

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
报告送出日期：2014年10月24日

§1 重要提示
基金管理人的董事、监事、经理及其他高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担法律责任。
基金托管人和中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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。
本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金基本情况	基金名称	基金类型	运作方式	投资目标
基金简称	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)	股票型基金	上市契约型开放式(LOF)	通过“标的指数”的指数化投资策略，实现基金投资组合对标的指数的收益风险控制，力争在扣除基金管理费、托管费后的净值增长率在任何连续的三个自然年度内都不低于8%，年均收益率不低于5%（以美元资产计）。
基金经理姓名	华宝兴业基金管理有限公司基金经理			
基金代码	162411			
交易代码	162411			
基金成立日	2011年9月29日			
报告期末基金份额总额	47,460,023.03份			

本基金采取“采掘业指数”为标的指数，按照行业分类的指数构成规则构建基金投资组合，并根据标的指数成份股的权重进行配置，从而有效降低行业集中度，分散投资风险。本基金将通过定期调整和不定期调整两种方式对标的指数的成分股进行调整，从而达到跟踪指数的效果。本基金将通过定期调整和不定期调整两种方式对标的指数的成分股进行调整，从而达到跟踪指数的效果。

业绩比较基准：标普石油天然气上游股票指数(基金收益指数)

风险收益特征：本基金是一只美国原版指数基金，风险与预期收益水平较低。

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 418,564.49

2.本期利润 -9,918,065.63

3.期初平均基金份额净值 1.0223

4.期末基金份额净值 52,858,588.21

5.期末基金份额净值 1.114

注：1.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，金额为人民币元，精确到小数点后两位，余额以人民币元为单位。
2.所列基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金产生的费用，计算上期实际收益水平时予以列示。
3.基金净价的表现形式为净值增长率，其与同期业绩比较基准收益的比较：

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -15.67% 1.42% -16.12% 1.50% 0.45% -0.08%

3.22 日基合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
(2011年9月29日至2014年9月30日)

基金份额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：基金合同生效以来至2014年9月30日，本基金A类基金份额净值增长率为1.114%，同期业绩比较基准收益率为1.114%。

4.32 年度定期报告中披露的当年基金业绩表现

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 418,564.49

2.本期利润 -9,918,065.63

3.期初平均基金份额净值 1.0223

4.期末基金份额净值 52,858,588.21

5.期末基金份额净值 1.114

注：1.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，金额为人民币元，精确到小数点后两位，余额以人民币元为单位。
2.所列基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金产生的费用，计算上期实际收益水平时予以列示。
3.基金净价的表现形式为净值增长率，其与同期业绩比较基准收益的比较：

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -15.67% 1.42% -16.12% 1.50% 0.45% -0.08%

3.22 日基合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
(2011年9月29日至2014年9月30日)

基金份额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：基金合同生效以来至2014年9月30日，本基金A类基金份额净值增长率为1.114%，同期业绩比较基准收益率为1.114%。

4.32 年度定期报告中披露的当年基金业绩表现

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 373,295.21

2.本期利润 42,425.64

3.期初平均基金份额净值 0.0020

4.期末基金份额净值 18,499,367.33

5.期末基金份额净值 1.040

注：1.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，金额为人民币元，精确到小数点后两位，余额以人民币元为单位。
2.所列基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算上期实际收益水平时予以列示。
3.基金净价的表现形式为净值增长率，其与同期业绩比较基准收益的比较：

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -0.29% 0.41% -2.95% 0.29% 2.66% 0.12%

3.22 日基合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
(2011年9月29日至2014年9月30日)

基金份额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：基金合同生效以来至2014年9月30日，本基金A类基金份额净值增长率为1.040%，同期业绩比较基准收益率为1.040%。

4.32 年度定期报告中披露的当年基金业绩表现

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 373,295.21

2.本期利润 42,425.64

3.期初平均基金份额净值 0.0020

4.期末基金份额净值 18,499,367.33

5.期末基金份额净值 1.040

注：1.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，金额为人民币元，精确到小数点后两位，余额以人民币元为单位。
2.所列基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算上期实际收益水平时予以列示。
3.基金净价的表现形式为净值增长率，其与同期业绩比较基准收益的比较：

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -0.29% 0.41% -2.95% 0.29% 2.66% 0.12%

3.22 日基合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
(2011年9月29日至2014年9月30日)

基金份额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：基金合同生效以来至2014年9月30日，本基金A类基金份额净值增长率为1.040%，同期业绩比较基准收益率为1.040%。

4.32 年度定期报告中披露的当年基金业绩表现

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 373,295.21

2.本期利润 42,425.64

3.期初平均基金份额净值 0.0020

4.期末基金份额净值 18,499,367.33

5.期末基金份额净值 1.040

注：1.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，金额为人民币元，精确到小数点后两位，余额以人民币元为单位。
2.所列基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算上期实际收益水平时予以列示。
3.基金净价的表现形式为净值增长率，其与同期业绩比较基准收益的比较：

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -0.29% 0.41% -2.95% 0.29% 2.66% 0.12%

3.22 日基合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
(2011年9月29日至2014年9月30日)

基金份额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：基金合同生效以来至2014年9月30日，本基金A类基金份额净值增长率为1.040%，同期业绩比较基准收益率为1.040%。

4.32 年度定期报告中披露的当年基金业绩表现

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 373,295.21

2.本期利润 42,425.64

3.期初平均基金份额净值 0.0020

4.期末基金份额净值 18,499,367.33

5.期末基金份额净值 1.040

注：1.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，金额为人民币元，精确到小数点后两位，余额以人民币元为单位。
2.所列基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算上期实际收益水平时予以列示。
3.基金净价的表现形式为净值增长率，其与同期业绩比较基准收益的比较：

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -0.29% 0.41% -2.95% 0.29% 2.66% 0.12%

3.22 日基合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
(2011年9月29日至2014年9月30日)

基金份额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：基金合同生效以来至2014年9月30日，本基金A类基金份额净值增长率为1.040%，同期业绩比较基准收益率为1.040%。

4.32 年度定期报告中披露的当年基金业绩表现

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 373,295.21

2.本期利润 42,425.64

3.期初平均基金份额净值 0.0020

4.期末基金份额净值 18,499,367.33

5.期末基金份额净值 1.040

注：1.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，金额为人民币元，精确到小数点后两位，余额以人民币元为单位。
2.所列基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算上期实际收益水平时予以列示。
3.基金净价的表现形式为净值增长率，其与同期业绩比较基准收益的比较：

阶段 净值增长 rate ① 净值增长率标准差 ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益标准差 ④ ①-③ ②-④
过去三个月 -0.29% 0.41% -2.95% 0.29% 2.66% 0.12%

3.22 日基合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
(2011年9月29日至2014年9月30日)

基金份额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：基金合同生效以来至2014年9月30日，本基金A类基金份额净值增长率为1.040%，同期业绩比较基准收益率为1.040%。

4.32 年度定期报告中披露的当年基金业绩表现

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 373,295.21

2.本期利润 42,425.64

3.期初平均基金份额净值 0.0020

4.期末基金份额净值 18,499,367.33

5.期末基金份额净值 1.040

注：1.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，金额为人民币元，精确到小数点后两位，余额以人民币元为单位。
2.所列基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算上期实际收益水平时予以列示。
3.基金净价的表现形式为净值增长率，其与同期业绩比较基准收益的比较：

阶段 净值增长 rate ① 净值增长率标准差 ② 业绩比较基准收益 ③ 业绩比较基准收益标准差 ④ ①-③ ②-④
过去三个月 -0.29% 0.41% -2.95% 0.29% 2.66% 0.12%

3.22 日基合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
(2011年9月29日至2014年9月30日)

基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比