

## 上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金

## [2015]第四季度报告

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  
报告送出日期:2016年1月21日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月20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信息,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。

本报告所载的财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞上证中小盘ETF
交易代码	610220
基金运作方式	交易型开放式
报告期末基金份额总额	7,229,161,000.00
报告期目标	紧密跟踪的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金实行完全复制法,即完全按照所跟踪的标的指数的构成比例及其权重构建股票投资组合,并定期根据标的指数成份股及其权重的变动进行调整,在正常情况下,本基金的股票投资组合与标的指数的构成比例及其权重的变动相一致。但因受法律法规、交易市场、基金合同条款等的限制,基金管理人可能会适当调整股票投资组合,但调整后的股票投资组合与标的指数的构成比例及其权重的变动相一致。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。
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,一月方差不高于基金净值,供基金与货币市场基金等产品进行套利,属于股票型基金中的高风险、高收益品种。本基金的预期收益和风险高于货币市场基金,同时风险和收益特征与指数基金保持基本一致。
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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-603,174.39
2.本期利润	6,003,006.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.8011
4.期末基金份额净值	34,111,642.00
5.期末基金份额净值	47.19

注: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,计入股息后实际收益水平要低于净值。

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.本基金于2015年11月11日在申购并进行了基金份额折算,折算比例为2.73231199,期后份额折算净值(期初基金份额净值+基金费用分摊金额)与折算比例之积等于1.00元购买中小ETF的实际情况。

4.本基金净值表现

5.期末基金份额净值

注:上述股票投资包括可赎回替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	33,630,496.97	97.29
2	固定收益投资	33,630,496.97	97.29
3	其中:债券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	967,462,658	2.60
9	其他资产	2,184.36	0.01
10	合计	34,600,134.01	100.00

注:上述股票投资包括可赎回替代款估值增值。

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	131,546.94	0.39
B	采矿业	1,780,376,766	5.22
C	制造业	15,379,561.64	45.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,314,084.14	6.78
E	建筑业	965,767.04	2.83
F	批发和零售业	2,013,995.64	5.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,800,902.39	8.21
H	住宿和餐饮业	56,452.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,044,161.00	5.99
J	金融业	3,113,102.23	9.19
K	房地产业	2,006,730.77	6.15
L	租赁和商务服务业	488,370.26	1.43
M	科学研究、技术服务及地质勘查业	171,675.85	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	62,774.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	567,070.77	1.66
S	综合	643,465.65	1.89
合计		33,630,496.97	98.69

注:上述股票投资不包括可赎回替代款估值增值。

5.4 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

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

5.6 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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资

5.8 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权证投资

5.9 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金融衍生品投资

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名证券投资基金

5.12 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股票投资组合

5.13 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债券投资组合

5.14 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组合

5.15 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组合

5.16 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组合

5.17 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金融衍生品投资组合

5.18 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证券投资基金组合

5.19 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组合

5.20 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债券投资组合

5.21 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组合

5.22 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组合

5.23 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权证投资组合

5.24 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买入返售金融资产

5.25 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证券投资基金

5.26 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组合

5.27 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债券投资组合

5.28 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组合

5.29 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组合

5.30 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权证投资组合

5.31 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买入返售金融资产

5.32 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证券投资基金

5.33 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组合

5.34 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债券投资组合

5.35 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组合

5.36 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组合

5.37 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权证投资组合

5.38 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买入返售金融资产

5.39 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证券投资基金

5.40 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组合

5.41 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债券投资组合

5.42 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组合

5.43 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组合

5.44 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权证投资组合

5.45 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买入返售金融资产

5.46 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证券投资基金

5.47 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组合

5.48 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债券投资组合

5.49 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组合

5.50 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组合

5.51 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权证投资组合

5.52 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买入返售金融资产

5.53 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证券投资基金

5.54 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组合

5.55 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债券投资组合

5.56 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组合

5.57 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组合

5.58 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权证投资组合

5.59 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买入返售金融资产

5.60 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证券投资基金

5.61 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组合

5.62 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债券投资组合</p