

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 2018年半年度报告摘要

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:2018年8月25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 重大透漏 并对其内容的真实性 准确性和完整性承担个别及走带的法律责任。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2018年8月24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

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 基金的过任业绩并个代表具未来表现 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2018年1月1日起至2018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。

| 基金简称 | 华泰柏瑞上证中小盘ETF联接 |
|------------|-----------------------------|
| 基金主代码 | 460220 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 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 | 56,911,916.18 () |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 上市日期 | 2011年3月28日 |

i金管理人名科

| 投资目标 | 緊密跟踪业绩比较基准, 追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小 化。 |
|---------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资策略 | 基基金为年季和国上证中小盘官中的取得基金。 作奉的知识 证中小盘官中是其严ਣ金额制实现力 证中小金融资格 则实的全级动物效基金。本基金主要通过设计手标参加目 证中小盘官下空间设理制度效益和资金制度。在中间设 证明,从金融平面,由于一个量量的。 的基础上,加定某用一级市场申标期间的方式或一级市场。 类的方式分标卷相加。证中小盘官已进行设置。 |
| 业绩比较基准 | 上证中小盘指数 × 96% +银行活期存款税后收益率 × 5% |
| 风险收益特征 | 本基金为华泰柏瑞上证中小盘区下的联接基金,采用主要投资于上证中小盘交易避开放式指数证券投资基金实现过整 饮产上证中小盘交易避开放式指数证券投资基金实现过整 比较基准的客预制度。因此,未基金的过滤为现金,上证中小盘 捐数的表现常切相尖。基基金的风险当收益水平离于都合型 基金、债券生基金与货币和场基金。 |
| 2.2.1 目标基金产品说 | 明 |
| | A second of the comment of the comme |

| 2.2.1 目标基金产品说明 | | |
|----------------|-------------------|------------|
| 基金名称 | 上证中小盘交易型开放式扩 | 自数证券投资基金 |
| 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 | |
| 基金管理人名称 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 1 |
| 基金托管人名称 | 中国银行股份有限公司 | |
| 2.3 基金管理人和基金托 | 管人 | |
| cost era | St. A. Morrey, J. | SEA ARAS I |

| | 姓名 | 陈原 | | 王永民 |
|---------------------------------|----------------------|----------------------------|--------------------------|----------------------|
| 信息披露负责人 | 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 | | 96566 |
| 传真 | | 021-38601799 01 | | 010-66594942 |
| 2.4信息披露: | 方式 | | | |
| 登载基金半年度扩 | 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 | |
| tide de sala describacións de a | te martide to | | 上海市油东新区民生 | 路1199弄上海证大五道口广场1号17 |

3.1 主要会计数据和财务指标

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | -56,709.22 |
| 本期利润 | -6,912,837.13 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1220 |
| 本期基金份额净值增长率 | -10.91% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0042 |
| 期末基金资产净值 | 56,674,629.29 |
| 期末基金份額净值 | 0.9958 |

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

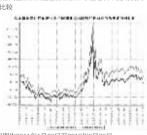
3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实 现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长室及其与同期业绩比较基准收益室的比较

| 阶段 | 份额净值增 长率① | 行關净值增 长率标准差 2 | 业绩比较基 准收益率(3) | 业项比较易 准收益率标 准整④ | ① – ③ | 2-4 |
|--------------|--------------|---------------------|------------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去一个月 | -7.14% | 1.36% | -8.23% | 1.38% | 1.09% | -0.02% |
| 过去三个月 | -8.57% | 1.08% | -10.22% | 1.10% | 1.65% | -0.02% |
| 过去六个月 | -10.91% | 1.14% | -1256% | 1.16% | 1.65% | -0.02% |
| 过去一年 | -5.25% | 0.94% | -9.44% | 0.96% | 4.19% | -0.02% |
| 过去三年 | -35.63% | 1.67% | -36.76% | 1.69% | 1.13% | -0.02% |
| 自合同生效日 至今 | -0.42% | 1.50% | 1255% | 1.53% | -12.97% | -0.03% |

准收益率变动的比较



注,1 图示日期为2011年1月26日至2018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十四条(二)投资范围中规定的比例,即投 资于华泰柏瑞上证中小盘ETF的比例不低于基金资产净值的90%;现金或者到期日在 -年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

411 基全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 市。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 下自理年來市地區巴里國底白星班分及瓦羅亚。年來市地亚十元億年相利國分星班分 投资基金、止延和英多與开放式情數電影等投资基金、生泰柏瑞货用市场证券投资基金、 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 或、千字中1·响上证:"小面之勿。並开放工员每或证分区及商业收收商业,于李伟中间由刊 利债券型证券投资益金、定秦柱瑞沙克300交易型开放式指数证券投资益金、生秦柏瑞 沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、生秦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 年梁門地中十匹切分並近分改良應並、年梁門地區北匹地及夜间配直晚口至延近分取內 金、华泰村館的新动力员配配置最合型证券投资基金、华泰村館是化驱动员活配置程 合型证券投资基金、华泰柏端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 00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、生泰拍瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、生泰拍瑞量化智慧灵活 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。 华泰柏瑞登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、华泰柏瑞普利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞普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 具版日至ய270义以卷並、十年1711週間中均次(日)地上电比日至地270次以卷並、十年17日間7日 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、华泰柏瑞纳利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞纳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、华泰柏瑞格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、华 次(II)机晶的(日達)が12以重率。十等(II)地面的(II)地面的日達地方以及重点,十 泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、生奉柏瑞国为灵活配置混合型证券投资基金、生泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞巷股通量化灵 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 但此直他们並此分以及雖並、「年來们。他取得到不广並他口至此分以及雖並、「年來们。 辦金巖地下克尼配置混合型证券投资基金。 作泰柏瑞MSCI中自私股国际通安易型开 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。截至2018年6月30日、公司基金管理规模为886.17亿元。 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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》《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, 中交易部为公嘉基金,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 是供了较好的保障。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

投资者等异常な見行为 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A股市场整体表现不佳。今年1月中上旬市场迎来了短暂的开门红,以 沪深300为代表的蓝筹股票表现优异。不过1月下旬后,在国内去杠杆以及中美贸易关 系持续紧张的背景下,市场开始持续至半年末的大幅调整,期间沪深300、中证500和中 证500的调整幅度均达到20%左右。尽管市场整体表现不佳,不过期间以食品饮料、医 药生物和休闲服务为代表的大消费股票表现出了较好的抗跌性。经过近几个月市场的 连续调整,A股的整体估值水平已经逐渐接近历史低位,截至6月底,沪深300的市盈 倍,处于2010年以来中证500指数 估值1%分位数的低位。

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0.9958元;本报告期基金份额净值增长率为

-10.91%,业绩比较基准收益率为-12.56%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们严格按照基金合同的规定,紧密跟踪业绩基准、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371.666%,且均绝对跟踪偏离度为0.033%,期间日跟踪误差为0.042%,较好地实现了本基金的投资目标。 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 的關总營理以及投资研究、风险控制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。

《不时间直及不日不多级级定则成为少东日西北部二分。 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,在符合有关基金分红条件的前提下,基金每年收益分配次 数最多为12 次;每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额 可供分配利润的10%,若基金合同生效不满3个月,可不进行收益分配。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 > &

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 木损告期内 木托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规 基金会同和

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,弹值表现,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: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 报告截止日: 2018年6月30日

| 38 100 | 附注号 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|------------|-----|-------------------|---------------------|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | | 3,364,983.10 | 3,103,089.78 |
| 结算备付金 | | - | 1,130.15 |
| 存出保证金 | | 481.16 | 961.47 |
| 交易性金融资产 | | 53,346,699.30 | 59,950,005.57 |
| 其中:股票投资 | | 335,203.00 | 1,990,254.50 |
| 基金投资 | | 53,011,49630 | 57,711,286.07 |
| 债券投资 | | - | 248,465.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | _ |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买人返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | | 671.16 | 3,969.38 |
| 应收股利 | | - | |
| 应收申购款 | | 8,745.73 | 3,771.55 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 56,721,580.45 | 63,062,927.90 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017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 | | - | 2,759.71 |
| 应付管理人报酬 | | 1,487.99 | 2,233.24 |
| 应付托管费 | | 297.62 | 446.65 |
| 应付销售服务费 | | - | _ |
| 应付交易费用 | | 534.57 | 567.50 |
| 应交税费 | | - | _ |
| 应付利息 | | - | _ |
| 应付利润 | | - | _ |
| 其他负债 | | 44,630.98 | 80,010.40 |
| 遊延所得税负债 | | - | _ |
| 负债合计 | | 46,951.16 | 86,017.50 |
| 所有者权益: | | , | |
| 实收基金 | | 56,911,916.18 | 56,344,757.06 |
| 未分配利润 | | -237,286.89 | 6,632,153.34 |
| 所有者权益合计 | 1 1 | 56,674,629.29 | 62,976,910.40 |
| 负债和所有者权益总计 | | 56,721,580.45 | 63,062,927,90 |

会计主体: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

| 項目 | 附注号 | 本期 2018年1月1日至2018 年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日 |
|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收人 | | -6,853,694.72 | -194,859.33 |
| 1.利息收入 | | 12,837.81 | 12,463.86 |
| 其中:存飲利息收入 | | 12,040.00 | 12,433.45 |
| 债券利息收人 | | 797.81 | 30.41 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | |
| 买人返售金融资产收人 | | - | _ |
| 其他利息收人 | | - | |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | -11,488.01 | -15,333.42 |
| 其中:股票投资收益 | | -18,496.15 | 31,352.91 |
| 基金投资收益 | | 2,330.74 | -52,542.91 |
| 债券投资收益 | | 213.00 | 75.00 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | _ |
| 贵金属投资收益 | | - | _ |
| 行生工具收益 | | - | _ |
| 股利收益 | | 4,464.40 | 5,781.58 |
| 3.公允价值变动收益(损失以 "-"号 真列) | | -6,856,127.91 | -194,744.10 |
| 1.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | |
| i.其他收入(损失以 "-" 号填列) | | 1,083.39 | 2,754.33 |
| 喊:二、费用 | | 59,142.41 | 92,962.69 |
| . 管理人报酬 | 6.4.8.2.1 | 10,474.74 | 8,743.00 |
| 2. 托管费 | 6.4.8.2.2 | 2,094.93 | 1,748.61 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.8.2.3 | - | |
| 交易费用 | | 1,421.76 | 41,596.04 |
| 5. 利息支出 | | - | |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | - | _ |
| . 税金及附加 | | - | _ |
| . 其他费用 | | 45,150.98 | 40,876.04 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | -6,912,837.13 | -287,822.02 |
| 喊:所得税费用 | | - | _ |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | -6,912,837.13 | -287,822.02 |

| 6.3 所有者权益(基金 | を净值)変动表 | | |
|----------------------------------------------------|-----------------|------------------------------|---------------|
| 会计主体:华泰柏瑞」 | 上证中小盘交易型开 | F放式指数证券投资 | 基金联接基金 |
| 本报告期:2018年1月 | 1日至2018年6月30 | D日 | |
| | | | 单位:人民 |
| 項目 | 201 | 本期 8年1月1日至2018年6月30日 | ı |
| -3KH | 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) | 56,344,757.06 | 6,632,153.34 | 62,976,910.40 |
| 二、本期经营活动产生的基 金净值变动数 (本期净利 润) | - | -6,912,837.13 | -6,912,837.13 |
| 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) | 567,159.12 | 43,396.90 | 610,556.02 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,615,078.35 | 151,100.50 | 1,766,178.85 |
| 2.基金赎回款 | -1,047,919.23 | -107,703.60 | -1,155,62283 |
| 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) | 56,911,916.18 | -237,286.89 | 56,674,629.29 |
| 項目 | 201 | 上年度可比期间 7年1月1日至2017年6月30日 | ı |
| | 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) | 10,589,033.38 | 239,315.09 | 10,828,348.47 |
| 二、本期经营活动产生的基 金净值变动数 (本期净利 润) | - | -287,822.02 | -287,822.02 |
| 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) | 46,584,931.74 | 2,964,777.91 | 49,549,709.65 |
| 其中:1.基金申购款 | 48,517,917.74 | 3,051,559.62 | 51,569,477.36 |
| 2.基金赎回款 | -1,932,986.00 | -86,781.71 | -2,019,767.71 |
| 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) | 57, 173, 965.12 | 2,916,270.98 | 60,090,236.10 |
| 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: 赵景云

6.4 报表附注

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 ")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《华泰柏 福上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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482.542.07250元、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26号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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482.562.90150份基金份额,其中认购资金利息折合20,829.00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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流 动性的金融工具,包括华泰帕瑞上证中小盘FTF、上证中小盘指数成份股及备选成份股、非成份股、债券、新股(一级市场初次发行和增发)、股指期货、货币市场工具及法 律法抑动中国证监会会许其全投资的其他全融工具 正堂情况下 木基全资产中投资 于华泰村强上证中小盘尼TP的比例不低于基金资产净值的90%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为上证中小盘 指数 × 96% + 銀行活期存款税后收益率 × 6%

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2018年8月25日批准报

为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

6.4.1 基金基本情况

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 投资基金基金联接基金基金合同》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2018年1月1日至2018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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018 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。

645 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。

他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

6.4.5.3 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《关于和人固定资产讲项税额抵扣等增值税政策的通知》及其

(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, 哲适用简易计税方 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 货结算价格作为买人价计算销售额

(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人应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1 年(含1年)的, 暂减按50%计人应纳税所得额; 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%计人应 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,买人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。

647 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

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

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。

注:无。

6.4.8.1.5 权证交易 注:本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

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

6.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

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 × 0.50% - 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

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 × 0.10% - 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。

6.4.8.2.3 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 注:本报告期及上年度可比期间内,除基金管理人之外的其它关联方未投资本基

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

| 关联方 夕称 | 本》 2018年1月1日至2 | | 上年度可 2017年1月1日至 | |
|----------------|-------------------|-----------|--------------------|-----------|
| | 期末余額 | 当期利息收入 | 期末余額 | 当期利息收入 |
| 中国银行股份 有限公司 | 3,364,983.10 | 12,016.91 | 3,278,720.73 | 11,705.35 |

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

6.4.9 期末(2018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 注:截至本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

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

期末 成本总額

注: 本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被

暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 64931 银行间市场债券正同购

64932 交易所市场债券正回顺

截至本报告期末,本基金从事银行间市场债券正同购交易形成的卖出同购证券会 麵0元 无债券作为质捆

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

6410 有肋于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

《7 投资组合报告

金额单位:人民币元

金额单位:人民币元

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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | |
|----|------------------|------------|--------------|--|
| Α | 农、林、牧、渔业 | 662.00 | 0.00 | |
| В | 采矿业 | 28,347.00 | 0.05 | |
| С | 制造业 | 117,269.00 | 0.21 | |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 54,278.00 | 0.10 | |
| Е | 建筑业 | 333.00 | 0.00 | |
| F | 批发和零售业 | - | | |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 22,192.00 | 0.04 | |
| Н | 住宿和餐饮业 | - | | |
| Ι | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - | |
| J | 金融业 | 86,358.00 | 0.15 | |
| K | 房地产业 | - | - | |
| L | 租赁和商务服务业 | 25,764.00 | 0.05 | |
| М | 科学研究和技术服务业 | - | - | |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - | |
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - | |
| P | 教育 | - | - | |
| Ω | 卫生和社会工作 | - | - | |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - | |
| S | 综合 | - | - | |
| | 合计 | 335,203.00 | 0.59 | |

72.2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

| 金额单位:人戶 | á | | | | |
|------------------|-----------|-------|------|--------|----|
| 占基金资产净值 比例(%) | 公允价值 | 数量(股) | 股票名称 | 股票代码 | 序号 |
| 0.0 | 41,964.00 | 2,600 | 长江电力 | 600900 | 1 |
| 0.0 | 30,304.00 | 3,200 | 海通证券 | 600837 | 2 |
| 0.0 | 27,456.00 | 1,200 | 康美药业 | 600518 | 3 |
| 0.0 | 25,764.00 | 400 | 中国国旅 | 601888 | 4 |
| 0.0 | 22,192.00 | 400 | 上海机场 | 600009 | 5 |
| 0.03 | 19,650.00 | 3,000 | 建设银行 | 601939 | 6 |
| 0.03 | 18,625.00 | 2,500 | 华夏银行 | 600015 | 7 |
| 0.03 | 17,779.00 | 2,300 | 南京银行 | 601009 | 8 |
| 0.03 | 16,556.00 | 400 | 复星医药 | 600196 | 9 |
| 0.03 | 16,146.00 | 1,800 | 三一田工 | 600031 | 10 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网 站的年度报告正文。

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

| 序号 | 股票代码 | R | | 占期初基金资产净 值比例(%) | |
|----|--------|------|-----------|--------------------|--|
| 1 | 600276 | 恒瑞医药 | 60,893.00 | 0.10 | |
| 2 | 600900 | 长江电力 | 41,676.00 | 0.07 | |
| 3 | 601939 | 建设银行 | 41,211.00 | 0.07 | |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 32,936.00 | 0.05 | |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 29,760.00 | 0.05 | |
| 6 | 600518 | 康美药业 | 27,513.00 | 0.04 | |
| 7 | 600585 | 海螺水泥 | 25,664.00 | 0.04 | |
| 8 | 601012 | 隆基股份 | 24,266.00 | 0.04 | |
| 9 | 600703 | 三安光电 | 22,180.00 | 0.04 | |
| 10 | 600015 | 华夏银行 | 22,075.00 | 0.04 | |
| 11 | 600690 | 青岛海尔 | 21,768.00 | 0.03 | |
| 12 | 601888 | 中国国旅 | 20,572.00 | 0.03 | |
| 13 | 600009 | 上海机场 | 19,788.00 | 0.03 | |
| 14 | 601009 | 南京银行 | 18,423.00 | 0.03 | |
| 15 | 601225 | 陕西煤业 | 17,956.00 | 0.03 | |
| 16 | 600031 | 三一班工 | 16,971.00 | 0.03 | |
| 17 | 600196 | 复星医药 | 15,532.00 | 0.02 | |
| 18 | 600867 | 通化东宝 | 14,766.00 | 0.02 | |
| 19 | 600795 | 国电电力 | 13,959.00 | 0.02 | |
| | | | | | |

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

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

| 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 | 600276 | 恒瑞医药 | 72,599.80 | 0.12 | |
| 2 | 600585 | 海螺水泥 | 28,640.00 | 0.08 | |
| 3 | 600309 | 万华化学 | 27,858.00 | 0.04 | |
| 4 | 601012 | 隆基股份 | 22,818.00 | 0.04 | |
| 5 | 600690 | 青岛海尔 | 21,756.00 | 0.03 | |
| 6 | 600703 | 三安光电 | 21,620.00 | 0.03 | |
| 7 | 601939 | 建设银行 | 19,953.00 | 0.03 | |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 16,277.00 | 0.03 | |
| 9 | 601600 | 中国铝业 | 11,570.00 | 0.02 | |
| 10 | 600150 | *ST船舶 | 5,460.00 | 0.01 | |
| 11 | 600157 | 永泰能源 | 4,440.00 | 0.01 | |
| 12 | 600645 | 中源协和 | 2,350.00 | 0.00 | |
| 13 | 603861 | 白云电器 | 1,722.00 | 0.00 | |
| 14 | 603298 | 杭叉集团 | 1,630.00 | 0.00 | |
| 15 | 600650 | 锦江投资 | 1,510.00 | 0.00 | |
| 16 | 603567 | 珍宝岛 | 1,444.00 | 0.00 | |
| 17 | 600119 | 长江投资 | 1,397.00 | 0.00 | |
| 18 | 600826 | 兰生股份 | 1,346.00 | 0.00 | |
| 10 | 601811 | 部份分紅 | 1 31000 | 0.00 | |

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

7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

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 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。

7.8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

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

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净 值比例(%) |
|----|--------|------|--------|----------------------|---------------|------------------|
| 1 | 中小盘ETF | 指數型 | 交易型开放式 | 华泰柏瑞基 金管理有限 公司 | 53,011,496.30 | 93.54 |

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.12报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 注:本基金本报告期末未持有国债期货。

本基金本报告期末投资的前十名证券中,南京银行(601009)于2018年1月29日

镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则的行为罚款3230万元人民币。公司镇江 分行已按要求完成整改,对相关责任人严肃问责,现经营正常有序。

对该股票投资决策程序的说明:上述股票系标的指数成份股,基金经理根据基金 合同的规定,采用完全复制法,投资上述股票,以实现紧密跟踪标的指数业绩表现的投 资目标。

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。 7133期末其他各项资产构成

单位:人民币元

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

§ 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

份麵单位:份

83 期末其全管理人的从业人员持有木其全的情况

注,截至水期末 其全管理人的从业人员去持有水其全 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:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本开放式基金。

单位:份

€10 重大事件揭示

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

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

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的证

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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。

10.4 基金投资策略的改变

106 管理人, 托管人及其高级管理人员受稽查或外罚等情况

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 交易单; **券商名** 占当期佣金 成交金額 佣金

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 向其或其合作券商和用其全专用交易度位 公司选择的提供交易单元的券商应

金额单位:人民币元

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

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

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

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。 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

全痴的位, 人民市元

| | 成交金額 | 比例 | 成交金额 | 成交总 额的比 例 | 成交金額 | 成交总额 的比例 | 成交金額 | 成交总额 的比例 |
|------|------|----|------|-----------------|------|-------------|----------------|-------------|
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | 127, 008.50 | 100.00% |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

§ 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

| 别 | 序号 | 到或者超过20%的时 间区间 | 分類 | 份额 | 份额 | 持有份额 | 份额占比 |
|-----|-------------------|--------------------------------------------|----------------------------------------|-------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|--------|
| 机构 | 1 | 20180101-20180630 | 47,010,154.19 | 0.00 | 0.00 | 47,010,154.19 | 82.60% |
| | - | - | - | - | - | - | - |
| 个人 | | | | | | | |
| | | | | | | | |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| | | • | 产品特有风 | 睑 | | | |
| 的投资 | 期内共 者赎回 赎回的 | 有1家机构持有基金份额 ,可能导致巨额赎回,从而 风险。当发生巨额赎回的 | 超过20%,累计达82. 同发流动性风险,可 ,投资者可能面临期 | 「能対基金 | ・产生加つ ・产生加つ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ | < 部2的: (1) GE 担日力に | 理時间由请 |

11.2影响投资者决策的其他重要信息

华泰柏瑞基金管理有限公司 2018年8月25日