

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

[2015] 第二季度报告

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:2015年6月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性、及时性和公平性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同，于2015年6月17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未来的表现。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2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

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)

场内简称 华宝油气

基金代码 162411

交易简称 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6日

报告期末基金份额总额 4,036,989,432.34份

投资目标 追踪标的指数，实现基金资产的长期增值。

投资策略 本基金主要通过投资于标的指数成份股以及可能被选为成份股的股票，跟踪标的指数的表现。本基金将根据对标的指数成份股的分析，结合对宏观经济、行业政策、市场环境等的判断，对股票的配置比例进行适时调整，力求实现对标的指数的跟踪效果。本基金将定期评估和调整投资组合，以达到对标的指数的跟踪效果。

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 风险与预期收益较高的股票型基金。

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

2.1 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)

场内简称 华宝油气

基金代码 162411

交易简称 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6日

报告期末基金份额总额 4,036,989,432.34份

投资目标 追踪标的指数，实现基金资产的长期增值。

投资策略 本基金主要通过投资于标的指数成份股以及可能被选为成份股的股票，跟踪标的指数的表现。本基金将根据对标的指数成份股的分析，结合对宏观经济、行业政策、市场环境等的判断，对股票的配置比例进行适时调整，力求实现对标的指数的跟踪效果。本基金将定期评估和调整投资组合，以达到对标的指数的跟踪效果。

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 风险与预期收益较高的股票型基金。

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

2.2 报告期投资组合和海外市场托管代理人

项目 瑞士信贷投资顾问有限公司 境外投资托管人

名称 The Bank of New York Mellon Corporation

中文名 纽约梅隆银行

注册地 美国 One Wall Street New York, NY10296

办公地址 美国 One Wall Street New York, NY10296

邮政编码 美国 NY10296

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期: 2015年4月1日 - 2015年6月30日

1.本期已实现收益 97,909,901.53

2.本期利润 -134,701,102.01

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0376

4.期末基金资产净值 2,896,169,103.53

5.期末基金份额净值 0.707

注:1.本期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，即为本期利润；本期利润与本期已实现收益的差额为公允价值变动收益。

2.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。

3.基金净值表现

3.1 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2011年9月6日至2015年6月30日) 业绩比较基准变动率

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

华宝兴业