

# 华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证 券投资基金 (LOF) 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 27 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	31
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	32
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	35
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	37
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.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	37
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.....	37
7.11 投资组合报告附注.....	38

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>39</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	42
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>43</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>44</b>
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	44
12.3 查阅方式.....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	华宝油气
基金主代码	162411
交易代码	162411
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2011 年 9 月 29 日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	77,951,225.99 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012-06-08

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的指数化投资策略，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%（以美元资产计价）。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普石油天然气上游股票指数（全收益指数）
风险收益特征	本基金是一只美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

## 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		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	尹东
	联系电话	021-38505888	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郑安国	王洪章

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	One Wall Street New York, NY10286
办公地址		-	One Wall Street New York, NY10286
邮政编码		-	NY10286

## 2.5 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	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.6 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	北京市西城区太平桥大街 17 号
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	430,242.12
本期利润	-2,021,723.77
加权平均基金份额本期利润	-0.0249
本期加权平均净值利润率	-2.58%
本期基金份额净值增长率	-8.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-8,377,039.61
期末可供分配基金份额利润	-0.1075
期末基金资产净值	69,574,186.38
期末基金份额净值	0.893
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-10.70%

注：1、所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、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）

3、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。

4、期末可供分配利润采用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 净值表现

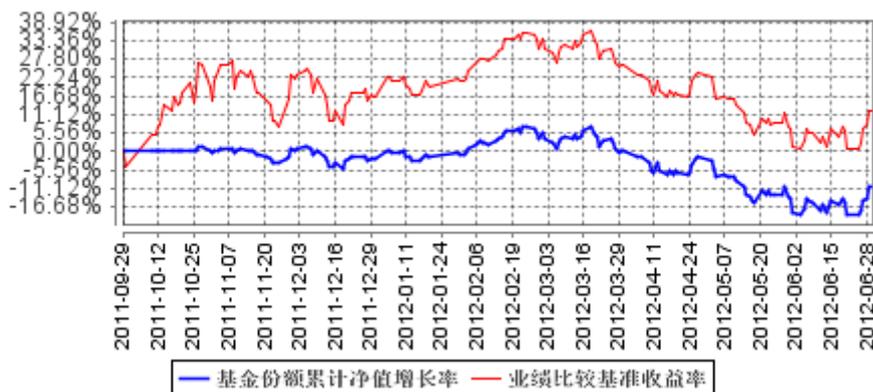
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.20%	2.56%	5.20%	2.81%	-1.00%	-0.25%

个月						
过去三 个月	-10.97%	2.05%	-10.89%	2.25%	-0.08%	-0.20%
过去六 个月	-8.69%	1.67%	-3.58%	1.92%	-5.11%	-0.25%
自基金 合同生 效日起 至今	-10.70%	1.43%	12.44%	2.46%	-23.14%	-1.03%

### 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、本基金基金合同生效于 2011 年 9 月 29 日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定,自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合,截至 2012 年 3 月 29 日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 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

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2012 年 6 月 30 日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基

金、华宝兴业医药生物、华宝短融 50，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 36,429,945,714.42 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		
尤柏年	本基金基金经理、华宝兴业成熟市场 QDII 基金经理	2011 年 9 月 29 日	-	9 年	博士，曾在澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队从事投资、金融工程模型开发、资产配置、行业研究等工作。2007 年 6 月加入本公司任金融工程部高级数量分析师，2008 年 8 月起任海外投资部高级分析师，2009 年 3 月至 2011 年 3 月任华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理助理兼任高级分析师，2011 年 3 月至

					今任华宝兴业成熟市场 QDII 基金经理，2011 年 9 月兼任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。
施施乐	本基金基金经理助理	2012 年 3 月 1 日	-	9 年	工商管理硕士，曾任职于法国兴业银行上海分行。2003 年 3 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任渠道业务发展及国际业务部总经理、内控审计风险管理部总经理，2012 年 2 月起任海外投资管理部高级分析师兼华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 基

					金经理助理。
--	--	--	--	--	--------

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 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》及其各项实施细则、《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，标普石油天然气上游股票指数基金在短期内出现过持有的成分股及备选股市值占基金净值低于 80%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

## 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，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

## 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

回顾期内油气各类资产以及美国股票市场的表现,以人民币计价 1 季度原油价格上涨了 4.9%,本基金基准指数上涨了 7.73%,标普 500 指数上涨了 11.18%。WTI2 季度 WTI 原油价格下跌了 -24.67%,本基金基准指数下跌了-14.16%,标普指 500 数下跌了-4.74%。总体上来看,本指数在 1 季度上涨幅度超过原油价格、2 季度下跌幅度也小于原油价格,相对于能源价格表现较好,但逊于标普 500 指数的表现。

从基本面来看,1 季度上涨期间能源价格仍然周期类股票资产表现逊于标普 500 指数的同期表现,一方面美国股票指数的上涨主要来自其就业数据改善的推动,从行业板块来看消费、科技以及房地产等传统与就业改善相关性的行业表现最好、如美国房地产行业的 1 季度涨幅是本基金基准指数涨幅的 3 倍左右、标普 500 指数的 2 倍左右。另一方面、目前全球经济的产出缺口较大,周期类资产较难取得超额收益。从 2 季度来看,本基金的表现主要受到了欧债危机复发以及美国原油库存大幅上升的影响,周期类资产价格在期间受到的压力较大、美国原油库存的大幅上升也引发了能源价格的较大调整。

在操作上本基金在 1 季度处于建仓期,2 季度基本维持了指数基金 90%-95%的资产配置比例。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为-8.69%,同期业绩比较基准收益率为-3.58 基金表现落后业绩比较基准 5.11%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,全球的经济形势较为复杂。西意两国债券收益率的大幅飙升目前来看已引起了欧盟政府以及欧央行的极度关注、有关救市政策目前正在酝酿当中,如在 3 季度成功实施,那么将在中短期内提升投资者的资产配置风险偏好因此利好能源类资产的表现。但另一方面,美国经济近期的下滑势头超出了投资者的预期、欧盟的救市政策并不能改善欧债危机国的经济基本面且需要突破的政治阻力很大。因此我们预期能源下半年的波动性较大、欧盟救市政策的发展以及美国经济趋势是否进一步放缓将主导能源资产的表现。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值中,各部门参与如下:

(一) 基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

(二) 金融工程部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，为估值提供相关模型。

(三) 估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性 & 适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

(四) 必要时基金经理参与估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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：华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,446,355.31	38,459,180.98
结算备付金		6,363.64	522,727.27
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	65,850,573.33	54,411,855.63
其中：股票投资		59,793,849.09	43,920,831.93
基金投资		6,056,724.24	10,491,023.70
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	20,000,000.00
应收证券清算款		262,014.04	146,443.50
应收利息	6.4.7.5	582.28	13,849.84
应收股利		8,649.30	3,790.94
应收申购款		226,698.80	20,353.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	55,887.80	-
资产总计		72,857,124.50	113,578,201.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2011 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		2,402,539.39	-
应付赎回款		623,302.75	533,385.12
应付管理人报酬		52,281.11	91,744.65
应付托管费		14,638.71	25,688.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	190,176.16	165,816.98
负债合计		3,282,938.12	816,635.27
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	77,951,225.99	115,245,049.84
未分配利润	6.4.7.10	-8,377,039.61	-2,483,483.14
所有者权益合计		69,574,186.38	112,761,566.70
负债和所有者权益总计		72,857,124.50	113,578,201.97

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.893 元，基金份额总额 77,951,225.99 份。

## 6.2 利润表

公告主体：华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日 至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-1,301,109.01
1. 利息收入		116,775.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	34,155.60
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		82,619.69
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		964,846.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	280,502.09
基金投资收益	6.4.7.13	466,311.12
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	218,033.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,451,965.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-17,478.65
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	86,713.50
<b>减：二、费用</b>		720,614.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	396,253.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	110,951.03
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	40,172.49

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		173,237.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）			-2,021,723.77
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）			-2,021,723.77

注：本基金合同于 2011 年 9 月 29 日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	115,245,049.84	-2,483,483.14	112,761,566.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-2,021,723.77	-2,021,723.77
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）	-37,293,823.85	-3,871,832.70	-41,165,656.55
其中：1.基金申购款	30,299,768.43	-2,096,461.52	28,203,306.91
2.基金赎回款	-67,593,592.28	-1,775,371.18	-69,368,963.46
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）	77,951,225.99	-8,377,039.61	69,574,186.38

注：本基金合同于 2011 年 9 月 29 日生效，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
裴长江  
基金管理公司负责人

\_\_\_\_\_  
黄小薏  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
张幸骏  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1301号文《关于核准华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)的申请》的核准，由基金管理人华宝兴业基金管理有限公司作为发起人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》及其他有关法律法规负责于2011年9月5日至2011年9月23日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2011)验字第60737318\_B05号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2011年9月29日正式生效，首次设立募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币373,155,341.85元，在募集期间产生的存款利息为人民币88,340.58元，以上实收基金（本息）合计为人民币373,243,682.43元，折合373,243,682.43份基金份额。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资于：（1）标普石油天然气上游股票指数成份股、备选成份股；（2）跟踪标普石油天然气上游股票指数的公募基金、上市交易型基金等；（3）固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标普石油天然气上游股票指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的80%，投资于跟踪标普石油天然气上游股票指数的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产净值的10%；投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

本基金的业绩比较基准为：标普石油天然气上游股票指数（全收益指数）。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会

计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》、《证券投资基金参与股指期货交易指引》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 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

本基金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。

### 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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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；
- (2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征收营业税和企业所得税；
- (3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区

税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

## 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 2012年6月30日
活期存款	6,446,355.31
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	6,446,355.31

注：于 2012 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 2,181,535.83 元和美元活期存款 674,290.42 元(折合人民币 4,264,819.48 元)。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	64,292,359.39	59,793,849.09	-4,498,510.30
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	6,062,246.49	6,056,724.24	-5,522.25
其他	-	-	-
合计	70,354,605.88	65,850,573.33	-4,504,032.55

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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 2012年6月30日
应收活期存款利息	579.38
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	2.90
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	582.28

### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	55,887.80
合计	55,887.80

### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本期末应付交易费用无余额。

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,349.04
预提费用	144,207.70
应付指数使用费	43,619.42
合计	190,176.16

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	115,245,049.84	115,245,049.84
本期申购	30,299,768.43	30,299,768.43
本期赎回(以“-”号填列)	-67,593,592.28	-67,593,592.28
本期末	77,951,225.99	77,951,225.99

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：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	-80,897.73	-2,402,585.41	-2,483,483.14
本期利润	430,242.12	-2,451,965.89	-2,021,723.77
本期基金份额交易产生的变动数	66,788.97	-3,938,621.67	-3,871,832.70
其中：基金申购款	391,182.70	-2,487,644.22	-2,096,461.52
基金赎回款	-324,393.73	-1,450,977.45	-1,775,371.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	416,133.36	-8,793,172.97	-8,377,039.61

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	33,037.25
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	1,068.92
其他	49.43
合计	34,155.60

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	28,386,149.49
减：卖出股票成本总额	28,105,647.40
买卖股票差价收入	280,502.09

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	12,169,215.46
减：卖出/赎回基金成本总额	11,702,904.34

基金投资收益	466,311.12
--------	------------

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内未产生债券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未产生衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	192,390.37
基金投资产生的股利收益	25,643.16
合计	218,033.53

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,451,965.89
——股票投资	-2,700,056.12
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	248,090.23
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-2,451,965.89

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	86,713.50
合计	86,713.50

注：本基金的赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	40,172.49

银行间市场交易费用	-
合计	40,172.49

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	119,344.68
上市费用	9,112.20
银行汇划费	105.00
指数使用费	19,812.66
合计	173,237.56

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 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

本基金本报告期内无特别或有事项的说明。

##### 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，本基金无其它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
华宝兴业基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
纽约梅隆银行股份有限公司	基金境外托管行
华宝信托有限责任公司	基金管理人的主要发起人
领先资产管理有限公司	基金管理人的股东
华宝投资有限公司	受同一实际控制人控制的关联方
宝钢集团有限公司	基金管理人的主要发起人的母公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本期无通过关联方交易单元进行的交易。

## 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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	396,253.68	-
其中：支付销售机构的客户维护费	321,450.41	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.0% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	110,951.03	-

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.28% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.28\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

### 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

本基金本报告期无与关联方进行的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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	1,260,899.68	-
期间申购/买入总份额	446,362.35	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	1,707,262.03	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.19%	-

注：1) 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额转换出份额。

2) 基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 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		上年度末	
	2012 年 6 月 30 日		2011 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
华宝投资有限公司	-	-	10,297,631.31	8.94%

### 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		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 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
中国建设银行	2,181,601.61	33,037.25	-	-
纽约梅隆银行	4,264,753.70	-	-	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人纽约梅隆银行保管，按

适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本期及上年度可比期间无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2012 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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

本基金为指数型基金，跟踪标普石油天然气上游股票指数。本基金在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

##### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金进行债券投资时，主要投资于信用等级为投资级以上的债券且持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，

要求所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

### 6.4.13.3 流动性风险

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。

本基金持有的法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。

### 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,446,355.31	-	-	-	6,446,355.31
结算备付金	6,363.64	-	-	-	6,363.64
交易性金融资产	-	-	-	65,850,573.33	65,850,573.33
应收证券清算款	-	-	-	262,014.04	262,014.04
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	582.28	582.28
应收股利	-	-	-	8,649.30	8,649.30
应收申购款	15,062.18	-	-	211,636.62	226,698.80
其他资产	-	-	-	55,887.80	55,887.80
资产总计	6,467,781.13	-	-	66,389,343.37	72,857,124.50
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,402,539.39	2,402,539.39
应付赎回款	-	-	-	623,302.75	623,302.75

应付管理人报酬	-	-	-	52,281.11	52,281.11
应付托管费	-	-	-	14,638.71	14,638.71
其他负债	-	-	-	190,176.16	190,176.16
负债总计	-	-	-	3,282,938.12	3,282,938.12
利率敏感度缺口	6,467,781.13	-	-	-63,106,405.25	69,574,186.38
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	38,459,180.98	-	-	-	38,459,180.98
结算备付金	522,727.27	-	-	-	522,727.27
交易性金融资产	-	-	-	-54,411,855.63	54,411,855.63
应收证券清算款	-	-	-	146,443.50	146,443.50
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收利息	-	-	-	13,849.84	13,849.84
应收股利	-	-	-	3,790.94	3,790.94
应收申购款	695.83	-	-	19,657.98	20,353.81
资产总计	58,982,604.08	-	-	-54,595,597.89	113,578,201.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	533,385.12	533,385.12
应付管理人报酬	-	-	-	91,744.65	91,744.65
应付托管费	-	-	-	25,688.52	25,688.52
其他负债	-	-	-	165,816.98	165,816.98
负债总计	-	-	-	816,635.27	816,635.27
利率敏感度缺口	58,982,604.08	-	-	-53,778,962.62	112,761,566.70

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 06 月 30 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。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2012 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	4,264,819.48	-	-	4,264,819.48
交易性金融资产	65,850,573.33	-	-	65,850,573.33
应收股利	8,649.30	-	-	8,649.30
应收利息	3.61	-	-	3.61
应收证券清算款	262,014.04	-	-	262,014.04
资产合计	70,386,059.76	-	-	70,386,059.76
以外币计价的负债				
应付证券清算款	2,402,539.39	-	-	2,402,539.39
负债合计	2,402,539.39	-	-	2,402,539.39
资产负债表外汇风险敞口净额	67,983,520.37	-	-	67,983,520.37
项目	上年度末 2011 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	13,783,010.13	-	-	13,783,010.13
交易性金融资产	54,411,855.63	-	-	54,411,855.63
应收股利	3,790.94	-	-	3,790.94
应收证券清算款	146,443.50	-	-	146,443.50
资产合计	68,345,100.20	-	-	68,345,100.20
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	68,345,100.20	-	-	68,345,100.20

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	汇率风险的敏感性分析较为理想的做法是确定一个主要货币后并考虑其他外币对于该主要货币的相关性。如果货币间的相关性较难取得，则简化处理为假设相关性为 1。		
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：人民币元）	
		本期末（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	美元相对人民币升值 5%	3,519,302.99	3,417,255.01
	美元相对人民币贬值 5%	-3,519,302.99	-3,417,255.01

#### 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和外汇汇率以

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。

本基金采用指数化投资策略，股票资产跟踪的标的指数为标普石油天然气上游股票指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于标普石油天然气上游股票指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 80%，投资于跟踪标普石油天然气上游股票指数的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产净值的 10%。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 VaR (Value at Risk) 指标等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。

#### 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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	59,793,849.09	85.94	43,920,831.93	38.95
交易性金融资产—基金投资	6,056,724.24	8.71	10,491,023.70	9.30
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	65,850,573.33	94.65	54,411,855.63	48.25

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2012 年 06 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

## § 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	59,793,849.09	82.07
	其中：普通股票	59,793,849.09	82.07
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	6,056,724.24	8.31
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,452,718.95	8.86
8	其他各项资产	553,832.22	0.76
9	合计	72,857,124.50	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	59,793,849.09	85.94
合计	59,793,849.09	85.94

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
能源	59,793,849.09	85.94
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-

必需消费品	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	59,793,849.09	85.94

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	QUICKSILVER RESOURCES INC	Quicksilver 资源股份有限公司	KWK US	纽约	美国	35,829	1,228,252.44	1.77
2	MCMORAN EXPLORATION CO	McMoRan Exploration Co	MMR US	纽约	美国	14,003	1,122,151.17	1.61
3	ULTRA PETROLEUM CORP	犹特拉石油公司	UPL US	纽约	美国	6,881	1,004,044.16	1.44
4	BILL BARRETT CORP	Bill Barrett Corp	BBG US	纽约	美国	7,371	998,618.35	1.44
5	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC US	纽约	美国	3,433	975,365.11	1.40
6	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天然气公司	COG US	纽约	美国	3,888	968,893.72	1.39
7	SOUTHWESTERN ENERGY CO	西南能源公司	SWN US	纽约	美国	4,735	956,252.46	1.37
8	EXCO RESOURCES INC	EXCO 资源公司	XCO US	纽约	美国	19,734	947,350.23	1.36
9	EQT CORP	EQT 公司	EQT US	纽约	美国	2,778	942,309.79	1.35
10	COMSTOCK RESOURCES INC	Comstock Resources Inc	CRK US	纽约	美国	9,069	941,859.71	1.35
11	WPX ENERGY INC	WPX 能源公司	WPX US	纽约	美国	9,149	936,280.13	1.35
12	QEP RESOURCES INC	QEP 资源公司	QEP US	纽约	美国	4,879	924,849.84	1.33
13	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO US	纽约	美国	6,031	921,213.15	1.32

14	CARRIZO OIL & GAS INC	Carrizo Oil & Gas Inc	CRZO US	纳斯达克	美国	6,175	918,212.61	1.32
15	HOLLYFRONTIER CORP	HollyFrontier 公司	HFC US	纽约	美国	4,091	916,757.13	1.32
16	WESTERN REFINING INC	Western Refining Inc	WNR US	纽约	美国	6,507	916,546.89	1.32
17	CIMAREX ENERGY CO	Cimarex 能源公司	XEC US	纽约	美国	2,595	904,690.93	1.30
18	TESORO CORP	特索罗公司	TSO US	纽约	美国	5,721	903,171.43	1.30
19	REX ENERGY CORP	Rex Energy Corp	REXX US	纳斯达克	美国	12,625	895,139.38	1.29
20	MURPHY OIL CORP	墨菲石油公司	MUR US	纽约	美国	2,800	890,621.82	1.28
21	CLEAN ENERGY FUELS CORP	Clean Energy Fuels Corp	CLNE US	纳斯达克	美国	9,084	890,558.57	1.28
22	GULFPORT ENERGY CORP	Gulfport Energy Corp	GPOR US	纳斯达克	美国	6,815	889,239.51	1.28
23	RESOLUTE ENERGY CORP	Resolute Energy Corp	REN US	纽约	美国	14,659	887,298.91	1.28
24	RANGE RESOURCES CORP	Range 资源公司	RRC US	纽约	美国	2,266	886,734.66	1.27
25	CVR ENERGY INC	CVR Energy Inc	CVI US	纽约	美国	5,234	879,918.32	1.26
26	ENERGY XXI BERMUDA	Energy XXI Bermuda Ltd	EXXI US	纳斯达克	美国	4,404	871,578.56	1.25
27	STONE ENERGY CORP	Stone Energy Corp	SGY US	纽约	美国	5,415	867,878.11	1.25
28	PDC ENERGY INC	PDC Energy Inc	PETD US	纳斯达克	美国	5,567	863,366.81	1.24
29	APACHE CORP	阿帕契	APA US	纽约	美国	1,545	858,858.49	1.23
30	EXXON MOBIL CORP	艾克森美孚石油	XOM US	纽约	美国	1,586	858,377.61	1.23
31	SANDRIDGE ENERGY INC	SandRidge 能源公司	SD US	纽约	美国	20,232	856,088.37	1.23
32	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	CVX US	纽约	美国	1,272	848,776.28	1.22
33	BERRY PETROLEUM CO-CLASS A	Berry Petroleum Co	BRY US	纽约	美国	3,381	848,108.75	1.22
34	ANADARKO PETROLEUM CORP	阿纳达科石油	APC US	纽约	美国	2,009	841,185.14	1.21
35	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽约	美国	2,376	839,762.54	1.21
36	PHILLIPS 66	Phillips 66	PSX US	纽约	美国	3,993	839,487.03	1.21
37	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	Cobalt 国际能源公司	CIE US	纽约	美国	5,643	838,748.15	1.21
38	MAGNUM HUNTER	Magnum Hunter	MHR US	纽约	美国	31,585	835,046.82	1.20

	RESOURCES CORP	Resources Corp						
39	MARATHON OIL CORP	马拉松石油	MRO US	纽约	美国	5,125	828,854.43	1.19
40	ENERGEN CORP	Energen 公司	EGN US	纽约	美国	2,894	826,071.28	1.19
41	SUNOCO INC	太阳石油	SUN US	纽约	美国	2,743	824,087.03	1.18
42	SWIFT ENERGY CO	Swift Energy Co	SFY US	纽约	美国	6,994	823,238.48	1.18
43	CHESAPEAKE ENERGY CORP	切萨皮克能源公司	CHK US	纽约	美国	6,986	821,854.98	1.18
44	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	纽约	美国	1,508	818,069.90	1.18
45	DENBURY RESOURCES INC	Denbury 资源公司	DNR US	纽约	美国	8,551	817,212.56	1.17
46	NEWFIELD EXPLORATION CO	新田石油勘探公司	NFX US	纽约	美国	4,392	814,201.34	1.17
47	VAALCO ENERGY INC	Vaalco Energy Inc	EGY US	纽约	美国	14,882	812,317.41	1.17
48	WORLD FUEL SERVICES CORP	World Fuel Services Corp	INT US	纽约	美国	3,376	812,049.36	1.17
49	NOBLE ENERGY INC	Noble 能源股份有限公司	NBL US	纽约	美国	1,511	810,618.29	1.17
50	SM ENERGY CO	SM 能源公司	SM US	纽约	美国	2,601	807,911.80	1.16
51	GEORESOURCES INC	GeoResources Inc	GEOI US	纳斯达克	美国	3,476	804,883.75	1.16
52	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	Plains 勘探和生产公司	PXP US	纽约	美国	3,610	803,261.04	1.15
53	DEVON ENERGY CORPORATION	戴文能源	DVN US	纽约	美国	2,184	801,049.60	1.15
54	GOODRICH PETROLEUM CORP	Goodrich Petroleum Corp	GDP US	纽约	美国	9,084	796,331.73	1.14
55	WHITING PETROLEUM CORP	怀汀石油公司	WLL US	纽约	美国	3,042	791,163.02	1.14
56	HESS CORP	阿美拉达赫斯	HES US	纽约	美国	2,868	788,174.88	1.13
57	W&T OFFSHORE INC	W&T Offshore 公司	WTI US	纽约	美国	8,133	787,038.30	1.13
58	OASIS PETROLEUM INC	Oasis Petroleum Inc	OAS US	纽约	美国	5,110	781,503.38	1.12
59	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG US	纽约	美国	1,366	778,533.59	1.12
60	APPROACH RESOURCES INC	Approach Resources Inc	AREX US	纳斯达克	美国	4,813	777,482.13	1.12

61	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	美国大陆资源股份有限公司 (俄	CLR US	纽约	美国	1,826	769,412.19	1.11
62	ROSETTA RESOURCES INC	Rosetta Resources Inc	ROSE US	纳斯达克	美国	3,299	764,524.56	1.10
63	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然资源公司	PXD US	纽约	美国	1,360	758,770.42	1.09
64	FOREST OIL CORP	福雷斯特石油公司	FST US	纽约	美国	16,298	755,600.00	1.09
65	CONCHO RESOURCES INC	康丘资源公司	CXO US	纽约	美国	1,390	748,341.93	1.08
66	BPZ RESOURCES INC	BPZ Resources Inc	BPZ US	纽约	美国	46,757	748,205.37	1.08
67	NORTHERN OIL AND GAS INC	Northern Oil and Gas Inc	NOG US	纽约	美国	7,415	747,572.19	1.07
68	RENTECH INC	Rentech Inc	RTK US	纽约	美国	50,288	655,217.14	0.94
69	CONTANGO OIL & GAS	Contango Oil & Gas Co	MCF US	纽约	美国	1,462	547,422.62	0.79
70	ENERGY PARTNERS LTD	Energy Partners Ltd	EPL US	纽约	美国	4,074	435,473.16	0.63
71	CLAYTON WILLIAMS ENERGY INC	Clayton Williams Energy Inc	CWEI US	纳斯达克	美国	1,385	423,808.15	0.61

#### 7.4.1 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	QUICKSILVER RESOURCES INC	KWK US	1,519,177.48	1.35
2	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	CIE US	1,347,646.10	1.20
3	REX ENERGY CORP	REXX US	1,218,664.26	1.08
4	COMSTOCK RESOURCES INC	CRK US	1,137,112.66	1.01

5	MAGNUM HUNTER RESOURCES CORP	MHR US	1, 112, 546. 83	0. 99
6	WPX ENERGY INC	WPX US	1, 079, 652. 50	0. 96
7	SANDRIDGE ENERGY INC	SD US	1, 002, 713. 32	0. 89
8	RESOLUTE ENERGY CORP	REN US	999, 461. 32	0. 89
9	CABOT OIL & GAS CORP	COG US	966, 458. 50	0. 86
10	DENBURY RESOURCES INC	DNR US	945, 264. 20	0. 84
11	ULTRA PETROLEUM CORP	UPL US	909, 044. 13	0. 81
12	EXCO RESOURCES INC	XCO US	908, 910. 24	0. 81
13	MURPHY OIL CORP	MUR US	905, 044. 68	0. 80
14	SOUTHWESTERN ENERGY CO	SWN US	893, 644. 73	0. 79
15	PDC ENERGY INC	PETD US	890, 820. 84	0. 79
16	EQT CORP	EQT US	877, 666. 74	0. 78
17	SM ENERGY CO	SM US	818, 116. 24	0. 73
18	FOREST OIL CORP	FST US	812, 190. 97	0. 72
19	CLEAN ENERGY FUELS CORP	CLNE US	800, 593. 56	0. 71
20	APPROACH RESOURCES INC	AREX US	782, 993. 92	0. 69

注：买入金额不包括相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	CIE US	1, 524, 715. 47	1. 35
2	HARVEST NATURAL RESOURCES IN	HNR US	1, 092, 423. 55	0. 97
3	ABRAXAS PETROLEUM CORP	AXAS US	1, 019, 125. 31	0. 90
4	CIMAREX ENERGY CO	XEC US	851, 238. 40	0. 75
5	PETROQUEST ENERGY INC	PQ US	824, 138. 38	0. 73
6	VAALCO ENERGY INC	EGY US	691, 256. 90	0. 61
7	WESTERN REFINING INC	WNR US	681, 479. 95	0. 60
8	APACHE CORP	APA US	660, 453. 13	0. 59
9	CHESAPEAKE ENERGY CORP	CHK US	645, 402. 95	0. 57
10	ATP OIL & GAS CORPORATION	ATPG US	639, 731. 94	0. 57
11	MAGNUM HUNTER RESOURCES CORP	MHR US	625, 382. 00	0. 55
12	ENERGY PARTNERS LTD	EPL US	614, 235. 16	0. 54
13	CLEAN ENERGY FUELS CORP	CLNE US	593, 801. 94	0. 53
14	COMSTOCK RESOURCES INC	CRK US	589, 817. 45	0. 52
15	SOUTHWESTERN ENERGY CO	SWN US	573, 023. 11	0. 51
16	RANGE RESOURCES CORP	RRC US	572, 970. 52	0. 51

17	VALERO ENERGY CORP	VLO US	567,800.36	0.50
18	TESORO CORP	TSO US	558,170.60	0.50
19	BERRY PETROLEUM CO-CLASS A	BRY US	548,405.12	0.49
20	CONTANGO OIL & GAS	MCF US	520,289.64	0.46

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	46,678,720.68
卖出收入（成交）总额	28,386,149.49

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

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名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产
----	------	------	------	-----	---------	-------

						净值比例 (%)
1	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR	ETF 基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	6,056,724.24	8.71
2	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

## 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1** 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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

**7.11.2** 本基金采取定量与定性相结合的个股精选策略，使用成长、价值、盈利等方面的指标对股票进行排序，并对排名靠前的股票进行案头研究和实地调研，深入研究企业的基本面和长期发展前景，挑选出预期表现将超过大盘的个股，构建核心组合，没有特定的股票备选库。

### 7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	262,014.04
3	应收股利	8,649.30
4	应收利息	582.28
5	应收申购款	226,698.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	55,887.80
8	其他	-
9	合计	553,832.22

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有积极投资。

**§ 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
2,886	27,010.13	5,129,905.03	6.58%	72,821,320.96	93.42%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	3,375,604.95	4.3304%

（一）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： 100 万份以上

（二）该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间： 0 至 10 万份（含）

附：数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2011 年 9 月 29 日）基金份额总额	373,243,682.43
本报告期期初基金份额总额	115,245,049.84
本报告期基金总申购份额	30,299,768.43
减：本报告期基金总赎回份额	67,593,592.28

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	77,951,225.99

注：总申购份额含红利再投资和转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2011年9月29日）起至本报告期末。

### 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

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元 数量	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	备注
Nomura International (HK) Ltd	-	43,607,157.00	58.09%	24175.52	61.35%	-
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	16,223,359.62	21.61%	7,121.56	18.07%	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	15,234,353.55	20.29%	8,106.59	20.57%	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资历雄厚，信誉良好；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本基金本报告期无新增交易单元。

### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额	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	成交金额	占当期基 金 成交总额 的比例

		的比 例						
Nomura International (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	8,149,452.30	42.47%
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	-	-	-	-	-	10,061,912.92	52.43%
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	978,364.89	5.10%
光大证券	-	-	13,000,000.00	18.65%	-	-	-	-
海通证券	-	-	21,000,000.00	30.13%	-	-	-	-
华宝证券	-	-	15,000,000.00	21.52%	-	-	-	-
华创证券	-	-	1,400,000.00	2.01%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	5,000,000.00	7.17%	-	-	-	-
银河证券	-	-	14,300,000.00	20.52%	-	-	-	-

### 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	华宝兴业基金管理有限公司关于在“e网金”网上直销平台新增上海银联电子支付服务有限公司相关银行卡支付业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年6月29日
2	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)因美国主要交易所休市暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年6月28日
3	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)上市交易提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年6月8日
4	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)上市交易公告书	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年6月5日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于	《中国证券报》、《证	2012年6月5日

	运用公司自有资金投资旗下基金的公告	券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	
6	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)因美国主要交易所休市暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年5月23日
7	华宝兴业基金管理有限公司关于在“e网金”网上直销平台新增上海银联电子支付服务有限公司相关银行卡支付业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年5月12日
8	华宝兴业基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下基金的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年3月28日
9	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加申银万国证券申购费率优惠活动并继续开通定投业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年3月15日
10	华宝兴业基金管理有限公司关于变更办公地址的预告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年2月14日
11	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券(浙江)有限责任公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2012年2月11日
12	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)资产净值公告	基金管理人网站	2012年1月4日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

2012年1月16日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自2012年1月16日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 基金合同；  
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书；  
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 托管协议；  
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司  
2012 年 8 月 27 日