

# 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

## 2019年半年度报告

2019年6月30日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019年8月29日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15

<a href="#">6.2 利润表</a> .....	16
<a href="#">6.3 所有者权益（基金净值）变动表</a> .....	17
<a href="#">6.4 报表附注</a> .....	18
<b><a href="#">§7 投资组合报告</a></b> .....	<b>42</b>
<a href="#">7.1 期末基金资产组合情况</a> .....	42
<a href="#">7.2 期末按行业分类的股票投资组合</a> .....	42
<a href="#">7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细</a> .....	43
<a href="#">7.4 报告期内股票投资组合的重大变动</a> .....	55
<a href="#">7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合</a> .....	56
<a href="#">7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细</a> .....	56
<a href="#">7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细</a> .....	56
<a href="#">7.8 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</a> .....	57
<a href="#">7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细</a> .....	57
<a href="#">7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明</a> .....	57
<a href="#">7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明</a> .....	57
<a href="#">7.12 投资组合报告附注</a> .....	57
<b><a href="#">§8 基金份额持有人信息</a></b> .....	<b>59</b>
<a href="#">8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构</a> .....	59
<a href="#">8.2 期末上市基金前十名持有人</a> .....	59
<a href="#">8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况</a> .....	59
<a href="#">8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况</a> .....	59
<b><a href="#">§9 开放式基金份额变动</a></b> .....	<b>61</b>
<b><a href="#">§10 重大事件揭示</a></b> .....	<b>62</b>
<a href="#">10.1 基金份额持有人大会决议</a> .....	62
<a href="#">10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动</a> .....	62
<a href="#">10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼</a> .....	62
<a href="#">10.4 基金投资策略的改变</a> .....	62
<a href="#">10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况</a> .....	62
<a href="#">10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况</a> .....	62
<a href="#">10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况</a> .....	62

---

<a href="#">10.8 其他重大事件</a> .....	63
<b><a href="#">§11 影响投资者决策的其他重要信息</a>.....</b>	<b>63</b>
<a href="#">11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况</a> .....	63
<a href="#">11.2 影响投资者决策的其他重要信息</a> .....	64
<b><a href="#">备查文件目录</a>.....</b>	<b>65</b>
<a href="#">11.3 备查文件目录</a> .....	65
<a href="#">11.4 存放地点</a> .....	65
<a href="#">11.5 查阅方式</a> .....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘ETF
基金主代码	510220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年1月26日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	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年3月28日

### 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	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场22-23层

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-803,903.49
本期利润	13,947,348.18
加权平均基金份额本期利润	0.7541
本期加权平均净值利润率	19.64%
本期基金份额净值增长率	22.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	5,509,590.03
期末可供分配基金份额利润	0.2942
期末基金资产净值	74,036,432.87
期末基金份额净值	3.9530
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	9.10%

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

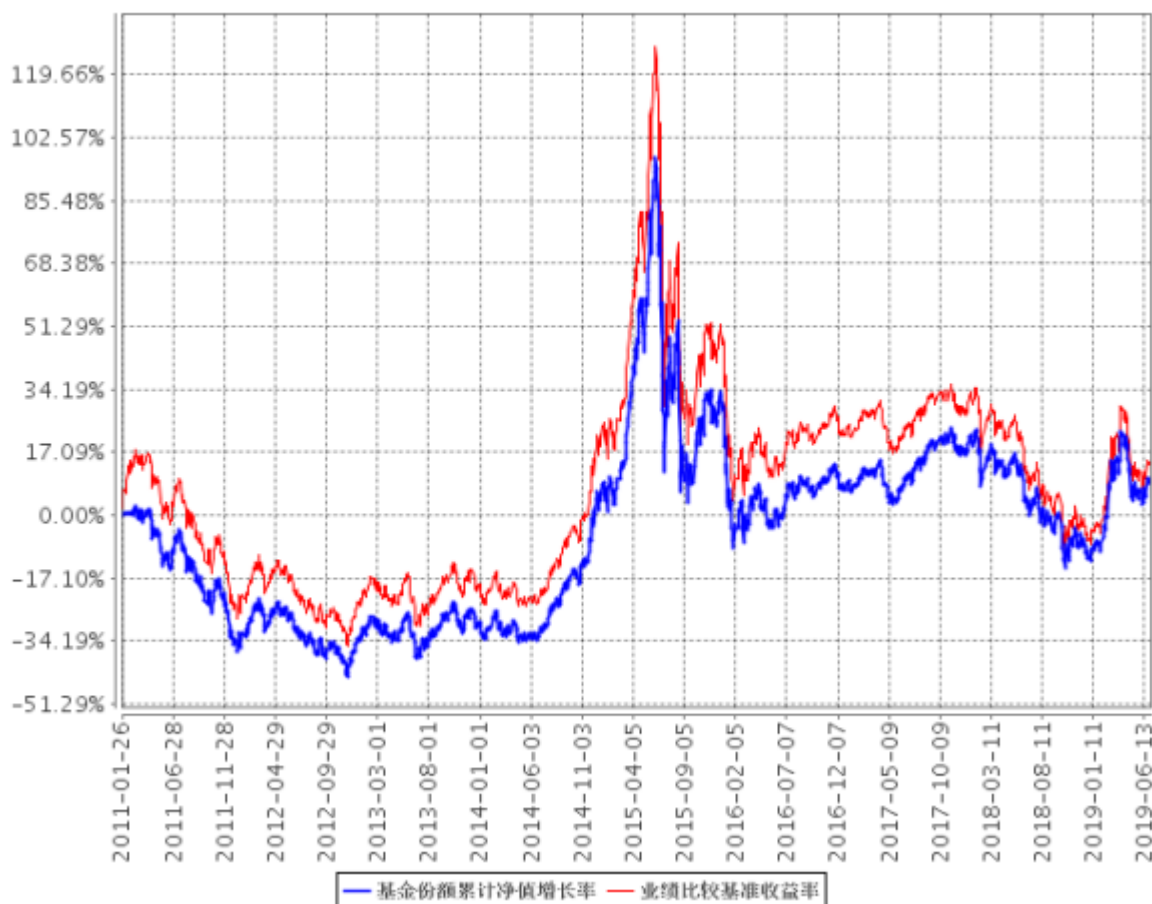
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	2.78%	1.19%	2.20%	1.20%	0.58%	-0.01%
过去三个月	-5.13%	1.62%	-6.46%	1.64%	1.33%	-0.02%
过去六个月	22.92%	1.63%	21.30%	1.66%	1.62%	-0.03%
过去一年	4.70%	1.54%	1.67%	1.56%	3.03%	-0.02%
过去三年	7.21%	1.14%	-1.74%	1.16%	8.95%	-0.02%
自合同生效日至今	9.10%	1.60%	13.61%	1.60%	-4.51%	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：图示日期为2011年1月26日至2019年6月30日。

## §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证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、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、华泰柏瑞享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证券投资基金、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、华泰柏瑞核心优势混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金。截至2019年6月30日，公司基金管理规模为1030.82亿元。

#### 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	-	18年	18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	2017年11月9日	-	6年	南开大学金融学硕士。2013

	的基金 经理助 理			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。任职日期指基金管理公司作出决定之日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报

告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期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

今年上半年股票市场整体表现较佳，年初至四月中旬在政策面偏暖、外部环境缓和的背景下，A股市场走出了一波估值修复行情，市场量能出现了显著放大，部分概念和主题板块表现活跃。而在四月中旬以后，随着投资者在高位获利回吐以及外部不确定性增加，市场从高位开始回落。整个上半年，沪深300、中证500和创业板指分别上涨27.07%、18.77%和20.87%，成长风格总体表现要优于价值风格。分行业来看，食品饮料、非银金融和农林牧渔等板块涨幅居前，而建筑装饰、钢铁、传媒等板块则表现相对落后。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的累计跟踪偏离为1.615%，日均绝对跟踪偏离度为0.026%，期间日跟踪误差为0.035%，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3.9530元；本报告期基金份额净值增长率为22.92%，业绩比较基准收益率为21.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前市场表现来看，投资者风险偏好仍较低，以白酒为代表的消费股机构投资者抱团较为严重。部分抱团股的估值已经处于历史偏高水平，投资者对于这些股票的业绩抱有较为乐观预期，一旦未来它们业绩不及预期，容易发生踩踏风险，投资者需对其谨慎对待。考虑到当前市场情绪仍较为脆弱，建议投资者关注历史业绩稳定，当前估值水平较低且今年表现滞涨的高股息板块，以提升投资组合的确定性。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

注：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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,105,177.25	974,351.20
结算备付金		-	810.03
存出保证金		1,449.35	70.56
交易性金融资产	6.4.7.2	73,106,825.74	59,430,546.06
其中：股票投资		73,106,825.74	59,430,546.06
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	13,180.94
应收利息	6.4.7.5	208.24	182.84
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-



其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		74,213,660.58	60,419,141.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		29,144.93	26,082.56
应付托管费		5,829.00	5,216.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	12,912.43	9,175.08
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	129,341.35	150,000.00
负债合计		177,227.71	190,474.15

<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	68,526,842.84	68,526,842.84
未分配利润	6.4.7.10	5,509,590.03	-8,298,175.36
所有者权益合计		74,036,432.87	60,228,667.48
负债和所有者权益总计		74,213,660.58	60,419,141.63

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值3.9530元，基金份额总额18,729,161.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日 至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6 月30日
<b>一、收入</b>		14,360,800.97	-7,999,886.14
1.利息收入		3,592.18	4,377.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,585.28	4,375.80
债券利息收入		6.90	2.18
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）		-397,068.23	2,763,121.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-947,697.46	2,165,435.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,507.30	470.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	548,121.93	597,215.21

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,751,251.67	-10,770,255.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,025.35	2,869.99
<b>减：二、费用</b>		413,452.79	422,419.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	175,355.93	177,016.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,071.20	35,403.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	23,054.31	29,778.01
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	6.4.7.20	179,971.35	180,221.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,947,348.18	-8,422,305.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,947,348.18	-8,422,305.88

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	68,526,842.84	-8,298,175.36	60,228,667.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	13,947,348.18	13,947,348.18

润)			
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)	-	-139,582.79	-139,582.79
其中: 1. 基金申购款	3,658,831.42	370,585.64	4,029,417.06
2. 基金赎回款	-3,658,831.42	-510,168.43	-4,168,999.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	68,526,842.84	5,509,590.03	74,036,432.87
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	-8,422,305.88	-8,422,305.88
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)	1,829,415.71	264,082.29	2,093,498.00
其中: 1. 基金申购款	3,658,831.42	528,194.87	4,187,026.29
2. 基金赎回款	-1,829,415.71	-264,112.58	-2,093,528.29
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)	63,038,595.68	2,010,708.45	65,049,304.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币348,418,327.00元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第022号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2011年1月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为348,427,447.00份基金份额，其中认购资金利息折合9,120.00份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于2011年3月11日进行了基金份额折算，折算比例为0.27331199，并于2011年3月14日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]第55号文审核同意，本基金95,229,161.00份基金份额于2011年3月28日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的95%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩基准为上证中小盘指数。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2019年8月29日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2019年1月1日至2019年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错。

#### 6.4.6 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：

(a) 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	1,105,177.25
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：	1,105,177.25

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	78,246,040.65	73,106,825.74	-5,139,214.91
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	78,246,040.65	73,106,825.74	-5,139,214.91

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

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金买入返售金融资产余额为0。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	207.54
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	-
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	0.70
合计	208.24

#### 6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	12,912.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,912.43

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	79,341.35
应付指数使用费	50,000.00
合计	129,341.35



### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,729,161.00	68,526,842.84
本期申购	1,000,000.00	3,658,831.42
本期赎回(以“-”号填列)	-1,000,000.00	-3,658,831.42
- 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。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,216,317.67	-40,514,493.03	-8,298,175.36
本期利润	-803,903.49	14,751,251.67	13,947,348.18
本期基金份额交易产生的变动数	-32,530.76	-107,052.03	-139,582.79
其中：基金申购款	1,696,421.85	-1,325,836.21	370,585.64
基金赎回款	-1,728,952.61	1,218,784.18	-510,168.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,379,883.42	-25,870,293.39	5,509,590.03

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	活期存款利息收入
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	88.33
其他	5.82
合计	3,585.28

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-841,692.37
股票投资收益——赎回差价收入	-106,005.09
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-947,697.46

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	7,926,473.80
减：卖出股票成本总额	8,768,166.17
买卖股票差价收入	-841,692.37

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	4,168,999.85
减：现金支付赎回款总额	-119,082.15
减：赎回股票成本总额	4,394,087.09
赎回差价收入	-106,005.09

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,507.30
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	2,507.30

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	53,514.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	51,000.00
减：应收利息总额	6.90
买卖债券差价收入	2,507.30

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	548,121.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	548,121.93

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	14,751,251.67
——股票投资	14,751,251.67
——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	14,751,251.67

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	3,025.35
合计	3,025.35

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

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	23,054.31
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	23,054.31

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	19,835.79
上市费	29,752.78
银行划款手续费	630.00
指数使用费	100,000.00
合计	179,971.35

#### 6.4.7.21 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，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“上证中小盘ETF联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

##### 6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

注：无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	175,355.93	177,016.96
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的0.50%的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$  H为每日应支付的管理人报酬 E为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,071.20	35,403.42

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$  H为每日应支付的托管费 E为前一日的基金资产净值 基金

托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金资产中一次性支取。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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
上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金	14,074,000.00	75.1449%	14,500,000.00	77.4194%

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,105,177.25	3,491.13	1,081,432.35	4,275.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本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2019年6月30日，本基金无债券投资(2018年12月31日：同)。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

### **6.4.13.3 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2019年6月30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。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

#### **6.4.13.3.2 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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2019年6月30日，本基金未持有流动性受限资产。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持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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,105,177.25	-	-	-	-	-	1,105,177.25

存出保证金	1,449.35	-	-	-	-	-	1,449.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-73,106,825.74	73,106,825.74
应收利息	-	-	-	-	-	208.24	208.24
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,106,626.60	-	-	-	-	-73,107,033.98	74,213,660.58
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	29,144.93	29,144.93
应付托管费	-	-	-	-	-	5,829.00	5,829.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,912.43	12,912.43
其他负债	-	-	-	-	-	129,341.35	129,341.35
负债总计	-	-	-	-	-	177,227.71	177,227.71
利率敏感度缺口	1,106,626.60	-	-	-	-	-72,929,806.27	74,036,432.87
上年度末 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

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。于2019年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2019年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2018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（2018年12月31日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	73,106,825.74	98.74	59,430,546.06	98.67
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	73,106,825.74	98.74	59,430,546.06	98.67

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证中小盘指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	上证中小盘指数上升5%	3,063,529.00	2,407,320.00
	上证中小盘指数下降5%	-3,063,529.00	-2,407,320.00

#### 6.4.13.1.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	73,106,825.74	98.51
	其中：股票	73,106,825.74	98.51
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	1,105,177.25	1.49
8	其他各项资产	1,657.59	0.00
9	合计	74,213,660.58	100.00

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	315,129.68	0.43
B	采矿业	4,225,423.69	5.71
C	制造业	30,677,278.26	41.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,356,719.44	7.24
E	建筑业	2,324,505.86	3.14
F	批发和零售业	3,396,970.67	4.59
G	交通运输、仓储和邮政业	5,869,510.92	7.93
H	住宿和餐饮业	207,172.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,255,911.64	5.75
J	金融业	11,062,698.60	14.94
K	房地产业	3,037,367.41	4.10
L	租赁和商务服务业	478,226.43	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	207,526.54	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	48,590.40	0.07
Q	卫生和社会工作	248,052.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	689,730.94	0.93
S	综合	706,011.26	0.95
	合计	73,106,825.74	98.74

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末持有通过港股通投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	94,842	1,697,671.80	2.29
2	601169	北京银行	212,600	1,256,466.00	1.70
3	603288	海天味业	11,714	1,229,970.00	1.66
4	600009	上海机场	13,886	1,163,369.08	1.57
5	601012	隆基股份	36,545	844,554.95	1.14
6	600919	江苏银行	99,600	723,096.00	0.98
7	601009	南京银行	85,329	704,817.54	0.95
8	600999	招商证券	41,100	702,399.00	0.95
9	601006	大秦铁路	85,400	690,886.00	0.93
10	600015	华夏银行	88,460	681,142.00	0.92
11	600570	恒生电子	9,213	627,865.95	0.85
12	601899	紫金矿业	159,932	602,943.64	0.81
13	600352	浙江龙盛	37,417	590,066.09	0.80
14	601933	永辉超市	55,102	562,591.42	0.76
15	600958	东方证券	51,500	550,020.00	0.74
16	601225	陕西煤业	57,500	531,300.00	0.72
17	601669	中国电建	100,200	530,058.00	0.72
18	601155	新城控股	13,000	517,530.00	0.70
19	600436	片仔癀	4,394	506,188.80	0.68
20	600406	国电南瑞	26,600	495,824.00	0.67
21	600741	华域汽车	22,717	490,687.20	0.66
22	600588	用友网络	17,902	481,205.76	0.65
23	600660	福耀玻璃	20,200	459,146.00	0.62
24	601377	兴业证券	67,400	454,276.00	0.61
25	600010	包钢股份	259,980	439,366.20	0.59
26	600547	山东黄金	10,600	436,402.00	0.59
27	600795	国电电力	169,400	430,276.00	0.58
28	601901	方正证券	59,200	420,912.00	0.57
29	600705	中航资本	76,124	412,592.08	0.56
30	600111	北方稀土	31,300	401,892.00	0.54
31	600011	华能国际	63,000	392,490.00	0.53



32	600438	通威股份	27,900	392,274.00	0.53
33	600383	金地集团	32,491	387,617.63	0.52
34	600089	特变电工	53,373	386,954.25	0.52
35	600886	国投电力	48,781	379,028.37	0.51
36	601985	中国核电	67,100	373,076.00	0.50
37	600271	航天信息	16,106	371,243.30	0.50
38	601600	中国铝业	93,960	368,323.20	0.50
39	600606	绿地控股	52,400	357,892.00	0.48
40	600115	东方航空	56,391	353,571.57	0.48
41	601555	东吴证券	34,466	353,276.50	0.48
42	601099	太平洋	97,912	348,566.72	0.47
43	600872	中炬高新	8,076	345,895.08	0.47
44	600221	海航控股	165,300	335,559.00	0.45
45	600109	国金证券	34,300	333,396.00	0.45
46	600332	白云山	8,113	332,389.61	0.45
47	600487	亨通光电	19,620	328,831.20	0.44
48	600522	中天科技	35,230	323,059.10	0.44
49	603589	口子窖	5,000	322,100.00	0.44
50	601788	光大证券	28,200	322,044.00	0.43
51	600177	雅戈尔	50,414	320,128.90	0.43
52	603019	中科曙光	9,100	319,410.00	0.43
53	600018	上港集团	46,200	315,084.00	0.43
54	601618	中国中冶	102,585	311,858.40	0.42
55	600637	东方明珠	29,260	308,400.40	0.42
56	601607	上海医药	16,585	301,017.75	0.41
57	600893	航发动力	12,900	292,959.00	0.40
58	600176	中国巨石	30,193	287,739.29	0.39
59	600516	方大炭素	23,251	285,754.79	0.39
60	601877	正泰电器	12,373	285,692.57	0.39
61	600498	烽火通信	10,188	283,837.68	0.38
62	601919	中远海控	55,700	279,614.00	0.38
63	601727	上海电气	50,700	272,766.00	0.37
64	600004	白云机场	14,910	271,362.00	0.37
65	600867	通化东宝	17,604	271,101.60	0.37
66	600809	山西汾酒	3,840	265,152.00	0.36
67	601998	中信银行	44,100	263,277.00	0.36
68	600201	生物股份	16,627	260,877.63	0.35
69	600739	辽宁成大	17,633	256,383.82	0.35
70	600489	中金黄金	24,862	255,332.74	0.34

71	601018	宁波港	56,747	249,119.33	0.34
72	600600	青岛啤酒	4,985	248,901.05	0.34
73	600066	宇通客车	19,100	248,682.00	0.34
74	600763	通策医疗	2,800	248,052.00	0.34
75	600068	葛洲坝	39,793	247,910.39	0.33
76	600926	杭州银行	29,560	246,234.80	0.33
77	601997	贵阳银行	28,380	245,487.00	0.33
78	600426	华鲁恒升	16,377	243,362.22	0.33
79	600170	上海建工	64,011	240,681.36	0.33
80	601233	桐昆股份	15,380	238,543.80	0.32
81	600642	申能股份	39,281	236,078.81	0.32
82	601198	东兴证券	19,800	235,224.00	0.32
83	600362	江西铜业	14,917	234,793.58	0.32
84	600482	中国动力	9,924	234,404.88	0.32
85	600398	海澜之家	25,831	234,287.17	0.32
86	600219	南山铝业	102,945	232,655.70	0.31
87	600536	中国软件	4,302	230,888.34	0.31
88	600183	生益科技	15,268	229,783.40	0.31
89	600085	同仁堂	7,898	229,042.00	0.31
90	601881	中国银河	18,600	227,850.00	0.31
91	600895	张江高科	11,100	227,772.00	0.31
92	600298	安琪酵母	7,200	227,736.00	0.31
93	600674	川投能源	25,343	225,552.70	0.30
94	601838	成都银行	25,422	224,476.26	0.30
95	600535	天士力	13,000	215,150.00	0.29
96	600256	广汇能源	58,607	208,640.92	0.28
97	600297	广汇汽车	45,860	204,535.60	0.28
98	603833	欧派家居	1,900	204,478.00	0.28
99	603369	今世缘	7,250	202,202.50	0.27
100	600369	西南证券	40,600	200,564.00	0.27
101	600801	华新水泥	9,820	198,855.00	0.27
102	603799	华友钴业	9,256	197,245.36	0.27
103	600161	天坛生物	7,720	194,930.00	0.26
104	600208	新湖中宝	61,889	194,331.46	0.26
105	603160	汇顶科技	1,400	194,320.00	0.26
106	600879	航天电子	31,300	192,808.00	0.26
107	600118	中国卫星	8,486	191,359.30	0.26
108	600325	华发股份	24,472	191,126.32	0.26
109	600460	士兰微	11,300	187,580.00	0.25

110	600497	驰宏锌锗	36,636	186,110.88	0.25
111	600346	恒力石化	15,260	185,561.60	0.25
112	600528	中铁工业	15,850	183,384.50	0.25
113	601108	财通证券	16,700	183,366.00	0.25
114	600779	水井坊	3,600	182,952.00	0.25
115	600153	建发股份	20,400	181,152.00	0.24
116	601992	金隅集团	48,018	180,547.68	0.24
117	600584	长电科技	13,911	178,756.35	0.24
118	600728	佳都科技	18,128	178,560.80	0.24
119	601878	浙商证券	19,200	178,560.00	0.24
120	600635	大众公用	27,761	178,225.62	0.24
121	600061	国投资本	12,700	177,927.00	0.24
122	600583	海油工程	31,769	177,906.40	0.24
123	600760	中航沈飞	6,100	177,083.00	0.24
124	600027	华电国际	46,928	176,918.56	0.24
125	601128	常熟银行	22,900	176,788.00	0.24
126	600745	闻泰科技	5,300	176,066.00	0.24
127	600549	厦门钨业	12,240	175,154.40	0.24
128	600699	均胜电子	8,200	175,152.00	0.24
129	601021	春秋航空	3,892	175,140.00	0.24
130	601168	西部矿业	27,428	174,990.64	0.24
131	600038	中直股份	4,261	174,786.22	0.24
132	600848	上海临港	5,600	174,328.00	0.24
133	603986	兆易创新	2,000	173,400.00	0.23
134	603899	晨光文具	3,900	171,483.00	0.23
135	601117	中国化学	28,436	171,184.72	0.23
136	600820	隧道股份	27,084	170,900.04	0.23
137	600673	东阳光	21,754	170,768.90	0.23
138	600410	华胜天成	15,780	169,319.40	0.23
139	600977	中国电影	10,800	169,128.00	0.23
140	600909	华安证券	25,700	168,078.00	0.23
141	600875	东方电气	15,800	167,796.00	0.23
142	600392	盛和资源	15,135	167,393.10	0.23
143	600572	康恩贝	26,012	166,476.80	0.22
144	603858	步长制药	6,410	165,185.70	0.22
145	600415	小商品城	39,129	161,211.48	0.22
146	600718	东软集团	12,500	160,250.00	0.22
147	601216	君正集团	48,488	159,525.52	0.22
148	600166	福田汽车	67,092	159,008.04	0.21

149	600811	东方集团	42,740	158,992.80	0.21
150	600885	宏发股份	6,540	158,922.00	0.21
151	600816	安信信托	31,424	158,691.20	0.21
152	600236	桂冠电力	26,167	158,572.02	0.21
153	600755	厦门国贸	18,273	157,695.99	0.21
154	600022	山东钢铁	94,405	157,656.35	0.21
155	601333	广深铁路	48,754	157,475.42	0.21
156	600839	四川长虹	53,036	156,456.20	0.21
157	600776	东方通信	6,800	156,264.00	0.21
158	600567	山鹰纸业	46,067	155,245.79	0.21
159	600804	鹏博士	20,562	154,626.24	0.21
160	603939	益丰药房	2,200	153,978.00	0.21
161	601866	中远海发	56,333	153,225.76	0.21
162	600521	华海药业	10,862	153,154.20	0.21
163	600486	扬农化工	2,793	152,777.10	0.21
164	600315	上海家化	4,800	149,520.00	0.20
165	600797	浙大网新	14,662	149,405.78	0.20
166	600881	亚泰集团	45,655	148,378.75	0.20
167	601238	广汽集团	13,420	146,680.60	0.20
168	600808	马钢股份	42,840	146,084.40	0.20
169	603077	和邦生物	76,159	144,702.10	0.20
170	600446	金证股份	7,353	144,412.92	0.20
171	601633	长城汽车	17,433	144,170.91	0.19
172	600273	嘉化能源	12,400	143,344.00	0.19
173	600845	宝信软件	4,940	140,691.20	0.19
174	600160	巨化股份	19,777	140,614.47	0.19
175	603000	人民网	7,800	139,074.00	0.19
176	600188	兖州煤业	12,776	138,875.12	0.19
177	600260	凯乐科技	6,949	138,841.02	0.19
178	600655	豫园股份	16,753	137,207.07	0.19
179	601699	潞安环能	17,261	137,052.34	0.19
180	600967	内蒙一机	12,040	134,848.00	0.18
181	600643	爱建集团	14,040	134,503.20	0.18
182	600604	市北高新	10,100	134,128.00	0.18
183	600566	济川药业	4,451	134,019.61	0.18
184	600388	龙净环保	10,804	133,861.56	0.18
185	600282	南钢股份	37,800	132,300.00	0.18
186	600435	北方导航	14,674	131,919.26	0.18
187	600064	南京高科	12,300	131,733.00	0.18

188	601098	中南传媒	10,402	131,481.28	0.18
189	600863	内蒙华电	41,727	131,022.78	0.18
190	603517	绝味食品	3,300	128,403.00	0.17
191	600171	上海贝岭	7,900	128,375.00	0.17
192	600466	蓝光发展	20,580	128,007.60	0.17
193	600026	中远海能	19,645	127,496.05	0.17
194	600737	中粮糖业	14,681	127,431.08	0.17
195	601118	海南橡胶	24,600	126,690.00	0.17
196	601898	中煤能源	26,366	126,556.80	0.17
197	600258	首旅酒店	7,000	125,860.00	0.17
198	601360	三六零	5,800	124,004.00	0.17
199	601106	中国一重	39,400	123,716.00	0.17
200	603156	养元饮品	3,320	123,105.60	0.17
201	600373	中文传媒	9,700	121,832.00	0.16
202	600380	健康元	13,888	120,131.20	0.16
203	601100	恒立液压	3,800	119,244.00	0.16
204	601966	玲珑轮胎	7,000	119,000.00	0.16
205	600649	城投控股	18,100	117,107.00	0.16
206	601000	唐山港	42,269	116,239.75	0.16
207	600008	首创股份	32,780	115,385.60	0.16
208	601231	环旭电子	9,442	113,776.10	0.15
209	600648	外高桥	5,400	113,292.00	0.15
210	600039	四川路桥	31,104	113,218.56	0.15
211	600756	浪潮软件	4,728	113,093.76	0.15
212	600372	中航电子	7,600	112,784.00	0.15
213	600323	瀚蓝环境	6,657	112,370.16	0.15
214	600782	新钢股份	22,400	112,000.00	0.15
215	600500	中化国际	14,980	111,900.60	0.15
216	601228	广州港	26,700	111,606.00	0.15
217	600515	海航基础	22,500	111,375.00	0.15
218	600598	北大荒	10,300	110,519.00	0.15
219	601991	大唐发电	35,733	110,414.97	0.15
220	603501	韦尔股份	2,000	109,820.00	0.15
221	600320	振华重工	28,744	108,077.44	0.15
222	601608	中信重工	25,009	108,038.88	0.15
223	600729	重庆百货	3,532	106,807.68	0.14
224	600025	华能水电	26,000	105,820.00	0.14
225	600138	中青旅	8,300	105,327.00	0.14
226	600682	南京新百	9,300	105,183.00	0.14

227	603444	吉比特	500	104,980.00	0.14
228	600120	浙江东方	8,152	103,856.48	0.14
229	600633	浙数文化	11,011	102,952.85	0.14
230	600507	方大特钢	10,500	102,690.00	0.14
231	601598	中国外运	21,431	102,654.49	0.14
232	600868	梅雁吉祥	27,300	102,648.00	0.14
233	603885	吉祥航空	7,820	102,442.00	0.14
234	600511	国药股份	4,442	102,032.74	0.14
235	600206	有研新材	8,522	101,837.90	0.14
236	600056	中国医药	7,542	101,741.58	0.14
237	600339	中油工程	24,100	101,702.00	0.14
238	600348	阳泉煤业	17,398	101,082.38	0.14
239	600711	盛屯矿业	18,431	99,711.71	0.13
240	600823	世茂股份	21,600	99,576.00	0.13
241	600155	华创阳安	7,400	99,382.00	0.13
242	600409	三友化工	17,534	99,242.44	0.13
243	600559	老白干酒	7,480	97,913.20	0.13
244	600060	海信电器	11,327	97,638.74	0.13
245	600777	新潮能源	46,900	97,552.00	0.13
246	600771	广誉远	5,000	97,000.00	0.13
247	601011	宝泰隆	15,900	96,831.00	0.13
248	600525	长园集团	15,277	96,550.64	0.13
249	600970	中材国际	14,976	96,295.68	0.13
250	600418	江淮汽车	18,600	95,976.00	0.13
251	600277	亿利洁能	19,662	95,753.94	0.13
252	603228	景旺电子	2,380	95,223.80	0.13
253	600216	浙江医药	9,289	95,119.36	0.13
254	600062	华润双鹤	7,527	94,915.47	0.13
255	601880	大连港	44,543	94,876.59	0.13
256	600597	光明乳业	8,769	94,266.75	0.13
257	601958	金铂股份	14,016	93,907.20	0.13
258	603883	老百姓	1,600	93,568.00	0.13
259	600717	天津港	14,485	92,993.70	0.13
260	600803	新奥股份	8,875	92,743.75	0.13
261	600259	广晟有色	2,300	92,690.00	0.13
262	600702	舍得酒业	3,400	92,412.00	0.12
263	600366	宁波韵升	10,059	92,341.62	0.12
264	600621	华鑫股份	6,200	92,318.00	0.12
265	600490	鹏欣资源	18,648	92,121.12	0.12

266	600677	航天通信	5,300	92,061.00	0.12
267	600580	卧龙电驱	10,908	91,736.28	0.12
268	600667	太极实业	12,100	91,355.00	0.12
269	600307	酒钢宏兴	44,988	91,325.64	0.12
270	600478	科力远	16,296	91,094.64	0.12
271	600330	天通股份	11,537	90,680.82	0.12
272	601636	旗滨集团	23,200	90,248.00	0.12
273	600664	哈药股份	21,794	90,227.16	0.12
274	600557	康缘药业	6,047	89,858.42	0.12
275	601200	上海环境	6,570	89,417.70	0.12
276	600316	洪都航空	6,216	88,950.96	0.12
277	600422	昆药集团	7,682	88,573.46	0.12
278	601611	中国核建	11,300	87,914.00	0.12
279	600864	哈投股份	11,246	87,718.80	0.12
280	600073	上海梅林	9,502	87,418.40	0.12
281	600884	杉杉股份	8,138	86,669.70	0.12
282	600596	新安股份	8,039	86,499.64	0.12
283	601588	北辰实业	23,010	86,287.50	0.12
284	600185	格力地产	17,700	86,199.00	0.12
285	601258	庞大集团	66,783	86,150.07	0.12
286	600226	瀚叶股份	27,000	85,860.00	0.12
287	600312	平高电气	11,127	85,566.63	0.12
288	600125	铁龙物流	13,262	85,539.90	0.12
289	600759	洲际油气	22,100	85,306.00	0.12
290	603816	顾家家居	2,660	84,907.20	0.11
291	603659	璞泰来	1,800	84,636.00	0.11
292	600563	法拉电子	2,046	84,233.82	0.11
293	601717	郑煤机	14,700	83,937.00	0.11
294	600017	日照港	26,563	83,673.45	0.11
295	600267	海正药业	8,353	83,530.00	0.11
296	600072	中船科技	6,400	82,816.00	0.11
297	603658	安图生物	1,200	82,032.00	0.11
298	600582	天地科技	23,764	81,985.80	0.11
299	601808	中海油服	8,498	81,835.74	0.11
300	601222	林洋能源	17,375	81,488.75	0.11
301	600988	赤峰黄金	13,300	81,396.00	0.11
302	600754	锦江股份	3,300	81,312.00	0.11
303	601519	大智慧	11,400	80,826.00	0.11
304	603708	家家悦	3,536	80,691.52	0.11

305	601162	天风证券	7,400	80,216.00	0.11
306	600859	王府井	5,256	79,838.64	0.11
307	600291	西水股份	7,900	79,474.00	0.11
308	600901	江苏租赁	12,900	78,561.00	0.11
309	600499	科达洁能	17,902	78,410.76	0.11
310	600108	亚盛集团	22,391	77,920.68	0.11
311	601375	中原证券	14,724	77,889.96	0.11
312	600175	美都能源	30,844	77,726.88	0.10
313	600377	宁沪高速	7,181	77,123.94	0.10
314	600317	营口港	27,911	77,034.36	0.10
315	600835	上海机电	4,617	76,642.20	0.10
316	600562	国睿科技	4,950	76,032.00	0.10
317	600751	海航科技	23,900	76,002.00	0.10
318	600908	无锡银行	13,400	75,576.00	0.10
319	600151	航天机电	14,500	74,675.00	0.10
320	600269	赣粤高速	16,792	74,556.48	0.10
321	600093	易见股份	6,500	74,425.00	0.10
322	601326	秦港股份	20,500	74,415.00	0.10
323	600993	马应龙	4,181	73,794.65	0.10
324	603515	欧普照明	2,280	73,530.00	0.10
325	600110	诺德股份	16,539	73,267.77	0.10
326	600611	大众交通	15,750	73,237.50	0.10
327	600123	兰花科创	9,931	72,694.92	0.10
328	600787	中储股份	12,625	72,341.25	0.10
329	600517	置信电气	9,779	71,582.28	0.10
330	601666	平煤股份	17,100	71,478.00	0.10
331	600685	中船防务	4,741	71,399.46	0.10
332	600783	鲁信创投	4,009	71,039.48	0.10
333	600210	紫江企业	17,500	70,875.00	0.10
334	600390	五矿资本	7,500	70,725.00	0.10
335	600740	山西焦化	8,300	70,467.00	0.10
336	600338	西藏珠峰	4,020	70,269.60	0.09
337	600458	时代新材	6,700	69,613.00	0.09
338	600502	安徽水利	14,896	69,266.40	0.09
339	600862	中航高科	7,700	69,223.00	0.09
340	600765	中航重机	7,494	69,169.62	0.09
341	600057	厦门象屿	15,482	68,894.90	0.09
342	600116	三峡水利	8,573	68,412.54	0.09
343	601828	美凯龙	5,627	68,368.05	0.09



344	601311	骆驼股份	6,300	68,355.00	0.09
345	600020	中原高速	12,800	67,200.00	0.09
346	603323	苏农银行	11,740	65,039.60	0.09
347	601019	山东出版	8,300	64,574.00	0.09
348	600846	同济科技	7,252	64,325.24	0.09
349	603712	七一二	3,000	63,690.00	0.09
350	601016	节能风电	23,900	63,574.00	0.09
351	603198	迎驾贡酒	3,500	62,685.00	0.08
352	603766	隆鑫通用	14,850	62,221.50	0.08
353	603888	新华网	3,100	61,876.00	0.08
354	600006	东风汽车	11,553	61,577.49	0.08
355	600640	号百控股	4,600	61,548.00	0.08
356	601689	拓普集团	4,000	61,280.00	0.08
357	603260	合盛硅业	1,300	61,178.00	0.08
358	600200	江苏吴中	10,400	61,152.00	0.08
359	600477	杭萧钢构	18,612	61,047.36	0.08
360	600694	大商股份	2,183	60,927.53	0.08
361	600750	江中药业	4,581	59,598.81	0.08
362	603568	伟明环保	2,767	59,545.84	0.08
363	600233	圆通速递	4,800	59,184.00	0.08
364	600757	长江传媒	8,686	59,151.66	0.08
365	600623	华谊集团	7,700	58,828.00	0.08
366	600789	鲁抗医药	8,780	58,474.80	0.08
367	600495	晋西车轴	12,216	57,903.84	0.08
368	601298	青岛港	6,900	57,891.00	0.08
369	600416	湘电股份	9,580	57,671.60	0.08
370	600343	航天动力	5,552	56,908.00	0.08
371	600187	国中水务	18,837	55,569.15	0.08
372	601001	大同煤业	12,088	55,242.16	0.07
373	600329	中新药业	3,857	55,116.53	0.07
374	601212	白银有色	12,300	53,997.00	0.07
375	601069	西部黄金	3,500	53,900.00	0.07
376	600874	创业环保	6,333	52,500.57	0.07
377	603056	德邦股份	3,700	52,096.00	0.07
378	601890	亚星锚链	8,300	51,792.00	0.07
379	601949	中国出版	7,900	51,350.00	0.07
380	601577	长沙银行	5,300	50,562.00	0.07
381	600971	恒源煤电	8,480	49,608.00	0.07
382	600391	航发科技	3,331	49,598.59	0.07

383	603113	金能科技	4,500	49,590.00	0.07
384	600733	北汽蓝谷	6,000	49,560.00	0.07
385	601908	京运通	14,129	49,310.21	0.07
386	600963	岳阳林纸	10,084	48,806.56	0.07
387	600230	沧州大化	3,560	48,594.00	0.07
388	603377	东方时尚	3,180	48,590.40	0.07
389	600996	贵广网络	4,500	48,510.00	0.07
390	601002	晋亿实业	6,850	48,361.00	0.07
391	600594	益佰制药	9,100	47,775.00	0.06
392	601886	江河集团	6,661	47,359.71	0.06
393	601139	深圳燃气	8,291	47,175.79	0.06
394	600350	山东高速	9,800	47,040.00	0.06
395	600569	安阳钢铁	16,100	47,012.00	0.06
396	600968	海油发展	13,190	46,824.50	0.06
397	601606	长城军工	3,100	46,283.00	0.06
398	601952	苏垦农发	5,990	46,003.20	0.06
399	600096	云天化	7,700	45,892.00	0.06
400	600428	中远海特	12,239	45,284.30	0.06
401	601869	长飞光纤	1,200	45,000.00	0.06
402	603881	数据港	1,400	44,548.00	0.06
403	603328	依顿电子	4,300	44,161.00	0.06
404	600856	中天能源	13,800	43,746.00	0.06
405	601860	紫金银行	5,800	43,732.00	0.06
406	601990	南京证券	4,400	43,604.00	0.06
407	600299	安迪苏	4,200	43,554.00	0.06
408	600855	航天长峰	3,134	43,531.26	0.06
409	601003	柳钢股份	7,400	42,846.00	0.06
410	601615	明阳智能	3,900	42,276.00	0.06
411	600715	文投控股	10,800	41,796.00	0.06
412	600903	贵州燃气	3,200	41,696.00	0.06
413	603220	贝通信	1,500	41,475.00	0.06
414	600122	宏图高科	12,771	40,994.91	0.06
415	601777	力帆股份	9,517	40,827.93	0.06
416	600581	八一钢铁	11,000	40,590.00	0.05
417	600172	黄河旋风	12,520	40,314.40	0.05
418	600571	信雅达	4,300	40,076.00	0.05
419	600758	红阳能源	7,700	39,963.00	0.05
420	600929	湖南盐业	4,900	39,886.00	0.05
421	601858	中国科传	3,000	39,330.00	0.05

422	600231	凌钢股份	11,900	38,318.00	0.05
423	600086	东方金钰	8,665	38,126.00	0.05
424	600335	国机汽车	5,500	38,060.00	0.05
425	600568	中珠医疗	17,767	38,021.38	0.05
426	603980	吉华集团	4,020	36,421.20	0.05
427	603650	彤程新材	1,663	36,319.92	0.05
428	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.05
429	601698	中国卫通	8,622	33,798.24	0.05
430	601330	绿色动力	2,100	32,571.00	0.04
431	603225	新凤鸣	2,452	30,625.48	0.04
432	600179	ST安通	10,300	30,179.00	0.04
433	600280	中央商场	8,400	30,156.00	0.04
434	601068	中铝国际	4,300	29,670.00	0.04
435	601020	华钰矿业	2,400	28,128.00	0.04
436	603868	飞科电器	700	27,405.00	0.04
437	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.04
438	603603	博天环境	1,800	25,992.00	0.04
439	603486	科沃斯	840	25,410.00	0.03
440	603587	地素时尚	1,100	25,014.00	0.03
441	603619	中曼石油	1,100	23,573.00	0.03
442	603693	江苏新能	1,800	22,374.00	0.03
443	603612	索通发展	2,060	22,062.60	0.03
444	600917	重庆燃气	2,800	19,488.00	0.03
445	603876	鼎胜新材	1,200	18,984.00	0.03
446	603533	掌阅科技	1,100	17,699.00	0.02
447	603025	大豪科技	1,721	17,623.04	0.02
448	603733	仙鹤股份	1,100	16,687.00	0.02
449	601619	嘉泽新能	3,600	16,632.00	0.02
450	603105	芯能科技	1,400	15,512.00	0.02
451	603013	亚普股份	900	14,292.00	0.02
452	603863	松炆资源	564	13,017.12	0.02
453	603103	横店影视	700	11,088.00	0.01
454	603877	太平鸟	700	10,864.00	0.01
455	603596	伯特利	600	9,906.00	0.01

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601169	北京银行	1,206,227.00	2.00
2	601006	大秦铁路	698,373.00	1.16
3	600547	山东黄金	361,192.00	0.60
4	600606	绿地控股	342,414.00	0.57
5	600989	宝丰能源	270,838.72	0.45
6	600895	张江高科	213,836.00	0.36
7	600031	三一重工	183,384.00	0.30
8	601838	成都银行	170,180.00	0.28
9	600776	东方通信	151,537.00	0.25
10	600604	市北高新	131,744.00	0.22
11	600064	南京高科	130,989.00	0.22
12	601118	海南橡胶	129,971.00	0.22
13	603939	益丰药房	124,233.00	0.21
14	601106	中国一重	123,106.00	0.20
15	601360	三六零	119,293.00	0.20
16	600649	城投控股	115,918.00	0.19
17	603517	绝味食品	115,254.00	0.19
18	601108	财通证券	108,500.00	0.18
19	600155	华创阳安	107,085.00	0.18
20	600010	包钢股份	98,535.00	0.16

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600837	海通证券	1,491,137.00	2.48
2	600031	三一重工	1,042,520.75	1.73
3	600989	宝丰能源	414,052.00	0.69
4	601111	中国国航	382,284.60	0.63
5	600023	浙能电力	268,052.40	0.45
6	600518	ST康美	196,758.00	0.33
7	600688	上海石化	149,968.28	0.25
8	600266	北京城建	135,440.00	0.22
9	600079	人福医药	134,799.65	0.22

10	600143	金发科技	132,447.96	0.22
11	601066	中信建投	131,833.00	0.22
12	601865	福莱特	114,036.14	0.19
13	600158	中体产业	108,488.86	0.18
14	600928	西安银行	94,051.20	0.16
15	600578	京能电力	89,923.00	0.15
16	600886	国投电力	85,172.00	0.14
17	601997	贵阳银行	82,286.00	0.14
18	603697	有友食品	70,501.72	0.12
19	603068	博通集成	70,200.00	0.12
20	601860	紫金银行	64,441.64	0.11

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,044,049.27
卖出股票收入（成交）总额	7,926,473.80

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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,449.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	208.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,657.59

#### **7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
752	24,905.80	14,168,473.00	75.65%	4,560,688.00	24.35%

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额(份)	占总份额比例
联接基金	14,074,000.00	75.14%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	覃晓春	250,300.00	1.34%
2	徐钧	108,134.00	0.58%
3	钟鸣	100,000.00	0.53%
4	郭秀琴	100,000.00	0.53%
5	沈曙明	96,295.00	0.51%
6	纪东琦	80,000.00	0.43%
7	福建道冲投资管理有限公司一道冲多策略轮动5号基金	71,000.00	0.38%
8	陈密	68,558.00	0.37%
9	王秀芬	65,240.00	0.35%
10	邝紫葡	64,351.00	0.34%
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券投资基金联接基金	14,074,000.00	75.14%

注：前十名持有人为除华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金之外的前十名持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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、基金投资和相关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





## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年1月26日）基金份额总额	348,427,447.00
本报告期期初基金份额总额	18,729,161.00
本报告期期间基金总申购份额	1,000,000.00
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,000,000.00
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

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019年3月11日，公司股东批准Anthony Gerard Fasso先生为公司董事。上述人事变动已按相关规定备案、报告。

2019年4月4日，公司股东批准王永筠女士为公司监事。

2019年4月15日，经公司董事会批准刘万方先生为公司副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

国泰君安	2	14,937,692.68	100.00%	13,911.67	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，本基金未新增租用专用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	53,514.20	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2019年6月25日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-

个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20190101-20190630	14,500,000.00	83,300.00	509,300.00	14,074,000.00	75.14%

产品特有风险

本基金报告期内本基金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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 备查文件目录

### 11.3 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

### 11.4 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

### 11.5 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019年8月29日