

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证  
券投资基金(LOF)  
2017 年半年度报告(摘要)

2017 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：2017 年 8 月 25 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 2017 年 8 月 22 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 2017 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	5,688,001,541.05 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 年 6 月 8 日

注：1. 本基金另设美元份额，基金代码 001481，与人民币份额并表披露。

2. 截止本报告期末，本基金人民币份额净值 0.541 元，人民币总份额 3,068,650,752.74 份；本基金美元份额净值 0.0799 美元，美元总份额 1,257,849.82 份。

### 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	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-10,202,344.28
本期利润	-748,792,470.50
加权平均基金份额本期利润	-0.1649
本期加权平均净值利润率	-26.61%
本期基金份额净值增长率	-24.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-2,610,829,610.50
期末可供分配基金份额利润	-0.4590
期末基金资产净值	3,077,171,930.55
期末基金份额净值	0.541
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-45.90%

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 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	-3.22%	2.05%	-3.14%	2.18%	-0.08%	-0.13%
过去三个月	-15.99%	1.79%	-16.09%	1.89%	0.10%	-0.10%
过去六个月	-24.23%	1.62%	-24.39%	1.70%	0.16%	-0.08%
过去一	-6.40%	1.86%	-5.24%	1.94%	-1.16%	-0.08%

年						
过去三年	-59.05%	2.47%	-55.73%	2.63%	-3.32%	-0.16%
自基金合同生效日起至今	-45.90%	2.01%	-18.91%	2.24%	-26.99%	-0.23%

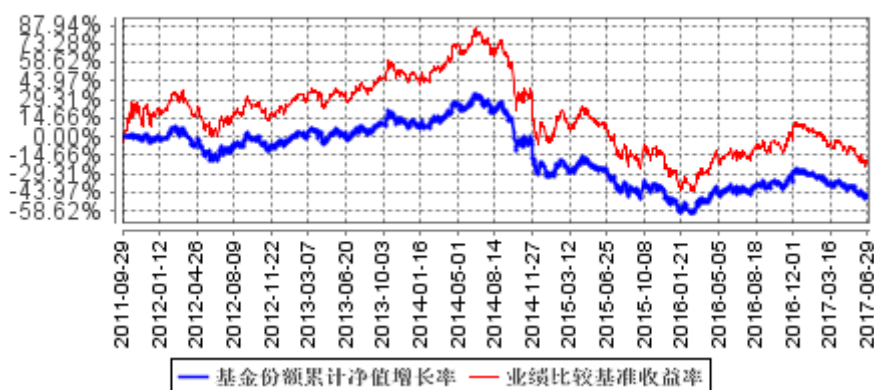
注：1、本基金业绩比较基准为：标普石油天然气上游股票指数（全收益指数）。

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2017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（2017 年 6 月 30 日），所管理的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、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、中国互联网基金、华宝兴业医药生物基金、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、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业 1000 分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业转型升级基金、核心优势基金、美国消费基金、宝鑫纯债基金、香港中小盘基金、中证全指证券公司 ETF、中证军工 ETF、新活力基金、沪深 300 指数增强基金、未来产业主导基金、新起点基金、红利基金、新动力基金、新飞跃基金、新回报基金、新优选基金、香港大盘基金、智慧产业基金、第三产业基金及新优享基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 122,557,514,320.78 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	国际业务部总经理、本基金基金经理、华宝中国互联股票、美国消费、华宝兴业	2014 年 9 月 18 日	-	11 年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、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公司任内控审计

	<p>标普香港上市中国中小盘指数 (LOF)、华宝兴业港股通恒生中国 (香港上市) 25 指数 (场内简称“香港大盘”) 基金经理、华宝兴业资产管理 (香港) 有限公司总经理</p>			<p>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 月至 2015 年 11 月任华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金经理, 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, 2015 年 9 月兼任华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金经理。2016 年 3 月任华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2016 年 6 月兼任华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 4 月任华宝兴业港股通恒生中国 (香港上市) 25 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) 有限公司总经理。</p>
--	---	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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以及指数成分股的调整，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%及持有不属于标普石油天然气上游股票指数成分股的情况。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，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

本基金采用全复制方法跟踪标普石油天然气上游股票指数 在报告期内按照这一原则比较好的实现了基金跟踪指数表现的目的。以下为对影响标的指数表现的市场因素分析。

17 年上半年全球油价震荡下行，下行跌破 50 美元大关后，最低触及 43 美元。截止六月三十日，WTI 油价收至 46.33 美元一桶，相对去年年末下跌 14.0%。油价下跌的主要原因首先是美国原油产量不断创新高，其次是投资者担忧欧佩克国家减产执行的力度，再次在于全球经济复苏缓

慢导致对原油的需求增速低于原先预期。油价的下跌牵连跟踪石油上游股票的基金标的指数走弱。整个 17 年上半年，本基金跟踪的标普石油天然气上游股票指数下跌 22.6%，下跌幅度高于国际油价下跌。主要原因在于较高的美股估值使股指相对油价本身修正更多。17 年上半年标普油气指数年化日均波幅 26.3%，超过标普 500 指数日均波幅 7.0%的水平。

日常操作过程中，人民币汇率方面，2017 年上半年人民币汇率震荡上行。上半年人行美元中间价从 6.9370 升值至 6.7744，相对于美元升值 2.3%。同期，人民币交易价也相对于美元升值 2.4%左右。基金在仓位控制上一直比较谨慎，尽可能使得基金的业绩表现能够和业绩比较基准贴近。整个上半年，华宝油气基金年化跟踪误差（剔除汇率因素）约为 1.7%。

#### 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-24.23%，同期业绩比较基准收益率为-24.39%，基金表现领先于业绩比较基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对于下半年油价走势保持谨慎态度，认为油价大概率将在 45-55 美元区间震荡。2017 年以来，OPEC 国家的原油减产执行率都保持在较高水平，且非 OPEC 国家的减产执行率也在逐步提高。而从最近的数据来看，美国原油产量有到达瓶颈的趋势，EIA 统计的美国原油库存六月底以来连续四周下降。随着夏季需求高峰季节的到来，美国炼油厂对原油的需求也将增加。我们认为 WTI 油价在三季度很有可能回到 55 美元每桶的水平。

但就中长期角度而言，OPEC 国家的减产行为只是有利于原油供需平衡格局的提前完成，对于短期价格有一定的支撑作用，但是原油价格的上涨会带动美国页岩油的增产，从而引发进一步的油价博弈。考虑到随着技术进步，美国页岩油的成本一直处于下降趋势，因此油价很难重新形成单边行情。另一方面，我们也要看到随着技术进步，新能源对于传统燃料的替代速度也会不断加快，油价回到以往 100 美元每桶的区间概率微乎其微。因此四季度油价反弹到 55 美元一桶的位置之后，很可能将引发投资者对美国产量提升的新一轮担忧，同时明年三月 OPEC 再度延长的可能性并不大，这也将压制油价的进一步反弹空间。

我们当前对美股下半年走势仍然保持谨慎乐观的态度。首先美国经济整体向上的趋势仍然在

继续。美国 17 年一季度 GDP 增速 1.4%，二季度 GDP 预计增速 2.6%，较 16 年同期的 0.8% 和 1.4% 都有明显提升。经济的进一步走强，将带来企业盈利的增长，从而推动股价进一步走高。其次，联储目前对于加息和缩表仍然处于谨慎态度，上半年加息两次后，下半年估计九月启动缩表，十二月再加息一次，货币政策仍然相对宽松。美国债券收益率目前仍然处于非常低的水平，作为基准的 10 年期美国国债的收益率目前 2.3% 左右。考虑到联储政策偏鸽派，美国国债下半年收益率大幅攀升的可能性并不大。处于低位的债券收益率水平将对美股估值提供强有力的支撑。考虑到能源板块是上半年整个美股表现最差的板块，标的指数相对于油价明显超跌。因此三季度油价如果能够如期反弹的话，标的指数应该相对于油价有更优的表现。

#### 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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

#### **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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		183,296,318.31	147,109,755.11
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		2,923,753,335.38	2,372,678,919.46
其中：股票投资		2,901,014,306.84	2,342,464,101.87
基金投资		22,739,028.54	30,214,817.59
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		-	-
应收利息		19,934.92	10,301.33
应收股利		630,724.69	407,748.05
应收申购款		17,656,397.26	26,862,910.74
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,125,356,710.56	2,547,069,634.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		27,783,724.37	-
应付赎回款		16,673,803.65	21,197,538.62
应付管理人报酬		2,334,466.99	2,172,425.06
应付托管费		653,650.75	608,279.04
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		739,134.25	1,575,305.16
负债合计		48,184,780.01	25,553,547.88
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		5,688,001,541.05	3,530,403,415.23
未分配利润		-2,610,829,610.50	-1,008,887,328.42
所有者权益合计		3,077,171,930.55	2,521,516,086.81
负债和所有者权益总计		3,125,356,710.56	2,547,069,634.69

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5410 元，基金份额总额 5,688,001,541.05 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-729,104,389.52	556,267,522.09
1. 利息收入		301,944.54	372,375.86
其中：存款利息收入		301,944.54	372,375.86
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）		14,730,326.58	38,384,912.36
其中：股票投资收益		1,468,945.79	36,071,871.37
基金投资收益		-	-14,327,354.32
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		-	-
股利收益		13,261,380.79	16,640,395.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-738,590,126.22	508,859,234.74

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-6,359,901.56	5,852,523.20
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		813,367.14	2,798,475.93
<b>减：二、费用</b>		19,688,080.98	21,645,899.08
1. 管理人报酬		13,905,187.59	14,983,293.25
2. 托管费		3,893,452.50	4,195,322.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		985,851.59	1,511,567.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		903,589.30	955,716.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-748,792,470.50	534,621,623.01
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-748,792,470.50	534,621,623.01

### 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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	3,530,403,415.23	-1,008,887,328.42	2,521,516,086.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-748,792,470.50	-748,792,470.50
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）	2,157,598,125.82	-853,149,811.58	1,304,448,314.24
其中：1.基金申购款	3,241,353,483.41	-1,251,639,463.40	1,989,714,020.01
2.基金赎回款	-1,083,755,357.59	398,489,651.82	-685,265,705.77



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）	5,688,001,541.05	-2,610,829,610.50	3,077,171,930.55
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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）	6,626,822,168.13	-3,344,099,436.46	3,282,722,731.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	534,621,623.01	534,621,623.01
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）	-1,778,173,714.10	763,812,474.85	-1,014,361,239.25
其中：1.基金申购款	2,301,232,626.69	-1,061,286,472.66	1,239,946,154.03
2.基金赎回款	-4,079,406,340.79	1,825,098,947.51	-2,254,307,393.28
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）	4,848,648,454.03	-2,045,665,338.60	2,802,983,115.43

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：

\_\_\_\_\_  
黄小蕙

\_\_\_\_\_  
向辉

\_\_\_\_\_  
张幸骏

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”)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《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, 由华宝兴业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》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 373, 155, 341.85 元, 业经安永华明会计师事务所安永华明 (2011) 验字第 60737318\_B05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《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》于 2011 年 9 月 29 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 373, 243, 682.43 份基金份额, 其中认购资金利息折合 88, 340.58 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司, 境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司 (The Bank of New York Mellon Corporation)。

本基金根据认购、申购、赎回所使用货币的不同, 将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别, 称为人民币份额; 以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别, 称为美元份额。本基金对人民币份额和美元份额分别设置代码, 分别计算基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《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》和《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》的有关规定, 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。

自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前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，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前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，在境内暂不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。

根据中国证监会于 2017 年 7 月 21 日发布的《关于核准华宝兴业基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可（2017）1321 号），中国证监会已核准“领先资产管理有限公司”将持有的我公司 49% 的股权转让给 Warburg Pincus Asset Management, L.P.。我公司及相关股东目前正在办理后续的工商变更登记等相关事宜，敬请投资者知悉。

### 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（“华宝兴业”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司（“纽约梅隆银行”）(The Bank of New York Mellon Corporation)	境外资产托管人
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
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司

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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,905,187.59	14,983,293.25
其中：支付销售机构的客户维护费	3,419,875.70	2,910,881.03

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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,893,452.50	4,195,322.11

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

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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
期初持有的基金份额	6,126,140.46	6,126,140.46
期间申购/买入总份额	-	-
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	6,126,140.46
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%	0.13%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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

本基金本报告期末及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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
纽约梅隆银行	30,827,522.99	-	230,851,653.60	-
中国建设银行	152,468,795.32	297,750.76	13,394,248.84	369,583.55

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（2017 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 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次的余额为 2,923,753,335.38 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2016 年 12 月 31

日：第一层次 2,372,678,919.46 元，无第二层次和第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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，暂适用简易计税方法，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	2,901,014,306.84	92.82
	其中：普通股票	2,901,014,306.84	92.82
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	22,739,028.54	0.73
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	183,296,318.31	5.86
8	其他各项资产	18,307,056.87	0.59
9	合计	3,125,356,710.56	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	2,901,014,306.84	94.28
合计	2,901,014,306.84	94.28

### 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	2,901,014,306.84	94.28
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	2,901,014,306.84	94.28

### 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	RICE ENERGY INC	Rice 能源股份有限公司	RICE US	纽约	美国	417,513	75,320,293.79	2.45
2	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天然气公司	COG US	纽约	美国	369,156	62,720,324.99	2.04
3	GULFPORT ENERGY CORP	Gulfport 能源公司	GPOR US	纳斯达克	美国	615,619	61,514,127.97	2.00

4	HOLLYFRONTIER CORP	HollyFrontier 公司	HFC US	纽约	美国	329,162	61,254,667.70	1.99
5	PHILLIPS 66	Phillips 66 公司	PSX US	纽约	美国	106,149	59,462,030.51	1.93
6	EQT CORP	EQT 公司	EQT US	纽约	美国	149,519	59,345,899.68	1.93
7	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO US	纽约	美国	129,425	59,147,357.53	1.92
8	QEP RESOURCES INC	QEP 资源公司	QEP US	纽约	美国	857,491	58,670,769.01	1.91
9	TESORO CORP	特索罗公司	TSO US	纽约	美国	92,027	58,352,833.54	1.90
10	MURPHY OIL CORP	墨菲石油公司	MUR US	纽约	美国	335,037	58,171,761.35	1.89

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益明细，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	TESORO CORP	TSO US	77,219,138.94	3.06
2	NOBLE ENERGY INC	NBL US	71,647,776.86	2.84
3	SANCHEZ ENERGY CORP	SN US	46,219,363.43	1.83
4	GULFPORT ENERGY CORP	GPOR US	44,917,617.46	1.78
5	WHITING PETROLEUM CORP	WLL US	44,837,743.49	1.78
6	QEP RESOURCES INC	QEP US	44,675,674.78	1.77
7	SM ENERGY CO	SM US	44,145,890.76	1.75

8	SOUTHWESTERN ENERGY CO	SWN US	43,803,458.04	1.74
9	CARRIZO OIL & GAS INC	CRZO US	43,031,462.12	1.71
10	CENTENNIAL RESOURCE DEVELO-A	CDEV US	38,956,085.14	1.54
11	PDC ENERGY INC	PDCE US	38,397,638.22	1.52
12	RANGE RESOURCES CORP	RRC US	37,404,643.92	1.48
13	CHESAPEAKE ENERGY CORP	CHK US	37,001,840.75	1.47
14	OASIS PETROLEUM INC	OAS US	36,941,877.51	1.47
15	CALLON PETROLEUM CO	CPE US	36,646,051.42	1.45
16	NEWFIELD EXPLORATION CO	NFX US	35,634,534.60	1.41
17	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	35,194,948.74	1.4
18	MARATHON OIL CORP	MRO US	34,145,561.64	1.35
19	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	CLR US	33,961,616.25	1.35
20	DEVON ENERGY CORP	DVN US	33,851,013.73	1.34

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	CLAYTON WILLIAMS ENERGY INC	CWEI US	85,783,292.77	3.40
2	TESORO CORP	TSO US	68,778,247.42	2.73
3	WESTERN REFINING INC	WNR US	59,771,009.33	2.37
4	NOBLE ENERGY INC	NBL US	37,148,921.85	1.47
5	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	22,518,785.91	0.89
6	MURPHY OIL CORP	SRCI US	19,920,537.42	0.79

7	RESOLUTE ENERGY CORP	REN US	19,704,751.82	0.78
8	BILL BARRETT CORP	BBG US	15,484,240.05	0.61
9	VALERO ENERGY CORP	VLO US	14,162,505.16	0.56
10	CABOT OIL & GAS CORP	COG US	14,032,381.88	0.56
11	ENERGEN CORP	EGN US	14,004,300.83	0.56
12	MURPHY OIL CORP	MTDR US	12,366,890.69	0.49
13	EXXON MOBIL CORP	XOM US	12,361,885.45	0.49
14	PHILLIPS 66	PSX US	11,879,277.23	0.47
15	PDC ENERGY INC	GPPE US	11,634,454.32	0.46
16	CHEVRON CORP	CVX US	11,344,991.29	0.45
17	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	11,016,069.57	0.44
18	CONOCOPHILLIPS	COP US	10,344,761.60	0.41
19	CONCHO RESOURCES INC	CXO US	9,391,977.09	0.37
20	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	9,147,099.20	0.36

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	1,956,328,884.39
卖出收入（成交）总额	668,133,106.16

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	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	22,739,028.54	0.74

### 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	-
3	应收股利	630,724.69
4	应收利息	19,934.92
5	应收申购款	17,656,397.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,307,056.87

#### 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
117, 135	48, 559. 37	471, 832, 222. 17	8. 30%	5, 216, 169, 318. 88	91. 70%

### 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	工银瑞信基金－工商银行－特定 客户资产管理	42, 192, 248. 00	0. 74%
2	国泰君安证券－建设银行－国泰 君安君得鑫股票集合资产管理计 划	36, 888, 000. 00	0. 65%
3	上海平安阖鼎投资管理有限责任 公司－平安阖鼎－全天候私募菁 英	32, 310, 000. 00	0. 57%
4	张志秀	32, 110, 201. 00	0. 56%
5	朱伟	31, 017, 458. 00	0. 55%
6	永安国富资产管理有限公司－永 安国富－永富 7 号私募资产管理	26, 952, 732. 00	0. 47%
7	章宁翔	24, 541, 300. 00	0. 43%
8	齐鲁证券资管－工商银行－齐鲁 星河 7 号集合资产管理计划	19, 326, 500. 00	0. 34%
9	深圳市融通资本管理股份有限公 司	19, 066, 500. 00	0. 34%
10	杨俊霞	17, 000, 000. 00	0. 30%
11	北京望道投资管理有限公司－望 道博泽进取 1 号私募基金	17, 000, 000. 00	0. 30%

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	7, 915, 469. 42	0. 1392%

持有本基金		
-------	--	--

#### 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	373,243,682.40
本报告期期初基金份额总额	3,530,403,415.23
本报告期基金总申购份额	3,241,353,483.41
减：本报告期基金总赎回份额	1,083,755,357.59
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	5,688,001,541.05

## § 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

#### 1、基金管理人的重大人事变动

2017 年 6 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，副总经理任志强先生因个人原因，自 2017 年 5 月 31 日起不再担任副总经理的职务。

2017 年 8 月 11 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，董事长郑安国先生因个人原因，自 2017 年 8 月 9 日起不再担任董事长的职务，由孔祥清先生接任公司董事长职务。

#### 2、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，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、基金财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

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2015 年 12 月 15 日至本报告期末。

### 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、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	
Nomura International (HK) Ltd	-	1,053,589,578.27	43.30%	421,436.36	43.30%	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	703,292,521.08	28.90%	281,316.69	28.90%	-
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	676,488,829.12	27.80%	270,596.42	27.80%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	-	-	-	-	-
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：资力雄厚，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
Nomura International (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

华宝兴业基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日