

# 华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证 券投资基金 (LOF) 2015 年半年度报告 (摘要)

2015 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：2015 年 8 月 28 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 2015 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。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 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
场内简称	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	4,035,988,433.34 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
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、 021-38924558	010-67595096
传真	021-38505777	010-66275853

## 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

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	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

# § 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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	23,339,244.04
本期利润	1,277,949.51
加权平均基金份额本期利润	0.0003
本期加权平均净值利润率	0.04%
本期基金份额净值增长率	-6.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	-1,180,819,329.81
期末可供分配基金份额利润	-0.2926

期末基金资产净值	2,855,169,103.53
期末基金份额净值	0.707
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末（2015年6月30日）</b>
基金份额累计净值增长率	-29.30%

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、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、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）。

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 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	-5.23%	1.37%	-5.46%	1.45%	0.23%	-0.08%
过去三个月	-5.61%	1.57%	-5.56%	1.65%	-0.05%	-0.08%
过去六个月	-6.85%	1.90%	-2.00%	2.12%	-4.85%	-0.22%
过去一年	-46.48%	2.24%	-42.98%	2.44%	-3.50%	-0.20%
过去三年	-20.83%	1.66%	-7.13%	1.79%	-13.70%	-0.13%
自基金合同生效日起至今	-29.30%	1.62%	4.43%	1.94%	-33.73%	-0.32%

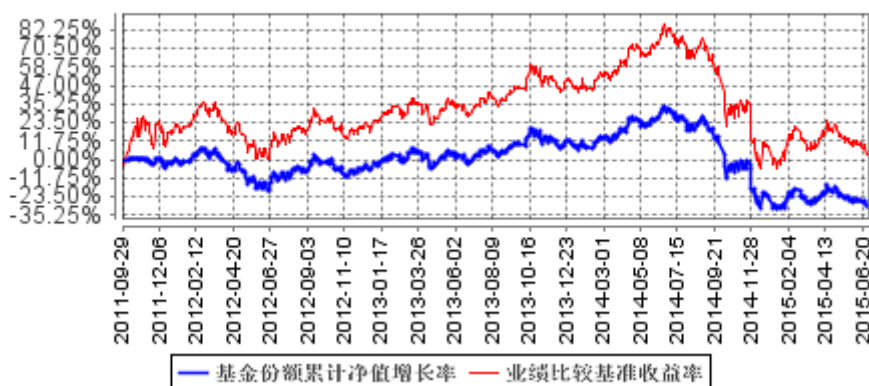
注：1、本基金业绩比较基准为：标普石油天然气上游股票指数（全收益指数）。

2、净值以及比较基准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）。

### 3.2.2 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

（2011年9月29日至2015年6月30日）

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：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（2015 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 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 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、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业活期货币市场基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向基金、华宝兴业新价值基金、华宝兴业新机遇基金、华宝兴业医疗分级基金、华宝兴业中证 1000 分级基金和华宝兴业万物互联基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 110,943,781,389.61 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		
周晶	国际业务部总经	2014	-	9 年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚

	理，本基金基金经理，华宝兴业成熟市场 QDII 基金经理、华宝兴业资产管理（香港）有限公司策略研究部经理	年 9 月 18 日			资本、泛太平洋证券（美国）和汇丰证券（美国）从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005 年至 2007 年在华宝兴业基金管理有限公司任内控审计风险管理部主管，2011 年再次加入华宝兴业基金管理有限公司任策略部总经理兼首席策略分析师，现任国际业务部总经理。2013 年 6 月起兼任华宝兴业成熟市场 QDII 基金经理，2014 年 9 月起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。目前兼任华宝兴业资产管理（香港）有限公司策略研究部经理
--	------------------------------------------------------	------------	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》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证券投资基金在短期内出现过持有现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于 5% 以及标普石油天然气上游股票指数成分股及其备选成分股的市值占基金资产净值比低于 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。

由于成分股调整，标普石油天然气上游股票指数证券投资基金在短期内出现过持有不属于标普石油天然气上游股票指数成分股及其备选成分股的情况。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，分析了本公司旗下所有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，我司服务优选基金与事件驱动基金于 6 月 11 日对股票——尚荣医疗（002551）发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的 5%。发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同，且事件驱动基金处于建仓期进行买入，服务优选为实现收益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定，同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度，不涉及利益输送行为。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

本基金采用完全复制方法跟踪标普石油天然气上游股票指数。以下为对 2015 年上半年影响标的指数表现的市场因素分析。

2015 年一季度全球油价继续低位波动。新年开始，油价继续了 2014 年下半年的下跌趋势，WTI 原油价格一度跌破 45 美元。一月底油价触底反弹，WTI 油价一度反弹至了 54 美元以上，但二月底开始由于美国库存数据一直超出预期，叠加美元指数由于对联储加息预期增强而迅速升破 100，油价继续下行，一度跌至最低 42 美元。此后，由于联储三月议息会议传递出来的信号较预期更为温和，美元指数下挫，油价开始反弹。2015 年二季度全球油价相对一季度略有回升，但是始终未能突破 60 美元关口。WTI 原油价格在五月初达到 60 美元后，一直在该价格附近震荡。截止 2015 年 6 月 30 日，WTI 油价收至 59.4 美元一桶。上半年，标普油气指数表现不及 WTI 油价。指数半年下跌 1.9%，而同期油价则上涨 10.6%。原因有两点：首先，美股整个上半年总体表现不佳，主要由于经济数据复苏之后市场对于联储加息的担忧升温，美股的疲软一定程度上压制了标普油气指数的走势。更重要的原因是，标普油气指数中的成分股一季报业绩不佳。4 月底到 5 月份是美股公布一季报的月份，而油气指数中的 74 家公司该季度公布的季报整体表现不佳，其中一半以上的公司营业利润为负数，60%以上的公司净利润出现亏损。然而，2014 年 4 季度时，指数成分股中 80 家公司，营业利润为负数的公司占比还只有 37%，净利润出现亏损的公司占比也只有



30%。指数内公司总盈利由 2014 年 Q4 的 102.93 亿美元下降至 2015 年 Q1 的-102.55 亿美元，整个行业由盈利直接步入亏损。整个上半年，油气指数下跌 6.9%，而标普 500 上半年微涨 0.2%。年化日均波幅 33.4%，也超过标普 500 指数日均波幅 12.3%的水平。

基金日常操作过程中，人民币汇率方面，2015 年一季度人民币实际交易汇率先贬值后反弹，从 6.2040 贬值至 6.2743 再反弹回 6.1996。同期人民银行中间价则从 6.1190 一路贬值至 6.1422。二季度人民币实际交易汇率比较稳定，平均维持在 6.20 左右。同期人行中间价则从 6.1422 继续一路贬值至 6.1136。整个上半年人民币实际交易价相对于人行中间价长期处于 1.5%到 2%的高溢价。与此同时，基金的规模上半年变动比较大。1 季度基金规模从 2014 年 12 月 31 日的 1.44 个亿，经过 3 个月膨胀到 2015 年 3 月 31 日的 42 个亿。而二季度基金规模有明显缩水，从一季度末的 42 亿下降到二季度末的 28.55 亿。如此巨大的规模变动伴随着极高的换汇成本，叠加双重汇率价格的负面影响，导致本基金以人民币计算的跟踪误差在 2015 年上半年有所放大。

#### 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-6.85%，同期业绩比较基准收益率为-2.00%，基金表现落后于业绩比较基准 4.85%。

#### 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 2015 年下半年，我们认为原油价格短期仍然有震荡整理的需要。目前对于油价最大的利空可能是伊朗在核问题谈判之后可能的出口扩大，而我们认为虽然伊朗核问题谈判已经取得了阶段性成果，但伊朗石油生产和出口的恢复可能远比表面上看起来的更为复杂，沙特、美国和伊朗之间的博弈后续仍然将持续一段时间；同时，作为 OPEC 主导国的沙特已经表态将大力开发自身的炼油产业，以从低廉的原油价格和全球燃油需求回升中获利，而其他 OPEC 成员国，包括海湾国家科威特与阿联酋也提升了炼油产能，增设交易分支。这些都将在需求端对于原油价格形成明显支撑。但同时，OPEC 居高不下的原油产能也会供给端对原油价格形成持续价格压力。不过考虑到美国页岩油生产由于去年底以来低迷的油价因素而大量停滞，同时随着美国夏季用油高峰的到来，我们认为油价三季度震荡向上的概率仍然偏大。

考虑到油价在二季度价格有所回升，我们估算的二季度 WTI 油价的平均价格由一季度的 50.75 美元上升到 53.75 美元一桶，同时考虑到油气公司在今年上半年普遍削减了资本开支，因此本基金投资的油气公司的盈利状况在二季度将会得到改善，我们预测七八月份美股二季报期间标普油气指数应该会有所表现，这将有助于本基金在三季度的业绩提升。

而看的更久远一些，我们认为石油的供给上升将趋于放缓，首先如果油价继续如此低迷的话，

美国页岩油生产商将面临更加严峻的财务形势，很多页岩油的开采计划有可能会被搁置，进一步提高原油供应量的可能性微乎其微；其次油价继续保持在当前的低位，OPEC 国家必然面临着政府支出减少和居民福利水准的全面下降，这种局面也是各国政府难以承受的。而需求面则有缓步增长的可能，主要来源于我们目前整体对 2015 年下半年的世界经济的谨慎乐观态度。这在很大程度上将改变今年原油的供需关系，从而有效地促进原油价格的上涨，我们仍然认为年底 WTI 油价有可能会回归到 65-75 美元一桶的水平。

#### 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过程中，公司内部参与估值流程的各方职责分工如下：

（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）、量化投资部：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，根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

（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及其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）、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

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的真实、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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		314,766,450.96	9,961,806.44
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		2,738,011,704.90	136,037,997.77
其中：股票投资		2,699,000,324.31	133,578,012.91
基金投资		39,011,380.59	2,459,984.86
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		129,500,982.97	-

应收利息		21,760.97	1,015.00
应收股利		487,233.50	6,878.74
应收申购款		2,230,213.31	5,554,886.31
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,185,018,346.61	151,562,584.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	5,239,586.44
应付赎回款		324,206,142.09	1,691,096.37
应付管理人报酬		2,742,277.86	75,597.36
应付托管费		767,837.81	21,167.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		2,132,985.32	498,826.26
负债合计		329,849,243.08	7,526,273.69
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		4,035,988,433.34	189,681,112.73
未分配利润		-1,180,819,329.81	-45,644,802.16
所有者权益合计		2,855,169,103.53	144,036,310.57
负债和所有者权益总计		3,185,018,346.61	151,562,584.26

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.707 元，基金份额总额 4,035,988,433.34 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年6月30日
一、收入		24,446,555.98	5,283,184.73
1. 利息收入		525,455.13	5,590.47

其中：存款利息收入		525,455.13	5,590.47
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		86,862,479.60	1,518,139.07
其中：股票投资收益		67,767,319.35	1,395,696.01
基金投资收益		6,233,237.11	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	220.18
股利收益		12,861,923.14	122,222.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-22,061,294.53	4,089,080.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-44,114,570.30	-347,230.18
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		3,234,486.08	17,605.19
<b>减：二、费用</b>		23,168,606.47	426,402.50
1. 管理人报酬		15,319,432.91	151,783.79
2. 托管费		4,289,441.20	42,499.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,732,523.04	24,213.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		827,209.32	207,905.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,277,949.51	4,856,782.23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,277,949.51	4,856,782.23

### 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：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015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)	189,681,112.73	-45,644,802.16	144,036,310.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	1,277,949.51	1,277,949.51
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)	3,846,307,320.61	-1,136,452,477.16	2,709,854,843.45
其中：1.基金申购款	7,189,457,062.88	-1,890,034,032.45	5,299,423,030.43
2.基金赎回款	-3,343,149,742.27	753,581,555.29	-2,589,568,186.98
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)	4,035,988,433.34	-1,180,819,329.81	2,855,169,103.53
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
项目	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)	24,347,126.23	2,927,210.04	27,274,336.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	4,856,782.23	4,856,782.23
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)	20,678,957.78	6,652,416.55	27,331,374.33
其中：1.基金申购款	38,169,578.11	10,078,209.75	48,247,787.86
2.基金赎回款	-17,490,620.33	-3,425,793.20	-20,916,413.53
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)	45,026,084.01	14,436,408.82	59,462,492.83

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：

<u>黄小薏</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
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

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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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〉》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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《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 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

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	基金境外托管人
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司 (Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司（“宝钢集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝钢集团控制的公司
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝钢集团控制的公司

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。

## 6.4.8 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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,319,432.91	151,783.79
其中：支付销售机构的客户维护费	3,046,439.66	67,432.14

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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,289,441.20	42,499.47

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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	149,978.33	149,978.33
期间申购/买入总份额	5,976,162.13	-
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	6,126,140.46	149,978.33
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.15%	0.33%

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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	100,000,000.00	2.48%	-	-
华宝信托有 限责任公司 —单一类资 金 信 托 R2007ZX057	700,000.00	0.02%	-	-

#### 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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	185,363,024.23	519,963.37	4,482,952.45	5,559.73
纽约梅隆银行	129,403,426.73	-	6,103,224.55	0.00

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。

#### 6.4.8.6 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8.7 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须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.9 期末（2015 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

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。

### 6.4.9.2 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。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 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，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 一 公允价值

#### 1. 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 2. 以公允价值计量的金融工具

##### 2.1 金融工具公允价值计量的方法

以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 2.2 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为人民币 2,738,011,704.90 元，无属于第二层级和第三层级的余额。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为人民币 136,037,997.77 元，无属于第二层级和第三层级的余额。

### 2.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

### 2.4 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

## 二 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

## 三 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	2,699,000,324.31	84.74
	其中：普通股票	2,699,000,324.31	84.74
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	39,011,380.59	1.22
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	314,766,450.96	9.88
8	其他各项资产	132,240,190.75	4.15
9	合计	3,185,018,346.61	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	占基金资产净值比列 (%)
美国	2,699,000,324.31	94.53
合计	2,699,000,324.31	94.53

## 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	占基金资产净值比列 (%)
能源	2,699,000,324.31	94.53
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	2,699,000,324.31	94.53

### 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。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

#### 7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

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	MAGNUM HUNTER RESOURCES CORP	Magnum Hunter 资源公司	MHR US	纽约	美国	4,790,738	54,769,786.41	1.92
2	PBF ENERGY INC-CLASS A	PBF 能源股份有限公司	PBF US	纽约	美国	238,730	41,478,982.27	1.45
3	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源公司	VLO US	纽约	美国	108,269	41,435,776.24	1.45
4	ALON USA ENERGY INC	Alon 美国能源公司	ALJ US	纽约	美国	358,161	41,384,443.39	1.45
5	HOLLYFRONTIER CORP	HollyFrontier 公司	HFC US	纽约	美国	156,016	40,718,550.94	1.43
6	PENN VIRGINIA CORP	Penn Virginia 公司	PVA US	纽约	美国	1,517,067	40,623,364.75	1.42
7	PHILLIPS 66	Phillips 66 公司	PSX US	纽约	美国	82,056	40,413,533.16	1.42
8	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC US	纽约	美国	124,861	39,930,849.46	1.40
9	DELEK US HOLDINGS INC	Delek 美国控股公司	DK US	纽约	美国	175,867	39,588,145.69	1.39
10	WESTERN REFINING INC	Western Refining 公司	WNR US	纽约	美国	148,351	39,561,537.34	1.39

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 [www.fsfund.com](http://www.fsfund.com) 的半年度报告正文。

#### 7.4.2 积极投资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	SANCHEZ ENERGY CORP	SN US	75,838,071.74	52.65
2	MAGNUM HUNTER RESOURCES CORP	MHR US	72,859,555.27	50.58
3	PENN VIRGINIA CORP	PVA US	67,295,288.83	46.72
4	CHESAPEAKE ENERGY CORP	CHK US	65,793,960.08	45.68
5	SANDRIDGE ENERGY INC	SD US	63,523,157.22	44.10
6	NORTHERN OIL AND GAS INC	NOG US	62,383,110.20	43.31
7	BONANZA CREEK ENERGY INC	BCEI US	61,986,976.95	43.04
8	SM ENERGY CO	SM US	60,407,959.99	41.94
9	HALCON RESOURCES CORP	HK US	60,179,360.91	41.78
10	DENBURY RESOURCES INC	DNR US	59,960,828.03	41.63
11	PBF ENERGY INC-CLASS A	PBF US	59,556,262.12	41.35
12	STONE ENERGY CORP	SGY US	59,137,038.30	41.06
13	TRIANGLE PETROLEUM CORP	TPLM US	59,106,964.58	41.04
14	ROSETTA RESOURCES INC	ROSE US	58,989,031.83	40.95
15	MATADOR RESOURCES CO	MTDR US	58,950,063.07	40.93
16	EXCO RESOURCES INC	XCO US	58,938,837.32	40.92
17	BILL BARRETT CORP	BBG US	58,531,037.63	40.64
18	HESS CORP	HES US	58,298,540.50	40.47
19	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	PE US	58,052,354.38	40.30
20	ENERGEN CORP	EGN US	57,803,127.29	40.13
21	ENERGY XXI LTD	EXXI US	57,663,347.38	40.03
22	MARATHON OIL CORP	MRO US	57,656,320.76	40.03
23	PDC ENERGY INC	PDCE US	57,238,305.83	39.74
24	NEWFIELD EXPLORATION CO	NFX US	57,173,650.99	39.69
25	OASIS PETROLEUM INC	OAS US	56,544,279.83	39.26
26	LAREDO PETROLEUM INC	LPI US	56,435,714.86	39.18
27	EP ENERGY CORP-CL A	EPE US	56,413,742.58	39.17
28	ULTRA PETROLEUM CORP	UPL US	55,995,406.96	38.88
29	CARRIZO OIL & GAS INC	CRZO US	55,977,973.77	38.86
30	WHITING PETROLEUM CORP	WLL US	55,023,097.11	38.20
31	QEP RESOURCES INC	QEP US	54,986,471.03	38.18
32	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	CLR US	54,794,093.25	38.04
33	MURPHY OIL CORP	MUR US	54,566,113.50	37.88
34	VALERO ENERGY CORP	VLO US	54,556,105.74	37.88
35	RANGE RESOURCES CORP	RRC US	54,451,025.03	37.80
36	DIAMONDBACK ENERGY INC	FANG US	53,991,646.99	37.48
37	APACHE CORP	APA US	53,963,359.75	37.47
38	CHEVRON CORP	CVX US	53,937,508.42	37.45



39	SOUTHWESTERN ENERGY CO	SWN US	53,907,321.99	37.43
40	EXXON MOBIL CORP	XOM US	53,774,234.32	37.33
41	SYNERGY RESOURCES CORP	SYRG US	53,649,072.03	37.25
42	PHILLIPS 66	PSX US	53,589,628.44	37.21
43	CALLON PETROLEUM CO	CPE US	53,379,762.95	37.06
44	NOBLE ENERGY INC	NBL US	53,288,408.82	37.00
45	EOG RESOURCES INC	EOG US	53,155,941.08	36.90
46	CONCHO RESOURCES INC	CXO US	53,124,129.34	36.88
47	CVR ENERGY INC	CVI US	52,742,810.09	36.62
48	RSP PERMIAN INC	RSPP US	52,612,674.30	36.53
49	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	52,504,598.23	36.45
50	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	52,441,408.68	36.41
51	DEVON ENERGY CORP	DVN US	52,276,571.45	36.29
52	MEMORIAL RESOURCE DEVELOPMEN	MRD US	52,090,846.96	36.17
53	CONOCOPHILLIPS	COP US	52,009,023.01	36.11
54	WPX ENERGY INC	WPX US	51,929,683.16	36.05
55	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	51,780,859.45	35.95
56	ANTERO RESOURCES CORP	AR US	51,732,730.19	35.92
57	WORLD FUEL SERVICES CORP	INT US	51,663,793.70	35.87
58	RICE ENERGY INC	RICE US	51,621,238.01	35.84
59	KOSMOS ENERGY LTD	KOS US	51,173,549.80	35.53
60	CABOT OIL & GAS CORP	COG US	50,678,757.25	35.18
61	EQT CORP	EQT US	50,553,514.17	35.10
62	DELEK US HOLDINGS INC	DK US	49,715,654.07	34.52
63	TESORO CORP	TSO US	49,558,764.47	34.41
64	CIMAREX ENERGY CO	XEC US	49,460,484.88	34.34
65	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	CIE US	48,670,755.31	33.79
66	WESTERN REFINING INC	WNR US	48,496,323.37	33.67
67	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	47,412,649.68	32.92
68	GREEN PLAINS INC	GPRE US	47,202,432.97	32.77
69	HOLLYFRONTIER CORP	HFC US	46,977,295.55	32.61
70	CONTANGO OIL & GAS	MCF US	46,928,936.95	32.58
71	GULFPORT ENERGY CORP	GPOR US	46,654,063.42	32.39
72	CLEAN ENERGY FUELS CORP	CLNE US	46,394,655.75	32.21
73	ALON USA ENERGY INC	ALJ US	44,479,089.42	30.88
74	APPROACH RESOURCES INC	AREX US	43,689,936.83	30.33
75	VAALCO ENERGY INC	EGY US	43,216,472.58	30.00
76	CALIFORNIA RESOURCES CORP	CRC US	41,855,103.37	29.06
77	ABRAXAS PETROLEUM CORP	AXAS US	40,039,637.86	27.80

78	COMSTOCK RESOURCES INC	CRK US	34,167,142.86	23.72
79	CLAYTON WILLIAMS ENERGY INC	CWEI US	33,211,772.84	23.06
80	REX AMERICAN RESOURCES CORP	REX US	28,707,100.77	19.93
81	REX ENERGY CORP	REXX US	19,454,569.27	13.51

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	EXCO RESOURCES INC	XCO US	52,714,696.61	36.60
2	APPROACH RESOURCES INC	AREX US	45,558,598.41	31.63
3	ABRAXAS PETROLEUM CORP	AXAS US	43,142,829.65	29.95
4	ROSETTA RESOURCES INC	ROSE US	40,285,068.93	27.97
5	LAREDO PETROLEUM INC	LPI US	37,941,647.07	26.34
6	SANCHEZ ENERGY CORP	SN US	36,132,344.76	25.09
7	EP ENERGY CORP-CL A	EPE US	35,598,342.98	24.71
8	MATADOR RESOURCES CO	MTDR US	33,650,556.25	23.36
9	CLEAN ENERGY FUELS CORP	CLNE US	33,396,274.68	23.19
10	SM ENERGY CO	SM US	32,705,842.34	22.71
11	NEWFIELD EXPLORATION CO	NFX US	32,347,811.92	22.46
12	PDC ENERGY INC	PDCE US	31,892,687.35	22.14
13	REX AMERICAN RESOURCES CORP	REX US	31,544,022.86	21.90
14	OASIS PETROLEUM INC	OAS US	29,987,755.26	20.82
15	CLAYTON WILLIAMS ENERGY INC	CWEI US	28,559,029.68	19.83
16	NORTHERN OIL AND GAS INC	NOG US	27,996,827.07	19.44
17	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	PE US	27,511,153.67	19.10
18	ENERGEN CORP	EGN US	27,237,635.32	18.91
19	CONTANGO OIL & GAS	MCF US	26,273,611.94	18.24
20	CARRIZO OIL & GAS INC	CRZO US	26,169,572.97	18.17
21	VAALCO ENERGY INC	EGY US	26,130,530.18	18.14
22	DIAMONDBACK ENERGY INC	FANG US	25,486,161.57	17.69
23	COMSTOCK RESOURCES INC	CRK US	24,472,548.08	16.99
24	REX ENERGY CORP	REXX US	24,020,626.69	16.68
25	ALON USA ENERGY INC	ALJ US	23,468,763.14	16.29
26	CONCHO RESOURCES INC	CXO US	22,890,695.61	15.89
27	CONTINENTAL RESOURCES	CLR US	22,831,385.88	15.85

	INC/OK			
28	RICE ENERGY INC	RICE US	22,749,683.77	15.79
29	ENERGY XXI LTD	EXXI US	22,554,133.16	15.66
30	VALERO ENERGY CORP	VLO US	22,445,724.15	15.58
31	TRIANGLE PETROLEUM CORP	TPLM US	22,402,997.13	15.55
32	CALLON PETROLEUM CO	CPE US	22,121,510.54	15.36
33	WPX ENERGY INC	WPX US	21,994,861.50	15.27
34	CABOT OIL & GAS CORP	COG US	21,682,631.47	15.05
35	WHITING PETROLEUM CORP	WLL US	21,510,278.31	14.93
36	RANGE RESOURCES CORP	RRC US	21,062,072.30	14.62
37	CALIFORNIA RESOURCES CORP	CRC US	21,035,146.06	14.60
38	PENN VIRGINIA CORP	PVA US	21,023,882.28	14.60
39	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	CIE US	20,717,525.72	14.38
40	MARATHON OIL CORP	MRO US	20,672,820.48	14.35
41	PHILLIPS 66	PSX US	20,526,802.09	14.25
42	GREEN PLAINS INC	GPPE US	20,513,211.71	14.24
43	DENBURY RESOURCES INC	DNR US	20,361,536.83	14.14
44	RSP PERMIAN INC	RSPP US	19,573,715.24	13.59
45	HESS CORP	HES US	19,498,754.32	13.54
46	STONE ENERGY CORP	SGY US	19,495,354.60	13.54
47	DELEK US HOLDINGS INC	DK US	19,411,930.72	13.48
48	PBF ENERGY INC-CLASS A	PBF US	18,956,701.36	13.16
49	ULTRA PETROLEUM CORP	UPL US	18,720,791.54	13.00
50	BONANZA CREEK ENERGY INC	BCEI US	18,011,538.25	12.50
51	CIMAREX ENERGY CO	XEC US	17,920,893.85	12.44
52	EQT CORP	EQT US	17,708,494.25	12.29
53	SYNERGY RESOURCES CORP	SYRG US	16,915,504.35	11.74
54	MEMORIAL RESOURCE DEVELOPMEN	MRD US	16,912,248.84	11.74
55	KOSMOS ENERGY LTD	KOS US	16,524,302.08	11.47
56	DEVON ENERGY CORP	DVN US	16,420,893.47	11.40
57	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	15,905,551.69	11.04
58	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	15,862,471.38	11.01
59	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	15,425,416.90	10.71
60	NOBLE ENERGY INC	NBL US	15,286,415.61	10.61
61	WESTERN REFINING INC	WNR US	15,228,902.47	10.57
62	EOG RESOURCES INC	EOG US	15,132,846.15	10.51
63	SOUTHWESTERN ENERGY CO	SWN US	14,866,983.48	10.32
64	ANTERO RESOURCES CORP	AR US	14,562,782.91	10.11
65	BILL BARRETT CORP	BBG US	14,369,062.30	9.98
66	HOLLYFRONTIER CORP	HFC US	14,338,477.86	9.95

67	APACHE CORP	APA US	14,204,849.65	9.86
68	CONOCOPHILLIPS	COP US	14,151,193.47	9.82
69	SANDRIDGE ENERGY INC	SD US	13,881,211.71	9.64
70	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	13,766,883.06	9.56
71	CVR ENERGY INC	CVI US	13,760,711.85	9.55
72	EXXON MOBIL CORP	XOM US	13,690,624.55	9.50
73	QEP RESOURCES INC	QEP US	13,677,678.76	9.50
74	CHEVRON CORP	CVX US	13,604,265.97	9.45
75	CHESAPEAKE ENERGY CORP	CHK US	13,543,995.88	9.40
76	GULFPORT ENERGY CORP	GPOR US	13,403,404.09	9.31
77	TESORO CORP	TSO US	13,385,762.45	9.29
78	WORLD FUEL SERVICES CORP	INT US	13,229,348.15	9.18
79	MURPHY OIL CORP	MUR US	13,206,459.05	9.17
80	MAGNUM HUNTER RESOURCES CORP	MHR US	12,715,806.81	8.83
81	HALCON RESOURCES CORP	HK US	11,723,294.76	8.14

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	4,300,933,089.66
卖出收入（成交）总额	1,782,317,362.20

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序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前十名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序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末金融衍生品余额为零。

### 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	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	39,011,380.59	1.37

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	129,500,982.97
3	应收股利	487,233.50
4	应收利息	21,760.97
5	应收申购款	2,230,213.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	132,240,190.75

### 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
62,012	65,083.99	329,976,251.89	8.18%	3,706,012,181.45	91.82%

### 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	华宝投资有限公司	100,000,000.00	2.48%
2	王民峰	76,139,471.00	1.89%
3	王静	52,269,050.00	1.30%
4	崔玉梅	49,129,400.00	1.22%
5	恒泰证券—光大银行—恒泰创富 37号集合资产管理计划	41,579,581.00	1.03%
6	恒泰证券—光大银行—恒泰创富 36号集合资产管理计划	40,000,000.00	0.99%
7	沈阳中一集团有限公司	25,000,000.00	0.62%
8	沈阳皇朝万鑫房屋开发有限公司	25,000,000.00	0.62%
9	张兴华	23,524,134.00	0.58%
10	孙志坚	21,029,868.00	0.52%
11	刘俊容	20,036,764.00	0.50%

注：上述持有人均为场内持有人。

### 8.3 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
基金管理人所有从业人员 持有本基金	7,479,073.71	0.1853%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 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	189,681,112.73
本报告期基金总申购份额	7,189,457,062.88
减：本报告期基金总赎回份额	3,343,149,742.27
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	4,035,988,433.34

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本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

报告期内，基金管理人、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

本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

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 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

1、报告期内基金管理人受稽查或处罚的情况

因公司原基金经理牟旭东被追究“利用非公开信息交易”刑事责任，上海证监局于 2014 年

11 月对公司进行了专项检查。公司于 2015 年 1 月 23 日收到了上海证监局下发的《沪证监决【2015】18 号-关于华宝兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。公司已经完成了相关问题的整改，并已向上海证监局上报了专项报告。

2、报告期内，本基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、报告期内，基金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	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	
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	3,312,158,622.38	54.45%	1,473,504.84	54.65%	-
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	1,910,214,910.32	31.40%	764,086.60	28.34%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	696,224,623.83	11.44%	345,643.50	12.82%	-
Nomura International (HK) Ltd	-	164,652,295.33	2.71%	112,776.17	4.18%	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

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：资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；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、本报告期交易单元无变动。

### 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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	150,890,922.07	37.54%
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	-	-	-	-	-	101,602,315.46	25.28%
Nomura International (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	149,472,582.99	37.19%
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司  
2015 年 8 月 28 日