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] 年度报告摘要

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:2016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2016年3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2015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	6,626,822,168.13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

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0.496元,人民币总份额6,624,437,240.94份;本基金美元份额净值0.0762美元,美元总份额2,384,927.19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	tianqing1.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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	-374,249,408.71	-4,868,271.60	4,353,346.74
本期利润	-694,187,153.41	-25,761,293.63	8,049,098.19
加权平均基金份额本期利润	-0.1781	-0.5767	0.2093
本期加权平均净值利润率	-26.48%	-54.92%	20.16%
本期基金份额净值增长率	-34.78%	-32.23%	18.39%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	-3,344,099,436.46	-45,644,802.16	2,927,210.04
期末可供分配基金份额利润	-0.5046	-0.2406	0.1202
期末基金资产净值	3,282,722,731.67	144,036,310.57	27,274,336.27
期末基金份额净值	0.495	0.759	1.120
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	-50.50%	-24.10%	12.00%

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.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日然日(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

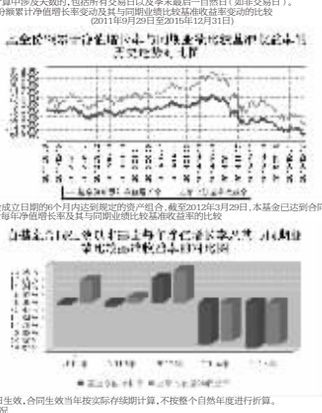
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.78%	3.76%	-5.81%	4.01%	-0.97%	-0.25%
过去六个月	-29.99%	3.28%	-30.75%	3.48%	0.76%	-0.20%
过去一年	-34.78%	2.69%	-32.14%	2.89%	-2.64%	-0.20%
过去三年	-47.67%	2.07%	-40.20%	2.21%	-7.47%	-0.14%
自基金合同生效日起至今	-50.50%	1.90%	-27.68%	2.18%	-22.82%	-0.28%

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日然日(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2015年12月31日)



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(2015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、上证180成长ETF联接基金、华宝油气基金、华宝兴业现金宝A类、华宝兴业现金宝B类基金、华宝兴业医疗保健基金、华宝兴业新经济基金、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、华宝兴业移动互联基金、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和华宝兴业转型升级基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计182,703,481,955.16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、华宝中国互联股票基金经理、华宝兴业资产管理(香港)有限公司策略研究部经理	2014年9月18日	-	9年	博士,先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、纪太平洋证券(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。目前兼任华宝兴业资产管理(香港)有限公司策略研究部经理。

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,坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的前提下,为基金份额持有人利益的最大化。

由于股、债市的系统性风险和审批额度问题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%及标普石油天然气上游股票指数成分股及其备选成分股的市值占基金资产净值比低于80%的情况。发生此类情况后,该基金应在合理期限内尽到了调整,应有的投资人异常波动风险或损失。

由于成分股调整,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不属于标普石油天然气上游股票指数成分股及其备选成分股的情况。发生此类情况后,该基金应在合理期限内尽到了调整,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。

公平交易主要通过两个渠道实现:一是在投资决策阶段,公司根据投资组合的风格、投资目标、风险收益特征等因素,为不同的投资组合配置不同的股票池,并在投资决策委员会的监督下,由投资经理在各自的股票池内进行投资决策;二是在交易执行阶段,公司采用公平的交易执行系统,对不同投资组合的交易指令进行公平的执行。

公平交易制度和控制方法还用于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。

公平交易制度和控制方法还用于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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,我司没有发生内部交易及违规交易的情况。

本报告期内,我司没有发生违反证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告的编制规则》、中国证券投资基金业协会《关于开展2015年年度报告信息披露工作的通知》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告的编制规则》》、《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》和在网站披露的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告的编制规则》》、《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》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90%,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%;投资于现金或者剩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)。本财务报表的编制基础

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金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《年度报告的编制规则》》、《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》和在网站披露的《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》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90%,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%;投资于现金或者剩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)。本财务报表的编制基础

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金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《年度报告的编制规则》》、《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》和在网站披露的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告的编制规则》