

# 华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）2013 年年度报告

2013 年 12 月 31 日

基金管理人：华宸未来基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2014 年 3 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 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。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	51
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51

8.9 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证投资明细 .....	51
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	54
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
11.2 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 .....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 其他重大事件 .....	56
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
13.1 备查文件目录 .....	58
13.2 存放地点 .....	59
13.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF)
基金简称	华宸 300
基金主代码	167901
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2013 年 4 月 26 日
基金管理人	华宸未来基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	40,457,169.79 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	2013-06-03

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以“指数化投资为主、积极增强投资为辅”，在复制沪深 300 指数的基础上，结合深入的基本面研究及数量化投资技术对投资组合进行适度优化调整，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 * 95% + 银行活期存款利率 (税后) * 5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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		华宸未来基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰飞燕	朱义明
	联系电话	021-26066803	010-65556899

	电子邮箱	lanfy@hcmirae fund.com	zhuyiming@citicbank.com
客户服务电话		4009200699	95558
传真		021-65870287	010-65550832
注册地址		上海市虹口区四川北路 859 号中信广场 16 楼	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
办公地址		上海市虹口区四川北路 859 号中信广场 16 楼	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
邮政编码		200085	100027
法定代表人		刘晓兵	常振明

## 2.4 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》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hcmirae.com">http://www.hcmirae.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区南京东路 61 号四楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	2013 年 4 月 26 日 (基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日	2012 年	2011 年
本期已实现收益	-2,387,220.46	-	-
本期利润	-3,240,360.91	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0402	-	-
本期加权平均净值利润率	-4.13%	-	-
本期基金份额净值增长率	-7.50%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	-3,015,889.76	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0745	-	-
期末基金资产净值	37,441,280.03	-	-

期末基金份额净值	0.925	-	-
3.1.3 累计期末指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	-7.50%	-	-

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、本基金成立于 2013 年 4 月 26 日，自基金合同生效日至本报告期末不满一年度。

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、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

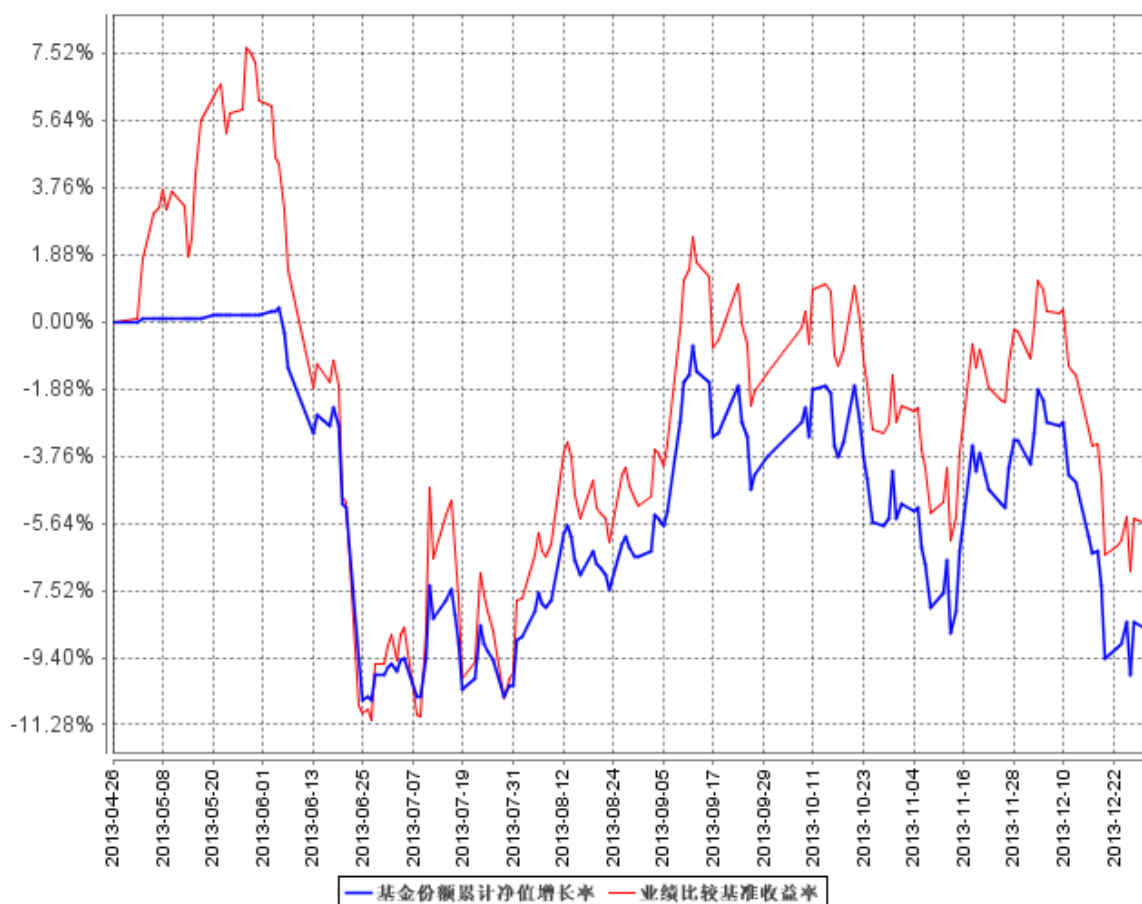
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.85%	1.04%	-3.10%	1.07%	-0.75%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-7.50%	0.94%	-5.23%	1.29%	-2.27%	-0.35%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

### 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

基金份额累计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

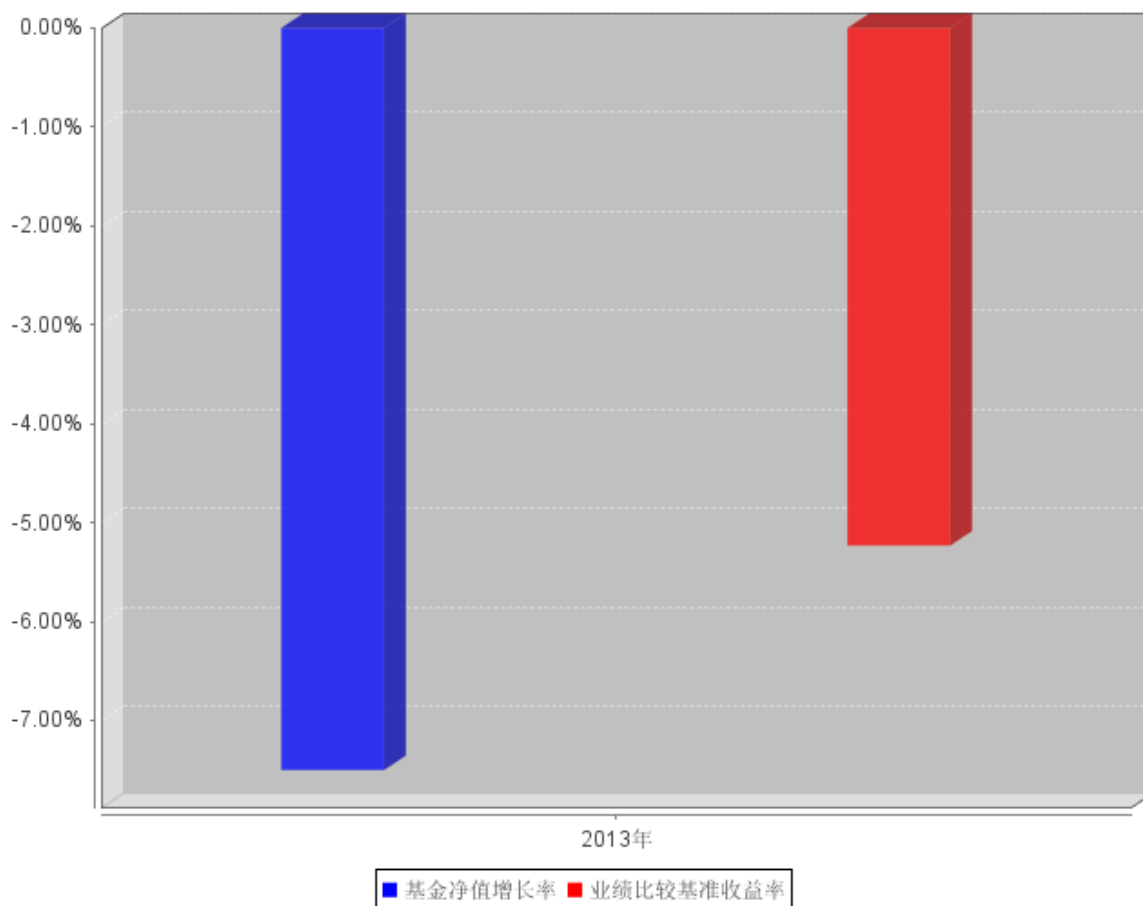


注：本基金成立于 2013 年 4 月 26 日，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。图示时间段为 2013 年 4 月 26 日至 2013 年 12 月 31 日。本基金自基金合同生效日至本报告期末不满一年。



### 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

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对比图



注：本基金基金合同生效日为 2013 年 4 月 26 日，图示时间段为 2013 年 4 月 26 日至 2013 年 12 月 31 日。合同生效当年按实际存续期计算，不按照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

注：本基金本报告期内未发生利润分配。

## § 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

华宸未来基金管理有限公司是经证监许可[2012]370 号文批准于 2012 年 6 月 20 日成立。截至本报告期末，公司股东由华宸信托有限责任公司、韩国未来资产管理公司、咸阳长涛电子科技有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司注册资本 2 亿元人民币。公司秉承“规范创造价值，创新推动成长”的经营理念，贯彻投资人利益优先原则，树立长期价值投资理念，专心致力于

细分市场的经营战略，从公司品牌、运行机制、企业文化和团队建设等方面构筑公司核心竞争力，努力做到“沉得下来不浮躁，专得下去不浮浅”，将公司改造成为受尊重的资产管理人。

截至本报告期末，本基金管理人共管理 2 只开放式基金：分别为华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）和华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金。

#### 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		
王宇	本基金基金经理	2013 年 4 月 26 日	-	14	毕业于美国加州州立大学获金融学硕士学位，FRM，十四年证券投资基金工作经历，现任华宸未来基金管理公司金融工程部总监，历任美国加州美国运通投资顾问公司（American Express Financial Advisors, Inc）分析师，鹏华基金管理有限公司研究部研究员，招商基金管理有限公司基金管理部高级研究员，泰达宏利基金管理有限公司产品及金融工程部总经理等职。
申蕾	本基金基金经理	2013 年 10 月 24 日	-	8	上海财经大学经济学硕士，CFA，具有基金从业资格，通过期货从业资格考试。历任广发银行上海分行统计分析师、贸易融资产品经理；上海金历投资公司高级研究员；光大保德信基金高级研究员、基金经理助理、专户理财部投资经理；大成基金委托投资部投资经理；2012 年 11 月加入华宸未来基金，历任专户理财部负责人、华宸未来沪深 300 基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会关于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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金

招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易控制机制，确保管理的不同受托资产得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，本基金管理人建立了科学的研究方法以及规范的研究管理平台，实行证券备选库和交易对手备选库制度，各受托资产之间实行防火墙制度，通过系统的投资决策方法和明确的投资授权制度，保证受托投资决策的客观性和独立性。

在交易执行方面，本基金管理人实行集中交易制度，并建立了公平的交易分配流程，保证投资指令得以公平对待。对以本基金管理人的名义参与债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易的，相关基金经理或投资经理应独立确定各受托资产拟申购的价格和数量，基金管理人在获配额度后，按照价格优先、比例分配的原则进行分配。对以各受托资产名义参与银行间交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的，交易部应充分询价，利用市场公认的第三方信息对交易价格的公允性进行审查，确保各受托资产获得公平的交易机会。

风险管理部对投资交易行为进行定期或不定期检查，重点关注公平交易的执行情况和异常交易行为的监控情况。严禁同一受托资产的同日反向交易及其他可能导致不公平或利益输送的交易行为，但完全按照有关指数构成比例进行证券投资的受托资产除外。严格控制不同受托资产间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易或利益输送的同日反向交易行为。风险管理部门对不同受托资产，尤其是同一位基金经理或投资经理管理的不同受托资产同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同受托资产临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。发现异常交易情况的，可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。风险管理部门对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同受托资产买卖该异常交易证券的情况进行分析。发现异常交易情况的，可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。风险管理部门编制定期公平交易报告，重点分析本基金管理人管理的不同受托资产整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及同一期间、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）不同受托资产同向交易的交易价差。公平交易报告由基金经理或投资经理确认后报督察长、总经理审阅。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在参与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% 的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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

2013 年的中国股市，可谓“冰火两重天”，结构性特征明显。涨幅最高的创业板指数，在 IPO 暂停、成长股供需失衡以及海外市场风险偏好等多种因素的影响下，演绎出典型的牛市行情，全年指数涨幅高达 82.73%。而主板市场全年萎靡不振，除了年初在资金面较为宽松，以及政策红利预期的背景下，延续 2012 年底的涨势。“两会”之后随即开始震荡走低，尤其是 6 月底开始的“钱荒”，在下半年几乎成为一种常态，市场利率始终处于相对高位，季末年初也愈演愈烈。全年，上证指数和沪深 300 指数跌幅分别为 6.75% 和 7.65%，与创业板指数形成强烈反差。

本基金于 2013 年 4 月 26 日成立，建仓期过后，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，积极研究并进行成分股的调整工作，保证基金与指数波动的一致性。同时，作为增强型被动投资的产品，本基金将继续坚持既定的投资策略，在控制跟踪误差的基础上，追求适度的超额收益，为投资者分享中国证券市场长期的增长提供良好的工具型产品。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.925 元，本报告期份额净值增长率为-7.5%，同期沪深 300 指数增长率为-5.59%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对于十八届三中全会后全面深化改革所带来的中期影响，相对乐观。但短期来看，影响 A 股市场波动的因素还有很多，我们对短期市场保持相对谨慎的态度。

一方面，资金面持续偏紧，同时暂停一年半的新股 IPO 重新开闸，股票供给大幅增加，市场整体估值承压。另一方面，从海外市场来看，利率市场化过程中，市场利率大部分都是先升后降的。预计只有在后期市场利率出现下降后，股市的估值才能得到持续提升。海外方面，美国 QE 的逐步退出在 2014 年已经成为确定性事件，预计资金也会逐步从新兴市场流出，对 A 股市场也

会有一定的冲击。另外，2014 年是全面推进改革的第一年，可能带来的短期阵痛，也使得 2014 年的经济增长存在较大的不确定性。

在对整体市场偏谨慎的背景下，我们相对看好大众消费、医疗保健以及具有长期成长性的 TMT 行业相关个股。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员在督察长的领导下，按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司董事会、总经理和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

##### (1) 梳理规章制度，完善内控体系

根据行业法律法规的变化以及公司内部部门结构调整等情况，本报告期内公司共制定和修订了二十四项制度规章，此外，由监察稽核部牵头，对涉及公司层面及具体业务部门层面的所有制度及流程进行了持续梳理，并根据实际运作情况进行修订和完善。这些制度的修订和完善对确保公司各项业务顺利、规范地进行起到了很好的促进作用。

##### (2) 发挥内部审计作用，改进内控流程

通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改。

##### (3) 开展合规培训，强化员工意识

监察稽核部及时将新颁布的法律法规传递给各相关部门，并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过邀请外部律所及利用基金业协会、上海基金同业公会等业内组织提供的培训交流机会对公司员工进行合规培训。

##### (4) 审查文件材料，确保合法合规

稽核监察部审查新产品申报材料、法定信息披露文件、基金募集和持续营销的宣传推介材料、各类新闻通稿、媒体采访稿以及各类合同协议，确保上述文件、材料内容的合法合规、真实完整。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续以风

险控制为核心，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规、安全运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括运营部以及投资部、研究部、监察稽核部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配。

## § 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

自 2013 年 4 月 26 日华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）（以下称“华宸基金”或“本基金”）成立以来，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——华宸未来基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由华宸基金管理人——华宸未来基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字（2014）第 130260 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表和 2013 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人华宸未来基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计</p>

	意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	高 飞	陈道瑾
会计师事务所的名称	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号四楼	
审计报告日期	2014 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,389,962.24	-
结算备付金		65,544.43	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	35,281,271.25	-
其中：股票投资		35,281,271.25	-
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	590.83	-
应收股利		-	-
应收申购款		592.88	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		37,737,961.63	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>



		2013 年 12 月 31 日	2012 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,389.44	-
应付托管费		4,948.02	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	20,344.14	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	245,000.00	-
负债合计		296,681.60	-
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	40,457,169.79	-
未分配利润	7.4.7.10	-3,015,889.76	-
所有者权益合计		37,441,280.03	-
负债和所有者权益总计		37,737,961.63	-

## 7.2 利润表

会计主体：华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 4 月 26 日(基金 合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-2,115,625.59	-
1.利息收入		1,131,133.80	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	621,296.60	-
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		509,837.20	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,273,009.96	-

其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,722,645.07	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	449,635.11	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-853,140.45	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	879,391.02	-
<b>减：二、费用</b>		<b>1,124,735.32</b>	<b>-</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	435,509.33	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	81,658.08	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	138,659.51	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	468,908.40	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-3,240,360.91</b>	<b>-</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-3,240,360.91</b>	<b>-</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 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）	272,952,491.85	-	272,952,491.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,240,360.91	-3,240,360.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-232,495,322.06	224,471.15	-232,270,850.91

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	1,355,185.58	-85,975.69	1,269,209.89
2.基金赎回款	-233,850,507.64	310,446.84	-233,540,060.80
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）	40,457,169.79	-3,015,889.76	37,441,280.03
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
阙水深

\_\_\_\_\_  
阙水深

\_\_\_\_\_  
王松三

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系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[2013]49 号文的核准，由基金管理人华

宸未来基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2013 年 4 月 26 日正式生效，首次设立募集规模为 272,952,491.85 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股、备选成份股、非成份股票、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金所持有的有价证券市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金投资业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年全年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本报告会计报表实际编制期间为 2013 年 4 月 26 日至 2013 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

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应确认为投资收益，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；

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）；本基金已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：放弃了对该金融资产控制的，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；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 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债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃

市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

## 1) 股票投资

### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

### C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

## 2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘净价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

### 3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

### 4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

### 5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

## 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。

未实现损益平准金与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，列入利息收入减项，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扣除应由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；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证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)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；

(9)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；

(10)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) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购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；
- (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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 90%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户的基金份额只能采取现金红利方式，不能选择红利再投资，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

3、基金收益分配后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。

- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 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

本基金本报告期内无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### (2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### (3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，

按照财税[2005]102 号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按 50% 计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自 2008 年 10 月 9 日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2013 年 1 月 1 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25% 计入应纳税所得额。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	2,389,962.24	-
定期存款	-	-
其中:存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计:	2,389,962.24	-

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	36,134,411.70	35,281,271.25	-853,140.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	36,134,411.70	35,281,271.25	-853,140.45
项目	上年度末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额均为零。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因买断式逆回购交易取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	558.36	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	32.45	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.02	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	590.83	-

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	20,344.14	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	20,344.14	-

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	245,000.00	-
合计	245,000.00	-

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	272,952,491.85	272,952,491.85
本期申购	1,355,185.58	1,355,185.58
本期赎回(以“-”号填列)	-233,850,507.64	-233,850,507.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	40,457,169.79	40,457,169.79

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,387,220.46	-853,140.45	-3,240,360.91
本期基金份额交易产生的变动数	-78,956.72	303,427.87	224,471.15
其中：基金申购款	-72,803.17	-13,172.52	-85,975.69
基金赎回款	-6,153.55	316,600.39	310,446.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,466,177.18	-549,712.58	-3,015,889.76

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	73,255.32	-
定期存款利息收入	541,251.67	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,491.02	-
其他	298.59	-
合计	621,296.60	-

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	39,754,645.04	-
减：卖出股票成本总额	43,477,290.11	-
买卖股票差价收入	-3,722,645.07	-

#### 7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内未投资债券。

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内未投资资产支持证券。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内未投资衍生工具。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	449,635.11	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	449,635.11	-

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-853,140.45	-
——股票投资	-853,140.45	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-853,140.45	-

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	879,391.02	-
合计	879,391.02	-

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	138,659.51	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	138,659.51	-

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
审计费用	35,000.00	-
信息披露费	320,000.00	-
指数使用费	105,307.89	-
银行汇划费用	7,700.51	-
开户费	900.00	-
合计	468,908.40	-

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告期末，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宸未来基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金代销机构
韩国未来资产基金管理公司	基金管理人的股东
华宸信托有限责任公司	基金管理人的股东
咸阳长涛电子科技有限公司	基金管理人的股东
深圳华宸未来资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同自 2013 年 4 月 26 日起生效，无上年度可比期间。

#### 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同自 2013 年 4 月 26 日起生效，无上年度可比期间。

#### 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金合同自 2013 年 4 月 26 日起生效，无上年度可比期间。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同自 2013 年 4 月 26 日起生效，无上年度可比期间。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。本基金合同自 2013 年 4 月 26 日起生效，无上年度可比期间。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	435,509.33	-
其中：支付销售机构的客户维护费	80,283.69	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.8% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.8%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	81,658.08	-

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行的银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2013 年 4 月 26 日）持有的基金份额	10,001,250.00	-
期初持有的基金份额	10,001,250.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
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	10,001,250.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.72%	-

注：1、期间申购/买入总份额含转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

##### 7.4.10.4.2 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

注：本基金本报告期内未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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
中信银行	2,389,962.24	614,506.99	-	-

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销证券。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未发生利润分配。

### 7.4.12 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
000625	长安汽车	-	临时停牌	11.45	2014 年 1 月 3 日	11.55	13,635	137,020.23	156,120.75	-
601901	方正证券	-	临时停牌	5.91	2014 年 1 月 13 日	6.01	19,355	128,778.99	114,388.05	-
600547	山东黄金	-	临时停牌	17.25	2014 年 1 月 2 日	18.05	4,532	98,007.74	78,177.00	-
000562	宏源证券	-	临时停牌	8.22	-	-	8,800	72,928.00	72,336.00	-
600058	五矿发展	-	临时停牌	13.56	2014 年 1 月 6 日	14.92	1,776	25,570.48	24,082.56	-

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理，对公司建立风险管理体系和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，协助董事会进行风险管理，风险管理委员会负责起草公司风险管理战略，审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。经理层负责落实董事会拟定的风险管理政策，并对风险控制的有效执行承担责任。经理层下设风险控制委员会，协助经理层进行风险控制，风险控制委员会负责组织风险管理体系的建设，确定风险管理原则、目标和方法，审议风险管理制度和流程，指导重大风险事件的处理。督察长负责监督检查公司风险管理工作的执行情况，评价公司内部风险控制制度的合法性、合规性和有效性，并向董事会报告。公司各部门是风险控制措施的执行部门，负责识别和控制业务活动中潜在风险，做好风险的事先防范与控制，作为一线责任人将风险控制在最小范围内。同时，公司设立监察稽核部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控与分析，并向经理层汇报。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持有的金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自基金份额持有人随时可以赎回其持有的份额，另一方面来自于投资品种所处的市场交易不活跃所带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此本期末本基金持有的证券均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、部分应收申购款及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月 以内	3 个月-1 年	6 个月-1 年	1 年以 内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	2,389,962.24	-	-	-	-	-	-	-	-	2,389,962.24
结算备付金	65,544.43	-	-	-	-	-	-	-	-	65,544.43
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	35,281,271.25	35,281,271.25
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	590.83	590.83
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	592.88	592.88
资产总计	2,455,506.67	-	-	-	-	-	-	-	35,282,454.96	37,737,961.63

负债										
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	26,389.44	26,389.44
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	4,948.02	4,948.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	20,344.14	20,344.14
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	245,000.00	245,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	296,681.60	296,681.60
利率敏感度缺口	2,455,506.67	-	-	-	-	-	-	-	-34,985,773.36	37,441,280.03
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月 以内	3 个月-1 年	6 个月-1 年	1 年以 内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
负债										

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 1 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采用的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2013 年 12 月 31 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	基准点利率增加 1 个基点	0.00	-
基准点利率减少 1 个基点	0.00	-	

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格

风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	35,281,271.25	94.23	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	35,281,271.25	94.23	-	-

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金所投资证券的贝塔系数紧密相关； 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2013 年 12 月 31 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准减少 1%	-345,803.66	-
	业绩比较基准增加 1%	345,803.66	-

注：1、本基金管理人运用资本-资产定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响；

2、本期末时间为 2013 年 12 月 31 日；

3、资产负债表日基金资产净值的影响金额单位为人民币元。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。



## § 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	35,281,271.25	93.49
	其中：股票	35,281,271.25	93.49
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	2,455,506.67	6.51
7	其他各项资产	1,183.71	0.00
8	合计	37,737,961.63	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	276,207.28	0.74
B	采矿业	2,078,352.69	5.55
C	制造业	12,908,865.94	34.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,084,212.45	2.90
E	建筑业	1,135,080.62	3.03
F	批发和零售业	1,107,190.14	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	745,751.22	1.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,090,026.70	2.91
J	金融业	12,012,875.50	32.08
K	房地产业	1,508,516.07	4.03

L	租赁和商务服务业	241,421.08	0.64
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	293,851.44	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	162,935.11	0.44
S	综合	338,985.01	0.91
	合计	34,984,271.25	93.44

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	297,000.00	0.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	297,000.00	0.79

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	118,883	1,294,635.87	3.46
2	600016	民生银行	158,313	1,222,176.36	3.26
3	601318	中国平安	28,552	1,191,474.96	3.18
4	601166	兴业银行	83,299	844,651.86	2.26
5	600000	浦发银行	81,417	767,762.31	2.05
6	600837	海通证券	62,549	708,054.68	1.89
7	600030	中信证券	51,987	662,834.25	1.77
8	000651	格力电器	19,071	622,858.86	1.66
9	000002	万科A	63,354	508,732.62	1.36
10	601601	中国太保	26,303	487,394.59	1.30
11	000001	平安银行	36,599	448,337.75	1.20
12	600887	伊利股份	10,897	425,854.76	1.14
13	601398	工商银行	113,446	406,136.68	1.08
14	601328	交通银行	97,703	375,179.52	1.00
15	601288	农业银行	149,465	370,673.20	0.99
16	600519	贵州茅台	2,835	363,957.30	0.97
17	601088	中国神华	22,687	358,908.34	0.96
18	600104	上汽集团	24,034	339,840.76	0.91
19	601668	中国建筑	97,180	305,145.20	0.81
20	601006	大秦铁路	37,908	280,140.12	0.75
21	601818	光大银行	104,029	276,717.14	0.74
22	002024	苏宁云商	30,595	276,272.85	0.74
23	601939	建设银行	65,254	270,151.56	0.72
24	601989	中国重工	47,893	268,679.73	0.72
25	600015	华夏银行	30,492	261,316.44	0.70
26	000776	广发证券	20,736	258,785.28	0.69
27	000538	云南白药	2,537	258,748.63	0.69
28	601169	北京银行	33,997	255,317.47	0.68
29	000333	美的集团	4,999	249,950.00	0.67

30	000876	新希望	16,503	236,487.99	0.63
31	600585	海螺水泥	13,796	233,980.16	0.62
32	600900	长江电力	36,927	233,378.64	0.62
33	600690	青岛海尔	11,967	233,356.50	0.62
34	600048	保利地产	27,745	228,896.25	0.61
35	600111	包钢稀土	9,941	221,386.07	0.59
36	600089	特变电工	20,295	217,562.40	0.58
37	600999	招商证券	17,056	216,270.08	0.58
38	600518	康美药业	11,499	206,982.00	0.55
39	600406	国电南瑞	13,718	203,986.66	0.54
40	000063	中兴通讯	15,444	201,853.08	0.54
41	000895	双汇发展	4,286	201,784.88	0.54
42	600535	天士力	4,687	201,025.43	0.54
43	600276	恒瑞医药	5,121	194,495.58	0.52
44	000858	五粮液	12,182	190,770.12	0.51
45	600383	金地集团	28,427	189,892.36	0.51
46	600256	广汇能源	20,984	183,400.16	0.49
47	002241	歌尔声学	5,139	180,276.12	0.48
48	601857	中国石油	23,129	178,324.59	0.48
49	600196	复星医药	8,924	174,821.16	0.47
50	601628	中国人寿	11,527	174,403.51	0.47
51	600050	中国联通	54,281	174,242.01	0.47
52	601766	中国南车	34,523	172,960.23	0.46
53	601688	华泰证券	19,235	172,345.60	0.46
54	600637	百视通	4,644	171,688.68	0.46
55	600739	辽宁成大	9,697	170,085.38	0.45
56	600028	中国石化	37,299	167,099.52	0.45
57	002230	科大讯飞	3,420	163,647.00	0.44
58	600011	华能国际	31,335	158,555.10	0.42
59	600804	鹏博士	11,139	156,614.34	0.42
60	000625	长安汽车	13,635	156,120.75	0.42
61	600795	国电电力	64,745	152,150.75	0.41
62	601299	中国北车	30,202	148,593.84	0.40
63	600315	上海家化	3,486	147,213.78	0.39
64	002236	大华股份	3,565	145,737.20	0.39
65	000157	中联重科	26,425	144,016.25	0.38
66	600309	万华化学	6,933	143,513.10	0.38
67	002415	海康威视	6,138	141,051.24	0.38
68	000423	东阿阿胶	3,540	140,042.40	0.37

69	002353	杰瑞股份	1,744	138,421.28	0.37
70	601633	长城汽车	3,228	132,896.76	0.35
71	000100	TCL 集	56,466	131,565.78	0.35
72	600031	三一重工	19,568	125,626.56	0.34
73	000581	威孚高科	4,063	125,140.40	0.33
74	000069	华侨城 A	23,574	124,942.20	0.33
75	600019	宝钢股份	30,440	124,499.60	0.33
76	600703	三安光电	4,926	122,115.54	0.33
77	002594	比亚迪	3,235	121,894.80	0.33
78	600832	东方明珠	12,252	119,702.04	0.32
79	000783	长江证券	11,285	117,364.00	0.31
80	601899	紫金矿业	50,730	117,186.30	0.31
81	000338	潍柴动力	6,078	115,482.00	0.31
82	601009	南京银行	14,213	114,983.17	0.31
83	601901	方正证券	19,355	114,388.05	0.31
84	600332	白云山	4,054	112,133.64	0.30
85	600600	青岛啤酒	2,213	108,326.35	0.29
86	000725	京东方 A	49,381	106,169.15	0.28
87	000768	中航飞机	11,033	105,254.82	0.28
88	600100	同方股份	10,326	105,015.42	0.28
89	600066	宇通客车	5,930	104,130.80	0.28
90	601377	兴业证券	10,855	102,688.30	0.27
91	601336	新华保险	4,479	102,479.52	0.27
92	601988	中国银行	38,966	102,090.92	0.27
93	600150	中国船舶	4,188	101,307.72	0.27
94	601607	上海医药	6,650	98,353.50	0.26
95	601117	中国化学	12,265	98,120.00	0.26
96	600085	同仁堂	4,505	96,407.00	0.26
97	000039	中集集团	6,476	96,233.36	0.26
98	600352	浙江龙盛	7,218	95,421.96	0.25
99	600583	海油工程	12,153	94,307.28	0.25
100	002570	贝因美	3,055	93,788.50	0.25
101	002081	金螳螂	4,213	92,601.74	0.25
102	002142	宁波银行	10,009	92,383.07	0.25
103	002038	双鹭药业	1,825	92,253.75	0.25
104	601808	中海油服	4,118	91,913.76	0.25
105	601186	中国铁建	19,592	91,886.48	0.25
106	000024	招商地产	4,421	91,868.38	0.25
107	600010	包钢股份	21,250	91,587.50	0.24

108	600649	城投控股	10,991	91,555.03	0.24
109	600886	国投电力	23,196	91,160.28	0.24
110	000568	泸州老窖	4,517	90,972.38	0.24
111	002385	大北农	5,517	90,202.95	0.24
112	601991	大唐发电	20,901	88,620.24	0.24
113	600118	中国卫星	4,777	88,517.81	0.24
114	601390	中国中铁	32,904	88,182.72	0.24
115	600009	上海机场	6,150	88,068.00	0.24
116	002304	洋河股份	2,129	86,905.78	0.23
117	002450	康得新	3,565	86,629.50	0.23
118	000623	吉林敖东	4,789	85,052.64	0.23
119	002202	金风科技	9,946	83,844.78	0.22
120	600108	亚盛集团	10,414	83,624.42	0.22
121	000970	中科三环	6,507	83,549.88	0.22
122	600893	航空动力	4,351	83,234.63	0.22
123	000009	中国宝安	8,692	82,139.40	0.22
124	000402	金融街	15,522	81,180.06	0.22
125	600489	中金黄金	9,454	80,831.70	0.22
126	600252	中恒集团	5,865	79,998.60	0.21
127	600369	西南证券	8,042	79,857.06	0.21
128	600674	川投能源	7,097	79,202.52	0.21
129	600547	山东黄金	4,532	78,177.00	0.21
130	002422	科伦药业	1,668	76,544.52	0.20
131	601669	中国水电	24,744	75,964.08	0.20
132	600362	江西铜业	5,353	75,905.54	0.20
133	600660	福耀玻璃	9,136	75,737.44	0.20
134	600271	航天信息	3,685	74,326.45	0.20
135	000729	燕京啤酒	9,150	74,115.00	0.20
136	600839	四川长虹	24,250	73,720.00	0.20
137	000012	南玻 A	8,967	72,991.38	0.19
138	000562	宏源证券	8,800	72,336.00	0.19
139	601118	海南橡胶	9,733	72,316.19	0.19
140	601998	中信银行	18,608	72,012.96	0.19
141	000983	西山煤电	10,139	71,986.90	0.19
142	600827	友谊股份	7,262	71,675.94	0.19
143	600718	东软集团	5,840	71,656.80	0.19
144	600741	华域汽车	7,058	71,568.12	0.19
145	601555	东吴证券	8,262	71,053.20	0.19
146	600642	申能股份	15,307	69,646.85	0.19

147	600340	华夏幸福	3,436	69,510.28	0.19
148	000792	盐湖股份	4,138	69,228.74	0.18
149	000963	华东医药	1,497	68,862.00	0.18
150	600372	中航电子	2,873	68,549.78	0.18
151	600153	建发股份	9,580	68,497.00	0.18
152	000728	国元证券	6,663	67,962.60	0.18
153	600177	雅戈尔	9,006	67,545.00	0.18
154	600655	豫园商城	8,613	66,836.88	0.18
155	000800	一汽轿车	5,610	66,759.00	0.18
156	601888	中国国旅	1,886	65,821.40	0.18
157	601168	西部矿业	12,198	65,747.22	0.18
158	600060	海信电器	5,685	65,604.90	0.18
159	000999	华润三九	2,626	65,361.14	0.17
160	601699	潞安环能	5,941	63,390.47	0.17
161	601600	中国铝业	18,389	62,522.60	0.17
162	600029	南方航空	22,703	62,433.25	0.17
163	601800	中国交建	15,451	62,422.04	0.17
164	601992	金隅股份	9,075	61,710.00	0.16
165	002344	海宁皮城	2,965	61,612.70	0.16
166	000425	徐工机械	8,016	61,001.76	0.16
167	601018	宁波港	24,827	60,577.88	0.16
168	600811	东方集团	9,507	59,799.03	0.16
169	000061	农产品	7,043	59,302.06	0.16
170	600598	北大荒	5,241	59,275.71	0.16
171	600316	洪都航空	3,407	59,213.66	0.16
172	000060	中金岭南	9,367	58,824.76	0.16
173	600498	烽火通信	3,776	58,150.40	0.16
174	000629	攀钢钒钛	27,105	58,004.70	0.15
175	600694	大商股份	1,996	57,644.48	0.15
176	601933	永辉超市	4,329	57,532.41	0.15
177	000750	国海证券	5,001	57,211.44	0.15
178	002375	亚厦股份	2,209	56,992.20	0.15
179	002007	华兰生物	1,956	56,137.20	0.15
180	601898	中煤能源	11,720	55,904.40	0.15
181	600143	金发科技	10,022	55,722.32	0.15
182	601928	凤凰传媒	5,788	55,333.28	0.15
183	600348	阳泉煤业	7,806	55,110.36	0.15
184	601618	中国中冶	31,483	55,095.25	0.15
185	600415	小商品城	9,316	54,684.92	0.15

186	600875	东方电气	4,265	53,611.05	0.14
187	600705	中航投资	3,139	53,300.22	0.14
188	600068	葛洲坝	13,423	53,155.08	0.14
189	600549	厦门钨业	2,201	52,912.04	0.14
190	600597	光明乳业	2,362	52,436.40	0.14
191	600018	上港集团	9,916	52,356.48	0.14
192	000709	河北钢铁	26,053	52,106.00	0.14
193	000793	华闻传媒	4,365	51,856.20	0.14
194	002310	东方园林	1,595	51,853.45	0.14
195	600062	华润双鹤	2,317	51,831.29	0.14
196	600208	新湖中宝	16,106	51,539.20	0.14
197	600436	片仔癀	543	51,210.33	0.14
198	002294	信立泰	1,485	51,084.00	0.14
199	600267	海正药业	3,423	50,728.86	0.14
200	601238	广汽集团	6,115	50,387.60	0.13
201	600497	驰宏锌锗	5,370	50,316.90	0.13
202	600588	用友软件	3,590	49,685.60	0.13
203	000826	桑德环境	1,414	49,207.20	0.13
204	601333	广深铁路	17,555	48,978.45	0.13
205	600079	人福医药	1,713	48,563.55	0.13
206	000400	许继电气	1,530	47,567.70	0.13
207	002146	荣盛发展	4,754	47,540.00	0.13
208	600123	兰花科创	4,436	47,332.12	0.13
209	000630	铜陵有色	4,583	45,921.66	0.12
210	002500	山西证券	6,616	45,650.40	0.12
211	601098	中南传媒	4,137	45,465.63	0.12
212	601958	金钼股份	6,269	45,450.25	0.12
213	600166	福田汽车	8,877	45,272.70	0.12
214	600863	内蒙华电	13,194	44,991.54	0.12
215	600115	东方航空	16,150	44,735.50	0.12
216	002001	新和成	2,304	44,467.20	0.12
217	000598	兴蓉投资	7,681	44,242.56	0.12
218	600109	国金证券	2,564	43,511.08	0.12
219	601111	中国国航	10,970	43,331.50	0.12
220	600516	方大炭素	5,556	42,281.16	0.11
221	000758	中色股份	3,809	40,946.75	0.11
222	002456	欧菲光	839	40,339.12	0.11
223	601666	平煤股份	7,646	40,217.96	0.11
224	000046	泛海建设	8,797	39,498.53	0.11



225	002065	东华软件	1,168	39,478.40	0.11
226	000878	云南铜业	4,528	39,438.88	0.11
227	601158	重庆水务	6,690	39,404.10	0.11
228	600170	上海建工	6,319	39,367.37	0.11
229	601099	太平洋	6,552	38,984.40	0.10
230	600219	南山铝业	7,451	38,819.71	0.10
231	601866	中海集运	15,532	38,364.04	0.10
232	000839	中信国安	6,101	38,131.25	0.10
233	600664	哈药股份	6,211	38,073.43	0.10
234	600157	永泰能源	6,872	37,040.08	0.10
235	600895	张江高科	4,913	36,896.63	0.10
236	600376	首开股份	7,285	36,643.55	0.10
237	600783	鲁信创投	1,782	36,548.82	0.10
238	600027	华电国际	12,037	36,351.74	0.10
239	601106	中国一重	17,205	35,958.45	0.10
240	600188	兖州煤业	3,871	34,374.48	0.09
241	000778	新兴铸管	5,380	34,270.60	0.09
242	601717	郑煤机	5,355	33,468.75	0.09
243	002106	莱宝高科	2,880	33,264.00	0.09
244	000937	冀中能源	4,475	33,204.50	0.09
245	000528	柳工	5,098	32,423.28	0.09
246	600216	浙江医药	3,058	31,956.10	0.09
247	600546	山煤国际	6,424	31,798.80	0.08
248	000960	锡业股份	2,961	31,623.48	0.08
249	002069	獐子岛	2,154	31,426.86	0.08
250	002155	辰州矿业	3,927	30,984.03	0.08
251	600809	山西汾酒	1,596	30,802.80	0.08
252	000401	冀东水泥	3,583	30,383.84	0.08
253	600160	巨化股份	5,646	30,319.02	0.08
254	600259	广晟有色	776	30,147.60	0.08
255	002299	圣农发展	3,070	29,564.10	0.08
256	600859	王府井	1,627	29,546.32	0.08
257	000933	神火股份	6,026	29,045.32	0.08
258	600096	云天化	3,092	27,518.80	0.07
259	600266	北京城建	2,818	27,278.24	0.07
260	601918	国投新集	6,813	27,115.74	0.07
261	600221	海南航空	13,383	26,766.00	0.07
262	600648	外高桥	813	26,202.99	0.07
263	002603	以岭药业	794	26,043.20	0.07

264	600008	首创股份	3,806	25,728.56	0.07
265	601001	大同煤业	4,313	24,929.14	0.07
266	002431	棕榈园林	1,192	24,626.72	0.07
267	600873	梅花集团	3,911	24,404.64	0.07
268	000718	苏宁环球	5,306	24,248.42	0.06
269	600058	五矿发展	1,776	24,082.56	0.06
270	600528	中铁二局	4,646	23,787.52	0.06
271	600395	盘江股份	3,257	23,645.82	0.06
272	000869	张裕 A	870	23,490.00	0.06
273	002129	中环股份	1,262	23,447.96	0.06
274	600971	恒源煤电	3,274	23,343.62	0.06
275	600970	中材国际	2,767	22,966.10	0.06
276	601101	昊华能源	3,111	22,430.31	0.06
277	600997	开滦股份	4,003	22,296.71	0.06
278	600582	天地科技	3,168	22,271.04	0.06
279	600403	大有能源	3,127	22,264.24	0.06
280	000536	华映科技	800	21,592.00	0.06
281	600688	上海石化	6,912	21,081.60	0.06
282	603000	人民网	268	20,895.96	0.06
283	601139	深圳燃气	2,627	20,779.57	0.06
284	600663	陆家嘴	1,185	20,133.15	0.05
285	000596	古井贡酒	771	17,285.82	0.05
286	002269	美邦服饰	1,370	16,892.10	0.05
287	000703	恒逸石化	2,141	16,014.68	0.04
288	000961	中南建设	2,259	15,880.77	0.04
289	002653	海思科	715	14,135.55	0.04
290	000156	华数传媒	500	10,280.00	0.03
291	002399	海普瑞	474	9,622.20	0.03
292	601231	环旭电子	451	9,493.55	0.03
293	603993	洛阳钼业	1,189	7,716.61	0.02

### 8.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002376	新北洋	27,000	297,000.00	0.79

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	3,389,299.36	9.05
2	600036	招商银行	2,888,899.57	7.72
3	601166	兴业银行	1,928,788.00	5.15
4	601318	中国平安	1,890,296.72	5.05
5	600837	海通证券	1,719,507.48	4.59
6	600000	浦发银行	1,625,023.12	4.34
7	600030	中信证券	1,503,908.28	4.02
8	000002	万科 A	1,483,714.00	3.96
9	601398	工商银行	1,407,309.00	3.76
10	601288	农业银行	1,302,986.00	3.48
11	601328	交通银行	1,256,254.61	3.36
12	600519	贵州茅台	1,134,784.34	3.03
13	000651	格力电器	973,227.05	2.60
14	000001	平安银行	944,432.65	2.52
15	601088	中国神华	904,759.00	2.42
16	601601	中国太保	833,369.24	2.23
17	601668	中国建筑	799,314.00	2.13
18	600887	伊利股份	737,555.87	1.97
19	601169	北京银行	711,751.00	1.90
20	600104	上汽集团	708,548.16	1.89

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	1,696,218.54	4.53
2	600036	招商银行	1,346,236.84	3.60
3	601398	工商银行	924,144.51	2.47
4	600837	海通证券	922,750.06	2.46
5	601166	兴业银行	895,794.15	2.39

6	601288	农业银行	871,987.31	2.33
7	600030	中信证券	813,483.83	2.17
8	600000	浦发银行	795,771.87	2.13
9	601328	交通银行	771,330.03	2.06
10	601318	中国平安	758,512.22	2.03
11	000002	万 科 A	687,443.72	1.84
12	600519	贵州茅台	610,026.45	1.63
13	000001	平安银行	471,704.40	1.26
14	000651	格力电器	456,829.94	1.22
15	601088	中国神华	446,672.17	1.19
16	601668	中国建筑	423,020.45	1.13
17	601169	北京银行	395,652.77	1.06
18	600887	伊利股份	366,168.59	0.98
19	000858	五 粮 液	365,204.78	0.98
20	600104	上汽集团	345,165.41	0.92

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	79,334,895.09
卖出股票收入（成交）总额	39,754,645.04

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 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证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本期，本基金持有的中国平安于 2013 年 5 月 21 日公告其集团控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）于近日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚和市场禁入事先告知书》，中国证监会对平安证券给予警告及行政处罚。中国平安为本基金跟踪标的指数的样本股，基金管理人将密切跟踪相关进展，在严格执行内部投资决策流程的基础上进行投资。

除此之外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 8.12.3 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	-
4	应收利息	590.83
5	应收申购款	592.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,183.71

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
589	68,687.89	10,501,250.00	25.96%	29,955,919.79	74.04%

### 9.2 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	王奇华	800,046.00	12.61%
2	江苏伟业安装集团有限公司	500,000.00	7.88%
3	王云	449,026.00	7.08%

4	陈方	250,007.00	3.94%
5	陈蕾颖	220,017.00	3.47%
6	孙岚	200,628.00	3.16%
7	张坚	182,005.00	2.87%
8	陈颐仙	167,011.00	2.63%
9	吴佩良	152,000.00	2.40%
10	朱汉华	150,018.00	2.37%

### 9.3 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	54,459.27	0.1346%

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,250.00	24.72	10,001,250.00	24.72	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,250.00	24.72	10,001,250.00	24.72	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 4 月 26 日）基金份额总额	272,952,491.85
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	1,355,185.58
减：本报告期基金总赎回份额	233,850,507.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	40,457,169.79

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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) 报告期内基金管理人重大人事变动

2013 年 4 月 21 日, 经华宸未来基金管理有限公司股东会第七次会议决议通过, 选举郑二薰为公司股东董事, 辛炯官不再担任公司董事职务。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内, 基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内, 因业务发展需要, 本基金改聘立信会计师事务所(特殊普通合伙)负责本基金审计业务。此事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告, 并已于 2013 年 9 月 6 日进行了披露。

### 11.6 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, 基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	



			例			
光大证券	2	13,181,522.75	11.11%	9,364.37	11.11%	席位已退租
民生证券	1	41,749,817.84	35.19%	29,659.46	35.19%	-
中信证券	2	63,709,879.47	53.70%	45,259.35	53.70%	-

### 11.7.2 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	
	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例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	40,200,000.00	4.48%	-	-
中信证券	-	-	857,000,000.00	95.52%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要 (2013 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 12 月 3 日
2	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2013 年第 1 号)	本公司网站	2013 年 12 月 3 日
3	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 2013 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 10 月 24 日
4	关于增聘申蕾女士为华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 10 月 24 日
5	华宸未来基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 9 月 6 日
6	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 2013 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 8 月 26 日
7	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 2013 年半	本公司网站	2013 年 8 月 26 日

	年度报告		
8	华宸未来基金管理有限公司关于网上交易中支付宝基金专户新增工商银行等支付渠道的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 8 月 9 日
9	华宸未来基金管理有限公司旗下开放式基金实施网上直销费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2014 年 8 月 8 日
10	华宸未来基金与支付宝合作开通网上直销业务并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 8 月 8 日
11	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 2013 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 7 月 18 日
12	华宸未来基金管理有限公司关于旗下证券投资基金 2013 年 6 月 30 日基金资产净值和基金份额净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 7 月 1 日
13	华宸未来基金管理有限公司关于华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 赎回费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 6 月 21 日
14	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 上市交易提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 6 月 3 日
15	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 开放定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 5 月 30 日
16	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(LOF)上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 5 月 29 日
17	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 5 月 29 日
18	华宸未来基金管理有限公司关于调整华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 赎回费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 5 月 29 日
19	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 4 月 27 日
20	关于新增杭州数米基金销售有限公司为华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 4 月 15 日

21	关于新增深圳众禄基金销售有限公司为华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 4 月 8 日
22	关于新增厦门证券有限公司为华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 3 月 25 日
23	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 份额上网发售提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 3 月 25 日
24	关于新增平安银行股份有限公司等为华宸 300 代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 3 月 22 日
25	华宸未来沪深 300 基金托管协议	本公司网站	2013 年 3 月 21 日
26	华宸未来沪深 300 基金基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 3 月 21 日
27	华宸未来沪深 300 基金基金合同	本公司网站	2013 年 3 月 21 日
28	华宸未来沪深 300 基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 3 月 21 日
29	华宸未来沪深 300 基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本公司网站	2013 年 3 月 21 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件；
- 2、《华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、《华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可登陆基金管理人互联网站 (<http://www.hcmirae.com>)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查询。

华宸未来基金管理有限公司  
2014 年 3 月 26 日