	3,363	24,516.27	0.07
404	600088	中视传媒	800	24,088.00	0.07
405	600618	氯碱化工	1,478	23,854.92	0.07
406	601008	连云港	3,500	23,660.00	0.07
407	603328	依顿电子	800	23,608.00	0.07
408	600449	宁夏建材	2,102	23,542.40	0.07

409	600997	开滦股份	4,200	23,436.00	0.07
410	600188	兖州煤业	2,476	23,398.20	0.07
411	600888	新疆众和	2,659	23,372.61	0.07
412	600864	哈投股份	2,146	23,348.48	0.07
413	600335	国机汽车	1,200	22,488.00	0.07
414	601689	拓普集团	800	22,280.00	0.07
415	603366	日出东方	2,100	22,260.00	0.07
416	600508	上海能源	2,159	22,216.11	0.07
417	600078	澄星股份	2,800	22,120.00	0.06
418	601016	节能风电	1,400	22,092.00	0.06
419	600971	恒源煤电	3,453	21,719.37	0.06
420	600780	通宝能源	3,062	21,709.58	0.06
421	600716	凤凰股份	1,853	21,513.33	0.06
422	600116	三峡水利	991	21,504.70	0.06
423	600724	宁波富达	2,839	21,491.23	0.06
424	603979	金诚信	700	21,385.00	0.06
425	601968	宝钢包装	1,600	21,376.00	0.06
426	600397	安源煤业	3,600	21,024.00	0.06
427	600268	国电南自	2,100	20,811.00	0.06
428	600523	贵航股份	926	20,742.40	0.06
429	601965	中国汽研	2,146	20,150.94	0.06
430	600375	华菱星马	2,600	20,098.00	0.06
431	601969	海南矿业	1,400	19,726.00	0.06
432	601069	西部黄金	900	19,197.00	0.06
433	603126	中材节能	1,335	18,930.30	0.06
434	601226	华电重工	1,481	18,734.65	0.05
435	600278	东方创业	1,003	18,395.02	0.05
436	600751	天海投资	1,900	18,278.00	0.05
437	601038	一拖股份	1,300	17,979.00	0.05
438	603698	航天工程	500	17,525.00	0.05
439	603899	晨光文具	400	16,824.00	0.05
440	600917	重庆燃气	1,100	16,709.00	0.05
441	601368	绿城水务	900	15,768.00	0.05
442	601996	丰林集团	1,725	15,732.00	0.05
443	603799	华友钴业	600	15,696.00	0.05
444	603568	伟明环保	300	15,210.00	0.04
445	603198	迎驾贡酒	500	14,895.00	0.04
446	603589	口子窖	300	12,882.00	0.04
447	603025	大豪科技	300	12,273.00	0.04

448	600153	建发股份	700	12,117.00	0.04
449	600801	华新水泥	1,295	10,554.25	0.03
450	603116	红蜻蜓	300	9,534.00	0.03
451	601015	陕西黑猫	800	9,344.00	0.03
452	600978	宜华木业	132	2,947.56	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	601988	中国银行	793,980.00	1.27
2	601009	南京银行	459,592.00	0.73
3	601899	紫金矿业	454,364.00	0.73
4	601111	中国国航	405,721.00	0.65
5	601788	光大证券	370,427.00	0.59
6	601727	上海电气	355,808.00	0.57
7	600703	三安光电	352,409.00	0.56
8	601919	中国远洋	347,242.00	0.55
9	600900	长江电力	336,692.00	0.54
10	600649	城投控股	331,986.00	0.53
11	600196	复星医药	323,256.00	0.52
12	601390	中国中铁	318,936.00	0.51
13	600654	中安消	316,300.00	0.51
14	600570	恒生电子	304,521.00	0.49
15	600023	浙能电力	302,071.00	0.48
16	601555	东吴证券	300,428.00	0.48
17	600594	益佰制药	287,692.00	0.46
18	600705	中航资本	273,259.00	0.44
19	601021	春秋航空	270,883.00	0.43
20	600410	华胜天成	251,615.00	0.40

注：不考虑相关交易费用。

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	601390	中国中铁	878,496.36	1.40
2	601988	中国银行	766,158.06	1.22
3	601186	中国铁建	466,893.80	0.75
4	600893	中航动力	403,456.44	0.64
5	601336	新华保险	381,777.70	0.61
6	601009	南京银行	353,054.83	0.56
7	600795	国电电力	336,786.23	0.54
8	601800	中国交建	331,166.82	0.53
9	600383	金地集团	290,783.84	0.46
10	601669	中国电建	279,559.00	0.45
11	601939	建设银行	221,137.67	0.35
12	601888	中国国旅	186,701.00	0.30
13	600583	海油工程	180,088.34	0.29
14	600276	恒瑞医药	154,129.61	0.25
15	600759	洲际油气	149,185.44	0.24
16	600238	海南椰岛	132,110.65	0.21
17	600433	冠豪高新	127,177.14	0.20
18	600649	城投控股	126,173.19	0.20
19	600594	益佰制药	112,048.80	0.18
20	600705	中航资本	109,761.89	0.18

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	36,529,298.23
卖出股票收入（成交）总额	16,127,913.43

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,974.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	209.56
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,184.36

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

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	601377	兴业证券	293,051.00	0.86	配股
2	600649	城投控股	221,548.56	0.65	重大资产重组事项

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

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	11,242.86	586,370.00	8.11%	4,119,996.00	56.99%

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例
本基金联接基金	2,522,795.00	34.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	深圳市衍盛资产管理有限公司－衍盛稳进	476,220.00	6.59%
2	卢瑛	112,000.00	1.55%
3	徐钧	108,134.00	1.50%
4	郭秀琴	100,000.00	1.38%
5	张家泰	100,000.00	1.38%
6	钟鸣	100,000.00	1.38%
7	薛成奇	96,700.00	1.34%
8	沈曙明	96,295.00	1.33%
9	何凤珍	90,962.00	1.26%
10	孙方帆	75,400.00	1.04%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

§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	16,229,161.00
本报告期基金总申购份额	92,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	101,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	7,229,161.00

§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

2015 年 5 月 13 日,经公司股东会批准杨智雅女士为公司董事, 2015 年 10 月 19 日, 经公司股东会批准童辉先生为公司监事。

2015 年 12 月 4 日, 公司任命董元星先生为公司副总经理, 董元星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。

2015 年 12 月 11 日, 公司任命程安至先生为公司副总经理, 程安至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。

2015 年 4 月, 李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 60000 元人民币, 该事务所已向本基金提供了 5 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	52,657,211.66	100.00%	48,133.91	100.00%	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	104,765.50	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华泰柏瑞基金管理有限公司关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-07-07
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-06-13
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于上证中小ETF场内赎回上限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015-05-12
4	华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资	中国证券报、上海证券	2015-04-01

资基金和华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金增加一级交易商的公告	报、证券时报	
---	--------	--

§12 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

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
2016 年 3 月 29 日