华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)2019年半年度报告（摘要）

2019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：2019年8月29日

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 2019 年 8 月 27 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

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	7,272,525,829.43 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 06 月 08 日

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 0.471 元，人民币总份额 7,252,989,532.13 份；本基金美元份额净值 0.0685 美元，美元总份额 19,536,297.30 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	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	中文	-	纽约梅隆银行
	英文	-	The Bank of New York Mellon Corporation
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。

§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(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-80,394,463.45
本期利润	92,195,024.13
加权平均基金份额本期利润	0.0205
本期加权平均净值利润率	4.14%
本期基金份额净值增长率	2.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	-3,845,109,491.79
期末可供分配基金份额利润	-0.5287
期末基金资产净值	3,427,416,337.64
期末基金份额净值	0.471
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-52.90%

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	5.61%	1.96%	6.31%	2.14%	-0.70%	-0.18%
过去三个月	-9.07%	2.02%	-9.16%	2.15%	0.09%	-0.13%
过去六个月	2.39%	2.00%	3.49%	2.11%	-1.10%	-0.11%
过去一年	-33.00%	2.02%	-33.45%	2.15%	0.45%	-0.13%
过去三年	-18.51%	1.84%	-16.01%	1.94%	-2.50%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-52.90%	1.96%	-28.13%	2.17%	-24.77%	-0.21%

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

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 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（2019 年 6 月 30 日），正在管理运作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、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、华宝银行 ETF、华宝银行 ETF 联接基金、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、华宝宝丰高等级债券基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金、华宝科技先锋基金、华宝宝裕纯债基金、华宝大健康基金、华宝中短债基金、华宝稳健 FOF 基金、华宝宝盛纯债基金、华宝宝怡纯债基金、华宝消费升级基金、华宝质量价值基金等，正在管理运作的证券投资基金资产净值合计 171,851,775,826.03 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”）、华宝标普	2014 年 9 月 18 日	-	14 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作。2005 年至 2007 年任华宝基金管理有限公司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兼华宝资产管理（香港）有限公司董事。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 月起任华宝标普

	沪港深中国增强价值指数（场内简称“价值基金”）基金经理				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 月起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 月起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 月起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 月起任华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金（LOF)基金经理，2018 年 10 月起任华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金经理。

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。

19 年上半年全球油价稳健上行后转为震荡。截止报告期，WTI 油价收至 58.20 美元一桶，相对去年年底上涨 27.1%。油价年初至四月上涨背后的主要原因在于：（1）OPEC+在 2018 年 12 月达成新的一轮减产协议；（2）伊朗禁运赦免到期后，产量和出口量迅速下降；（3）美联储在 2019 年 1 月进入货币政策边际宽松期，打开全球央行宽松空间；4）中美之间上半年贸易摩擦出现缓和迹象，市场对于经济增长产生修复预期。后续 4 月到 6 月初油价的大幅震荡，主要源于市场对于中美贸易局势的担忧的再次加剧，以及原油官方组织机构对于原油需求增长预期的不断下修。进入 6 月后，油价的反弹重启主要源于 G20 峰会中美达成共识的预期上升，OPEC+减产确认进一步延长，联储宽松趋势进一步深化，以及美国用油旺季期到来后库存数据持续超预期下行等

因素。

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 3.32%，上涨幅度低于国际油价上涨。上半年标普油气指数年化波动率为 33.2%，超过标普 500 指数日均波幅 12.6%的水平。之所以该指数相对油价明显走弱，核心原因在于远期油价并未如现货呈现出类同的向上弹性，因此对于上游石油勘探板块权益的估值形成了一定的压制。此外，油价中枢相对去年同期的下移，对于石油勘探企业形成了盈利上的向下压力，指数成分股企业年初至今同比盈利增速难言理想，增加了投资者对企业未来盈利能力的担忧。

日常操作过程中，人民币汇率方面，2019 年上半年人民币汇率呈现先升后贬走势。上半年人行中间价从 6.8632 贬值至 6.8747，相对于美元贬值 0.17%。同期，人民币交易价也相对于美元贬值 0.04%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。2019 年上半年，华宝油气基金年化跟踪误差（剔除汇率因素）约为 2.2%。

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 2.39%，同期业绩比较基准收益率为 3.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，我们对于油价依然持较为谨慎的态度。我们认为下半年原油仍将处于供需持续博弈阶段 — 综合考虑 OPEC+减产推进、中东主要国家财政平衡线、北美页岩油开采成本、全球经济增长动能、以及美国通胀敏感线等多重因素，和上半年给出区间类似，下半年我们维持布油 60 到 75 美元每桶、WTI 原油 50 到 65 美元每桶区间大幅震荡的判断，年内后续仍以捕捉波段性机会为主。

鉴于自身财政平衡线的制约以及美国关于中东政经局势需要其传统中东盟友帮助维持稳定的诉求，我们认为 OPEC+国家的减产履约率将维持于高位，叠加伊朗禁运开启后地缘政治摩擦的潜在升温，油价存在动态的托稳支撑力。全球需求和美国原油产量的潜在上升依然对于油价构成主要的下行压力。全球需求方面，主要经济体经济先行和同步指标皆仍处于下行通道，后续关注中国经济托稳政策以及美国金融条件宽松政策的有效性。美国原油产量方面，如果原油价格稳定在 60 美元以上，美国的页岩油增产概率提升，美国对于全球原油价格的控制力将显著上升。但近期我们注意到，美国页岩油钻数持续下滑，美国原油产量增长呈现出放缓趋势。鉴于 EIA 目前预计 2019-2020 年美国原油产量增长分别为 140 万桶每日和 90 万桶每日，占据同期全球原油产量增量的主要份额，美国原油产量是否可以如市场预期上升构成下半年油价最大的上行预期差。此

外，下半年布油若高于 73 美元每桶，通胀方面会构成对于美国货币政策宽松的制约，而布油若低于 60 美元每桶，高收益债利差方面会形成美国金融条件收紧的威胁，以上两点对于美国金融稳定皆会形成动摇，因此大概率为美国选举政治周期内，特朗普总统所要尽力避免的两大情景。综上，布油 60 到 75 美元每桶，大概率是一个多方可以接受的价格区间。

美股方面，宽松政策和经济下行的赛跑已经开启，实际利率下行成为宏观一条主线，目前美国国债利率曲线表明市场依然将降息视为“预防式”降息 — 宽松将有效，且将防止美国经济进入衰退。美国居民部门当下杠杆率依然较低，建议关注利率敏感板块例如地产汽车等行业景气度的潜在回升假设是否可以得到验证。美股当下动态和静态估值和经济增长动能和利率水平匹配程度良好，未出现泡沫化情况，因此我们对美股下半年走势保持谨慎乐观。对于基金追踪的标普石油天然气上游指数而言，如果远期油价表现出向上趋势，我们预计指数成分股将会表现出相比油价更强的向上弹性，但这一趋势的形成还有待观察。而从企业盈利角度分析，今年头两季度指数成分股盈利预期均已大幅度下修。我们预测下半年，尤其是四季度，考虑到去年年底的低基数，指数成分股公司同比盈利增速存在上调的可能性，因此我们认为指数下半年可能存在着一定的反弹空间。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	207,072,422.63	20,420,251.43
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	3,241,594,630.68	1,793,285,562.83
其中：股票投资	3,241,594,630.68	1,793,285,562.83
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	25,774.41	2,300.18
应收股利	721,916.44	303,803.87
应收申购款	25,009,262.08	150,876,707.59
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,474,424,006.24	1,964,888,625.90
负债和所有者权益	**本期末 2019 年 6 月 30 日**	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	23,656,329.36	9,614,779.80
应付赎回款	18,464,036.02	38,208,549.61
应付管理人报酬	2,456,012.87	1,301,741.46
应付托管费	687,683.61	364,487.59
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,743,606.74	1,559,497.19
负债合计	47,007,668.60	51,049,055.65
所有者权益：		
实收基金	7,272,525,829.43	4,159,150,546.34
未分配利润	-3,845,109,491.79	-2,245,310,976.09
所有者权益合计	3,427,416,337.64	1,913,839,570.25
负债和所有者权益总计	3,474,424,006.24	1,964,888,625.90

注： 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 7,272,525,829.43 份，其中华宝油气基金份额总额为 7,252,989,532.13 份，基金份额净值 0.471 元；华宝油气美元基金份额总额为 19,536,297.30 份，基金份额净值 0.0685 元。

6.2 利润表

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	108,125,358.83	371,722,006.67
1.利息收入	540,748.45	412,157.24
其中：存款利息收入	540,748.45	412,157.24
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）	-58,245,541.80	165,134,595.36
其中：股票投资收益	-70,670,742.55	154,183,248.98
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	12,425,200.75	10,951,346.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	172,589,487.58	203,620,198.58

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-8,093,342.57	206,588.35
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,334,007.17	2,348,467.14
减：二、费用	15,930,334.70	16,714,802.06
1．管理人报酬	10,951,577.68	11,733,727.97
2．托管费	3,066,441.77	3,285,443.83
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	1,204,271.28	905,929.28
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	708,043.97	789,700.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	92,195,024.13	355,007,204.61
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	92,195,024.13	355,007,204.61

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	4,159,150,546.34	-2,245,310,976.09	1,913,839,570.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	92,195,024.13	92,195,024.13
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）	3,113,375,283.09	-1,691,993,539.83	1,421,381,743.26
其中：1.基金申购款	5,076,016,003.64	-2,655,858,822.66	2,420,157,180.98

2.基金赎回款	-1,962,640,720.55	963,865,282.83	-998,775,437.72
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）	7,272,525,829.43	-3,845,109,491.79	3,427,416,337.64

项目	上年度可比期间 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

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	向辉	张幸骏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	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)。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 29 日已经本基金的基金管理人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《 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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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 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》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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的转让收入免征增值税，对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。

(2)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。

(3)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。

(4)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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,951,577.68	11,733,727.97
其中：支付销售机构的客户维护费	2,663,960.74	2,902,797.15

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,066,441.77	3,285,443.83

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

该基金没有销售服务费用。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2011 年 9 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	6,126,140.46	6,126,140.46
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	6,126,140.46	6,126,140.46
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0800%	0.2100%

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。

6.4.8.4.2 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

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。

6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	73,053,263.68	295,897.17	85,808,851.74	108,180.53
中国建设银行	134,019,158.95	237,870.32	69,979,384.42	301,609.19

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。

6.4.8.6 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 2019 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 3,241,594,630.68 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 1,793,285,562.83 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 2019 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(2018 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	3,241,594,630.68	93.30

	其中：普通股	3,241,594,630.68	93.30
	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	207,072,422.63	5.96
8	其他各项资产	25,756,952.93	0.74
9	合计	3,474,424,006.24	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	3,241,594,630.68	94.58
合计	3,241,594,630.68	94.58

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(%)
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	3,241,594,630.68	94.58
金融	-	-
医疗保健	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-

合计	3,241,594,630.68	94.58

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	PBF ENERGY INC-CLASS A	PBF 能源股份有限公司	PBF US	美国	美国	378,411	81,425,763.78	2.38
2	OASIS PETROLEUM INC	绿洲石油公司	OAS US	美国	美国	1,940,780	75,784,151.91	2.21
3	WHITING PETROLEUM CORP	怀汀石油公司	WLL US	美国	美国	569,166	73,091,953.94	2.13
4	CALIFORNIA RESOURCES CORP	加利福尼亚资源公司	CRC US	美国	美国	537,696	72,747,094.24	2.12
5	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC US	美国	美国	188,574	72,442,255.20	2.11
6	MATADOR RESOURCES CO	Matador 资源公司	MTDR US	美国	美国	528,132	72,179,291.32	2.11
7	HOLLYFRONTIER CORP	HollyFrontier 公司	HFC US	美国	美国	224,418	71,401,081.33	2.08
8	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	美国大陆资源股份有限公司（俄	CLR US	美国	美国	246,297	71,267,545.03	2.08

9	NOBLE ENERGY INC	Noble 能源股份有限公司	NBL US	美国	美国	458,390	70,588,979.62	2.06
10	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO US	美国	美国	117,822	69,343,321.24	2.02

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 的半年度报告正文。

7.4.2 期末积极投资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	CHESAPEAKE ENERGY CORP	CHK US	72,362,086.24	3.78
2	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	60,930,653.24	3.18
3	WHITING PETROLEUM CORP	WLL US	59,034,674.84	3.08
4	Antero Resources Corp	AR US	58,663,965.20	3.07
5	RANGE RESOURCES CORP	RRC US	58,006,990.06	3.03
6	CIMAREX ENERGY CO	XEC US	51,701,088.72	2.70
7	PBF Energy Inc	PBF US	49,026,244.95	2.56
8	OASIS PETROLEUM INC	OAS US	47,582,475.99	2.49
9	CARRIZO OIL & GAS INC	CRZO US	47,216,263.11	2.47
10	SM ENERGY CO	SM US	46,246,933.49	2.42
11	HOLLYFRONTIER CORP	HFC US	45,428,776.61	2.37
12	EQT CORP	EQT US	45,232,068.62	2.36
13	SOUTHWESTERN ENERGY CO	SWN US	45,137,760.00	2.36
14	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	45,117,486.41	2.36

15	CONCHO RESOURCES INC	CXO US	45,100,797.42	2.36
16	EOG RESOURCES INC	EOG US	44,759,140.16	2.34
17	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	CLR US	44,678,559.28	2.33
18	Delek US Holdings	DK US	44,581,598.52	2.33
19	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	44,458,208.36	2.32
20	CALIFORNIA RESOURCES CORP	CRC US	44,370,364.50	2.32
21	CENTENNIAL RESOURCE DEVELO-A	CDEV US	43,993,807.55	2.30
22	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	43,326,917.74	2.26
23	WPX Energy Inc	WPX US	43,067,203.16	2.25
24	Callon Petroleum Co	CPE US	43,022,882.84	2.25
25	MURPHY OIL CORP	MUR US	42,590,694.87	2.23
26	MARATHON OIL CORP	MRO US	42,265,122.07	2.21
27	NOBLE ENERGY INC	NBL US	42,121,711.96	2.20
28	Diamondback Energy IncCORP	FANG US	40,797,257.30	2.13
29	Parsley Energy Inc	PE US	40,538,336.48	2.12
30	DEVON ENERGY CORPORATION	DVN US	39,947,645.00	2.09
31	HESS CORP	HES US	39,345,428.76	2.06
32	CABOT OIL & GAS CORP	COG US	39,271,680.63	2.05
33	APACHE CORP	APA US	38,819,657.65	2.03
34	CONOCOPHILLIPS	COP US	38,529,955.00	2.01

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	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	54,630,812.55	1.59
2	NEWFIELD EXPLORATION CO	NFX US	42,714,290.85	1.25
3	ENCANA CORP	ECA US	37,684,650.08	1.10
4	CHESAPEAKE ENERGY CORP	CHK US	31,282,063.86	0.91

5	WILDHORSE RESOURCE DEVELOPME	WRD US	28,750,652.76	0.84
6	CVR ENERGY INC	CVI US	23,822,158.48	0.70
7	QEP RESOURCES INC	QEP US	22,450,569.25	0.66
8	Delek US Holdings	DK US	20,316,026.42	0.59
9	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	20,112,371.99	0.59
10	Laredo Petroleum Holdings In	LPI US	18,495,873.98	0.54
11	W&T OFFSHORE INC	WTI US	17,502,380.15	0.51
12	Diamondback Energy IncCORP	FANG US	17,370,852.04	0.51
13	HESS CORP	HES US	17,117,268.99	0.50
14	PDC Energy Inc	PDCE US	17,009,111.01	0.50
15	DENBURY RESOURCES INC	DNR US	15,860,677.49	0.46
16	Resolute Energy Corp	REN US	15,349,060.93	0.45
17	HALCON RESOURCES	HK US	14,878,719.41	0.43
18	CIMAREX ENERGY CO	XEC US	14,540,697.76	0.42
19	Parsley Energy Inc	PE US	14,174,263.26	0.41
20	CHEVRON CORP	CVX US	13,700,812.13	0.40

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	2,233,494,790.35
卖出收入（成交）总额	887,104,467.53

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名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名的前十名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名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	721,916.44
4	应收利息	25,774.41
5	应收申购款	25,009,262.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,756,952.93

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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§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（%）
218,795	33,238.99	229,411,110.12	3.15	7,043,114,719.31	96.85

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	尹瑛姬	32,000,000.00	0.77
2	工银瑞信基金－工商银行－特定客户资产管理	31,501,773.00	0.76
3	成都吉锐触摸技术股份有限公司	29,279,900.00	0.70
4	周聪	27,988,713.00	0.67
5	陈火那	24,731,870.00	0.59
6	胡承雅	22,696,708.00	0.55
7	DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	17,967,970.00	0.43
8	杨文斌	12,985,100.00	0.31
9	林燕坤	11,332,579.00	0.27
10	颜荣斌	11,312,200.00	0.27

注:上述持有人均为场内。

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	5,761,927.38	0.0792

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	373,243,682.43
本报告期期初基金份额总额	4,159,150,546.34
本报告期基金总申购份额	5,076,016,003.64
减：本报告期基金总赎回份额	1,962,640,720.55
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	7,272,525,829.43

§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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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	
J.P.Morgan Securities (Asia	-	1,265,413,028	42.46%	506,165.	42.46%	-

Pacific) Limited		.16	%	02	%	
Daiwa Securities SWBC Singapore Ltd	-	991,786,199.28	33.28% %	396,713.75	33.28% %	-
Nomura International (HK) Ltd	-	723,328,963.20	24.27% %	289,331.96	24.27% %	-
Goldman Sachs NY LLC	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

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: 资力雄厚，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	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

				例				
J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Securities SWBC Singapore Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs NY LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

华宝基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日