

# 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 (更新) 摘要

2017 年第 2 号

基金管理人：华宝基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

### 【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会 2011 年 8 月 12 日证监许可【2011】1301 号文核准募集。

基金管理人保证《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》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。另外，本基金投资的标的为石油天然气上游行业上市公司的股票，而非与原油价格直接挂钩的现货商品或期货，因此，本基金的业绩表现虽然与油气价格变化存在明显差异，但是也可能随着油气价格波动而出现较大波动。

本基金已于 2012 年 6 月 8 日在深圳证券交易所上市交易。在上市交易期间，如继续接受申购可能导致本基金突破国家外汇局批准的外汇额度，此时本基金将暂停申购，由此可能导致二级市场价格短期内剧烈波动并出现较大折溢价。这种折溢价水平会在国家外汇局批准基金管理人新增外汇额度以及本基金恢复申购业务后大幅缩小。

根据深圳证券交易所于 2015 年 1 月 9 日发布的关于修改《深圳证券交易所交易规则》第 3.1.4 条的通知，本基金已于 2015 年 1 月 19 日起实行当日回转交易，即 T+0 回转交易。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书摘要所载内容截止日为 2017 年 9 月 29 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日，财务数据未经审计。

## 一、 基金管理人

### (一) 基金管理人概况

基金管理人：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：孔祥清

总经理：HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元

电话：021-38505888

联系人：章希

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份，外方股东 Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持有 49% 的股份。

### (二) 主要人员情况

#### 1. 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

##### (1) 董事会成员

孔祥清先生，董事长，硕士，高级会计师。曾任宝钢计财部资金处主办、主管、副处长，宝钢集团财务有限公司总经理。现任华宝基金管理有限公司董事长、华宝投资有限公司副总经理、法兴华宝汽车租赁（上海）有限公司董事长、华宝信托有限责任公司董事、华宝都鼎（上海）融资租赁有限公司董事长、中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大 TD Securities 公司金融分析师，Acthop 投资公司财务总监。2003 年 5 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任华宝基金管理有限公司总经理。

Michael Martin 先生，董事，博士。曾任 Wachtell Lipton Rosen & Katz 律师助理；第一波士顿银行董事总经理；瑞银证券董事总经理；Brooklyn NY Holdings 总裁；现任美国华平投资集团全球执行委员会成员、全球金融行业负责人、董事总经理，美国 Financial Engines 董事、加拿大 DBRS 董事、美国 Mariner Finance 董事。

周朗朗先生，董事，本科。曾任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）分析师；花旗银行（香港）投资银行部分析师；现任美国华平集团中国金融行业负责人、董事总经理，华融资产管理股份有限公司董事，上海灿谷投资管理咨询服务股份有限公司董事。

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师、飞利浦电子中国集团法律顾问、上海市邦信阳律师事务所合伙人。现任上海胡光律师事务所主任、首席合伙人。

尉安宁先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视大学讲师，中国社会科学院经济研究所助理研究员，世界银行农业经济学家，荷兰合作银行东北亚区食品农业研究主管，新希望集团常务副总裁，比利时富通银行中国区 CEO 兼上海分行行长，山东亚太中慧集团董事长。现任上海谷旺投资管理有限公司董事长。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任毕马威会计师事务所合伙人、普华永道会计师事务所合伙人，苏黎世金融服务集团中国区董事长，华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

## （2）监事会成员

朱莉丽女士，监事，硕士。曾就职于美林投资银行部、德意志银行投资银行部；现任美国华平集团执行董事。

杨莹女士，监事，本科。曾在三九集团、中国平安保险（集团）股份有限公司、永亨银行（中国）有限公司、中国民生银行工作，现任华宝投资有限公司风控合规部总经理。

贺桂先先生，监事，本科。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理；现任华宝基金管理有限公司营运副总监。

王波先生，监事，硕士。曾任上海证券报记者；现任华宝基金管理有限公司市场总监兼战略策划部总经理。

## （3）总经理及其他高级管理人员

孔祥清先生，董事长，简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，总经理，简历同上。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002 年加入华宝兴业基金公司参与公司的筹建工作，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监，现任华宝基金管理有限公司副总经理。

欧江洪先生，副总经理，本科。曾任宝钢集团财务部主办、宝钢集团成本管理处主管、宝钢集团办公室（董事会办公室）主管/高级秘书、宝钢集团办公厅秘书室主任、华宝投资有限公司总经理助理兼行政人事部总经理、党委组织部部长，党委办公室主任、董事会秘书等职务。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

刘月华先生，督察长，硕士。曾在冶金工业部、国家冶金工业局、中国证券业协会等单位工作。现任华宝基金管理有限公司督察长。

## 2. 本基金基金经理

周晶先生，经济学博士、工商管理硕士。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月起担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。

### 3. 权益投资决策委员会成员

刘自强先生，投资总监、华宝兴业动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业高端制造股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

闫旭女士，投资总监、国内投资部总经理、华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

胡戈游先生，助理投资总监、华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

曾豪先生，研究部总经理。

蔡目荣先生，国内投资部副总经理、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝兴业资源优选混合型证券投资基金基金经理。

### （三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

1. 依法募集本基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2. 办理本基金备案手续；
3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制中期和年度基金报告；

7. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 中国证监会规定的其他职责。

#### (四) 基金管理人承诺

1. 基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2. 基金管理人不得从事下列行为：

将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

不公平地对待其管理的不同基金财产；

利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3. 基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人内部控制制度

本基金管理人将借助于本公司已经开发的指数基金风险管理系统，对投资过程中的各种风险使用风险控制指标进行量化分析和评估，并据此制定具体的控制措施，科学有效地进行投资风险管理。同时，加强投资者教育，向投资者充分揭示产品的风险，将该基金销售给适合的对象。

##### (1) 基金投资运作风险控制

根据公司内控制度和投资管理制度的内容，结合本基金的特点，本基金投资运作风险控制主要内容包括：

###### 1) 风险控制制度

为了配合风险管理指标的应用以及风险控制体系的贯彻，公司制定了系列风险管理制度，形

成岗位自控、部门互控、监察检查、董事会合规审核委员会和公司内部控制委员会五道防线，全面而深入地对各种风险进行管理和控制。

## 2) 跟踪偏离度和跟踪误差分析

针对影响跟踪偏离度和跟踪误差的各种因素，制定合适的交易策略，减少跟踪偏离度和跟踪误差。每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。在正常情况下，本基金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）。

## 3) 加强系统建设

加强系统建设，确保各项计算的准确性和信息传递的及时性。

### (2) 汇率风险管理

在充分做好风险披露的同时，本基金将采用以下措施控制汇率风险：

投资人员将利用利率平价模型，考虑投资标的国的利率水平及变化趋势等因素，对汇率变化进行预测。同时，对于短期内出现的某一货币汇率剧烈波动的情况，本基金也会采用一定的汇率对冲手段进行管理。

### (3) 充分的风险揭示和投资者教育

本基金属于跟踪海外细分行业的股票型基金，是基金中风险较高、预期收益也较高的品种，适合风险承受能力较强的投资者。基金管理人及其代销机构在向投资者销售产品时，一方面充分揭示产品的风险，另一方面尽量了解投资者的风险承受能力，将其卖给合适的投资者。

## 二、 基金托管人

### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## (二) 主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构



及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 三、境外托管人

### （一）境外托管人的基本情况

名称：纽约梅隆银行股份有限公司 The Bank of New York Mellon Corporation

注册地址：One Wall Street, New York, NY 10286

办公地址：One Wall Street, New York, NY 10286

法定代表人：Gerald L. Hassell (Chairman & CEO - 董事长兼首席执行官)

成立时间：1784 年

### （二）最近一个会计年度、托管资产规模、信用等级等

纽约梅隆银行公司总部设在美国纽约 225 Liberty Street, 是美国历史最悠久的商业银行，也是全球最大的金融服务公司之一。公司集多元化及其配套业务于一体，服务内容包括资产管理、资产服务、发行人服务、清算服务、资金服务和财富管理。公司通过在全球 35 个国家和地区设立的分支机构，为超过 100 个金融市场的投资提供证券托管服务，为全球最大的托管行，并且是全球最大的资产管理服务提供商之一。公司在存托凭证、公司信托、股东服务、清算贸易、融资服务、佣金管理等业务方面都位居全球前列，并且是领先的美元现金管理、结算服务和全球支付服务供应公司。

截至 2016 年 6 月 30 日,纽约梅隆银行托管资产规模达 29.5 万亿美元,管理资产规模为 1.7 万亿美元。

截至 2016 年 6 月 30 日，纽约梅隆银行股东权益为 386 亿美元，一级资本充足率为 11.5%。全球员工总人数为 52,200。

信用等级: Aa2 评级（穆迪），AA-（标普）（截止 2016 年 6 月 30 日）。

### （三）境外托管人的职责

- 1、安全保管受托财产；
- 2、按照相关合同的约定，计算或复核受托资产的资产净值；
- 3、按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；
- 4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；
- 5、按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；
- 6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料。

## 四、 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：孔祥清

直销柜台电话：021-38505731、38505732、021-38505888-301 或 302

直销柜台传真：021-50499663、50988055

网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)

##### （2）直销 e 网金

投资者可以通过本公司直销 e 网金网上交易系统办理本基金的申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。直销 e 网金网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)。

#### 2、人民币份额代销机构：

##### 场外代销机构：

##### （1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(2) 中国工商银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

客户电话：95588

公司网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(3) 中国农业银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

客户电话：95599

公司网址：[www.95599.cn](http://www.95599.cn)

(4) 中国银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

客户电话：95566

公司网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(5) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市银城中路 188 号

联系人：曹榕

联系电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

客户电话：95559

公司网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(6) 招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

联系人：邓炯鹏

联系电话：0755—83198888

客户电话：95555

公司网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(7) 兴业银行股份有限公司

客户电话：95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：<http://www.cib.com.cn>

(8) 中国民生银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

联系人：杨成茜

联系电话：010-58560666

传真：010-57092611

客户电话：95568

公司网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(9) 渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦

客户电话：95541

公司网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

(10) 广发银行股份有限公司

办公地址：广东省广州市农林下路 83 号

客户电话：800-830-8003；400-830-8003

公司网址：[www.gdb.com.cn](http://www.gdb.com.cn)

(11) 华夏银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

客户电话：95577

公司网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

(12) 江苏银行股份有限公司

客户电话：96098，40086-96098

公司网址：[www.jsbchina.cn](http://www.jsbchina.cn)

(13) 平安银行股份有限公司

联系人：张莉

联系电话：021-38637673

传真：021-50979507

客户电话：95511-3

公司网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

(14) 上海浦东发展银行股份有限公司

联系人：高天、姚磊

联系电话：021-61618888

传真：021-63604196

客户电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（15）中国邮政储蓄银行有限责任公司

办公地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

联系人：陈春林

客户电话：95580

公司网址：www.psbc.com

（16）中信银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

联系人：陈国媚

客户电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

（17）安信证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：杨天枝

联系电话：0755-82558323

传真：0755-82558355

客户电话：4008-001-001

公司网址：www.essence.com.cn

（18）渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区云际道立达公寓 F 座渤海证券

法定代表人：王春峰

联系人：王星

联系电话：022-28451922

客户电话：4006515988

公司网址：www.ewww.com.cn

(19) 长城证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

法定代表人：丁益

联系人：金夏

联系电话：0755-83516289

客户电话：400-6666-888

公司网址：[www.cgws.com/cczq/](http://www.cgws.com/cczq/)

(20) 长江证券股份有限公司

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇、黄美慧

联系电话：021-68751860；027-65799827

客户电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(21) 北京创金启富投资管理有限公司

办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

联系人：李婷婷

联系电话：010-66154828-8038

传真：010-63583991

客户电话：400-6262-818

公司网址：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(22) 上海大智慧财富管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

联系人：施燕华

联系电话：021-20219966

传真：021-20219923

客户电话：021-20219931

公司网址：<https://8.gw.com.cn/>

(23) 德邦证券股份有限公司

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：刘熠

联系电话：68761616-8076

传真：862168767981

客户电话：400-8888-128

公司网址：www.tebon.com.cn

（24）东北证券股份有限公司

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：付静雅

联系电话：0431-82006251

传真：0431-85096795

客户电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

（25）东方证券股份有限公司

办公地址：上海市中山南路 318 号东方国际金融广场 2 号楼 21-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：黄静

联系电话：63325888-3137

传真：021-63326729

客户电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

（26）东海证券股份有限公司

办公地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

联系电话：20333910

传真：021-50498871

客户电话：95531

公司网址：www.longone.com.cn



(27) 东吴证券股份有限公司

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：0512-62938521

传真：0512-65588021

客户电话：95330

公司网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

(28) 东兴证券股份有限公司

联系人：汤漫川

联系电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户电话：400-8888-993

公司网址：[www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

(29) 方正证券股份有限公司

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：何其聪

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户电话：95571

公司网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

(30) 光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 3 楼

法定代表人：薛峰

联系人：李晓哲、姚巍、李芳芳

联系电话：021-22169111、021-22169502

传真：021—22169134

客户电话：95525

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(31) 广发证券股份有限公司

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 18 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888-8333

客户电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

（32）国都证券股份有限公司

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

法定代表人：王少华

联系人：李弢

联系电话：010-84183331

客户电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

（33）国海证券股份有限公司

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

联系人：牛孟宇

联系电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客户电话：95563

公司网址：<http://www.ghzq.com.cn>

（34）中国国际金融股份有限公司

联系人：罗春蓉、陈曦、康楠

联系电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户电话：400-910-1166

（35）国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

联系电话：028-86690057

传真：028-86690126

客户电话：95310

公司网址：www.gjq.com.cn

（36）国泰君安证券股份有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

联系电话：38032284

传真：021-38670666

客户电话：95521、4008886666

公司网址：www.gtja.com

（37）国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

联系人：李颖

联系电话：(0755)82130833--701266、(0755)82133066

传真：0755-82133952

客户电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

（38）国元证券股份有限公司

客户电话：400888777 或 95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

（39）海通证券股份有限公司

办公地址：上海广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：李楠、涂洋

联系电话：23219061、23219290

客户电话：95553

公司网址：www.htsec.com

（40）上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

联系人：陆敏

联系电话：021-20613600

传真：021-68596919

客户电话：400-700-9665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

（41）和讯信息科技有限公司

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

联系人：刘洋

联系电话：021-20835879

传真：021-20835788

客户电话：400-920-0022

公司网址：[www.licaike.com](http://www.licaike.com)

（42）恒泰证券股份有限公司

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

联系人：王旭华

联系电话：0471-4972343

客户电话：400-196-6188

公司网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

（43）申万宏源西部证券有限公司

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：黄莹

联系电话：021-33388211

传真：0991-2301927

客户电话：400-800-0562

公司网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

（44）华安证券股份有限公司

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座 0327 室

法定代表人：李工

联系人：樊忠亚

联系电话：0551-65161675

传真：0551-65161672

客户电话：95318

公司网址：www.hazq.com

（45）华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

联系人：胡星煜

联系电话：20515583

传真：021-20515593

客户电话：400-820-9898，021-38929908

公司网址：www.cnhbstock.com

（46）华宝直销

联系电话：021-38505888-731/732

（47）华福证券有限责任公司

联系电话：0591-96326

客户电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（48）华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客户电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（49）江海证券有限公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

联系电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客户电话：400-666-2288

公司网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

(50) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

联系人：文雯

联系电话：010-83363010

传真：010-83363099

客户电话：400-166-1188

公司网址：<http://8.jrj.com.cn>

(51) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

办公地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

联系人：赵德赛

联系电话：4000988511

传真：010-89188000

客户电话：4000988511

公司网址：<http://kenterui.jd.com>

(52) 利得基金

(53) 上海联泰资产管理有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

联系人：兰敏

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客户电话：4000-466-788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(54) 联讯证券

(55) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

联系人：程晨

联系电话：021-20665952

传真：021-50783597

客户电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

（56）民生证券有限责任公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

传真：010-85127917

客户电话：400-619-8888

公司网址：www.msq.com

（57）中国民族证券有限责任公司

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：何亚刚

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户电话：4008895618

公司网址：www.e5618.com

（58）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

联系人：方成

联系电话：021-38609777

客户电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（59）平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：曹实凡

联系人：周一涵

联系电话：021-38637436

传真：0755-82435367

客户电话：95511-8

公司网址：www.stock.pingan.com

（60）山西证券股份有限公司

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：韩笑

联系电话：0351-8686656

传真：0351-8686619

客户电话：95573

公司网址：www.i618.com.cn

（61）上海证券有限责任公司

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686262

传真：021-53686100，021-53686200

客户电话：4008918918 、021-962518

公司网址：www.962518.com

（62）申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

联系电话：021-33388211

传真：021-33388224

客户电话：95523、4008895523

公司网址：www.swhysc.com

（63）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

联系人：韩爱彬

联系电话：021-60897840



传真：0571-26697013

客户电话：4000-776-123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

(64) 深圳腾元基金销售有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1810

联系人：鄢萌莎

联系电话：0755-33376922

客户电话：4006-877-899

公司网址：[www.tenyuanfund.com](http://www.tenyuanfund.com)

(65) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

联系人：杨蕾

联系电话：021-54509998

传真：021-64385308

客户电话：400-1818-188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(66) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

联系人：董一锋

联系电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户电话：4008-773-772

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(67) 上海万得投资顾问有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

联系电话：021-51327185

传真：021-6888 2281

客户电话：400-821-0203

(68) 西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：吴坚

联系人：周青

联系电话：023-67616310

传真：023-63786212

客户电话：400-8096-096、95355

公司网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

（69）北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

联系人：付文红

联系电话：010-62675979

传真：010-62675369

客户电话：010-62675369

公司网址：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

（70）信达证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

客户电话：95321

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（71）兴业证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：乔琳雪、吴嘉虹

联系电话：021-38565547、021-38565570

客户电话：95562

公司网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

（72）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

联系人：宋欣怡

联系电话：010-52855713

传真：010-85894285

客户电话：400-6099-200

公司网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

（73）中国银河证券股份有限公司

办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政； 邓颜

联系电话：010-83574507； 010-66568292

传真：010-66568990

客户电话：95551、400-8888-888

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

（74）招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

联系电话：86-755-82960167

客户电话：4008895565 或 95565

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

（75）中经北证（北京）资产管理有限公司

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

联系人：陶涛

联系电话：010-68292745

传真：010-68292941

客户电话：400-600-0030

公司网址：[www.bzfunds.com](http://www.bzfunds.com)

（76）中泰证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315290

客户电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

（77）中国中投证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层  
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

法定代表人：高涛

联系人：张鹏

联系电话：0755-82023442

客户电话：95532 或 400 600 8008

公司网址：www.china-invs.cn

（78）中信建投证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

联系电话：010-85156398

客户电话：400-8888-108、95587

公司网址：www.csc108.com

（79）中信期货有限公司

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

联系人：洪诚

联系电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客户电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

（80）中信证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

联系电话：010-60833889

传真：010-6083 6029

客户电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

（81）中信证券（山东）有限责任公司

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

联系人：赵艳青

联系电话：0532-85023924

传真：0532-85022605

客户电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（82）中银国际证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼

法定代表人：宁敏

联系人：许慧琳

联系电话：021-20328531

传真：021-50372474

客户电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

（83）深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客户电话：400-678-8887

公司网址：www.zlfund.cn

（84）珠海盈米财富管理有限公司

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

联系人：李孟军

联系电话：020-89629066

传真：020-89629011

客户电话：020-89629099

公司网址：www.yingmi.cn

场内代销机构：具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

### 3. 美元份额代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（二）注册登记机构：

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：崔巍

电话：010-59378835

传真：010-59378907

（三）律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：(86 21) 3135 8666

传真：(86 21) 3135 8600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：薛竞、曹阳

## 五、 基金的名称

本基金名称：华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）

## 六、 基金的类型

本基金类型：上市契约型开放式

## 七、 基金的投资目标

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）。

本基金标的指数为标普石油天然气上游股票指数（S&P Oil & Gas Exploration & Production Select Industry Index），该指数是基于标普全市场指数（S&P Total Markets Index<sup>TM</sup>）的精选子行业指数之一，选择在美国主要交易所（纽约证券交易所、美国证券交易所、纳斯达克等）上市的石油天然气勘探、采掘和生产等上游行业的公司为标的，采用等市值加权的方法计算。

## 八、 基金的投资范围

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。

## 九、基金的投资策略

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。

本基金在投资的过程中，造成跟踪误差的原因主要有以下几方面：

1. 开放式基金日常运作过程中必须保有一定比例的现金资产；
2. 基金投资组合的权重与目标指数的成份股的权重可能在调整周期当中出现不一致；
3. 基金补券过程中股票买卖价格与股票收盘价存在差异；
4. 各种交易费用及基金运作过程中所产生的费用和开支；
5. 成份股红利再投资等。

基金管理人会定期对跟踪误差进行归因分析，为基金投资组合下一步的调整及跟踪目标指数偏离风险的控制提供量化决策依据。同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下，适当开展证券借贷业务，以期降低跟踪误差水平。

同时，本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将适当投资于美国短期国债和其他货币市场工具，固定收益投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

## 十、基金的业绩比较基准



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）

标普石油天然气上游股票指数（S&P Oil & Gas Exploration & Production Select Industry Index）是基于标普全市场指数（S&P Total Markets Index™）的精选子行业指数之一，选择在美国主要交易所（纽约证券交易所、美国证券交易所、纳斯达克等）上市的石油天然气勘探、采掘和生产等上游行业的公司为标的，采用等市值加权的方法计算。

未来，如果标普石油天然气上游股票指数的提供商标准普尔公司终止对基金管理人继续使用该指数的授权，或者是标准普尔公司基于其独立判断停止继续发布该指数，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金管理人在保护持有人合法利益的前提下，以不损害持有人利益为原则，可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无须召开基金份额持有人大会。

## 十一、基金的风险收益特征

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。

## 十二、基金的投资组合报告

本基金的投资组合报告所载的数据截至 2017 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	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	2,901,014,306.84	92.82
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	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	其他资产	18,307,056.87	0.59
9	合计	3,125,356,710.56	100.00

## 2、报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	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

## 3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

### 1) 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	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

### 2) 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

## 4、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

### 1) 报告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股票及存托凭证投资明细

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(人民币元)	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 能源公司	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

2) 报告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股票及存托凭证投资明细  
本基金本报告期末未持有积极投资。

#### 5、报告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。

#### 6、报告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、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

#### 8、报告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

本基金本报告期末金融衍生品余额为零。

#### 9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	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	22,739,028.54	0.74

#### 10、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
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

(4) 报告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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1) 报告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未存在流通受限情况。

2) 报告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。

### 十三、基金的业绩

基金业绩截止日为 2017 年 6 月 30 日，所列数据未经审计。

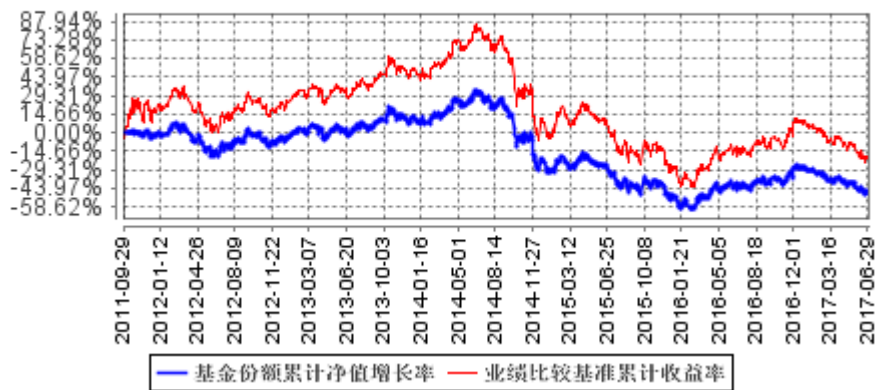
1、净值增长率与同期比较基准收益率比较：

阶段	净值增长率 ①	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
2011/09/29-2011/12/31	-2.20%	0.84%	16.62%	3.26%	-18.82%	-2.42%
2012/01/01-2012/12/31	-3.27%	1.53%	3.70%	1.70%	-6.97%	-0.17%
2013/01/01-2013/12/31	18.39%	1.27%	24.40%	1.33%	-6.01%	-0.06%
2014/01/01-2014/12/31	-32.23%	1.97%	-29.16%	2.11%	-3.07%	-0.14%
2015/01/01-2015/12/31	-34.78%	2.69%	-32.14%	2.89%	-2.64%	-0.20%
2016/01/01-2016/12/31	44.24%	2.55%	48.30%	2.67%	-4.06%	-0.12%
2017/01/01-2017/06/30	-24.23%	1.62%	-24.39%	1.70%	0.16%	-0.08%
2011/09/29-2017/06/30	-45.90%	2.01%	-18.91%	2.24%	-26.99%	-0.23%

2、自基金合同生效以来基金累计份额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。

### 十四、基金的费用

## （一）与基金运作有关的费用

### 1、费用的种类

- （1）基金管理人的管理费，含境外投资顾问收取的费用；
- （2）基金托管人的托管费，含境外托管代理行收取的费用；
- （3）标的指数许可使用费；
- （4）基金财产拨划支付的银行费用；
- （5）基金合同生效后的基金信息披露费用；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （8）基金的证券交易费用；
- （9）基金上市费及年费；
- （10）外汇兑换交易的相关费用；
- （11）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### （1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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。

#### （2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.28%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.28\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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。

### （3） 基金的指数许可使用费

标的指数许可使用费按照基金管理人与指数许可方签署的指数许可使用合同的约定从基金财产中支付。

（4）除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 3、 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

4、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

### 5、 基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人应聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管银行根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

## （二） 与基金有关的销售费用

### 1、 申购费与赎回费

#### 1) 人民币份额申购费率

投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费率表如下：

场内、场外申购费	申购金额	申购费率
	500 万（含）以上	每笔 1000 元
	大于等于 200 万，小于 500 万	0.5%
	大于等于 100 万，小于 200 万	1.0%

	大于等于 50 万，小于 100 万	1.2%
	50 万以下	1.5%

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

#### 2) 人民币份额赎回费率

赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

场外赎回费	持有基金份额期限	赎回费率(%)
	小于 1 年	0.50%
	大于等于 1 年，小于 2 年	0.25%
	大于等于 2 年	0
场内赎回费	本基金场内赎回费为固定值 <b>0.5%</b> ，不按份额持有时间分段设置赎回费率	

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

#### 3) 美元份额申购费率

投资者申购本基金美元份额需缴纳申购费，申购费率按照申购金额递减。投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体申购费率如下：

申购金额 M (美元)	申购费率
5 万以下	1.5%
5 万 (含) 至 10 万	1.2%
10 万 (含) 至 30 万	1.0%
30 万 (含) 至 60 万	0.5%
60 万 (含) 以上	每笔 200 美元

申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

#### 4) 美元份额赎回费率

赎回费随基金持有时间的增加而递减，赎回费率如下：

持有期限	赎回费率
小于 1 年	0.50%



大于等于1年，小于2年	0.25%
大于等于2年	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

## 2、申购赎回余额的处理方式

1) 申购份额的计算及余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，场外申购份额的计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生收益和损失由基金财产承担。场内申购份额的计算结果采用截位法保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

2) 赎回金额的计算及处理方式：赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生收益和损失由基金财产承担。

## 3、申购赎回的计算

### 1) 申购份额的计算

申购份额计算公式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购手续费} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金单位净值}$$

例一：投资人通过场内申购基金份额的计算

某投资人投资 6,000 元通过场内申购本基金，其对应的场内申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.060 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 6,000 / (1 + 1.5\%) = 5,911.33 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 6,000 - 5,911.33 = 88.67 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 5,911.33 / 1.060 = 5,576 \text{ 份 (保留至整数位)}$$

即：投资人投资 6,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.060 元，则其可得到 5,576 份基金份额。

例二：投资人通过场外申购基金份额的计算

某投资人投资 6,000 元通过场外申购本基金，其对应的场外申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.060 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 6,000 / (1 + 1.5\%) = 5,911.33 \text{ 元}$$

申购费用=6,000-5,911.33=88.67 元

申购份额=5,911.33/1.060=5,576.73 份

即：投资人投资 6,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.060 元，则其可得到 5,576.73 份基金份额。

## 2) 赎回金额的计算

赎回金额计算公式如下：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金单位净值

赎回手续费=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回手续费

### 例三：投资人通过场内赎回金额的计算

某投资人从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.5%=57.40 元

净赎回金额=11,480-57.40=11,422.60 元

即：投资人从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

### 例四：投资人通过场外赎回金额的计算

某投资人赎回本基金 10,000 份基金份额，持有时间为一年六个月，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.25%=28.7 元

净赎回金额=11,480-28.7=11,451.3 元

即：某投资人持有 10,000 份本基金基金份额一年三个月后赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则其可得到的净赎回金额为 11,451.3 元。

4、以人民币申购的基金份额确认为人民币份额，以美元申购的基金份额确认为美元份额。

## 十五、《招募说明书》更新部分的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定,华宝基金管理有限公司对《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》作如下更新:

- 1、“四、基金管理人”更新了基金管理人的相关信息。
- 2、“九、基金的投资”更新了截至2017年6月30日的基金的投资组合报告。
- 3、“十、基金的业绩”更新了截至2017年6月30日的基金业绩数据。
- 4、“二十、相关服务机构”更新了本基金场外代销机构的相关信息。
- 5、“二十三、对基金份额持有人的服务”更新了定期定额投资计划的相关信息。
- 6、“二十四、其他应披露事项”对本报告期内的相关公告作了信息披露。

上述内容仅为摘要,须与本基金《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝基金管理有限公司

2017年11月9日