

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更新的招募说明书(摘要)

2015年第2号

投资组合报告截止日为2015年6月30日。
1. 期末总资产资产净值情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的 比例(%) |
|----|--------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 424,926.80 | 1.87 |
| | 其中:股票 | 424,926.80 | 1.87 |
| 2 | 基金投资 | 19,833,349.33 | 87.15 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 贵金属投资 | - | - |
| 6 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 7 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融 资产 | - | - |
| 8 | 其他资产 | 2,196,874.47 | 9.66 |
| 9 | 合计 | 22,766,886.36 | 100.00 |

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 154,673.80 | 0.73 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应 业 | 74,715.00 | 0.36 |
| E | 建筑业 | 15,696.00 | 0.07 |
| F | 批发和零售业 | 10,914.00 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 36,168.00 | 0.17 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务 业 | 28,704.00 | 0.13 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 71,523.00 | 0.34 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 32,523.00 | 0.15 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 国防服务业、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 | | 424,926.80 | 2.00 |

3. 报告期末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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产 净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|-----------|---------------|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 4,500 | 64,575.00 | 0.30 |
| 2 | 600747 | 大连控股 | 5,000 | 44,408.00 | 0.21 |
| 3 | 600967 | 太钢实业 | 6,400 | 37,120.00 | 0.17 |
| 4 | 600675 | 皖江物流 | 8,800 | 36,168.00 | 0.17 |
| 5 | 600645 | 中钢国际 | 400 | 32,523.00 | 0.15 |
| 6 | 600040 | 华铁天成 | 600 | 28,704.00 | 0.13 |
| 7 | 600649 | 城投控股 | 2,900 | 27,115.00 | 0.13 |
| 8 | 600667 | 北方创业 | 1,200 | 20,544.00 | 0.10 |
| 9 | 600614 | 东方航空 | 600 | 17,928.00 | 0.08 |
| 10 | 600209 | 罗顿发展 | 1,200 | 15,696.00 | 0.07 |

4. 报告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。
5. 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债券投资明细
注:本基金本报告期末未持有债券。
6. 报告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. 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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
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十名股指期货投资明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货。
9. 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国债期货投资明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。
10. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
11. 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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
12. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细
注:本基金本报告期末未持有衍生品。

3. 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

8. 投资组合报告附注

1. 报告期内本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。
2. 本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。

1. 基金的投资组合

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 37,246.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 230,200.64 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 450.32 |
| 5 | 其他应收款 | 31,842.10 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 待转期货损益 | - |
| 8 | 合计 | 299,738.75 |

4. 报告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。
5. 报告期末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。

信息披露

华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”或“华泰柏瑞上证中小盘ETF联接”)根据2014年11月3日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金募集申请的批复》(证监许可[2014]1155号)和2014年12月19日《关于上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集时间安排的确认书》(基金通字[2014]748号)的核准,进行募集。本基金的基金合同于2015年1月20日正式生效。

华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”)在招募说明书中详细披露了基金的投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

(3)中国证券投资基金业协会为证券基金投资者开立基金账户,并协助投资者开立基金账户,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并自行承担基金投资中出现的各类风险,包括:政治风险、经济风险、社会风险、利率风险、汇率风险、信用风险、流动性风险、市场风险、基金管理人职责范围风险、由于基金投资者连续大额赎回基金产生的流动性风险。基金管理人引入基金投资过程中产生的基金管理风险,本基金特定的投资风险等。

本基金为上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金,跟踪标的ETF的基金份额净值,其投资目标紧密跟踪业绩比较基准,力求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

本基金主要投资于:(1)跟踪目标ETF;(2)标的指数的成份股和备选成份股;(3)中国证券投资基金业协会为证券基金投资者开立基金账户,并协助投资者开立基金账户,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并自行承担基金投资中出现的各类风险,包括:政治风险、经济风险、社会风险、利率风险、汇率风险、信用风险、流动性风险、市场风险、基金管理人职责范围风险、由于基金投资者连续大额赎回基金产生的流动性风险。基金管理人引入基金投资过程中产生的基金管理风险,本基金特定的投资风险等。

本基金为上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金,跟踪标的ETF的基金份额净值,其投资目标紧密跟踪业绩比较基准,力求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

本基金主要投资于:(1)跟踪目标ETF;(2)标的指数的成份股和备选成份股;(3)中国证券投资基金业协会为证券基金投资者开立基金账户,并协助投资者开立基金账户,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并自行承担基金投资中出现的各类风险,包括:政治风险、经济风险、社会风险