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:2013年3月27日

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

【2012】年度报告摘要

§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一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2013年3月20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,安永华明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2012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
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	68,201,292.19份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012-06-08

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	tianqing1.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		上海浦东新区世纪大道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		上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郑安国	王洪章

2.4境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	One Wall Street New York,NY10286
办公地址		-	One Wall Street New York,NY10286
邮政编码		-	NY10286

2.5信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金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	2012年	2011年9月29日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	1,304,127.35	225,474.68
本期利润	1,886,500.30	-1,826,591.98
加权平均基金份额本期利润	0.0249	-0.0105
本期加权平均净值利润率	2.62%	-1.05%
本期基金份额净值增长率	-3.27%	-2.20%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	-3,662,737.24	-2,483,483.14
期末可供分配基金份额利润	-0.0537	-0.0215
期末基金资产净值	64,538,554.95	112,761,566.70
期末基金份额净值	0.946	0.978
3.1.3 累计期末指标	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	-5.40%	-2.20%

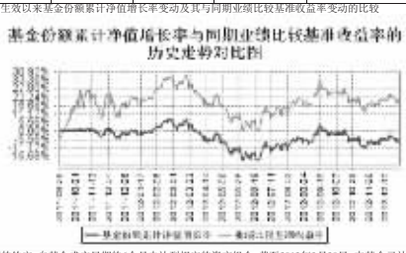
1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、净值相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。
4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 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

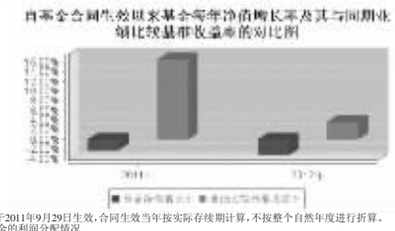
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.57%	1.29%	-3.18%	1.38%	-0.39%	-0.09%
过去六个月	5.94%	1.39%	7.55%	1.48%	-1.61%	-0.09%
过去一年	-3.27%	1.53%	3.70%	1.70%	-6.97%	-0.17%
自基金合同生效日起至今	-5.40%	1.42%	20.93%	2.11%	-26.33%	-0.69%

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



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 自基金合同生效以来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



注:本基金合同于2011年9月29日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2011年9月29日,过去两年未实施利润分配。

§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(2012年12月31日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证100基金、上证180价值ETF、上证180价值ETF联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、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、华宝恒融50基金、华宝兴业资源优选基金和华宝添益基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计37,660,892,995.57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		
尤柏年	本基金基金经理、华宝兴业成熟市场QDII基金经理	2011年9月29日	-	9年	博士,曾在澳大利亚BConnect公司Apex投资咨询团队从事投资、金融工程模型开发、资产配置、行业研究等工作。2007年6月加入本公司任金融工程部高级数量分析师,2008年8月起任海外投资部高级分析师,2009年3月至2011年3月任华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理助理兼任高级分析师,2011年3月至今任华宝兴业成熟市场QDII基金经理,2011年9月起兼任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理。
施施乐	本基金基金经理助理	2012年3月1日	2012年9月18日	9年	工商管理硕士,曾任职于法国兴业银行上海分行。2003年3月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任柔道业务发展及国际业务部总经理、内控审计风险管理部总经理,2012年2月至2012年9月任海外投资管理部高级分析师兼华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理助理。现任投资经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。
2、证券从业年限按照证券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。

由于证券的市值波动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指数基金在短期内出现过持有的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%的情况和持有的成分股及备选股市值占基金净值低于80%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、对最交易、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行业配置、个股投资比例等投资风格进行分析。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

2012年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法,确保了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。公司内部制定的公平交易制度涉及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。

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,分析了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,并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(1日、3日、5日)同向交易的相关规定,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当期损益;支付的价款中包含了应告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券起息日以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;

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量,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;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基公司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的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;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的,分别下列情况处理:放弃了该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者偿清债的金额。

本基金持有的基金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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的,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。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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括新基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益(/损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得(/损失)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确认。

未实现损益平准金于已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,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

1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损(/失)。对利息收入减项,存款利息收入以净额列示。

2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额和除应出债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

8)基金投资收益/(损失)于卖出/赎回基金成交日确认,并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账;

9)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

10)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

11)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

1)基金管理费在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提;

2)基金托管费在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.28%年费率计提;

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

4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1)本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2)收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额;

3)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的10%;

4)若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;

5)本基金收益分配方式为现金分红;

6)基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日;

7)基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

8)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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金额。

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,与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

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)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)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。

本基金目前以一个经营分部运作。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税;

2)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,在境内暂免征收营业税和企业所得税;

3)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,在境内暂未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	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
纽约梅隆银行股份有限公司	基金境外托管人
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝钢集团控制的公司
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝钢集团控制的公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月29日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	730,768.26	476,135.15
其中,支付销售机构的客户维护费	517,600.21	373,600.33

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×1.0%/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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月29日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	204,615.08	133,317.89

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.28%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.28%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

7.4.8.2.3 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未与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.2.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.2.4.1 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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月29日(基金合同生效日)至2011年12月31日
基金合同生效日(2011年9月29日)持有的基金份额	1,210,427.26	1,210,427.26
期初持有的基金份额	1,260,899.68	-
期间申购/买入总份额	446,362.35	50,472.42
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	1,707,262.03	1,260,899.68
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.50%	1.09%

注:1.基金管理人华宝兴业基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托国泰君安证券股份有限公司办理,适用费率为1.5%。

7.4.8.2.4.2 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 2012年12月31日		上年度末 2011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	0.00	0.00%	10,297,631.31	8.94%

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年9月29日(基金合同生效日)至2011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
中国建设银行股份有限公司	1,505,763.62	42,686.15	24,676,170.85	613,283.10
纽约梅隆银行股份有限公司	4,738,225.18	-	13,783,010.13	-

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

本基金本期及上年度可比期间未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(2012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。

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

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。第二层级:直接(比如有价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

7.4.10.1.2.2 各层次金融工具公允价值

于2012年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为59,121,535.34元,无属于第二层级和第三层级的余额。

7.4.10.1.2.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

7.4.10.1.2.4 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2013年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§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	59,121,535.34	90.23
	其中:普通股	59,121,535.34	90.23
	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	6,243,988.80	9.53
8	其他各项资产	154,362.86	0.24
9	合计	65,519,887.00	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	59,121,535.34	91.61
合计	59,121,535.34	91.61

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	59,121,535.34	91.61
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	59,121,535.34	91.61

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股票。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

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	CVR ENERGY INC	CVR Energy Inc	CVI US	纽约	美国	3,800	1,165,344.27	1.81
2	EQT CORP	EQT公司	EQT US	纽约	美国	2,695	999,087.14	1.55
3	PDC Energy Inc	PDC Energy Inc	PDCE US	纳斯达克	美国	4,732	987,764.57	1.53
4	OASIS PETROLEUM INC	Oasis Petroleum Inc	OAS US	纽约	美国	4,919	983,204.31	1.52
5	HESS CORP	阿美拉达赫斯	HES US	纽约	美国	2,849	948,375.35	1.47
6	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer自然资源公司	PXD US	纽约	美国	1,412	945,999.68	1.47
7	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	XOM US	纽约	美国	1,731	941,681.35	1.46
8	SOUTHWESTERN ENERGY CO	西南能源公司	SWN US	纽约	美国	4,481	941,003.52	1.46
9	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天然气公司	COG US	纽约	美国	2,976	930,418.93	1.44
10	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	CVX US	纽约	美国	1,363	926,450.14	1.44

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	QUICKSILVER RESOURCES INC	KWK US	1,668,186.55	1.48
2	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	CIE US	1,631,071.74	1.45
3	REX ENERGY CORP	REXX US	1,329,973.93	1.18
4	HALCON RESOURCES CORP	HK US	1,246,045.01	1.11
5	WPX ENERGY INC	WPX US	1,208,143.30	1.07
6	MAGNUM HUNTER RESOURCES CORP	MHR US	1,191,524.74	1.06
7	PDC ENERGY INC	PDCE US	1,168,262.24	1.04
8	COMSTOCK RESOURCES INC	CRK US	1,137,112.66	1.01
9	SANDRIDGE ENERGY INC	SD US	1,087,900.77	0.96
10	EXCO RESOURCES INC	XCO US	1,074,170.76	0.95
11	DENBURY RESOURCES INC	DNR US	1,072,689.30	0.95
12	FOREST OIL CORP	FST US	1,045,470.26	0.93
13	CLEAN ENERGY FUELS CORP	CLNE US	1,024,853.89	0.91
14	RESOLUTE ENERGY CORP	REN US	1,024,303.21	0.91
15	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	PXP US	1,005,715.99	0.89
16	DELEK US HOLDINGS INC	DK US	998,606.48	0.89
17	MURPHY OIL CORP	MUR US	992,429.80	0.88
18	SUNOCO INC	SUN US	983,605.54	0.87
19	CABOT OIL & GAS CORP	COG US	966,458.50	0.86