

华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资 基金(LOF) 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 24 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 2018 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 2018 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 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人..... | 7 |
| 2.5 信息披露方式..... | 7 |
| 2.6 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 9 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 16 |
| 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..... | 17 |
| §5 托管人报告 | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 18 |
| 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..... | 18 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 18 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 19 |
| 6.1 资产负债表..... | 19 |
| 6.2 利润表..... | 20 |

| | |
|--------------------------------------------|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 21 |
| 6.4 报表附注..... | 22 |
| §7 投资组合报告..... | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 44 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布..... | 44 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合..... | 44 |
| 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..... | 45 |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动..... | 49 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合..... | 51 |
| 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..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 52 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 54 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 54 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 54 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 56 |
| §10 重大事件揭示..... | 57 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 57 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 57 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 57 |
| 10.8 其他重大事件..... | 59 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 61 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.1 影响投资者决策的其他重要信息..... | 61 |
| §12 备查文件目录..... | 62 |
| 12.1 备查文件目录..... | 62 |
| 12.2 存放地点..... | 62 |
| 12.3 查阅方式..... | 62 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-----------------------------|
| 基金名称 | 华宝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 |
| 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 | 2,979,314,209.61 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 |

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 0.703 元，人民币总份额 2,963,731,573.28 份；本基金美元份额净值 0.1062 美元，美元总份额 15,582,636.33 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 | | 孔祥清 | 田国立 |

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 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 |

§ 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(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 151,387,006.03 |
| 本期利润 | 355,007,204.61 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0896 |
| 本期加权平均净值利润率 | 14.98% |
| 本期基金份额净值增长率 | 16.39% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | -884,633,553.07 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2969 |
| 期末基金资产净值 | 2,094,680,656.54 |
| 期末基金份额净值 | 0.703 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -29.70% |

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 | 5.40% | 1.76% | 5.36% | 1.88% | 0.04% | -0.12% |
| 过去三个月 | 27.59% | 1.71% | 28.84% | 1.80% | -1.25% | -0.09% |
| 过去六个月 | 16.39% | 1.81% | 17.57% | 1.91% | -1.18% | -0.10% |
| 过去一 | 29.94% | 1.63% | 33.18% | 1.72% | -3.24% | -0.09% |

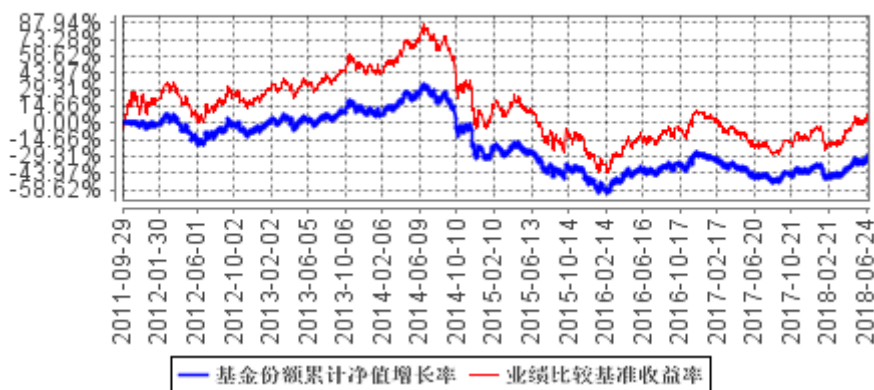
| | | | | | | |
|-------------|---------|-------|-------|-------|---------|--------|
| 年 | | | | | | |
| 过去三年 | -0.57% | 2.30% | 3.41% | 2.43% | -3.98% | -0.13% |
| 自基金合同生效日起至今 | -29.70% | 1.95% | 7.99% | 2.17% | -37.69% | -0.22% |

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

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（2018 年 6 月 30 日），所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、上证 180 成长 ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证 1000 分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝宝鑫纯债基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证军工 ETF、华宝新活力基金、华宝沪深 300 指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝新优享基金、华宝银行 ETF、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证 500 指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商 ETF 联接基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 153,280,039,194.92 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、美国消费、华 | 2014 年 9 月 18 日 | - | 12 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 |

| | | | | |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>宝标普香港上市中国中小盘指数 (LOF)、华宝港股通恒生中国 (香港上市) 25 指数 (场内简称 “香港大盘”)、华宝港股通恒生香港 35 指数 (场内简称 “香港本地”) 基金经理</p> | | | <p>作。2005 年至 2007 年在华宝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 月至 2017 年 8 月任华宝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 月兼任华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF) 基金经理,2017 年 4 月任华宝港股通恒生中国 (香港上市) 25 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理,2018 年 3 月兼任华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。目前兼任华宝资产管理 (香港) 有限公司董事</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

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。

18 年上半年全球油价震荡上行。截止报告期尾，WTI 油价收至 74.29 美元一桶，相对去年年底上涨 23.6%。油价的上涨需要从供需两方面进行分析。首先需求方面，全球经济维持缓慢复苏状况，导致对原油需求在持续增加。而在供给方，美国原油库存持续下降表明美国原油产量短期可能见顶；而欧佩克国家今年以来减产协议履约率高达 130%以上。供给今年以来的明显缩窄导致了供需缺口开始出现，推动了油价的稳步上涨。而五月之后，美国单方面退出伊朗核协议，并准备对伊朗和委内瑞拉这两个产油国进行全面制裁。虽然欧佩克国家和俄罗斯在六月底达成将减产协议履约率降低至 100%从而增加供给，但市场预期这样并不能弥补两大产油国遭制裁带来的供给下降。因此后续原油供给缺口可能进一步扩大，这导致了油价六月下旬后继续推高。油价的上涨使得跟踪石油上游股票的基金标的指数走强。整个上半年，本基金跟踪的标普石油天然气上游股票指数上涨 16.11%，上涨幅度低于国际油价上涨。主要原因在于美国原油上游开采公司在去年四季度时发生较大亏损，从而导致整个油气板块一季度股价表现低迷。指数一季度下跌 5.17%，与油价表现明显背离。而四月份发布的美股一季报显示能源板块整体利润增长迅速，从而带动整个板块二季度有明显的补涨。标的指数二季度上涨 22.44%，上涨幅度高于国际油价二季度的上涨。上半年标普油气指数年化波动率为 29.9%，超过标 500 指数日均波幅 16.5%的水平。

日常操作过程中，人民币汇率方面，2018 年上半年人民币汇率呈现先升后贬走势，尤其六月中旬以来，伴随着中美贸易摩擦加剧叠加中美利差收窄，人民币兑美元加速贬值。上半年人行中间价从 6.5342 贬值至 6.6166，相对于美元贬值 1.26%。同期，人民币交易价也相对于美元贬值 1.73%左右。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。2018 年上半年，华宝油气基金年化跟踪误差（剔除汇率因素）约为 2.1%。

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 16.39%，同期业绩比较基准收益率为 17.57%，基金表现落后于比较基准 1.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基金的表现受油价，美股和汇率三方面影响，我们就这三个方面阐述一下我们对 18 年下半年的观点。展望 18 年全年，我们认为油价大概率仍将保持高位振荡走势。从需求端来看，当前全球主要经济体除了美国一枝独秀之外，其他均有增长放缓的趋势，这样会导致 18 年下半年对原油需求的增长较上半年有所放缓。而从供给端来看，欧佩克国家和俄罗斯在六月底达成将减产协议履约率降低至 100%，从而增加下半年原油供给。但伊朗和委内瑞拉的原油供给减少则取决于美国对其制裁的力度，这方面存在着比较大的不确定性，因此原油下半年的供给可能会有一定的波动。在这样的情况下，我们认为油价下半年将改变上半年单边上涨的趋势，变为高位震荡。WTI 原油的振荡空间有可能在 65-75 美元每桶之间。

我们当前对美股 18 年下半年走势仍然保持谨慎乐观的态度。美国经济整体向上的趋势仍然在继续。美国 18 年下半年 GDP 同比可能将继续维持 2.9%左右的高增长，较 17 年三四季度的 2.3%和 2.6%GDP 增速有明显提升。经济的进一步走强，将带来企业盈利的增长，从而推动股价进一步走高。而美债收益率我们认为下半年会趋于稳定，作为基准的 10 年期美国国债的收益率在联储六月加息之后稳定在 2.9%左右，主要原因是因为联储加息路径已经基本明确，后续半年再出现超预期上调的可能性较低。稳定的债券收益率有助于股市的进一步走高。考虑到 17 年下半年油价均价仅为 52 美元每桶，如果油价下半年维持在 65 美元之上的话，我们认为标的指数三季报和四季报均会有良好的表现，因此标的指数应该相对于油价有更优的表现。但是根据以往加息周期的经验来看，利率水平整体提升之后，美股的波动性会有明显提升，美股后面再次出现较大幅度回撤的可能性仍然存在。尤其是中美之间的贸易战如果失控的话，可能会对美股情绪上带来比较大的负面影响，这个风险点在下半年不能排除。

而对于汇率而言，我们认为这主要还是取决于美元指数的走势。18 年 4 月起，美元指数明显上扬，目前已经到达了 95 的位置。根据上轮美国加息周期的经验，我们认为后续半年美元指数仍然有上扬的空间。而且从全球实际情况来看，美国经济的强势明显好于欧洲和日本，这也有助于美元指数进一步走高。可能当 19 年下半年美国加息周期步入末期之后，美元指数才能真正出现趋势性的走弱。美元如果继续走强的话，对于基金的业绩表现也将有一定的正面影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，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。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

（1）日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，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，量化投资部根据估值委员会确定的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，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体： 华宝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： 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 155,788,236.16 | 259,704,525.50 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,001,090,381.82 | 2,617,669,074.49 |
| 其中：股票投资 | | 2,001,090,381.82 | 2,617,669,074.49 |
| 基金投资 | | - | - |
| 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 | | - | 146,886,524.72 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 9,984.81 | 13,011.82 |
| 应收股利 | | 369,526.72 | 448,057.35 |
| 应收申购款 | | 4,689,942.55 | 2,052,155.14 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,161,948,072.06 | 3,026,773,349.02 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 62,929,818.19 | 265,261,371.48 |
| 应付管理人报酬 | | 1,715,234.68 | 2,499,106.67 |
| 应付托管费 | | 480,265.71 | 699,749.89 |
| 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 | 2,142,096.94 | 2,565,011.87 |
| 负债合计 | | 67,267,415.52 | 271,025,239.91 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 2,979,314,209.61 | 4,561,785,126.66 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -884,633,553.07 | -1,806,037,017.55 |
| 所有者权益合计 | | 2,094,680,656.54 | 2,755,748,109.11 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,161,948,072.06 | 3,026,773,349.02 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.703 元，基金份额总额 2,979,314,209.61 份。其中，人民币份额净值 0.703 元，人民币份额 2,963,731,573.28 份；美元份额净值 0.1062 美元，美元份额 15,582,636.33 份。

6.2 利润表

公告主体：华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入 | | 371,722,006.67 | -729,104,389.52 |
| 1. 利息收入 | | 412,157.24 | 301,944.54 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 412,157.24 | 301,944.54 |
| 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） | | 165,134,595.36 | 14,730,326.58 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 154,183,248.98 | 1,468,945.79 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 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 | 10,951,346.38 | 13,261,380.79 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|-----------------|
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.18 | 203,620,198.58 | -738,590,126.22 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | 206,588.35 | -6,359,901.56 |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.19 | 2,348,467.14 | 813,367.14 |
| 减：二、费用 | | 16,714,802.06 | 19,688,080.98 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 11,733,727.97 | 13,905,187.59 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 3,285,443.83 | 3,893,452.50 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 905,929.28 | 985,851.59 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.21 | 789,700.98 | 903,589.30 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 355,007,204.61 | -748,792,470.50 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 355,007,204.61 | -748,792,470.50 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018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) | 4,561,785,126.66 | -1,806,037,017.55 | 2,755,748,109.11 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 355,007,204.61 | 355,007,204.61 |
| 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) | -1,582,470,917.05 | 566,396,259.87 | -1,016,074,657.18 |

| | | | |
|----------------------------------------|---------------------------------|-------------------|-------------------|
| 其中：1.基金申购款 | 884,043,689.18 | -367,897,840.43 | 516,145,848.75 |
| 2.基金赎回款 | -2,466,514,606.23 | 934,294,100.30 | -1,532,220,505.93 |
| 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） | 2,979,314,209.61 | -884,633,553.07 | 2,094,680,656.54 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 3,530,403,415.23 | -1,008,887,328.42 | 2,521,516,086.81 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | -748,792,470.50 | -748,792,470.50 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 2,157,598,125.82 | -853,149,811.58 | 1,304,448,314.24 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,241,353,483.41 | -1,251,639,463.40 | 1,989,714,020.01 |
| 2.基金赎回款 | -1,083,755,357.59 | 398,489,651.82 | -685,265,705.77 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 5,688,001,541.05 | -2,610,829,610.50 | 3,077,171,930.55 |

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

华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)(原名为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,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于2017年10月17日办理完成工商变更登记)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《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)于2017年12月30日起更名为华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)。

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《华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于:(1)标普石油天然气上游股票指数成份股、备选成份股;(2)跟踪标普石油天然气上游股票指数的公募基金、上市交易型基金等;(3)固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标普石油天然气上游股票指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的80%,投资于跟踪标普石油天然气上游股票指

数的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产净值的 10%；投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。本基金的业绩比较基准为：标普石油天然气上游股票指数(全收益指数)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及[适用于有国债、地方政府债类境内投资的 QDII 基金]金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 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，在境内暂不征收企业所得税。

(c) 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。

(d) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 155,788,236.16 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - |
| 存款期限1-3个月 | - |
| 存款期限3个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 155,788,236.16 |

注：于 2018 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 30,039,134.77 元和美元活期存款 19,005,093.46 元(折合人民币 125,749,101.39 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 | | |
|-------------------|-------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 1,671,703,382.75 | 2,001,090,381.82 | 329,386,999.07 |
| 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 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 1,671,703,382.75 | 2,001,090,381.82 | 329,386,999.07 |

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 2018年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 9,984.81 |
| 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 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 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 | 9,984.81 |

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 2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 178,342.90 |
| 预提费用 | 199,756.75 |
| 应付指数使用费 | 1,763,997.29 |
| 合计 | 2,142,096.94 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 4,561,785,126.66 | 4,561,785,126.66 |
| 本期申购 | 884,043,689.18 | 884,043,689.18 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,466,514,606.23 | -2,466,514,606.23 |
| 本期末 | 2,979,314,209.61 | 2,979,314,209.61 |

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 | 596,963,382.06 | -2,403,000,399.61 | -1,806,037,017.55 |
| 本期利润 | 151,387,006.03 | 203,620,198.58 | 355,007,204.61 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -220,133,380.19 | 786,529,640.06 | 566,396,259.87 |
| 其中：基金申购款 | 120,641,707.27 | -488,539,547.70 | -367,897,840.43 |
| 基金赎回款 | -340,775,087.46 | 1,275,069,187.76 | 934,294,100.30 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 528,217,007.90 | -1,412,850,560.97 | -884,633,553.07 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 409,789.72 |
| 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 | 2,367.52 |
| 合计 | 412,157.24 |

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,580,814,572.91 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,426,631,323.93 |
| 买卖股票差价收入 | 154,183,248.98 |

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

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 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 10,951,346.38 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 10,951,346.38 |

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 203,620,198.58 |
| ——股票投资 | 203,620,198.58 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 203,620,198.58 |

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 2,348,467.14 |
| 合计 | 2,348,467.14 |

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减；场内赎回费为固定值 0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 905,929.28 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 905,929.28 |

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 89,260.15 |
| 信息披露费 | 110,496.60 |
| 银行汇划费 | 3,257.82 |
| 指数使用费 | 586,686.41 |
| 合计 | 789,700.98 |

6.4.7.22 分部报告

无。

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 |
|-----------------------------------------------------------------|--------------------------|
| 华宝基金管理有限公司（“华宝基金”） | 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 |
| 华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.） | 基金管理人的股东 |
| 中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集 | 华宝信托的最终控制人 |

| | |
|----------------------|------------|
| 团”) | |
| 华宝证券有限责任公司(“华宝证券”) | 受宝武集团控制的公司 |
| 华宝投资有限公司(“华宝投资”) | 受宝武集团控制的公司 |
| 宝钢集团财务有限责任公司(“宝钢财务”) | 受宝武集团控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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 2018年1月1日至2018年6 月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 11,733,727.97 | 13,905,187.59 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,902,797.15 | 3,419,875.70 |

注：支付基金管理人 华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6 月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,285,443.83 | 3,893,452.50 |

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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.28%/当年天数。

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 2018年1月1日至2018年6 月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日 |
|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 期初持有的基金份额 | 6,126,140.46 | 6,126,140.46 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 6,126,140.46 | 6,126,140.46 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 0.21% | 0.11% |

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2018年6月30日 | | 上年度末 2017年12月31日 | |
|----------------------|-------------------|----------------------------------|---------------------|----------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例 | 持有的 基金份额 | 持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例 |
| 华宝 投资 有限 公司 | - | - | 5,000,000.00 | 0.1100% |

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 85,808,851.74 | 108,180.53 | 30,827,522.99 | - |
| 中国建设银行 | 69,979,384.42 | 301,609.19 | 152,468,795.32 | 297,750.76 |

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（2018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**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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、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。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并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。风险管理部在督察长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。

本基金的基金管理人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。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

于 2018 年 6 月 30 日，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%,本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内,基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则,严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易,不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度,按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性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 2018 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 | 155,788,236.16 | - | - | - | 155,788,236.16 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -2,001,090,381.82 | -2,001,090,381.82 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|-------|-------|-------------------|------------------|
| 应收利息 | - | - | - | 9,984.81 | 9,984.81 |
| 应收股利 | - | - | - | 369,526.72 | 369,526.72 |
| 应收申购款 | 225,854.00 | - | - | 4,464,088.55 | 4,689,942.55 |
| 资产总计 | 156,014,090.16 | - | - | -2,005,933,981.90 | 2,161,948,072.06 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 62,929,818.19 | 62,929,818.19 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,715,234.68 | 1,715,234.68 |
| 应付托管费 | - | - | - | 480,265.71 | 480,265.71 |
| 其他负债 | - | - | - | 2,142,096.94 | 2,142,096.94 |
| 负债总计 | - | - | - | 67,267,415.52 | 67,267,415.52 |
| 利率敏感度缺口 | 156,014,090.16 | - | - | -1,938,666,566.38 | 2,094,680,656.54 |
| 上年度末 2017 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 | 259,704,525.50 | - | - | - | 259,704,525.50 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -2,617,669,074.49 | 2,617,669,074.49 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 146,886,524.72 | 146,886,524.72 |
| 应收利息 | - | - | - | 13,011.82 | 13,011.82 |
| 应收股利 | - | - | - | 448,057.35 | 448,057.35 |
| 应收申购款 | 36,950.64 | - | - | 2,015,204.50 | 2,052,155.14 |
| 资产总计 | 259,741,476.14 | - | - | -2,767,031,872.88 | 3,026,773,349.02 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 265,261,371.48 | 265,261,371.48 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,499,106.67 | 2,499,106.67 |
| 应付托管费 | - | - | - | 699,749.89 | 699,749.89 |
| 其他负债 | - | - | - | 2,565,011.87 | 2,565,011.87 |
| 负债总计 | - | - | - | 271,025,239.91 | 271,025,239.91 |
| 利率敏感度缺口 | 259,741,476.14 | - | - | -2,496,006,632.97 | 2,755,748,109.11 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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 2018 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。（2017 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 2018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 | 125,749,101.39 | - | - | 125,749,101.39 |
| 交易性金融资产 | 2,001,090,381.82 | - | - | 2,001,090,381.82 |
| 应收股利 | 369,526.72 | - | - | 369,526.72 |
| 应收利息 | 3,544.51 | - | - | 3,544.51 |
| 应收申购款 | 21,512.02 | - | - | 21,512.02 |
| 资产合计 | 2,127,234,066.46 | - | - | 2,127,234,066.46 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付赎回款 | 318,529.41 | - | - | 318,529.41 |
| 其它负债 | 970.19 | - | - | 970.19 |
| 负债合计 | 319,499.60 | - | - | 319,499.60 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 2,126,914,566.86 | - | - | 2,126,914,566.86 |
| 项目 | 上年度末 2017年12月31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 | 154,878,084.46 | - | - | 154,878,084.46 |
| 交易性金融资产 | 2,617,669,074.49 | - | - | 2,617,669,074.49 |
| 应收股利 | 448,057.35 | - | - | 448,057.35 |
| 应收利息 | 1,167.40 | - | - | 1,167.40 |
| 应收申购款 | 1,931.25 | - | - | 1,931.25 |
| 应收证券清算款 | 146,886,524.72 | - | - | 146,886,524.72 |
| 其它资产 | - | - | - | - |
| 资产合计 | 2,919,884,839.67 | - | - | 2,919,884,839.67 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付赎回款 | 150,195.12 | - | - | 150,195.12 |
| 其它负债 | 519.27 | - | - | 519.27 |
| 负债合计 | 150,714.39 | - | - | 150,714.39 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 2,919,734,125.28 | - | - | 2,919,734,125.28 |

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（2018年6月30日） | 上年度末（2017年12月31日） |
| 1. 所有外币相对人民币升值 5% | 106,361,703.32 | 145,986,706.26 |
| 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | -106,361,703.32 | -145,986,706.26 |

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的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

| | 2018 年 6 月 30 日 | | 2017 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 | 2,001,090,381.82 | 95.53 | 2,617,669,074.49 | 94.99 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 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 | 2,001,090,381.82 | 95.53 | 2,617,669,074.49 | 94.99 |

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 (2018 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2017 年 12 月 31 日) |
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | 100,269,116.27 | 131,520,379.56 |
| 2. 业绩比较基准下降 5% | -100,269,116.27 | -131,520,379.56 | |

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 2018 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 2,001,090,381.82 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 2,617,669,074.49 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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 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。

§ 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 | 2,001,090,381.82 | 92.56 |
| | 其中: 普通股票 | 2,001,090,381.82 | 92.56 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 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 | 155,788,236.16 | 7.21 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,069,454.08 | 0.23 |
| 9 | 合计 | 2,161,948,072.06 | 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 | 2,001,090,381.82 | 95.53 |
| 合计 | 2,001,090,381.82 | 95.53 |

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|------|------------------|--------------|
| 能源 | 2,001,090,381.82 | 95.53 |
| 合计 | 2,001,090,381.82 | 95.53 |

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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 | GULFPORT ENERGY CORP | Gulfport 能源公司 | GPOR US | 纳斯达克 | 美国 | 505,286 | 42,024,971.12 | 2.01 |
| 2 | CIMAREX ENERGY CO | Cimarex 能源公司 | XEC US | 纽约 | 美国 | 60,748 | 40,893,906.36 | 1.95 |
| 3 | MATADOR RESOURCES CO | Matador 资源公司 | MTDR US | 纽约 | 美国 | 200,208 | 39,807,122.40 | 1.90 |
| 4 | DIAMONDBACK ENERGY INC | Diamondback 能源股份有限公司 | FANG US | 纳斯达克 | 美国 | 45,625 | 39,718,664.08 | 1.90 |
| 5 | ENERGEN CORP | Energen 公司 | EGN US | 纽约 | 美国 | 82,178 | 39,595,070.69 | 1.89 |
| 6 | CALIFORNIA RESOURCES CORP | 加利福尼亚资源公司 | CRC US | 纽约 | 美国 | 128,794 | 38,722,985.61 | 1.85 |
| 7 | PARSLEY ENERGY INC-CLASS A | Parsley 能源股份有限公司 | PE US | 纽约 | 美国 | 191,154 | 38,297,827.77 | 1.83 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------------|------------------------------|------------|------------------|----|-----------|---------------|------|
| 8 | APACHE CORP | 阿帕契 | APA US | 纽约 | 美国 | 123,092 | 38,075,562.15 | 1.82 |
| 9 | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 切萨皮克能源 公司 | CHK US | 纽约 | 美国 | 1,080,954 | 37,477,738.84 | 1.79 |
| 10 | ANTERO RESOURCES CORP | Antero 资源公 司 | AR US | 纽约 | 美国 | 265,005 | 37,435,774.97 | 1.79 |
| 11 | SOUTHWESTERN ENERGY CO | Southwestern 能源公司 | SWN US | 纽约 | 美国 | 1,065,449 | 37,363,144.22 | 1.78 |
| 12 | HESS CORP | 赫斯公司 | HES US | 纽约 | 美国 | 84,078 | 37,211,609.00 | 1.78 |
| 13 | RSP PERMIAN INC | RSP Permian 股 份有限公司 | RSPP US | 纽约 | 美国 | 127,561 | 37,153,765.36 | 1.77 |
| 14 | CONCHO RESOURCES INC | 康丘资源公司 | CXO US | 纽约 | 美国 | 40,531 | 37,102,345.31 | 1.77 |
| 15 | SM ENERGY CO | SM 能源公司 | SM US | 纽约 | 美国 | 217,822 | 37,025,482.45 | 1.77 |
| 16 | CENTENNIAL RESOURCE DEVELO-A | Centennial 资 源开发股份有 限公 | CDEV US | 纳 斯 达 克 | 美国 | 307,111 | 36,698,473.41 | 1.75 |
| 17 | CALLON PETROLEUM CO | Callon 石油公 司 | CPE US | 纽约 | 美国 | 512,761 | 36,437,967.81 | 1.74 |
| 18 | EOG RESOURCES INC | EOG 资源 | EOG US | 纽约 | 美国 | 44,186 | 36,378,490.13 | 1.74 |
| 19 | QEP RESOURCES INC | QEP 资源公司 | QEP US | 纽约 | 美国 | 446,684 | 36,234,789.88 | 1.73 |
| 20 | CARRIZO OIL & GAS INC | Carrizo 油气 股份有限公司 | CRZO US | 纳 斯 达 克 | 美国 | 195,539 | 36,032,423.23 | 1.72 |
| 21 | DEVON ENERGY CORP | 戴文能源 | DVN US | 纽约 | 美国 | 123,326 | 35,871,307.76 | 1.71 |
| 22 | RANGE RESOURCES CORP | Range 资源公 司 | RRC US | 纽约 | 美国 | 323,748 | 35,837,517.31 | 1.71 |
| 23 | EQT CORP | EQT 公司 | EQT US | 纽约 | 美国 | 97,880 | 35,736,378.35 | 1.71 |
| 24 | NEWFIELD EXPLORATION CO | 新田石油勘探 公司 | NFX US | 纽约 | 美国 | 178,366 | 35,700,338.39 | 1.70 |
| 25 | NOBLE ENERGY INC | Noble 能源股 份有限公司 | NBL US | 纽约 | 美国 | 152,654 | 35,634,580.10 | 1.70 |
| 26 | CNX RESOURCES CORP | CNX 资源公司 | CNX US | 纽约 | 美国 | 300,023 | 35,295,650.19 | 1.69 |
| 27 | ANADARKO PETROLEUM CORP | 阿纳达科石油 | APC US | 纽约 | 美国 | 72,820 | 35,293,374.48 | 1.68 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------|---------------------|---------|------|----|-----------|---------------|------|
| 28 | CABOT OIL & GAS CORP | 卡伯特石油天然气公司 | COG US | 纽约 | 美国 | 220,875 | 34,782,308.30 | 1.66 |
| 29 | OASIS PETROLEUM INC | 绿洲石油公司 | OAS US | 纽约 | 美国 | 404,308 | 34,696,621.74 | 1.66 |
| 30 | WPX ENERGY INC | WPX 能源股份有限公司 | WPX US | 纽约 | 美国 | 290,145 | 34,613,514.53 | 1.65 |
| 31 | CONOCOPHILLIPS | 康菲石油 | COP US | 纽约 | 美国 | 74,887 | 34,496,523.71 | 1.65 |
| 32 | MURPHY OIL CORP | 墨菲石油公司 | MUR US | 纽约 | 美国 | 154,102 | 34,432,948.77 | 1.64 |
| 33 | CHEVRON CORP | 雪佛龙 | CVX US | 纽约 | 美国 | 41,122 | 34,400,063.74 | 1.64 |
| 34 | MARATHON OIL CORP | Marathon 石油公司 | MRO US | 纽约 | 美国 | 247,708 | 34,189,221.94 | 1.63 |
| 35 | PDC ENERGY INC | PDC 能源股份有限公司 | PDCE US | 纳斯达克 | 美国 | 85,180 | 34,069,740.17 | 1.63 |
| 36 | EXXON MOBIL CORP | 埃克森美孚石油 | XOM US | 纽约 | 美国 | 62,194 | 34,044,455.63 | 1.63 |
| 37 | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 美国大陆资源股份有限公司 (俄) | CLR US | 纽约 | 美国 | 78,970 | 33,837,935.53 | 1.62 |
| 38 | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | Pioneer 自然资源公司 | PXD US | 纽约 | 美国 | 26,906 | 33,689,685.58 | 1.61 |
| 39 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 西方石油 | OXY US | 纽约 | 美国 | 60,833 | 33,681,838.29 | 1.61 |
| 40 | WHITING PETROLEUM CORP | 怀汀石油公司 | WLL US | 纽约 | 美国 | 96,428 | 33,636,704.61 | 1.61 |
| 41 | PHILLIPS 66 | Phillips 66 | PSX US | 纽约 | 美国 | 44,500 | 33,068,410.40 | 1.58 |
| 42 | DENBURY RESOURCES INC | Denbury 资源公司 | DNR US | 纽约 | 美国 | 1,026,576 | 32,671,649.68 | 1.56 |
| 43 | VALERO ENERGY CORP | Valero 能源 | VLO US | 纽约 | 美国 | 43,430 | 31,847,991.10 | 1.52 |
| 44 | LAREDO PETROLEUM INC | Laredo 石油公司 | LPI US | 纽约 | 美国 | 491,818 | 31,305,047.86 | 1.49 |
| 45 | ANDEAVOR | Andeavor | ANDV US | 纽约 | 美国 | 35,937 | 31,192,079.34 | 1.49 |
| 46 | MARATHON PETROLEUM CORP | 马拉松石油公司 | MPC US | 纽约 | 美国 | 65,823 | 30,556,396.24 | 1.46 |
| 47 | HOLLYFRONTIER CORP | HollyFrontier 公司 | HFC US | 纽约 | 美国 | 67,358 | 30,497,946.92 | 1.46 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------|-------------------------|---------|------|----|---------|---------------|------|
| 48 | DELEK US HOLDINGS INC | Delek US Holdings 有限公司 | DK US | 纽约 | 美国 | 91,716 | 30,445,568.45 | 1.45 |
| 49 | PBF ENERGY INC-CLASS A | PBF 能源股份有限公司 | PBF US | 纽约 | 美国 | 106,110 | 29,438,525.77 | 1.41 |
| 50 | SRC ENERGY INC | SRC 能源股份有限公司 | SRCI US | 纽约 | 美国 | 367,610 | 26,804,258.15 | 1.28 |
| 51 | JAGGED PEAK ENERGY INC | Jagged Peak Energy 公司 | JAG US | 纽约 | 美国 | 230,625 | 19,867,912.94 | 0.95 |
| 52 | EXTRACTION OIL & GAS INC | Extraction 石油与天然气股份有限公司 | XOG US | 纳斯达克 | 美国 | 192,271 | 18,688,328.59 | 0.89 |
| 53 | HALCON RESOURCES CORP | Halcon 资源公司 | HK US | 纽约 | 美国 | 608,565 | 17,676,910.88 | 0.84 |
| 54 | RESOLUTE ENERGY CORP | Resolute 能源公司 | REN US | 纽约 | 美国 | 82,075 | 16,943,392.28 | 0.81 |
| 55 | WILDHORSE RESOURCE DEVELOPME | WildHorse 资源开发公司 | WRD US | 纽约 | 美国 | 95,186 | 15,971,922.96 | 0.76 |
| 56 | WORLD FUEL SERVICES CORP | 全球燃料服务公司 | INT US | 纽约 | 美国 | 112,131 | 15,142,709.14 | 0.72 |
| 57 | W&T OFFSHORE INC | W&T Offshore 公司 | WTI US | 纽约 | 美国 | 304,919 | 14,425,318.45 | 0.69 |
| 58 | KOSMOS ENERGY LTD | 科斯莫斯能源有限公司 | KOS US | 纽约 | 美国 | 248,318 | 13,587,782.67 | 0.65 |
| 59 | ULTRA PETROLEUM CORP | 犹特拉石油公司 | UPL US | 纽约 | 美国 | 838,959 | 12,822,939.64 | 0.61 |
| 60 | CVR ENERGY INC | CVR 能源公司 | CVI US | 纽约 | 美国 | 47,425 | 11,607,175.51 | 0.55 |
| 61 | HIGHPOINT RESOURCES CORP | HighPoint Resources 公司 | HPR US | 纽约 | 美国 | 240,422 | 9,671,919.33 | 0.46 |
| 62 | GREEN PLAINS INC | Green Plains 股份有限公司 | GPRES | 纳斯达克 | 美国 | 71,199 | 8,621,044.05 | 0.41 |
| 63 | RING ENERGY INC | Ring 能源股份有限公司 | REI US | 纳斯达克 | 美国 | 93,116 | 7,775,324.93 | 0.37 |
| 64 | TELLURIAN INC | Tellurian 有限公司 | TELL US | 纳斯达克 | 美国 | 136,325 | 7,504,706.52 | 0.36 |

| | | | | | | | | |
|----|----------------------------------|-------------------------------|------------|-----------------------|----|---------|--------------|------|
| | | | | 克 纳 斯 达 克 | | | | |
| 65 | RENEWABLE ENERGY GROUP INC | 可再生能源集 团股份有限公 司 | REGI US | 纳 斯 达 克 | 美国 | 62,259 | 7,353,180.75 | 0.35 |
| 66 | PENN VIRGINIA CORP | Penn Virginia 公司 | PVAC US | 纳 斯 达 克 | 美国 | 11,911 | 6,690,208.29 | 0.32 |
| 67 | BONANZA CREEK ENERGY INC | Bonanza Creek 能源股份有限公 司 | BCEI US | 纽 约 | 美国 | 25,701 | 6,439,916.07 | 0.31 |
| 68 | ALTA MESA RESOURCES INC | Alta Mesa Resources 公 司 | AMR US | 纳 斯 达 克 | 美国 | 139,408 | 6,281,591.48 | 0.30 |
| 69 | TALOS ENERGY INC | Talos 能源公 司 | TALO US | 纽 约 | 美国 | 28,132 | 5,980,620.08 | 0.29 |
| 70 | SANDRIDGE ENERGY INC | SandRidge 能 源公司 | SD US | 纽 约 | 美国 | 44,694 | 5,246,113.96 | 0.25 |
| 71 | ABRAXAS PETROLEUM CORP | Abraxas 石油 有限公司 | AXAS US | 纳 斯 达 克 | 美国 | 194,808 | 3,725,113.51 | 0.18 |
| 72 | REX AMERICAN RESOURCES CORP | 雷克斯美国资 源公司 | REX US | 纽 约 | 美国 | 5,367 | 2,875,349.33 | 0.14 |
| 73 | PAR PACIFIC HOLDINGS INC | Par 太平洋控 股股份有限公 司 | PARR US | 纽 约 | 美国 | 23,504 | 2,702,877.92 | 0.13 |
| 74 | CLEAN ENERGY FUELS CORP | 清洁能源燃料 公司 | CLNE US | 纳 斯 达 克 | 美国 | 83,199 | 2,031,324.72 | 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 | ULTRA PETROLEUM CORP | UPL US | 19,529,777.35 | 0.71 |
| 2 | CALIFORNIA RESOURCES CORP | CRC US | 18,696,457.08 | 0.68 |
| 3 | CENTENNIAL RESOURCE DEVELO-A | CDEV US | 17,834,704.92 | 0.65 |
| 4 | CIMAREX ENERGY CO | XEC US | 16,465,346.76 | 0.60 |
| 5 | MURPHY OIL CORP | MTDR US | 15,943,840.19 | 0.58 |
| 6 | WILDHORSE RESOURCE DEVELOPME | WRD US | 15,592,024.83 | 0.57 |
| 7 | JAGGED PEAK ENERGY INC | JAG US | 14,286,294.00 | 0.52 |
| 8 | HALCON RESOURCES CORP | HK US | 14,218,879.36 | 0.52 |
| 9 | CARRIZO OIL & GAS INC | CRZO US | 14,153,755.14 | 0.51 |
| 10 | DELEK US HOLDINGS INC | DK US | 14,014,724.76 | 0.51 |
| 11 | W OFFSHORE INC | WTI US | 13,938,445.17 | 0.51 |
| 12 | CONCHO RESOURCES INC | CXO US | 13,898,191.33 | 0.50 |
| 13 | GULFPORT ENERGY CORP | GPOR US | 13,516,322.00 | 0.49 |
| 14 | CALLON PETROLEUM CO | CPE US | 13,097,581.75 | 0.48 |
| 15 | DIAMONDBACK ENERGY INC | FANG US | 12,968,038.46 | 0.47 |
| 16 | DENBURY RESOURCES INC | DNR US | 12,882,727.21 | 0.47 |
| 17 | CABOT OIL & GAS CORP | COG US | 12,294,720.18 | 0.45 |
| 18 | SOUTHWESTERN ENERGY CO | SWN US | 11,701,423.34 | 0.42 |
| 19 | Newfield Exploration Co | NFX US | 10,989,414.19 | 0.40 |
| 20 | Antero Resources Corp | AR US | 10,802,323.09 | 0.39 |

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 | WHITING PETROLEUM CORP | WLL US | 55,239,654.62 | 2.00 |
| 2 | CALIFORNIA RESOURCES CORP | CRC US | 49,979,661.32 | 1.81 |
| 3 | CARRIZO OIL & GAS INC | CRZO US | 46,258,100.34 | 1.68 |
| 4 | HOLLYFRONTIER CORP | HFC US | 42,632,077.81 | 1.55 |
| 5 | ANADARKO PETROLEUM CORP | APC US | 36,655,379.90 | 1.33 |
| 6 | PBF ENERGY INC-CLASS A | PBF US | 34,728,614.47 | 1.26 |
| 7 | OASIS PETROLEUM INC | OAS US | 34,416,747.23 | 1.25 |
| 8 | CHESAPEAKE ENERGY CORP | CHK US | 33,440,026.41 | 1.21 |
| 9 | PDC ENERGY INC | PDCE US | 33,264,202.76 | 1.21 |
| 10 | MARATHON OIL CORP | MRO US | 33,234,378.16 | 1.21 |
| 11 | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | CLR US | 33,090,841.28 | 1.20 |
| 12 | DELEK US HOLDINGS INC | DK US | 32,669,874.13 | 1.19 |
| 13 | WPX ENERGY INC | WPX US | 32,448,492.86 | 1.18 |
| 14 | HESS CORP | HES US | 31,957,588.52 | 1.16 |
| 15 | VALERO ENERGY CORP | VLO US | 31,421,657.04 | 1.14 |
| 16 | CONOCOPHILLIPS | COP US | 31,348,276.87 | 1.14 |
| 17 | ANDEAVOR | ANDV US | 30,806,100.77 | 1.12 |
| 18 | NOBLE ENERGY INC | NBL US | 30,595,826.19 | 1.11 |
| 19 | RSP PERMIAN INC | RSPP US | 29,891,134.16 | 1.08 |
| 20 | DIAMONDBACK ENERGY INC | FANG US | 29,652,194.26 | 1.08 |

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 | 661,967,428.91 |
| 卖出收入(成交)总额 | 1,580,814,572.91 |

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

本基金本报告期末未持有基金。

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 | 369,526.72 |
| 4 | 应收利息 | 9,984.81 |
| 5 | 应收申购款 | 4,689,942.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,069,454.08 |

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 |
| 87,600 | 34,010.44 | 399,362,905.55 | 13.40% | 2,579,951,304.06 | 86.60% |

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 | JPMORGAN CHASE BANK, NATIONAL ASSOCIATION | 13,454,176.00 | 0.88% |
| 2 | 黄宁 | 13,731,032.00 | 0.90% |
| 3 | 胡承雅 | 14,600,000.00 | 0.96% |
| 4 | 颜荣斌 | 15,351,300.00 | 1.01% |
| 5 | 周聪 | 18,956,321.00 | 1.24% |
| 6 | 工银瑞信基金公司—农行—中国农业银行离退休人员福利负债 | 22,229,700.00 | 1.46% |
| 7 | 张志秀 | 22,726,201.00 | 1.49% |
| 8 | 北京宏长泰投资管理有限公司 | 29,121,094.00 | 1.91% |
| 9 | 工银瑞信基金—工商银行—特定客户资产管理 | 83,750,891.00 | 5.50% |
| 10 | 安信证券股份有限公司 | 142,964,717.00 | 9.39% |

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 | 7,440,874.61 | 0.2498% |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|----|-------------------|
|----|-------------------|

| | |
|--------------------------------|-------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2011年9月29日）基金份额总额 | 373,243,682.40 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,561,785,126.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 884,043,689.18 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,466,514,606.23 |
| 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 | 2,979,314,209.61 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2018 年 4 月 11 日,经公司董事会审议通过,聘任李慧勇为公司副总经理。该事项经中国证券投资基金业协会备案,并在指定媒体上披露。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|-----------------------------------------------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| Nomura International (HK) Ltd | - | 973,747,302.03 | 44.52% | 389,499.46 | 44.52% | - |
| Daiwa Securities SMBC Singapore Ltd | - | 729,413,584.21 | 33.35% | 291,765.17 | 33.35% | - |
| J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited | - | 484,086,119.40 | 22.13% | 193,633.67 | 22.13% | - |

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；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期交易单元无变动。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|-------------------------------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| Nomura International (HK) Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Daiwa | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|-----------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|
| Securities SMBC Singapore Ltd | | | | | | | | |
| J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited | | | | | | | | |

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 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年1月12日 |
| 2 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年1月17日 |
| 3 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年1月17日 |
| 4 | 华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)2017年第4季度报告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年1月22日 |
| 5 | 关于华宝现金宝E货币基金转换、赎回转申购业务费率优惠公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年1月24日 |
| 6 | 华宝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 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年1月26日 |
| 7 | 关于华宝现金宝E基金定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年3月16日 |
| 8 | 华宝基金公司关于旗下部分基金增加西南证券为代销机构的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年3月19日 |
| 9 | 华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)2017年度报告(摘要) | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年3月27日 |

| | | | |
|----|---------------------------------------------------------|---------------------------|------------|
| 10 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年3月27日 |
| 11 | 华宝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 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年3月27日 |
| 12 | 华宝基金管理有限公司关于旗下基金修订基金合同有关条款的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年3月28日 |
| 13 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海万得基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年4月16日 |
| 14 | 华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)2018年第1季度报告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年4月21日 |
| 15 | 华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年5月11日 |
| 16 | 华宝基金公司关于华宝油气基金增加长城证券为代销机构的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年5月22日 |
| 17 | 华宝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 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年5月23日 |
| 18 | 华宝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 | 上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站 | 2018年6月29日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2018 年 3 月 28 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下基金修订基金合同有关条款的公告》，公司根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，对旗下部分基金基金合同有关条款进行修订并相应修订了托管协议，具体修订内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝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。

12.2 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。

12.3 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。

华宝基金管理有限公司

2018 年 8 月 24 日