

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF
基金主代码	510220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,729,161.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011-03-28

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	上证中小盘指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-278,769.97
本期利润	212,896.15
加权平均基金份额本期利润	0.0165
本期基金份额净值增长率	3.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.3388
期末基金资产净值	70,875,223.08
期末基金份额净值	3.9977

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

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

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

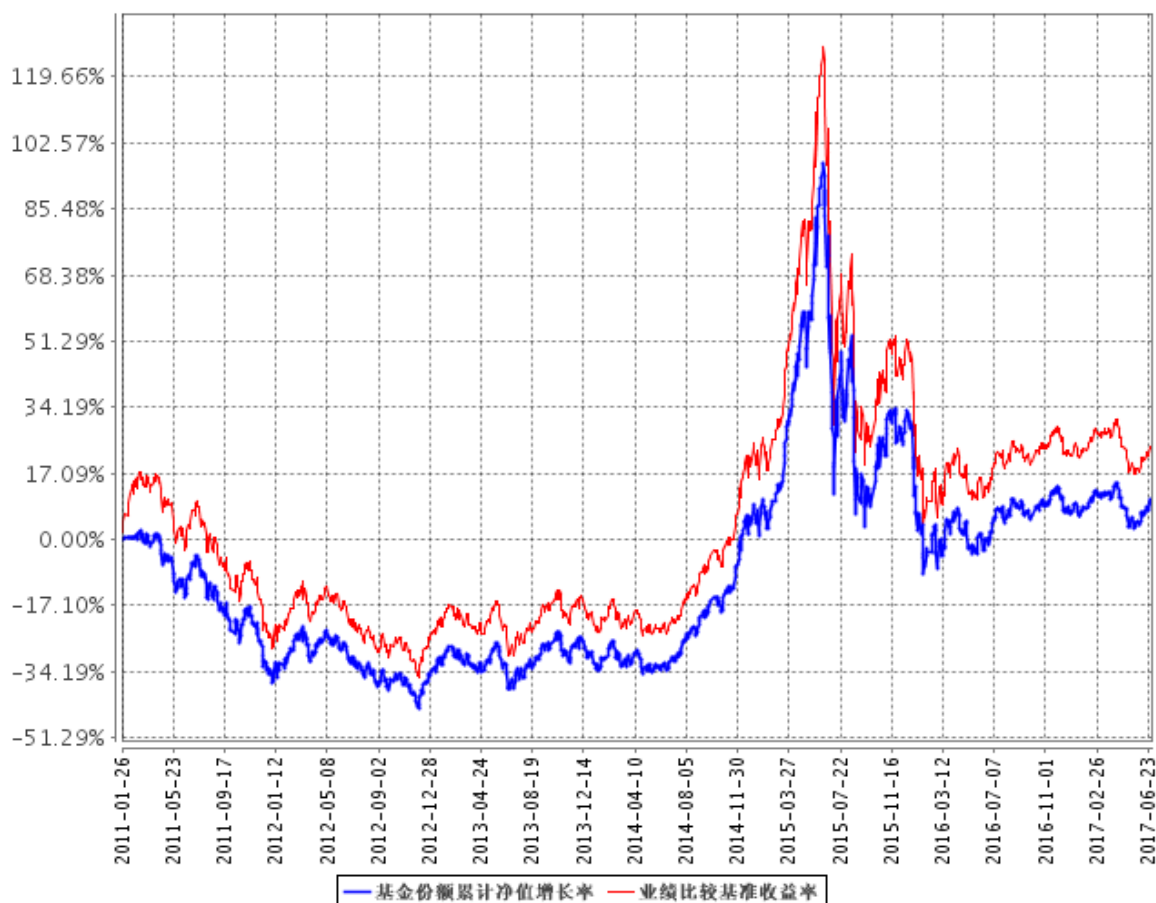
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.47%	0.65%	4.75%	0.65%	0.72%	0.00%
过去三个月	-0.42%	0.77%	-1.95%	0.77%	1.53%	0.00%
过去六个月	3.19%	0.67%	1.98%	0.67%	1.21%	0.00%
过去一年	8.43%	0.75%	7.37%	0.75%	1.06%	0.00%
过去三年	61.07%	2.02%	58.57%	1.99%	2.50%	0.03%
自基金合同生效起至今	10.33%	1.68%	24.15%	1.68%	-13.82%	0.00%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2011 年 1 月 26 日至 2017 年 6 月 30 日。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资

资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 916.45 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳军	指数投资部总监、本基金的基金经理	2011 年 1 月 26 日	—	16 年	16 年证券(基金)从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月起加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010 年 10 月起任指数投资部副总监。2011 年 1 月起担任上证中小盘 ETF 及华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起担任华泰柏瑞沪深 300ETF 及华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的累计跟踪偏离为 1.210%，日均绝对跟踪偏离度为 0.021%，期间日跟踪误差为 0.030%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.9977 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.19%，业绩比较基准收益率为 1.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		1,143,044.97	478,516.28
结算备付金		8,105.58	-
存出保证金		3,158.58	1.28
交易性金融资产		69,844,189.76	23,926,994.40
其中：股票投资		69,844,189.76	23,926,994.40
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		50,756.45	-
应收利息		162.50	104.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		71,049,417.84	24,405,616.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		28,239.69	10,419.02
应付托管费		5,647.92	2,083.82
应付销售服务费		-	-

应付交易费用		10,965.80	3,810.98
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		129,341.35	260,000.00
负债合计		174,194.76	276,313.82
所有者权益：			
实收基金		64,868,011.39	22,791,450.01
未分配利润		6,007,211.69	1,337,852.99
所有者权益合计		70,875,223.08	24,129,303.00
负债和所有者权益总计		71,049,417.84	24,405,616.82

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

6.2 利润表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		568,761.65	-6,871,017.44
1.利息收入		4,890.91	1,694.66
其中：存款利息收入		4,889.70	1,689.37
债券利息收入		1.21	5.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		46,604.52	-1,643,577.16
其中：股票投资收益		-457,772.10	-1,858,052.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益		273.59	5,079.71
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		504,103.03	209,395.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		491,666.12	-5,226,805.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		25,600.10	-2,329.49

减：二、费用		355,865.50	324,753.94
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	124,867.65	66,668.55
2. 托管费	6.4.8.2.2	24,973.53	13,333.69
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		25,593.61	8,899.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		180,430.71	235,852.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		212,896.15	-7,195,771.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		212,896.15	-7,195,771.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,791,450.01	1,337,852.99	24,129,303.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	212,896.15	212,896.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	42,076,561.38	4,456,462.55	46,533,023.93
其中：1. 基金申购款	42,076,561.38	4,456,462.55	46,533,023.93
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	64,868,011.39	6,007,211.69	70,875,223.08

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	26,450,281.43	7,661,261.37	34,111,542.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-7,195,771.38	-7,195,771.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	61,778.37	61,778.37
其中：1. 基金申购款	3,658,831.42	232,939.80	3,891,771.22
2. 基金赎回款	-3,658,831.42	-171,161.43	-3,829,992.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-320,937.38	-320,937.38
五、期末所有者权益（基金净值）	26,450,281.43	206,330.98	26,656,612.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

基金管理人负责人

房伟力

主管会计工作负责人

赵景云

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 348,418,327.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 022 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

348,427,447.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,120.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2011 年 3 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.27331199，并于 2011 年 3 月 14 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]第 55 号文审核同意，本基金 95,229,161.00 份基金份额于 2011 年 3 月 28 日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩基准为上证中小盘指数。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2017 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本年度采用的会计政策和会计估计与上年度相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	124,867.65	66,668.55
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,973.53	13,333.69

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.2.3 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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
上证中小盘 ETF 联接基金	14,026,177.00	79.1100%	2,599,377.00	41.7300%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,143,044.97	4,747.26	302,763.65	1,642.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	874	8,416.62	8,416.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大资产重组	3.60	-	-	157,600	512,216.00	567,360.00	-
601727	上海电气	2017 年 6 月 22 日	审核公司资产重组事项	7.57	2017 年 7 月 3 日	7.54	41,300	329,662.00	312,641.00	-
600643	爱建集团	2017 年 4 月 17 日	重大资产重组	14.98	2017 年 8 月 2 日	16.48	20,340	290,233.01	304,693.20	-
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大资产重组	5.35	2017 年 7 月 27 日	6.48	54,300	316,398.00	290,505.00	-
600666	奥瑞	2017 年	重大	17.40	-	-	10,560	192,626.00	183,744.00	-

	德	5月31日	资产重组							
601872	招商轮船	2017年5月2日	发行股份购买资产	5.16	-	-	27,591	169,947.66	142,369.56	-
600172	黄河旋风	2017年6月30日	重大事项	8.23	2017年7月14日	8.00	13,420	133,361.06	110,446.60	-
601717	郑煤机	2017年4月24日	重大资产重组	7.79	-	-	13,600	117,697.05	105,944.00	-
601608	中信重工	2017年4月19日	发行股票购买资产	5.54	2017年7月26日	5.26	17,509	120,186.82	96,999.86	-
600255	鑫科材料	2017年6月26日	重大资产重组	4.04	-	-	23,543	114,986.07	95,113.72	-
600568	中珠医疗	2017年4月25日	重大资产重组	19.16	2017年7月26日	-	4,874	95,260.37	93,385.84	-
600634	富控互动	2017年4月19日	重大资产重组	18.03	2017年7月17日	17.21	5,000	91,050.00	90,150.00	-
601069	西部黄金	2017年5月26日	发行股票及支付现金购买资产	26.26	-	-	3,200	63,852.09	84,032.00	-
600289	亿阳信通	2017年6月26日	发行股票购买资产	10.94	2017年8月18日	12.03	6,804	102,470.55	74,435.76	-
600057	象屿股份	2017年6月27日	筹划配股事项	10.17	2017年7月4日	10.07	7,190	79,384.28	73,122.30	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	重大事项	7.29	-	-	8,954	77,655.36	65,274.66	-
600653	申华控股	2017年5月8日	重大资产	3.26	2017年8月24日	3.59	19,800	86,699.49	64,548.00	-

		日	重组							
601001	大同煤业	2017 年 6 月 22 日	重大事项	5.25	2017 年 7 月 21 日	5.78	11,588	75,860.10	60,837.00	-
600460	士兰微	2017 年 5 月 22 日	重大资产重组	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	9,900	68,737.05	60,093.00	-
600490	鹏欣资源	2017 年 2 月 21 日	重大资产重组	7.91	-	-	7,448	65,249.97	58,913.68	-
600655	豫园商城	2017 年 5 月 17 日	重大资产重组	11.32	-	-	5,053	81,197.45	57,199.96	-
603126	中材节能	2017 年 6 月 27 日	发行股份购买资产	16.46	-	-	3,435	45,698.16	56,540.10	-
600654	*ST 中安	2017 年 6 月 7 日	重大资产重组	13.48	-	-	3,937	130,546.36	53,070.76	-
603501	韦尔股份	2017 年 6 月 5 日	重大资产重组	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-
600277	亿利洁能	2017 年 3 月 6 日	重大资产重组	7.83	-	-	4,262	40,441.53	33,371.46	-
603861	白云电器	2017 年 6 月 15 日	重大资产重组	24.27	-	-	1,200	35,221.41	29,124.00	-
600636	*ST 爱富	2016 年 5 月 9 日	重大资产重组	13.86	2017 年 8 月 4 日	14.55	1,498	23,061.13	20,762.28	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	69,844,189.76	98.30
	其中：股票	69,844,189.76	98.30
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,151,150.55	1.62
7	其他各项资产	54,077.53	0.08
8	合计	71,049,417.84	100.00

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	204,680.57	0.29
B	采矿业	3,971,274.72	5.60
C	制造业	33,266,964.28	46.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,309,252.24	7.49
E	建筑业	2,498,417.56	3.53
F	批发和零售业	4,196,087.13	5.92
G	交通运输、仓储和邮政业	4,946,271.49	6.98
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,243,458.61	4.58
J	金融业	5,971,897.38	8.43
K	房地产业	3,254,914.31	4.59
L	租赁和商务服务业	1,124,418.44	1.59
M	科学研究和技术服务业	178,833.80	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	101,449.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	63,903.00	0.09
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,011,479.14	1.43
S	综合	500,888.09	0.71
	合计	69,844,189.76	98.55

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期没有通过沪港通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	89,842	1,381,769.96	1.95
2	600276	恒瑞医药	23,382	1,182,895.38	1.67
3	600015	华夏银行	88,560	816,523.20	1.15
4	600019	宝钢股份	120,355	807,582.05	1.14
5	600703	三安光电	33,105	652,168.50	0.92
6	600690	青岛海尔	42,200	635,110.00	0.90
7	600585	海螺水泥	27,700	629,621.00	0.89
8	601939	建设银行	92,829	570,898.35	0.81
9	600795	国电电力	157,600	567,360.00	0.80
10	601009	南京银行	49,421	554,009.41	0.78

注：1、股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www. Huatai-pb.com](http://www.Huatai-pb.com) 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601377	兴业证券	476,192.00	1.97
2	600637	东方明珠	375,830.00	1.56
3	600893	航发动力	349,879.00	1.45
4	600109	国金证券	344,180.00	1.43
5	601727	上海电气	320,250.00	1.33
6	600900	长江电力	296,636.00	1.23
7	600585	海螺水泥	279,296.00	1.16
8	601998	中信银行	257,607.00	1.07
9	600276	恒瑞医药	227,480.00	0.94
10	600886	国投电力	213,770.00	0.89
11	600406	国电南瑞	192,694.00	0.80
12	600271	航天信息	184,680.00	0.77
13	600867	通化东宝	165,518.00	0.69
14	600690	青岛海尔	164,424.00	0.68
15	600660	福耀玻璃	164,081.00	0.68
16	600977	中国电影	150,202.00	0.62
17	600208	新湖中宝	149,954.66	0.62
18	601997	贵阳银行	149,815.00	0.62
19	600649	城投控股	148,410.00	0.62
20	600909	华安证券	146,550.00	0.61

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600340	华夏幸福	445,313.55	1.85
2	600606	绿地控股	274,720.00	1.14
3	600959	江苏有线	216,480.40	0.90
4	600252	中恒集团	158,638.01	0.66
5	600240	华业资本	129,646.00	0.54
6	600064	南京高科	110,887.00	0.46
7	601928	凤凰传媒	101,810.24	0.42
8	600401	*ST 海润	90,915.00	0.38
9	600851	海欣股份	86,846.72	0.36
10	600261	阳光照明	79,897.60	0.33
11	600812	华北制药	76,577.10	0.32
12	600805	悦达投资	67,918.46	0.28
13	600063	皖维高新	66,952.80	0.28
14	600220	江苏阳光	65,561.68	0.27
15	600586	金晶科技	65,393.32	0.27
16	600133	东湖高新	65,212.05	0.27
17	603866	桃李面包	62,562.00	0.26
18	600053	九鼎投资	61,380.00	0.25
19	601369	陕鼓动力	60,876.80	0.25
20	603868	飞科电器	60,150.00	0.25

注：不考虑相关交易费用。本基金基金合同于报告期内生效，占比计算采用期末基金资产净值。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

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

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,158.58
2	应收证券清算款	50,756.45
3	应收股利	—
4	应收利息	162.50
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	54,077.53

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
524	33,834.28	437,645.00	2.47%	3,265,339.00	18.42%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
本基金的联接基金	14,026,177.00	79.11%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	福建省嘉诚资产管理有限公司—嘉诚 2 号私募证券投资基金	413,272.00	2.33%
2	徐钧	108,134.00	0.61%
3	陈密	107,800.00	0.61%
4	钟鸣	100,000.00	0.56%
5	郭秀琴	100,000.00	0.56%
6	沈曙明	96,295.00	0.54%
7	薛成奇	94,700.00	0.53%
8	刘飞跃	67,900.00	0.38%
9	王秀芬	65,240.00	0.37%
10	邝紫葡	64,351.00	0.36%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：1、本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 1 月 26 日）基金份额总额	348,427,447.00
本报告期期初基金份额总额	6,229,161.00
本报告期基金总申购份额	11,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	17,729,161.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	19,833,085.94	100.00%	18,471.04	100.00%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	4,274.80	100.00%	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

产品特有风险

本基金期内共有 1 家机构持有基金份额超过 20%, 累计达 79.11%, 本期共赎回 500,000.00 份, 如果这些份额持有比例较大的投资者赎回, 可能导致巨额赎回, 从而引发流动性风险, 可能对基金产生如下影响: (1) 延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时, 投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。(2) 基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现, 这将对基金资产净值产生不利影响, 同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题, 这些都可能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。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2017 年 8 月 26 日