

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证 券投资基金 (LOF) 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 26 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 2016 年 8 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	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	11
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
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	13
§5 托管人报告	13
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真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
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
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	34
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	34
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	37
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	39
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	39
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	39
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	39
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	39
7.11 投资组合报告附注	39

§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末上市基金前十名持有人	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	44
§11 备查文件目录	46
11.1 备查文件目录	46
11.2 存放地点	47
11.3 查阅方式	47

§ 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	4,848,648,454.03 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

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 0.578 元，人民币总份额 4,841,315,084.41 份；本基金美元份额净值 0.0872 美元，美元总份额 7,333,369.62 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
注册地址		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	北京市西城区金融大街 25 号
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	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	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、 基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 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(2016 年 1 月 1 日 – 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	25,762,388.27
本期利润	534,621,623.01
加权平均基金份额本期利润	0.0886
本期加权平均净值利润率	17.71%
本期基金份额净值增长率	16.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,045,665,338.60
期末可供分配基金份额利润	-0.4219
期末基金资产净值	2,802,983,115.43
期末基金份额净值	0.578
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-42.20%

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	-1.37%	2.74%	-1.00%	2.83%	-0.37%	-0.09%
过去三个 月	16.77%	2.40%	17.95%	2.47%	-1.18%	-0.07%

过去六个月	16.77%	2.99%	18.33%	3.14%	-1.56%	-0.15%
过去一年	-18.25%	3.14%	-18.06%	3.32%	-0.19%	-0.18%
过去三年	-41.44%	2.32%	-33.66%	2.48%	-7.78%	-0.16%
自基金合同生效日起至今	-42.20%	2.04%	-14.43%	2.30%	-27.77%	-0.26%

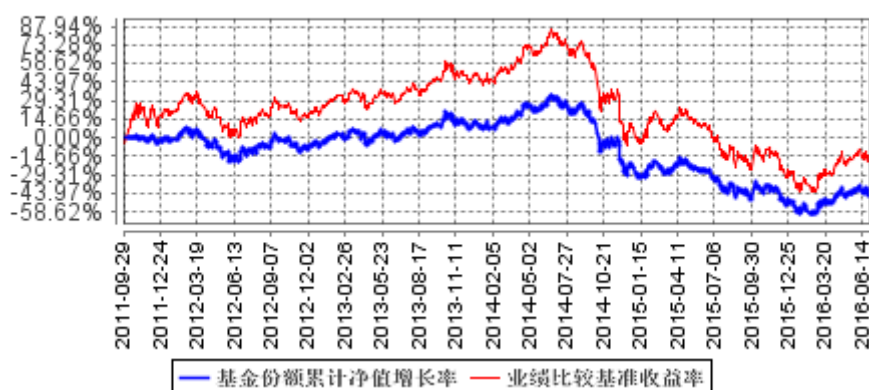
注：1、本基金业绩比较基准为：标普石油天然气上游股票指数（全收益指数）。

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 2016 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（2016 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、新兴产业基金、可转债债券、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接、华宝油气基金、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、华宝兴业中国互联网、华宝兴业核心优势、华宝兴业转型升级、华宝标普美国消费、华宝宝鑫纯债及华宝香港中小，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 157,478,315,809.98 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、华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数（LOF）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	2014 年 9 月 18 日	-	10 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。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% 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。

16 年上半年全球油价触底反弹，产生了上扬的趋势，在六月初最高突破 50 美元/桶大关后略有所回落，目前在 47-49 美元/桶水平附近震荡。截止六月三十日，WTI 油价收至 48.40 美元/桶，相对去年年末大涨 30.6%。整个 16 年上半年，本基金跟踪的标普石油天然气上游股票指数上涨 15.9%，反弹幅度低于国际油价上涨。主要原因在于受美股上半年疲软走势和英国公投脱欧和法国恐怖袭击等黑天鹅事件的拖累。16 年上半年标普油气指数年化日均波幅 47.9%，超过标普 500 指数日均波幅 16.0%的水平。

日常操作过程中，人民币汇率方面，2016 年上半年人民币汇率波动比较大。人民币对美金先扬后抑。上半年人行中间价从 6.4939 贬值至 6.6312，相对于美元贬值 2.1%。同期，人民币交易价也相对于贬值 2.3%左右。人民币汇率的变动带来比较高的换汇成本，对基金的表现有一定的影响。但汇率上半年整体而言对基金的人民币计价业绩有正面影响。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 2.7%。

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 16.77%，同期业绩比较基准收益率为 18.33%，基金表现落后于业绩比较基准 1.56%。低于基准的主要原因来源于基金的仓位上限限制以及基金申赎带来的汇兑损失。

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 16 年下半年，尽管原油市场正在向平衡状态发展，但市场供需的平衡目前仍未到来，供大于求的状态或将持续一段时间。英国脱欧给欧洲乃至全球经济带来的不确定性仍未消散，最近法国尼斯和德国慕尼黑接连发生恐怖袭击，加剧了对欧洲稳定性、经济增长和原油需求的担

忧。根据能源信息提供商标普 Global Platts 的数据显示，由于尼日利亚和利比亚等国的原油产量出现暂时性的回升，而沙特和伊朗的产量也在稳步回升，6 月份欧佩克石油产量每日上涨了 30 万桶，接近每日 3273 万桶的 8 年高点。与此同时欧佩克在 7 月 12 日发布的原油市场报告称，由于非欧佩克国家的原油产量，尤其是美国的原油产量，将继续减少，今明两年原油市场的供给过剩的局面将得到缓解。这显示出欧佩克 2014 年油价大幅下滑以来坚持的不减产以捍卫市场份额的策略正在取得成效。但被低油价挤出的产能将在何时以何种速度回归市场仍然对原油市场的平衡有巨大的影响。不过在全球货币超发及流动性宽松的大背景下，大宗商品的价格预计仍将较为坚挺，我们认为中期上油价上攻乏力，在 45-55 美元/桶波动仍为大概率事件。但是我们对下半年美股的走势目前比较乐观。当前标普 500 指数点位对应 2016 年盈利仅有 17 倍左右，处于历史估值区间的中位数。只要美国经济复苏势头不变，股市完全可以通过盈利的增长来化解当前估值偏高的风险，而这一进程，目前来看，实现的概率还是相当大的。而联储下半年我们目前认为仅仅为四季度末加息一次，这有利于美股走高。因此，在油价保持区间震荡的时候，如果美股能继续走高的话，无疑将有利于基金标的指数在下半年进一步上扬。

长期来看，在新能源发展迟迟不能取得令人振奋突破的情况下，石油供需两端最终会向供需平衡的方向发展。而这种平衡我们相信正在逐步发生，我们预计目前全球原油过剩的规模已经从每天 150 万桶收窄至 120 万桶左右。但同时我们也必须看到世界主要经济区的经济增长也同样疲软，无论是美国、欧洲、还是中国，经济复苏增长都异常艰辛挣扎，这将为能源的需求带来极强的不确定性。因此长期油价如何发展，目前还有待进一步的观察。

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 & 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，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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	244,245,902.44	139,518,298.27
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,693,868,370.00	3,121,554,601.36
其中：股票投资		2,642,668,200.61	3,041,155,095.96
基金投资		51,200,169.39	80,399,505.40
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	229,549,582.41
应收利息	6.4.7.5	12,516.14	24,443.95
应收股利		484,837.73	351,365.71
应收申购款		234,336,271.12	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,172,947,897.43	3,490,998,291.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:			
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		198,482,843.55	-
应付赎回款		165,574,630.41	203,085,415.49
应付管理人报酬		2,311,841.66	2,266,280.16
应付托管费		647,315.69	634,558.46
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	2,948,150.69	2,289,305.92
负债合计		369,964,782.00	208,275,560.03
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	4,848,648,454.03	6,626,822,168.13
未分配利润	6.4.7.10	-2,045,665,338.60	-3,344,099,436.46
所有者权益合计		2,802,983,115.43	3,282,722,731.67

负债和所有者权益总计		3,172,947,897.43	3,490,998,291.70
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.578 元，基金份额总额 4,848,648,454.03 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		556,267,522.09	24,446,555.98
1. 利息收入		372,375.86	525,455.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	372,375.86	525,455.13
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）		38,384,912.36	86,862,479.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	36,071,871.37	67,767,319.35
基金投资收益	6.4.7.13	-14,327,354.32	6,233,237.11
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	16,640,395.31	12,861,923.14
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	508,859,234.74	-22,061,294.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		5,852,523.20	-44,114,570.30
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	2,798,475.93	3,234,486.08
减：二、费用		21,645,899.08	23,168,606.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,983,293.25	15,319,432.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,195,322.11	4,289,441.20
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,511,567.26	2,732,523.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6.4.7.21	955,716.46	827,209.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		534,621,623.01	1,277,949.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		534,621,623.01	1,277,949.51

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 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	-	1,277,949.51	1,277,949.51

期净利润)			
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

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：

黄小薏

基金管理人负责人

向辉

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”)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。本基金为上市契约型开放式,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)。

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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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) 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) 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 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	244,245,902.44
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	244,245,902.44

注：于 2016 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 7,114,218.36 元和美元活期存款 35,759,995.79 元(折合人民币 237,131,684.08 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,469,070,317.75	2,642,668,200.61	173,597,882.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	54,543,526.50	51,200,169.39	-3,343,357.11
其他	-	-	-
合计	2,523,613,844.25	2,693,868,370.00	170,254,525.75

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/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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	12, 516. 14
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	12, 516. 14

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	618, 487. 05
预提费用	266, 526. 74
应付指数使用费	2, 063, 136. 90

合计	2,948,150.69
----	--------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,626,822,168.13	6,626,822,168.13
本期申购	2,301,232,626.69	2,301,232,626.69
本期赎回(以“-”号填列)	-4,079,406,340.79	-4,079,406,340.79
本期末	4,848,648,454.03	4,848,648,454.03

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	209,929,167.14	-3,554,028,603.60	-3,344,099,436.46
本期利润	25,762,388.27	508,859,234.74	534,621,623.01
本期基金份额交易产生的变动数	-27,384,420.02	791,196,894.87	763,812,474.85
其中：基金申购款	58,063,953.91	-1,119,350,426.57	-1,061,286,472.66
基金赎回款	-85,448,373.93	1,910,547,321.44	1,825,098,947.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	208,307,135.39	-2,253,972,473.99	-2,045,665,338.60

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	369,583.55
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	-
其他	2,792.31
合计	372,375.86

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,274,273,416.02
减：卖出股票成本总额	2,238,201,544.65
买卖股票差价收入	36,071,871.37

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	31,878,259.70
减：卖出/赎回基金成本总额	46,205,614.02
基金投资收益	-14,327,354.32

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	16,433,623.21
基金投资产生的股利收益	206,772.10
合计	16,640,395.31

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
------	---------------------------------------

1. 交易性金融资产	508,859,234.74
——股票投资	491,852,956.73
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	17,006,278.01
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	508,859,234.74

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,798,475.93
合计	2,798,475.93

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,511,567.26
银行间市场交易费用	—
合计	1,511,567.26

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	59,672.34
信息披露费	117,019.14
银行汇划费	25.00
上市费用	29,835.26
指数使用费	749,164.72
合计	955,716.46

6.4.7.22 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，无需披露分部报告。

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

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（“华宝兴业”）	基金管理人、美元份额的注册登记机构、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
宝钢集团有限公司（“宝钢集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	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。

6.4.10 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。

6.4.10.2 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
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,983,293.25	15,319,432.91
其中：支付销售机构的客户维护费	2,910,881.03	3,046,439.66

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,195,322.11	4,289,441.20

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。

6.4.10.4 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	--

	月 30 日	日
期初持有的基金份额	6,126,140.46	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	6,126,140.46
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.13%	0.15%

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。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	230,851,653.60	-	129,403,426.73	-
中国建设银行	13,394,248.84	369,583.55	185,363,024.23	519,963.37

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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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，因此没有在交易所市场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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、副总经理、督察长、监察稽核部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；监察稽核部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和监察稽核部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特

征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行和纽约梅隆银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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%。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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 2016 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	244,245,902.44	-	-	-	244,245,902.44
交易性金融资产	-	-	-	-2,693,868,370.00	2,693,868,370.00
应收申购款	13,611,780.51	-	-	220,724,490.61	234,336,271.12
应收利息	-	-	-	12,516.14	12,516.14
应收股利	-	-	-	484,837.73	484,837.73
资产总计	257,857,682.95	-	-	-2,915,090,214.48	3,172,947,897.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	198,482,843.55	198,482,843.55
应付赎回款	-	-	-	165,574,630.41	165,574,630.41
应付管理人报酬	-	-	-	2,311,841.66	2,311,841.66
应付托管费	-	-	-	647,315.69	647,315.69
其他负债	-	-	-	2,948,150.69	2,948,150.69
负债总计	-	-	-	369,964,782.00	369,964,782.00
利率敏感度缺口	257,857,682.95	-	-	-2,545,125,432.48	2,802,983,115.43
上年度末 2015 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	139,518,298.27	-	-	-	139,518,298.27
交易性金融资产	-	-	-	-3,121,554,601.36	3,121,554,601.36
应收证券清算款	-	-	-	229,549,582.41	229,549,582.41
应收利息	-	-	-	24,443.95	24,443.95
应收股利	-	-	-	351,365.71	351,365.71
资产总计	139,518,298.27	-	-	-3,351,479,993.43	3,490,998,291.70
负债					

应付赎回款	-	-	-	203,085,415.49	203,085,415.49
应付管理人报酬	-	-	-	2,266,280.16	2,266,280.16
应付托管费	-	-	-	634,558.46	634,558.46
其他负债	-	-	-	2,289,305.92	2,289,305.92
负债总计	-	-	-	208,275,560.03	208,275,560.03
利率敏感度缺口	139,518,298.27	-	-	-3,143,204,433.40	3,282,722,731.67

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2015 年 12 月 31 日：同）

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 2016 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	237,131,684.08	-	-	237,131,684.08
交易性金融资产	2,693,868,370.00	-	-	2,693,868,370.00
			-	
衍生金融资产	-	-		
			-	-
应收股利	484,837.73	-		484,837.73
			-	
应收利息	391.70	-		391.70
			-	
应收申购款	78,398.36	-		78,398.36
			-	
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	28,730,371.57	-	-	28,730,371.57
交易性金融资产	3,121,554,601.36	-	-	3,121,554,601.36
			-	
应收股利	351,365.71	-	-	351,365.71
			-	
应收利息	221.24	-	-	221.24
			-	
应收证券清算款	229,549,582.41	-	-	229,549,582.41
			-	
资产负债表外汇风险敞口净额	3,380,186,142.29	-	-	3,380,186,142.29

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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(2016年6月30日)	上年度末(2015年12月31日)
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	136,642,010.48	169,009,307.11
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-136,642,010.48	-169,009,307.11

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	2,642,668,200.61	94.28	3,041,155,095.96	92.64
交易性金融资产—基金投资	51,200,169.39	1.83	80,399,505.40	2.45
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,693,868,370.00	96.11	3,121,554,601.36	95.09

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	132,558,621.44	152,237,727.49
	2. 业绩比较基准下降 5%	-132,558,621.44	-152,237,727.49

6.4.14 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 2016 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 2,693,868,370.00 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 3,121,554,601.36 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。

§ 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	2,642,668,200.61	83.29
	其中：普通股票	2,642,668,200.61	83.29
	存托凭证	—	0.00
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	0.00
2	基金投资	51,200,169.39	1.61
3	固定收益投资	—	0.00
	其中：债券	—	0.00
	资产支持证券	—	0.00
4	金融衍生品投资	—	0.00
	其中：远期	—	0.00
	期货	—	0.00
	期权	—	0.00
	权证	—	0.00
5	买入返售金融资产	—	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	0.00
6	货币市场工具	—	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	244,245,902.44	7.70
8	其他各项资产	234,833,624.99	7.40
9	合计	3,172,947,897.43	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	2,642,668,200.61	94.28
合计	2,642,668,200.61	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	2,642,668,200.61	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	2,642,668,200.61	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	MARATHON OIL CORP	马拉松石油公司	MRO US	纽约	美国	587,599	58,486,262.20	2.09
2	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	美国大陆资源股份有限公司	CLR US	纽约	美国	193,273	58,019,476.91	2.07
3	NEWFIELD	新田石油勘探	NFX US	纽约	美国	197,831	57,957,839.04	2.07

	EXPLORATION CO	公司						
4	MURPHY OIL CORP	墨菲石油公司	MUR US	纽约	美国	268,307	56,489,516.76	2.02
5	RICE ENERGY INC	Rice 能源股份有限公司	RICE US	纽约	美国	383,164	56,000,050.05	2.00
6	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC US	纽约	美国	216,638	54,532,193.62	1.95
7	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油公司	XOM US	纽约	美国	87,637	54,475,920.59	1.94
8	ENERGEN CORP	Energen 公司	EGN US	纽约	美国	170,387	54,471,045.93	1.94
9	HESS CORP	阿美拉达赫斯公司	HES US	纽约	美国	136,665	54,465,802.17	1.94
10	CIMAREX ENERGY CO	Cimarex 能源公司	XEC US	纽约	美国	68,767	54,410,842.39	1.94
11	APACHE CORP	阿帕契公司	APA US	纽约	美国	147,340	54,391,872.92	1.94
12	RSP PERMIAN INC	RSP Permian 股份有限公司	RSPP US	纽约	美国	233,716	54,073,133.94	1.93
13	DEVON ENERGY CORP	戴文能源公司	DVN US	纽约	美国	224,531	53,972,986.31	1.93
14	CHEVRON CORP	雪佛龙公司	CVX US	纽约	美国	77,325	53,752,372.92	1.92
15	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天然气公司	COG US	纽约	美国	314,794	53,731,271.18	1.92
16	EQT CORP	EQT 公司	EQT US	纽约	美国	104,431	53,620,495.46	1.91
17	EOG RESOURCES INC	EOG 资源公司	EOG US	纽约	美国	96,685	53,483,696.26	1.91
18	PDC ENERGY INC	PDC 能源股份有限公司	PDCE US	纳斯达克	美国	139,989	53,479,078.22	1.91
19	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克	美国	88,265	53,385,474.59	1.90
20	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	帕斯利能源股份有限公司	PE US	纽约	美国	297,231	53,335,211.49	1.90
21	ANADARKO PETROLEUM CORP	阿纳达科石油公司	APC US	纽约	美国	148,784	52,537,326.54	1.87
22	WESTERN REFINING INC	Western Refining 公司	WNR US	纽约	美国	383,358	52,444,009.24	1.87
23	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油公司	OXY US	纽约	美国	104,515	52,367,603.63	1.87
24	RANGE RESOURCES CORP	Range 资源公司	RRC US	纽约	美国	182,492	52,205,480.60	1.86
25	CONCHO RESOURCES INC	康丘资源公司	CXO US	纽约	美国	65,834	52,068,322.85	1.86
26	PHILLIPS 66	Phillips 66 公司	PSX US	纽约	美国	98,484	51,814,343.78	1.85
27	NOBLE ENERGY	Noble 能源股	NBL US	纽约	美国	215,925	51,360,167.52	1.83

	INC	份有限公司						
28	CONOCOPHILLIPS	康菲石油公司	COP US	纽约	美国	177, 165	51, 222, 001. 49	1. 83
29	TESORO CORP	特索罗公司	TSO US	纽约	美国	102, 132	50, 740, 148. 26	1. 81
30	CHESAPEAKE ENERGY CORP	切萨皮克能源 公司	CHK US	纽约	美国	1, 784, 077	50, 634, 845. 60	1. 81
31	SOUTHWESTERN ENERGY CO	西南能源公司	SWN US	纽约	美国	599, 656	50, 023, 600. 95	1. 78
32	GULFPORT ENERGY CORP	Gulfport 能源 公司	GPOR US	纳斯 达克	美国	241, 223	50, 003, 432. 15	1. 78
33	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源公 司	VLO US	纽约	美国	147, 588	49, 912, 962. 83	1. 78
34	CARRIZO OIL & GAS INC	Carrizo 油气 股份有限公司	CRZO US	纳斯 达克	美国	208, 944	49, 671, 947. 88	1. 77
35	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然 资源公司	PXD US	纽约	美国	49, 424	49, 557, 630. 24	1. 77
36	OASIS PETROLEUM INC	绿洲石油公司	OAS US	纽约	美国	796, 519	49, 332, 729. 24	1. 76
37	DENBURY RESOURCES INC	Denbury 资源 公司	DNR US	纽约	美国	2, 064, 309	49, 142, 956. 57	1. 75
38	ANTERO RESOURCES CORP	Antero 资源公 司	AR US	纽约	美国	284, 987	49, 097, 154. 54	1. 75
39	QEP RESOURCES INC	QEP 资源公司	QEP US	纽约	美国	419, 442	49, 036, 148. 82	1. 75
40	PBF ENERGY INC-CLASS A	PBF 能源股份 有限公司	PBF US	纽约	美国	310, 826	49, 014, 132. 05	1. 75
41	MEMORIAL RESOURCE DEVELOPMEN	Memorial 资源 开发有限公司	MRD US	纳斯 达克	美国	465, 343	49, 002, 226. 13	1. 75
42	WPX ENERGY INC	WPX 能源公司	WPX US	纽约	美国	787, 761	48, 633, 584. 92	1. 74
43	SM ENERGY CO	SM 能源公司	SM US	纽约	美国	264, 612	47, 376, 767. 55	1. 69
44	HOLLYFRONTIER CORP	HollyFrontier 公司	HFC US	纽约	美国	291, 737	45, 984, 643. 19	1. 64
45	LAREDO PETROLEUM INC	Laredo 石油公 司	LPI US	纽约	美国	649, 467	45, 134, 693. 58	1. 61
46	WHITING PETROLEUM CORP	怀汀石油公司	WLL US	纽约	美国	662, 093	40, 655, 762. 40	1. 45
47	CALLON PETROLEUM CO	Callon 石油公 司	CPE US	纽约	美国	506, 845	37, 743, 924. 03	1. 35
48	MATADOR RESOURCES CO	Matador 资源 公司	MTDR US	纽约	美国	251, 040	32, 960, 989. 67	1. 18
49	SYNERGY RESOURCES CORP	Synergy 资源 公司	SYRG US	纽约	美国	707, 790	31, 258, 690. 34	1. 12
50	WORLD FUEL	全球燃料服务	INT US	纽约	美国	93, 227	29, 358, 644. 85	1. 05

	SERVICES CORP	公司						
51	CALIFORNIA RESOURCES CORP	加利福尼亚资源公司	CRC US	纽约	美国	357,891	28,953,610.95	1.03
52	DELEK US HOLDINGS INC	Delek 美国控股公司	DK US	纽约	美国	294,814	25,825,161.58	0.92
53	SANCHEZ ENERGY CORP	桑切斯能源公司	SN US	纽约	美国	419,764	19,651,785.60	0.70
54	GREEN PLAINS INC	绿色平原可再生能源股份有限公司	GPRI US	纳斯达克	美国	110,584	14,460,767.12	0.52
55	CVR ENERGY INC	CVR 能源公司	CVI US	纽约	美国	135,215	13,897,884.47	0.50
56	KOSMOS ENERGY LTD	科斯莫斯能源有限公司	KOS US	纽约	美国	285,489	10,317,583.88	0.37
57	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	Cobalt 国际能源公司	CIE US	纽约	美国	1,124,115	9,988,670.06	0.36
58	PAR PACIFIC HOLDINGS INC	Par 太平洋控股股份有限公司	PARR US	纽约	美国	26,949	2,741,322.56	0.10

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	WESTERN REFINING INC	WNR US	48,423,220.33	1.48
2	HOLLYFRONTIER CORP	HFC US	40,160,433.31	1.22
3	SM ENERGY CO	SM US	38,463,189.93	1.17
4	ENERGEN CORP	EGN US	38,193,726.06	1.16
5	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	37,435,961.76	1.14
6	PBF ENERGY INC-CLASS A	PBF US	37,218,315.01	1.13
7	DEVON ENERGY CORP	DVN US	36,398,654.17	1.11
8	CALIFORNIA RESOURCES CORP	CRC US	34,380,333.50	1.05
9	TESORO CORP	TSO US	33,499,718.66	1.02
10	WHITING PETROLEUM CORP	WLL US	32,764,157.95	1.00
11	MARATHON OIL CORP	MRO US	31,346,718.66	0.95

12	VALERO ENERGY CORP	VLO US	30,938,934.01	0.94
13	DENBURY RESOURCES INC	DNR US	30,595,361.00	0.93
14	SYNERGY RESOURCES CORP	SYRG US	29,520,872.30	0.90
15	MEMORIAL RESOURCE DEVELOPMEN	MRD US	29,388,349.64	0.90
16	CONOCOPHILLIPS	COP US	27,836,281.17	0.85
17	OASIS PETROLEUM INC	OAS US	27,428,060.95	0.84
18	CARRIZO OIL & GAS INC	CRZO US	27,391,188.31	0.83
19	CHESAPEAKE ENERGY CORP	CHK US	25,318,189.56	0.77
20	NEWFIELD EXPLORATION CO	NFX US	24,579,142.84	0.75

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	SOUTHWESTERN ENERGY CO	SWN US	90,124,261.62	2.75
2	RANGE RESOURCES CORP	RRC US	76,586,809.98	2.33
3	SM ENERGY CO	SM US	75,227,637.53	2.29
4	WPX ENERGY INC	WPX US	64,767,204.67	1.97
5	QEP RESOURCES INC	QEP US	60,097,601.32	1.83
6	RICE ENERGY INC	RICE US	59,684,103.18	1.82
7	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	CLR US	59,084,717.05	1.80
8	CABOT OIL & GAS CORP	COG US	58,540,798.09	1.78
9	GULFPORT ENERGY CORP	GPOR US	56,899,327.08	1.73
10	EQT CORP	EQT US	55,434,143.07	1.69
11	DEVON ENERGY CORP	DVN US	54,817,727.74	1.67
12	DENBURY RESOURCES INC	DNR US	53,740,370.13	1.64
13	ANTERO RESOURCES CORP	AR US	52,766,373.61	1.61
14	WHITING PETROLEUM CORP	WLL US	51,782,102.71	1.58
15	ENERGEN CORP	EGN US	50,821,055.61	1.55
16	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	PE US	50,397,707.98	1.54
17	CARRIZO OIL & GAS INC	CRZO US	47,592,314.66	1.45
18	OASIS PETROLEUM INC	OAS US	47,442,379.99	1.45
19	MURPHY OIL CORP	MUR US	47,354,999.07	1.44
20	RSP PERMIAN INC	RSPP US	44,356,048.35	1.35

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	1,347,861,692.57
卖出收入（成交）总额	2,274,273,416.02

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	51,200,169.39	1.83

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	484,837.73
4	应收利息	12,516.14
5	应收申购款	234,336,271.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	234,833,624.99

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
77,704	62,398.96	658,495,087.81	13.58%	4,190,153,366.22	86.42%

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	西南证券股份有限公司	67,552,264.00	1.39%
2	工银瑞信基金—工商银行—特定 客户资产管理计划	40,183,148.00	0.83%
3	章宁翔	37,150,000.00	0.77%
4	嘉实资本—中国银行—粤享财富	36,275,374.00	0.75%

	5 号—嘉实资本分级基金 A 份额		
5	嘉实资本—中国银行—粤享财富 3 号—嘉实资本分级基金 A 份额	36,209,916.00	0.75%
6	上海斯诺波投资管理有限公司—私募工场自由之路母基金证券投资	34,928,571.00	0.72%
7	平安大华基金—平安银行—平安大华固定收益增强六号特定客户资	24,000,000.00	0.49%
8	粤享财富 6 号—嘉实资本分级基金 A 份额专项资产管理计划	21,060,439.00	0.43%
9	平安大华基金—平安银行—平安大华固定收益增强七号特定客户资	19,000,000.00	0.39%
10	赵元	17,447,212.00	0.36%

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	7,763,068.28	0.1601%

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	6,626,822,168.13
本报告期基金总申购份额	2,301,232,626.69
减：本报告期基金总赎回份额	4,079,406,340.79
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	4,848,648,454.03

§ 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

本基金自 2015 年 12 月 15 日起更换会计师事务所，由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)更换为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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 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	
Daiwa Securities SMBC Singapore	-	2,017,059,244.83	55.69%	806,823.89	55.20%	-

Ltd						
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	1,605,075,864.01	44.31%	654,782.01	44.80%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	-	-	-	-	-
Nomura International (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

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，具备健全的内部控制制度，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
Daiwa Securities	-	-	-	-	-	-	-	-

SMBC Singapore Ltd								
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited							31,878,259.70	100.00%
Goldman Sachs Asia LLC								
Nomura International (HK) Ltd								
银河证券								
海通证券								
光大证券								
瑞银证券								
华创证券								
华宝证券								

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旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 6 月 30 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	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 6 月 29 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 6 月 24 日
4	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 5 月 31 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行股份有限公司直销银行“基金通”费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 5 月 30 日

6	关于华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 参加恒泰证券股份有限公司申购费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 5 月 26 日
7	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	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 5 月 25 日
8	关于调整华宝油气基金网上直销申购费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 5 月 7 日
9	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰资产管理有限公司开通转换、定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 5 月 3 日
10	关于调整华宝油气基金网上直销申购费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 4 月 26 日
11	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加诺亚正行 (上海) 基金投资顾问有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 4 月 25 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) 恢复大额申购、大额定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 4 月 19 日
13	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 4 月 12 日
14	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 调整大额申购、大额定期定额投资金额上限的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 4 月 8 日
15	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 恢复申购、定期定额投资业务并暂停大额申购、大额定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 3 月 25 日
16	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赎回业务的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 3 月 23 日

17	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赎回业务的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 2 月 5 日
18	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 暂停申购、定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
19	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并调整大额申购、大额定期定额投资金额上限的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 1 月 16 日
20	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 恢复申购、定期定额投资业务并暂停大额申购、大额定期定额投资业务的公告	以及基金管理人网站上上证报、中证报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
21	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国都证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
22	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间场内申购赎回业务安排的提示性公告	上证报、中证报、证券时报以及基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
23	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	2016 年 1 月 4 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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
2016 年 8 月 26 日