

# 上证红利交易型开放式指数证券投资基金

## 2017 年半年度报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。

基金托管人招商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、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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	错误！未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b>	10
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遵规守信情况的说明	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	13
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	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§5 托管人报告</b>	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	16
6.1 资产负债表	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	39
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 .....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	43
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 .....	44
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 .....	44
7.8 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 .....	44
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 .....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
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 .....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49

---

10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
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 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞上证红利 ETF
基金主代码	510880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 17 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	456,675,703.00 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	2007 年 1 月 18 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	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。
业绩比较基准	上证红利指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证红利指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 陈晖 联系电话 021-38601777	张燕 0755-83199084

	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95555
传真		021-38601799	0755-83195201
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	深圳深南大道 7088 号招商银行 大厦	
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	深圳深南大道 7088 号招商银行 大厦	
邮政编码	200135	518040	
法定代表人	贾波	李建红	

## 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

## 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(2017 年 1 月 1 日 – 2017 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	39,331,596.43
本期利润	134,836,757.43
加权平均基金份额本期利润	0.3345
本期加权平均净值利润率	12.18%
本期基金份额净值增长率	12.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	632,417,548.73
期末可供分配基金份额利润	1.3848
期末基金资产净值	1,329,335,386.23
期末基金份额净值	2.9109
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	134.12%

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。

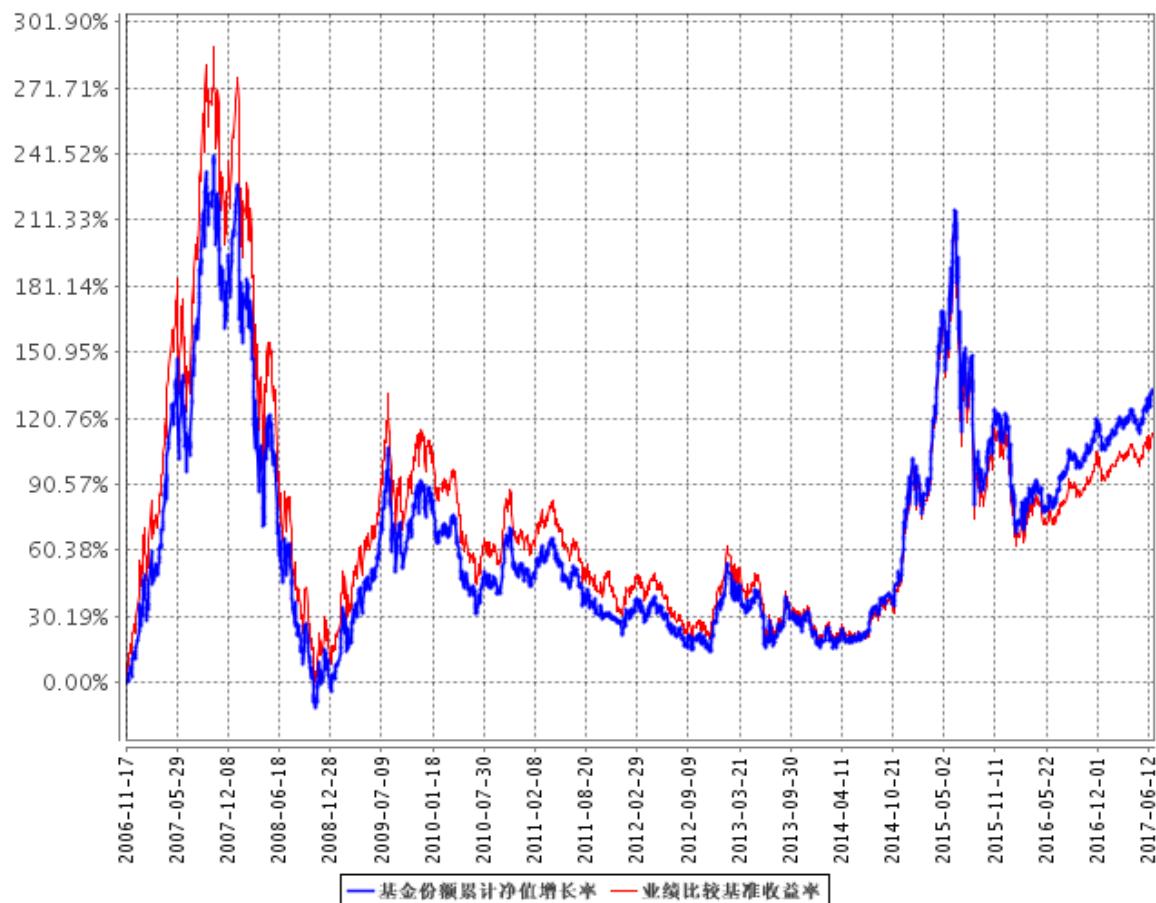
### 3.2 基金净值表现

#### 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	4.04%	0.59%	2.44%	0.67%	1.60%	-0.08%
过去三个月	5.67%	0.56%	3.69%	0.58%	1.98%	-0.02%
过去六个月	12.93%	0.54%	10.74%	0.55%	2.19%	-0.01%
过去一年	27.30%	0.65%	22.17%	0.66%	5.13%	-0.01%
过去三年	92.49%	1.80%	75.91%	1.81%	16.58%	-0.01%
自基金合同生效起至今	134.12%	1.93%	113.61%	1.95%	20.51%	-0.02%

### 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 2006 年 11 月 17 日至 2017 年 6 月 30 日。

按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 3 个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十六条（二）投资范围及投资比例中规定的比例，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、华泰柏瑞添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证

券投资基金、华泰柏瑞享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	2009 年 6 月 4 日	-	16	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。
龚丽丽	本基金的基金经理	2015 年 6 月 3 日	-	6	上海交通大学数学系硕士。2011 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部研究员、基金经理助理。2015 年 6 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

注：1、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。

2、龚丽丽于 2017 年 8 月 10 日离任。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《上证红利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

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。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。

### 4.3.2 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 2.188%，日均绝对跟踪偏离度为 0.023%，期间日跟踪误差为 0.058%，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 2.9109 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.93%，业绩比较基准收益率为 10.74%。

#### 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。本基金已于 2017 年 1 月对 2016 年度可分配利润实施了分红，每 10 份基金份额派发现金红利 0.91 元。

#### **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**

本基金本报告期内无对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

## § 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：上证红利交易型开放式指数证券投资基金管理人

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	12,160,225.78	4,871,603.30
结算备付金		79,317.63	—
存出保证金		37,693.57	8,941.11
交易性金融资产	6.4.7.2	1,318,499,960.03	822,240,261.30
其中：股票投资		1,318,499,960.03	822,240,261.30
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		65,063.82	762.60
应收利息	6.4.7.5	1,796.41	901.14
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		1,330,844,057.24	827,122,469.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		526,629.62	342,097.51
应付托管费		105,325.90	68,419.50
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	54,550.72	392,089.65

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	822, 164. 77	680, 000. 00
负债合计		1, 508, 671. 01	1, 482, 606. 66
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	696, 917, 837. 50	472, 585, 950. 75
未分配利润	6.4.7.10	632, 417, 548. 73	353, 053, 912. 04
所有者权益合计		1, 329, 335, 386. 23	825, 639, 862. 79
负债和所有者权益总计		1, 330, 844, 057. 24	827, 122, 469. 45

注: 报告截止日 2017 年 6 月 30 日, 基金份额净值 2.9109 元, 基金份额总额 456, 675, 703. 00 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 上证红利交易型开放式指数证券投资基金管理人

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
<b>一、收入</b>		138, 598, 123. 54	-94, 023, 047. 14
1.利息收入		20, 813. 93	11, 192. 14
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	20, 673. 66	11, 192. 14
债券利息收入		140. 27	—
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)		43, 275, 196. 85	3, 321, 076. 70
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	19, 689, 735. 99	-7, 229, 890. 43
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	45, 619. 73	—
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	23, 539, 841. 13	10, 550, 967. 13
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.17	95, 505, 161. 00	-97, 306, 171. 58
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	-203, 048. 24	-49, 144. 40

<b>减：二、费用</b>		3,761,366.11	2,064,618.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,723,841.47	1,432,924.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	544,768.32	286,584.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	—	—
4. 交易费用	6.4.7.19	185,998.43	79,324.29
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.20	306,757.89	265,784.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		134,836,757.43	-96,087,665.53
<b>减：所得税费用</b>		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		134,836,757.43	-96,087,665.53

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证红利交易型开放式指数证券投资基金管理人

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）	472,585,950.75	353,053,912.04	825,639,862.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	134,836,757.43	134,836,757.43
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)	224,331,886.75	173,662,868.04	397,994,754.79
其中：1. 基金申购款	419,668,495.83	332,355,264.44	752,023,760.27
2. 基金赎回款	-195,336,609.08	-158,692,396.40	-354,029,005.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	-29,135,988.78	-29,135,988.78
五、期末所有者权益（基金净值）	696,917,837.50	632,417,548.73	1,329,335,386.23

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）	346,685,402.02	297,675,443.77	644,360,845.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-96,087,665.53	-96,087,665.53
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)	25,943,143.40	15,134,848.60	41,077,992.00
其中：1. 基金申购款	64,857,858.51	37,363,915.57	102,221,774.08
2. 基金赎回款	-38,914,715.11	-22,229,066.97	-61,143,782.08
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）	-	-11,958,785.15	-11,958,785.15
五、期末所有者权益（基金净值）	372,628,545.42	204,763,841.69	577,392,387.11

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

上证红利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[2006]第 196 号《关于同意上证红利交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》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《上证红利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 2,222,962,819.00 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(2006)第 170 号验资

报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,222,985,094.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 22,275.00 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。根据《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证红利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 2007 年 1 月 10 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.65527799,并于 2007 年 1 月 11 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[2007]第 4 号文审核同意,本基金 1,456,675,703 份基金份额于 2007 年 1 月 18 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《上证红利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,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的业绩基准为上证红利指数。

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(以下简称“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》、《上证红利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 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度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、会计估值与最近一期年度报告相一致。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计估计变更。

### 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) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券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) 对于内地投资者持有的基金类别，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 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	12,160,225.78
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	12,160,225.78

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,235,663,782.67	1,318,499,960.03	82,836,177.36
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	1,235,663,782.67	1,318,499,960.03	82,836,177.36

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

#### 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，本基金未持有买入返售金融资产。

#### 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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,743.71
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	35.70
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	17.00
合计	1,796.41

#### 6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	54,550.72
银行间市场应付交易费用	—
合计	54,550.72

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 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	518,190.07
上交所可退替代款	289,201.50
上交所应付替代款	14,773.20

合计	822,164.77
----	------------

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	账面金额
上年度末	309,675,703.00	472,585,950.75
本期申购	275,000,000.00	419,668,495.83
本期赎回(以"-"号填列)	-128,000,000.00	-195,336,609.08
- 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	456,675,703.00	696,917,837.50

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	567,503,995.34	-214,450,083.30	353,053,912.04
本期利润	39,331,596.43	95,505,161.00	134,836,757.43
本期基金份额交易产生的变动数	258,701,149.65	-85,038,281.61	173,662,868.04
其中：基金申购款	485,381,676.89	-153,026,412.45	332,355,264.44
基金赎回款	-226,680,527.24	67,988,130.84	-158,692,396.40
本期已分配利润	-29,135,988.78	-	-29,135,988.78
本期末	836,400,752.64	-203,983,203.91	632,417,548.73

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		17,143.66
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		3,213.22
其他		316.78

合计	20,673.66
----	-----------

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,824,927.82
股票投资收益——赎回差价收入	12,864,808.17
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	19,689,735.99

##### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	64,369,892.39
减：卖出股票成本总额	57,544,964.57
买卖股票差价收入	6,824,927.82

##### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	354,029,005.48
减：现金支付赎回款总额	-90,340.52
减：赎回股票成本总额	341,254,537.83
赎回差价收入	12,864,808.17

##### 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 2017年1月1日至2017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	45,619.73
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	45,619.73

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,645,760.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,600,000.00
减：应收利息总额	140.27
买卖债券差价收入	45,619.73

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	-90,340.52
减：现金支付赎回款总额	-90,340.52
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应收利息总额	-
赎回差价收入	-

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 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：本基金本报告期内未持有贵金属。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内未持有贵金属。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未持有贵金属。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未持有贵金属。

#### 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：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 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。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	23,539,841.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,539,841.13

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	95,505,161.00
——股票投资	95,505,161.00
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	95,505,161.00

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	-203,048.24
合计	-203,048.24

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	185,998.43
银行间市场交易费用	—
合计	185,998.43

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
上市费	29,752.78
银行划款手续费	1,159.85
分红手续费	87,407.97
合计	306,757.89

### 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。

### 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

截至资产负债表日，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

截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需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
招商银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、一级交易商

注：1、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：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本报告期及上年度可比期间本基金未支付关联方佣金。

#### 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 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	2,723,841.47	1,432,924.84
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： $H = E \times 0.50\% \div$  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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 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	544,768.32	286,584.99

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： $H = E \times 0.10\% \div$  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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内无销售服务费。

#### 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：本基金本报告期内以及上年度可比期间内均未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：本报告期内以及上年度可比期间内，基金管理公司未投资本基金。

##### 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 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
华泰证券股份 有限公司	1,383,135.00	0.3000%	-	-

#### 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 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
招商银行股份有限 公司	12,160,225.78	17,143.66	4,455,177.12	8,952.16

注：本报告期，基金托管人招商银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

#### 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：本基金在本报告期内及上年可比期间内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内未有其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2017 年 1 月 23 日	2017 年 1 月 23 日	0.91	29,135,988.78		-29,135,988.78	
合计	-	-	0.91	29,135,988.78		-29,135,988.78	

#### 6.4.12 期末（2017 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
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	999	9,620.37	9,620.37	-
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	-

#### 6.4.12.2 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
601088	中国神华	2017年6月5日	临时停牌	22.29	-	-	1,193,541	20,195,394.25	26,604,028.89	-
600795	国电电力	2017年6月5日	临时停牌	3.60	-	-	6,755,893	23,757,196.00	24,321,214.80	-

#### 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 2017 年 6 月 30 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

#### 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

本基金为指数型股票基金，采用完全复制策略，跟踪上证红利指数。本基金在日常经营活动 中面临的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，它是风险管理工作的运作基础；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。本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与该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，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2016 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 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

### **6.4.13.3 流动性风险**

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要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。针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 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下，其余金融资产

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。此外，由于本基金的申购赎回采用股票交付方式进行，申购赎回对本基金的流动性风险影响小。本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为三个月以内且不计息，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。

#### 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。

本基金为指数型股票基金，仅投资少量债券。本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，并针对敏感性大小进行利率风险管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	12,160,225.78	-	-	-	-	-	12,160,225.78
结算备付金	79,317.63	-	-	-	-	-	79,317.63
存出保证金	37,693.57	-	-	-	-	-	37,693.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,318,499,960.03	1,318,499,960.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	65,063.82	65,063.82
应收利息	-	-	-	-	-	1,796.41	1,796.41
资产总计	12,277,236.98	-	-	-	-	1,318,566,820.26	1,330,844,057.24
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	526,629.62	526,629.62
应付托管费	-	-	-	-	-	105,325.90	105,325.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	54,550.72	54,550.72

其他负债	-	-	-	-	-	822,164.77	822,164.77
负债总计	-	-	-	-	-	1,508,671.01	1,508,671.01
利率敏感度缺口	12,277,236.98	-	-	-	-	-1,317,058,149.25	1,329,335,386.23
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,871,603.30	-	-	-	-	-	4,871,603.30
存出保证金	8,941.11	-	-	-	-	-	8,941.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	822,240,261.30	822,240,261.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	762.60	762.60
应收利息	-	-	-	-	-	901.14	901.14
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,880,544.41	-	-	-	-	822,241,925.04	827,122,469.45
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	342,097.51	342,097.51
应付托管费	-	-	-	-	-	68,419.50	68,419.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	392,089.65	392,089.65
其他负债	-	-	-	-	-	680,000.00	680,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,482,606.66	1,482,606.66
利率敏感度缺口	4,880,544.41	-	-	-	-	820,759,318.38	825,639,862.79

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 年 12 月 31 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（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金本报告期末未持有外汇。

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金以标的指数成份股、备选成份股为

主要投资对象，指数化投资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%，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，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,318,499,960.03	99.18	822,240,261.30	99.59
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	1,318,499,960.03	99.18	822,240,261.30	99.59

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“上证红利指数”外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动		对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）
	本期末（2017 年 6 月 30 日）		上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	上证红利指数上升 5%	6,459.19	4,087
	上证红利指数下降 5%	-6,459.19	-4,087

#### **6.4.13.4.4 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。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

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	1,318,499,960.03	99.07
	其中：股票	1,318,499,960.03	99.07
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	12,239,543.41	0.92
7	其他各项资产	104,553.80	0.01
8	合计	1,330,844,057.24	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	—	—
B	采矿业	66,050,906.40	4.97
C	制造业	379,563,550.64	28.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	225,712,659.63	16.98
E	建筑业	31,767,121.50	2.39
F	批发和零售业	12,004,201.89	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	115,103,903.44	8.66
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	412,009,949.80	30.99
K	房地产业	76,287,666.73	5.74

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学、研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,318,499,960.03	99.18

### 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：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 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	600104	上汽集团	1,864,019	57,877,789.95	4.35
2	600741	华域汽车	2,234,070	54,153,856.80	4.07
3	600660	福耀玻璃	2,024,600	52,720,584.00	3.97
4	601006	大秦铁路	5,246,662	44,019,494.18	3.31
5	601398	工商银行	8,305,704	43,604,946.00	3.28
6	601288	农业银行	11,503,322	40,491,693.44	3.05
7	600066	宇通客车	1,826,222	40,122,097.34	3.02
8	601939	建设银行	6,470,553	39,793,900.95	2.99
9	600004	白云机场	2,085,361	38,495,764.06	2.90
10	600036	招商银行	1,527,257	36,516,714.87	2.75
11	601988	中国银行	9,628,261	35,624,565.70	2.68
12	600011	华能国际	4,613,895	33,865,989.30	2.55
13	601328	交通银行	5,272,881	32,480,946.96	2.44
14	601818	光大银行	7,763,100	31,440,555.00	2.37
15	600177	雅戈尔	3,083,038	31,200,344.56	2.35
16	600027	华电国际	6,067,659	29,306,792.97	2.20
17	600900	长江电力	1,836,492	28,245,246.96	2.12

18	600886	国投电力	3,447,300	27,233,670.00	2.05
19	600023	浙能电力	4,922,618	26,877,494.28	2.02
20	601088	中国神华	1,193,541	26,604,028.89	2.00
21	600000	浦发银行	2,073,025	26,223,766.25	1.97
22	600585	海螺水泥	1,109,100	25,209,843.00	1.90
23	601166	兴业银行	1,446,868	24,394,194.48	1.84
24	600019	宝钢股份	3,634,406	24,386,864.26	1.83
25	600795	国电电力	6,755,893	24,321,214.80	1.83
26	600028	中国石化	4,019,607	23,836,269.51	1.79
27	600183	生益科技	1,873,796	23,122,642.64	1.74
28	600015	华夏银行	2,450,548	22,594,052.56	1.70
29	600887	伊利股份	1,045,000	22,561,550.00	1.70
30	601601	中国太保	629,724	21,328,751.88	1.60
31	601668	中国建筑	2,167,342	20,979,870.56	1.58
32	600642	申能股份	3,251,241	20,482,818.30	1.54
33	600018	上港集团	3,174,511	20,126,399.74	1.51
34	600048	保利地产	2,015,097	20,090,517.09	1.51
35	600999	招商证券	1,149,500	19,794,390.00	1.49
36	601877	正泰电器	977,610	19,640,184.90	1.48
37	601009	南京银行	1,741,982	19,527,618.22	1.47
38	601158	重庆水务	2,577,363	18,428,145.45	1.39
39	600016	民生银行	2,190,500	18,005,910.00	1.35
40	600863	内蒙华电	5,631,657	16,951,287.57	1.28
41	600398	海澜之家	1,775,400	16,848,546.00	1.27
42	600312	平高电气	1,219,100	16,750,434.00	1.26
43	600583	海油工程	2,501,700	15,610,608.00	1.17
44	600894	广日股份	1,303,327	15,431,391.68	1.16
45	600376	首开股份	1,253,480	14,339,811.20	1.08
46	600012	皖通高速	922,446	12,462,245.46	0.94
47	600694	大商股份	308,037	12,004,201.89	0.90
48	601800	中国交建	676,430	10,748,472.70	0.81
49	600743	华远地产	2,525,354	10,656,993.88	0.80
50	600481	双良节能	1,973,408	10,478,796.48	0.79
51	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
52	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
53	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
54	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
55	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
56	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00

57	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
58	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
59	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
60	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
61	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
62	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
63	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	600004	白云机场	16,491,480.68	2.00
2	600019	宝钢股份	12,337,844.00	1.49
3	600741	华域汽车	10,176,567.50	1.23
4	600104	上汽集团	2,428,958.00	0.29
5	600481	双良节能	1,827,000.00	0.22
6	601877	正泰电器	1,805,534.00	0.22
7	600018	上港集团	1,246,763.00	0.15
8	600887	伊利股份	651,379.00	0.08
9	600011	华能国际	400,410.00	0.05
10	601398	工商银行	395,285.00	0.05
11	600694	大商股份	391,639.00	0.05
12	601288	农业银行	387,366.00	0.05
13	600023	浙能电力	385,534.00	0.05
14	600660	福耀玻璃	385,524.00	0.05
15	601939	建设银行	374,045.00	0.05
16	600066	宇通客车	371,134.80	0.04
17	601328	交通银行	356,736.00	0.04
18	600048	保利地产	353,034.00	0.04
19	601881	中国银河	335,876.01	0.04
20	601988	中国银行	334,335.00	0.04

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	601166	兴业银行	2,507,785.83	0.30
2	600104	上汽集团	2,461,118.00	0.30
3	600660	福耀玻璃	1,803,512.59	0.22
4	601398	工商银行	1,779,301.00	0.22
5	601006	大秦铁路	1,755,194.00	0.21
6	601939	建设银行	1,680,706.83	0.20
7	601288	农业银行	1,673,088.00	0.20
8	600066	宇通客车	1,573,806.24	0.19
9	601988	中国银行	1,549,570.00	0.19
10	600011	华能国际	1,542,612.97	0.19
11	601328	交通银行	1,475,330.00	0.18
12	601818	光大银行	1,446,054.19	0.18
13	600027	华电国际	1,405,243.00	0.17
14	600177	雅戈尔	1,398,593.00	0.17
15	600036	招商银行	1,392,053.00	0.17
16	600741	华域汽车	1,387,067.39	0.17
17	600023	浙能电力	1,337,456.00	0.16
18	600000	浦发银行	1,222,696.10	0.15
19	601877	正泰电器	1,137,026.94	0.14
20	600886	国投电力	1,131,810.00	0.14

注：不考虑相关交易费用。

### 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	57,545,213.13
卖出股票收入（成交）总额	64,369,892.39

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 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。

## 7.8 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。

## 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

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。

### 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	37,693.57
2	应收证券清算款	65,063.82
3	应收股利	—
4	应收利息	1,796.41
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	104,553.80

### 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：报告期末前十名股票中不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
38,599	11,831.28	92,282,720.00	20.21%	364,392,983.00	79.79%

### 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	招商基金—工商银行—永安 2 号特 定客户资产管理计划	21,521,600.00	4.71%
2	永安国富资产管理有限公司—永安 国富—永富 7 号私募资产管理计划	7,378,400.00	1.62%
3	永安国富资产管理有限公司—永安 国富—永富 8 号资产管理计划	7,311,000.00	1.60%
4	上海平安阖鼎投资管理有限责任公 司—平安阖鼎—全天候私募菁英组 合 1 号证券投资基金	6,603,000.00	1.45%
5	中国农业银行股份有限公司企业年 金计划—中行	3,718,600.00	0.81%
6	潘卫国	3,642,900.00	0.80%
7	海南洋浦海悦药业有限公司	3,600,000.00	0.79%
8	永安国富资产管理有限公司—永安 国富—升华 1 号私募投资基金	3,512,854.00	0.77%
9	蒋荣方	3,381,103.00	0.74%
10	上海奇宇建筑工程设计咨询有限公 司	2,400,000.00	0.53%

### 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**

注：1、期末基金从业人员持有本基金份额为 0。  
2、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。  
3、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（2006 年 11 月 17 日）基金份额总额	2,222,985,094.00
本报告期期初基金份额总额	309,675,703.00
本报告期基金总申购份额	275,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	128,000,000.00
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	456,675,703.00

## § 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，基金管理人及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

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	
光大证券	1	119,240,728.37	100.00%	111,048.78	100.00%	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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、本基金在本报告期内未增加交易单元。

### 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
光大证券	1,645,760.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

## 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	上证红利交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 24 日
2	上证红利交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
3	上证红利交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
4	关于旗下上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值计算位数变更及修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 9 日
5	上证红利交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日
6	华泰柏瑞基金关于上证红利交易型开放式指数证券投资基金收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 17 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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上证红利交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《上证红利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、上证红利交易型开放式指数证券投资基金的公告

### 12.2 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

### 12.3 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日