

# 华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证 券投资基金(L0F)2016 年年度报告（摘 要）

2016 年 12 月 31 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 3 月 28 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 3 月 24 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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   | 3,530,403,415.23 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 0.714 元，人民币总份额 3,518,256,438.03 份；本基金美元份额净值 0.1029 美元，美元总份额 12,146,977.2 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

|                     |                                 |
|---------------------|---------------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fsfund.com                  |
| 基金年度报告备置地点          | 本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。 |

# §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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 | 2016 年 | 2015 年 | 2014 年 |
|---------------|--------|--------|--------|
|---------------|--------|--------|--------|

|                      |                   |                   |                |
|----------------------|-------------------|-------------------|----------------|
| 本期已实现收益              | 361,036,825.41    | -374,249,408.71   | -4,868,271.60  |
| 本期利润                 | 1,163,752,057.93  | -694,187,153.41   | -25,761,293.63 |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.2303            | -0.1781           | -0.5767        |
| 本期加权平均净值利润率          | 41.64%            | -26.48%           | -54.92%        |
| 本期基金份额净值增长率          | 44.24%            | -34.78%           | -32.23%        |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2016 年末</b>    | <b>2015 年末</b>    | <b>2014 年末</b> |
| 期末可供分配利润             | -1,008,887,328.42 | -3,344,099,436.46 | -45,644,802.16 |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.2858           | -0.5046           | -0.2406        |
| 期末基金资产净值             | 2,521,516,086.81  | 3,282,722,731.67  | 144,036,310.57 |
| 期末基金份额净值             | 0.714             | 0.495             | 0.759          |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2016 年末</b>    | <b>2015 年末</b>    | <b>2014 年末</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | -28.60%           | -50.50%           | -24.10%        |

1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段          | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④    |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月       | 11.56%   | 2.07%       | 12.26%     | 2.13%         | -0.70%  | -0.06% |
| 过去六个月       | 23.53%   | 2.05%       | 25.33%     | 2.13%         | -1.80%  | -0.08% |
| 过去一年        | 44.24%   | 2.55%       | 48.30%     | 2.67%         | -4.06%  | -0.12% |
| 过去三年        | -36.25%  | 2.43%       | -28.71%    | 2.58%         | -7.54%  | -0.15% |
| 过去五年        | -26.99%  | 2.08%       | -8.04%     | 2.22%         | -18.95% | -0.14% |
| 自基金合同生效日起至今 | -28.60%  | 2.04%       | 7.25%      | 2.28%         | -35.85% | -0.24% |

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）。

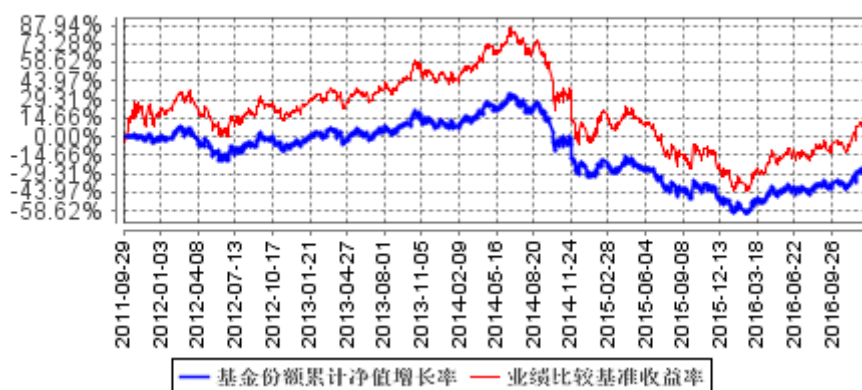
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如

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 12 月 31 日)

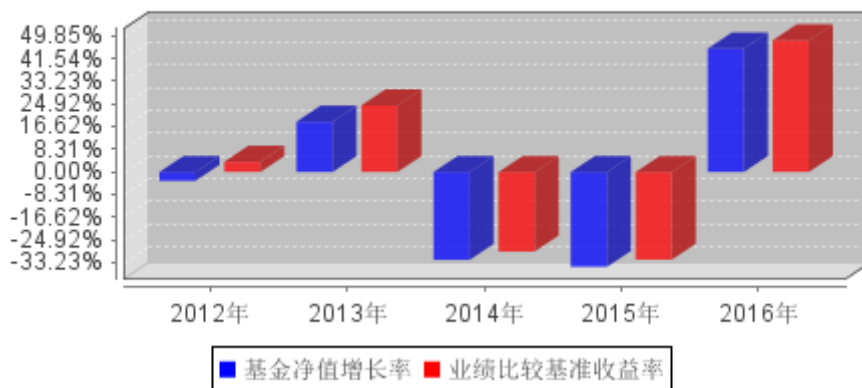
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

## §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 12 月 31 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、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、未来产业主导基金和新起点基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 119,691,851,523.98 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 | 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 |

|  |               |  |  |  |                                                                                                                                                                                     |
|--|---------------|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 管理（香港）有限公司总经理 |  |  |  | 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）有限公司总经理。 |
|--|---------------|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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，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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对



应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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。

2016 年全年油价先抑后扬，走出了触底反弹的上扬的趋势，二月份 WTI 油价一度走低至 26.05 美元/桶。此后油价开始反弹，WTI 油价在六月初最高突破 50 美元/桶大关后开始回落。此后英国脱欧，联储加息概率增发，美国总统大选选情不明等事件推动油价进一步下挫，油价一度跌破 40 美元/桶。但是十一月三十日 OPEC 国家在维也纳会议上出人意料的达成了八年来第一个减产协议，11 个成员国 2017 年起每日减少产量共 120 万桶。WIT 油价当天大涨 8.29%。此后以俄罗斯为首的非 OPEC 国家也达成小幅度减产协议，促使油价进一步走高。截止十二月三十日，WTI 油价收至 53.89 美元/桶，相对去年年末大涨 45.4%。整个 16 年，本基金跟踪的标普石油天然气上游股票指数上涨 38.8%，涨幅略低于国际油价。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，特朗普当选等黑天鹅事件的拖累。2016 年标普油气指数年化日均波幅 41.6%，超过标普 500 指数日均波幅 13.1%的水平。

日常操作过程中，人民币汇率方面，2016 年人民币对美金先扬后抑，年底一路下跌。全年人行美元中间价从 6.4936 贬值至 6.9370，相对于美元贬值 6.8%。同期，人民币交易价也相对于美元贬值 7.0%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。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 2016 年，华宝油气基金年化跟踪误差（剔除汇率因素）约为 2.2%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为 44.24%，同期业绩比较基准收益率为 48.30%，基金表现落后于业绩比较基准 4.06%。落后于基准的主要原因来源于基金的仓位上的限制和大额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 2017 年上半年，我们对原油价格走势比较乐观。首先是去年十一月达成的冻产协议目前进展顺利，OPEC 12 月原油产量下降 32 万桶/日至 3309 万桶/日，1 月下降 69 万桶，两个月合计减产超过 100 万桶。预计至 3 月，能够完成去年减产协议达成的 120 万桶指标。沙特石油部长表示，过去两年原油市场的波动令 OPEC 与非 OPEC 产油国达成一致。投资和利润下降要求各方采取一致行动，OPEC 与非 OPEC 的减产协议将加速市场恢复均衡。诚然随着油价的反弹，美国页岩油的产量在逐渐恢复，但是我们认为至少在 2017 年上半年，页岩油的产量恢复将比较有限，因此从供给侧而言，2017 年上半年原油供给较 2016 年下降是大概率事件，而从需求端来看，美国近期的经济数据继续走强，1 月的非农就业数据大幅度超预期，后续如果特朗普的基建和减税等扩张式经济政策能够顺利落地的话，美国经济今年将持续走强。而中国和欧洲当前的经济数据也比较稳健。我们认为就 2017 年上半年而言，对原油的需求端会得到比较强的支持。此外，联储一月份的议息会议表明，联储在特朗普经济政策进程不明朗的情况下，将会延迟加息，六月份可能才会第一次加息，因此美元指数上半年走势可能会偏弱，这也对包括原油在内的大宗商品价格提供了一定的支撑。

对于美股而言，我们认为 2017 年上半年美股走势将保持稳健。当前美国标普 500 指数点位对应 2016 年盈利仅有 17.6 倍左右，仍然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。而联储上半年我们目前认为仅仅为六月份加息一次，这有利于美股保持在当前高位。因此，在油价继续震荡向上的时候，如果美股能走势稳健的话，无疑将有利于基金标的指数在 2017 年上半年进一步上扬。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监

察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2016 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计、根据监管要求开展了涉及投资、销售等方面的专项自查；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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。

#### **4.9 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 审计报告

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            |            | 147,109,755.11                  | 139,518,298.27                   |
| 结算备付金           |            | —                               | —                                |
| 存出保证金           |            | —                               | —                                |
| 交易性金融资产         |            | 2,372,678,919.46                | 3,121,554,601.36                 |
| 其中：股票投资         |            | 2,342,464,101.87                | 3,041,155,095.96                 |
| 基金投资            |            | 30,214,817.59                   | 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          |            | —                               | —                                |
| 买入返售金融资产        |            | —                               | —                                |
| 应收证券清算款         |            | —                               | 229,549,582.41                   |
| 应收利息            |            | 10,301.33                       | 24,443.95                        |
| 应收股利            |            | 407,748.05                      | 351,365.71                       |
| 应收申购款           |            | 26,862,910.74                   | —                                |
| 递延所得税资产         |            | —                               | —                                |
| 其他资产            |            | —                               | —                                |
| 资产总计            |            | 2,547,069,634.69                | 3,490,998,291.70                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 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         |            | —                               | —                                |

|               |  |                   |                   |
|---------------|--|-------------------|-------------------|
| 应付赎回款         |  | 21,197,538.62     | 203,085,415.49    |
| 应付管理人报酬       |  | 2,172,425.06      | 2,266,280.16      |
| 应付托管费         |  | 608,279.04        | 634,558.46        |
| 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          |  | 1,575,305.16      | 2,289,305.92      |
| 负债合计          |  | 25,553,547.88     | 208,275,560.03    |
| <b>所有者权益：</b> |  |                   |                   |
| 实收基金          |  | 3,530,403,415.23  | 6,626,822,168.13  |
| 未分配利润         |  | -1,008,887,328.42 | -3,344,099,436.46 |
| 所有者权益合计       |  | 2,521,516,086.81  | 3,282,722,731.67  |
| 负债和所有者权益总计    |  | 2,547,069,634.69  | 3,490,998,291.70  |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.714 元，基金份额总额 3,530,403,415.23 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------------|-----|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>       |     | 1,204,238,356.81                          | -654,320,866.37                                |
| 1. 利息收入           |     | 697,840.88                                | 769,274.90                                     |
| 其中：存款利息收入         |     | 697,840.88                                | 769,274.90                                     |
| 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） |     | 384,843,793.43                            | -309,109,573.87                                |
| 其中：股票投资收益         |     | 362,951,302.33                            | -333,961,893.69                                |
| 基金投资收益            |     | -8,723,140.01                             | 1,338,928.26                                   |
| 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            |     | 8,253.67                                  | —                                              |

|                            |  |                         |                        |
|----------------------------|--|-------------------------|------------------------|
| 股利收益                       |  | 30,607,377.44           | 23,513,391.56          |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     |  | 802,715,232.52          | -319,937,744.70        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |  | 10,141,910.52           | -31,664,891.07         |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         |  | 5,839,579.46            | 5,622,068.37           |
| <b>减：二、费用</b>              |  | <b>40,486,298.88</b>    | <b>39,866,287.04</b>   |
| 1. 管理人报酬                   |  | 27,927,011.14           | 26,104,718.91          |
| 2. 托管费                     |  | 7,819,563.18            | 7,309,321.25           |
| 3. 销售服务费                   |  | -                       | -                      |
| 4. 交易费用                    |  | 2,923,348.98            | 4,914,875.46           |
| 5. 利息支出                    |  | -                       | -                      |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |  | -                       | -                      |
| 6. 其他费用                    |  | 1,816,375.58            | 1,537,371.42           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |  | <b>1,163,752,057.93</b> | <b>-694,187,153.41</b> |
| 减：所得税费用                    |  | -                       | -                      |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |  | <b>1,163,752,057.93</b> | <b>-694,187,153.41</b> |

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）         | -                                      | 1,163,752,057.93  | 1,163,752,057.93  |
| 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） | -3,096,418,752.90                      | 1,171,460,050.11  | -1,924,958,702.79 |
| 其中：1. 基金申购款                       | 4,860,260,808.09                       | -2,033,475,114.26 | 2,826,785,693.83  |
| 2. 基金赎回款                          | -7,956,679,560.99                      | 3,204,935,164.37  | -4,751,744,396.62 |



|                                        |                                             |                   |                   |
|----------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| 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）                        | 3,530,403,415.23                            | -1,008,887,328.42 | 2,521,516,086.81  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                   |                   |
|                                        | 实收基金                                        | 未分配利润             | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 189,681,112.73                              | -45,644,802.16    | 144,036,310.57    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                           | -694,187,153.41   | -694,187,153.41   |
| 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）      | 6,437,141,055.40                            | -2,604,267,480.89 | 3,832,873,574.51  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 12,919,490,180.95                           | -4,585,794,374.78 | 8,333,695,806.17  |
| 2. 基金赎回款                               | -6,482,349,125.55                           | 1,981,526,893.89  | -4,500,822,231.66 |
| 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）                        | 6,626,822,168.13                            | -3,344,099,436.46 | 3,282,722,731.67  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 黄小薏      | 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 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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)。本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本

基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额，确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### **7.4.4.13 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有

关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 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。

#### **7.4.5.2 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。

#### **7.4.5.3 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。

### **7.4.6 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。

### 7.4.7 关联方关系

| 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                 |
| 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：

- 1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
- 2、宝武集团由原宝钢集团有限公司和武汉钢铁(集团)公司联合重组而成，于 2016 年 12 月 1 日正式成立。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单位进行交易。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 27,927,011.14                          | 26,104,718.91                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,987,992.79                           | 5,548,200.32                                |



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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 7,819,563.18                           | 7,309,321.25                                |

注：支付基金托管人 中国建设银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.28%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.28\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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 | 0.17%                                  | 0.09%                                       |

**7.4.8.4.2 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末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**7.4.8.5 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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 | 97,191,472.19                          | -          | 2,638,370.72                                | -          |
| 中国建设银行 | 49,918,282.92                          | 691,072.56 | 136,879,927.55                              | 761,211.02 |

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。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比较期均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**7.4.8.7 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。

**7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 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。

**7.4.9.2 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。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本期末无银行间市场债券正回购，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。

**7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 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 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,372,678,919.46 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。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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              | 2,342,464,101.87 | 91.97         |
|    | 其中：普通股            | 2,342,464,101.87 | 91.97         |
|    | 存托凭证              | —                | —             |
|    | 优先股               | —                | —             |
|    | 房地产信托凭证           | —                | —             |
| 2  | 基金投资              | 30,214,817.59    | 1.19          |
| 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      | 147,109,755.11   | 5.78          |
|    |                   |                  |               |
| 8  | 其他各项资产            | 27,280,960.12    | 1.07          |
| 9  | 合计                | 2,547,069,634.69 | 100.00        |

### 8.2 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     | 2,342,464,101.87 | 92.90         |
| 合计     | 2,342,464,101.87 | 92.90         |

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

#### 8.3.1 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     | 2,342,464,101.87 | 92.90         |
| 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     | 2,342,464,101.87 | 92.90         |

#### 8.3.2 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。

### 8.4 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  | CLAYTON WILLIAMS ENERGY INC | 克莱顿威廉姆斯能源公司        | CWEI US | 纳斯达克   | 美国       | 70,271  | 58,135,663.49 | 2.31          |
| 2  | RSP PERMIAN INC             | RSP Permian 股份有限公司 | RSPP US | 纽约     | 美国       | 152,684 | 47,260,116.67 | 1.87          |
| 3  | MARATHON PETROLEUM CORP     | 马拉松石油公司            | MPC US  | 纽约     | 美国       | 134,216 | 46,878,689.34 | 1.86          |
| 4  | CHEVRON CORP                | 雪佛龙                | CVX US  | 纽约     | 美国       | 57,298  | 46,782,951.80 | 1.86          |
| 5  | EXXON MOBIL CORP            | 埃克森美孚石油            | XOM US  | 纽约     | 美国       | 74,558  | 46,683,270.44 | 1.85          |
| 6  | OCCIDENTAL                  | 西方石油               | OXY     | 纽      | 美国       | 94,016  | 46,455,421.90 | 1.84          |

|    |                    |                  |        |    |    |         |               |      |
|----|--------------------|------------------|--------|----|----|---------|---------------|------|
|    | PETROLEUM CORP     |                  | US     | 约  |    |         |               |      |
| 7  | VALERO ENERGY CORP | Valero 能源        | VLO US | 纽约 | 美国 | 97,583  | 46,248,081.07 | 1.83 |
| 8  | HESS CORP          | 阿美拉达赫斯           | HES US | 纽约 | 美国 | 105,731 | 45,686,970.94 | 1.81 |
| 9  | PHILLIPS 66        | Phillips 66 公司   | PSX US | 纽约 | 美国 | 76,132  | 45,635,513.17 | 1.81 |
| 10 | HOLLYFRONTIER CORP | HollyFrontier 公司 | HFC US | 纽约 | 美国 | 200,655 | 45,600,076.76 | 1.81 |

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) 的年度报告正文。

#### 8.4.1 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。

### 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 8.5.1 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  | CALIFORNIA RESOURCES CORP | CRC US  | 70,007,203.52 | 2.13           |
| 2  | WHITING PETROLEUM CORP    | WLL US  | 68,135,356.66 | 2.08           |
| 3  | WESTERN REFINING INC      | WNR US  | 66,747,763.66 | 2.03           |
| 4  | PBF ENERGY INC-CLASS A    | PBF US  | 65,228,624.10 | 1.99           |
| 5  | HOLLYFRONTIER CORP        | HFC US  | 61,749,460.99 | 1.88           |
| 6  | SM ENERGY CO              | SM US   | 60,864,494.20 | 1.85           |
| 7  | ENERGEN CORP              | EGN US  | 55,143,233.91 | 1.68           |
| 8  | MARATHON PETROLEUM CORP   | MPC US  | 54,859,881.86 | 1.67           |
| 9  | TESORO CORP               | TSO US  | 53,358,542.34 | 1.63           |
| 10 | DEVON ENERGY CORP         | DVN US  | 53,015,462.90 | 1.61           |
| 11 | SYNERGY                   | SYRG US | 52,374,738.82 | 1.60           |

|    |                             |         |               |      |
|----|-----------------------------|---------|---------------|------|
|    | RESOURCES CORP              |         |               |      |
| 12 | VALERO ENERGY CORP          | VLO US  | 51,844,611.54 | 1.58 |
| 13 | CLAYTON WILLIAMS ENERGY INC | CWEI US | 51,299,480.84 | 1.56 |
| 14 | CABOT OIL & GAS CORP        | COG US  | 51,028,548.51 | 1.55 |
| 15 | DENBURY RESOURCES INC       | DNR US  | 50,665,448.93 | 1.54 |
| 16 | CONOCOPHILLIPS              | COP US  | 50,298,138.11 | 1.53 |
| 17 | SOUTHWESTERN ENERGY CO      | SWN US  | 48,589,383.02 | 1.48 |
| 18 | CARRIZO OIL & GAS INC       | CRZO US | 47,451,094.80 | 1.45 |
| 19 | MARATHON OIL CORP           | MRO US  | 47,183,800.12 | 1.44 |
| 20 | CHEVRON CORP                | CVX US  | 46,196,420.71 | 1.41 |

注：买入金额不包括相关交易费用。

### 8.5.2 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  | 126,188,556.70 | 3.84           |
| 2  | SM ENERGY CO                 | SM US   | 119,403,563.19 | 3.64           |
| 3  | WPX ENERGY INC               | WPX US  | 110,634,918.13 | 3.37           |
| 4  | WHITING PETROLEUM CORP       | WLL US  | 107,758,144.17 | 3.28           |
| 5  | RANGE RESOURCES CORP         | RRC US  | 105,604,464.12 | 3.22           |
| 6  | RICE ENERGY INC              | RICE US | 103,444,349.54 | 3.15           |
| 7  | CHESAPEAKE ENERGY CORP       | CHK US  | 101,903,480.55 | 3.10           |
| 8  | OASIS PETROLEUM INC          | OAS US  | 101,866,473.40 | 3.10           |
| 9  | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | CLR US  | 100,429,761.79 | 3.06           |
| 10 | CABOT OIL & GAS CORP         | COG US  | 99,268,263.59  | 3.02           |
| 11 | DEVON ENERGY                 | DVN US  | 97,655,865.88  | 2.97           |

|    | CORP                               |         |               |      |
|----|------------------------------------|---------|---------------|------|
| 12 | PARSLEY ENERGY<br>INC-CLASS A      | PE US   | 94,667,738.82 | 2.88 |
| 13 | DENBURY<br>RESOURCES INC           | DNR US  | 94,041,695.40 | 2.86 |
| 14 | WESTERN REFINING<br>INC            | WNR US  | 93,956,951.06 | 2.86 |
| 15 | QEP RESOURCES<br>INC               | QEP US  | 93,809,492.91 | 2.86 |
| 16 | ENERGEN CORP                       | EGN US  | 91,415,073.12 | 2.78 |
| 17 | EQT CORP                           | EQT US  | 86,822,372.04 | 2.64 |
| 18 | MURPHY OIL CORP                    | MUR US  | 85,708,460.04 | 2.61 |
| 19 | GULFPORT ENERGY<br>CORP            | GPOR US | 85,554,175.65 | 2.61 |
| 20 | CALIFORNIA<br>RESOURCES CORP       | CRC US  | 85,175,016.56 | 2.59 |
| 21 | RSP PERMIAN INC                    | RSPP US | 84,653,657.85 | 2.58 |
| 22 | ANTERO RESOURCES<br>CORP           | AR US   | 84,006,477.90 | 2.56 |
| 23 | MEMORIAL<br>RESOURCE<br>DEVELOPMEN | MRD US  | 82,246,310.62 | 2.51 |
| 24 | MARATHON OIL<br>CORP               | MRO US  | 82,233,243.16 | 2.51 |
| 25 | CHEVRON CORP                       | CVX US  | 81,113,498.94 | 2.47 |
| 26 | CARRIZO OIL & GAS<br>INC           | CRZO US | 80,874,305.21 | 2.46 |
| 27 | APACHE CORP                        | APA US  | 79,033,488.30 | 2.41 |
| 28 | CIMAREX ENERGY<br>CO               | XEC US  | 77,806,799.93 | 2.37 |
| 29 | NEWFIELD<br>EXPLORATION CO         | NFX US  | 77,705,148.71 | 2.37 |
| 30 | ANADARKO<br>PETROLEUM CORP         | APC US  | 77,377,627.19 | 2.36 |
| 31 | HESS CORP                          | HES US  | 76,924,611.94 | 2.34 |
| 32 | PDC ENERGY INC                     | PDCE US | 76,627,703.56 | 2.33 |
| 33 | PBF ENERGY INC-<br>CLASS A         | PBF US  | 74,342,583.89 | 2.26 |
| 34 | CONCHO RESOURCES<br>INC            | CXO US  | 74,061,080.71 | 2.26 |
| 35 | MARATHON<br>PETROLEUM CORP         | MPC US  | 73,947,554.93 | 2.25 |
| 36 | PIONEER NATURAL<br>RESOURCES CO    | PXD US  | 73,563,277.67 | 2.24 |



|    |                              |         |               |      |
|----|------------------------------|---------|---------------|------|
| 37 | EOG RESOURCES<br>INC         | EOG US  | 72,511,843.10 | 2.21 |
| 38 | CONOCOPHILLIPS               | COP US  | 72,174,731.70 | 2.20 |
| 39 | EXXON MOBIL CORP             | XOM US  | 72,105,003.72 | 2.20 |
| 40 | DIAMONDBACK<br>ENERGY INC    | FANG US | 71,294,358.21 | 2.17 |
| 41 | VALERO ENERGY<br>CORP        | VLO US  | 71,180,910.98 | 2.17 |
| 42 | HOLLYFRONTIER<br>CORP        | HFC US  | 70,191,434.59 | 2.14 |
| 43 | PHILLIPS 66                  | PSX US  | 67,890,558.57 | 2.07 |
| 44 | OCCIDENTAL<br>PETROLEUM CORP | OXY US  | 67,667,696.57 | 2.06 |
| 45 | NOBLE ENERGY INC             | NBL US  | 66,109,185.42 | 2.01 |

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 8.5.3 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 | 2,578,606,843.48 |
| 卖出收入（成交）总额 | 4,418,258,587.9  |

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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<br>净值比例<br>(%) |
|----|-----------------------|--------|------|--------------------------|---------------|----------------------|
| 1  | SPDR S&P<br>OIL & GAS | ETF 基金 | 开放式  | SSGA Funds<br>Management | 30,214,817.59 | 1.20                 |

|  |          |  |  |     |  |  |
|--|----------|--|--|-----|--|--|
|  | EXP & PR |  |  | Inc |  |  |
|--|----------|--|--|-----|--|--|

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 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    | 407,748.05    |
| 4  | 应收利息    | 10,301.33     |
| 5  | 应收申购款   | 26,862,910.74 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 27,280,960.12 |

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.11.5.2 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 76,450       | 46,179.25     | 344,293,874.82 | 9.75%      | 3,186,109,540.41 | 90.25%     |

### 9.2 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 | 2.39%    |
| 2  | 永安国富资产管理有限公司—永安国富—永富10号私募证券投资 | 40,675,162.00 | 2.30%    |
| 3  | 朱伟                            | 39,349,925.00 | 2.23%    |
| 4  | 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 | 1.53%    |
| 5  | 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 | 21,890,000.00 | 1.24%    |
| 6  | 杭州恩宝资产管理有限公司—恩宝芝麻1号基金         | 19,530,000.00 | 1.11%    |
| 7  | 王玲华                           | 16,481,266.79 | 0.93%    |
| 8  | 中信证券股份有限公司                    | 14,556,449.00 | 0.82%    |
| 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 | 14,309,967.00 | 0.81%    |
| 10 | 杨阳                            | 14,210,000.00 | 0.81%    |

注：上述持有人均为场内持有人。

### 9.3 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 | 7,626,287.27 | 0.2160%  |

**9.4 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             |

**§10 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                    | 4,860,260,808.09 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                  | 7,956,679,560.99 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -                |
| 本报告期末基金份额总额                    | 3,530,403,415.23 |

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**11.2 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**

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

**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。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 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。

## 11.5 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）。

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 120000 元人民币。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 日起至本报告期末。

## 11.6 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 Ltd           | -      | 3,783,457,931.44 | 54.07%       | 1,513,383.76 | 53.56%     | -  |
| J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited | -      | 2,775,137,904.91 | 39.66%       | 1,130,954.58 | 40.02%     | -  |
| Nomura International (HK) Ltd                 | -      | 438,077,320.46   | 6.26%        | 181,491.09   | 6.42%      | -  |
| 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：资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本报告期交易单元无变动。

## 11.7.2 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 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | 52,246,113.57 | 78.96%       |
| Nomura International (HK) Ltd                 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | 13,921,218.76 | 21.04%       |
| 银河证券                                          | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -             | -            |
| 海通证券                                          | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -             | -            |
| 华宝证券                                          | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -             | -            |
| 光大证券                                          | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -             | -            |
| 瑞银证券                                          | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -             | -            |
| 华创证券                                          | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -             | -            |

华宝兴业基金管理有限公司  
2017 年 3 月 28 日