

华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）2015 年半年度报告 摘要

2015 年 6 月 30 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：2015 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华宸 300
场内简称	-
基金主代码	167901
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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	12,734,603.04 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	杨桐	方韡
	联系电话	021-26066888	010-89936330
	电子邮箱	yangt@hcmirafund.com	fangwei@citicibank.com
客户服务电话		4009200699	95558
传真		021-65870287	010-65550832

2.4 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	http://www.hcmirae.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	8,638,833.74
本期利润	6,400,666.77
加权平均基金份额本期利润	0.4059
本期基金份额净值增长率	25.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.5613
期末基金资产净值	22,405,614.48
期末基金份额净值	1.759

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，包含停牌股票按公允价值调整的影响。

3、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。

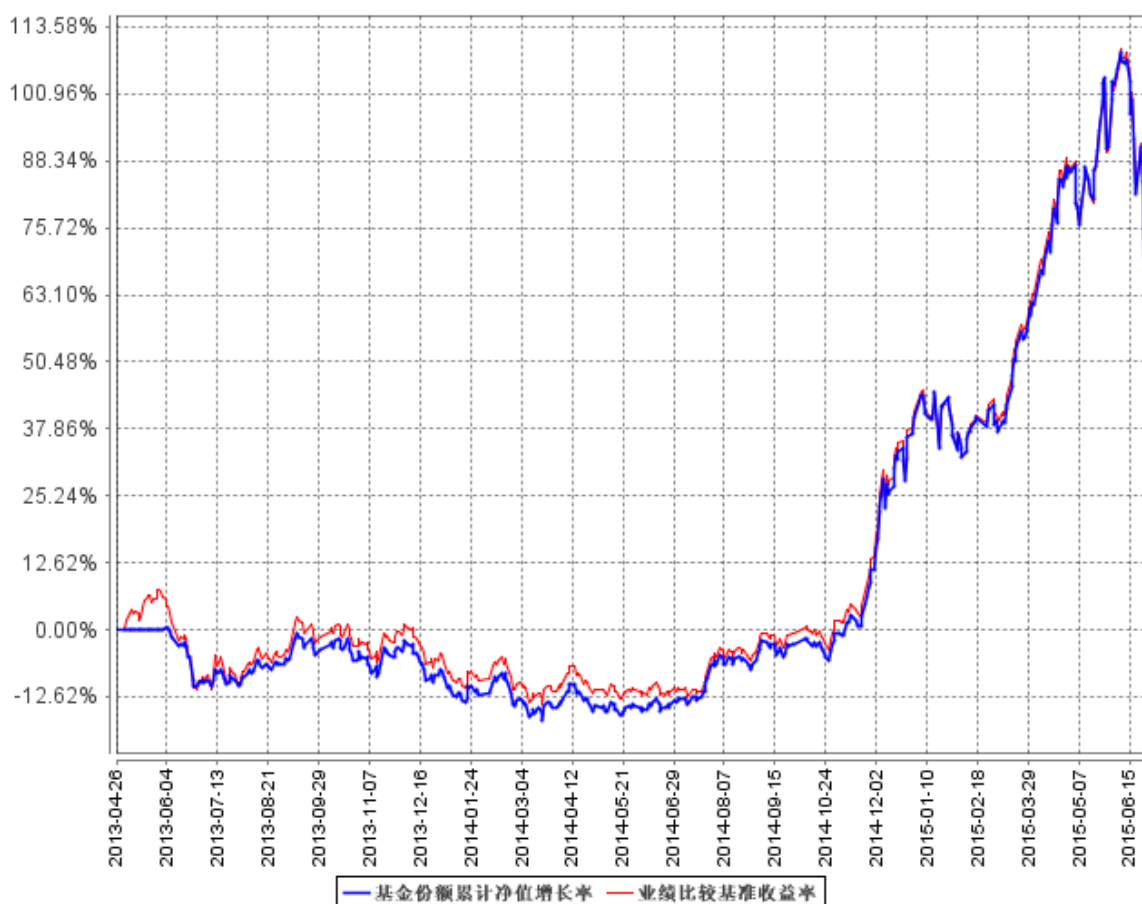
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-7.91%	3.32%	-7.18%	3.32%	-0.73%	0.00%
过去三个月	10.56%	2.47%	9.98%	2.48%	0.58%	-0.01%
过去六个月	25.73%	2.15%	25.29%	2.15%	0.44%	0.00%
过去一年	103.12%	1.75%	99.67%	1.75%	3.45%	0.00%
自基金合同生效起至今	75.90%	1.39%	76.55%	1.47%	-0.65%	-0.08%

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：1、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%；
 2、本基金成立于 2013 年 4 月 26 日，图示时间段为 2013 年 4 月 26 日至 2015 年 6 月 30 日。本基金自基金合同生效日至本报告期末已满一年；

§ 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		
蔡文	本基金基金经理	2014年10月14日	-	5	复旦大学管理学硕士，CPA，具有基金从业资格。历任毕马威(KPMG)财务咨询担任财务咨询师；美国投资银行Cowen Group 投资分析师；汇丰晋信基金管理有限公司行业研究员；2012年7月加入华宸未来基金，历任高级研究员和投决会委员
王宇	本基金基金经理	2013年4月26日	2014年4月30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。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	2014年12月15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基金经理。

蔡建文	本基金基金经理助理	2014年1月8日	-	4	厦门大学投资学硕士，具有基金从业资格，通过期货从业资格考试。2011年7月至2012年11月，曾任日信证券金融工程研究员。2012年11月加入华宸未来基金，历任金融工程研究员、基金经理助理。
-----	-----------	-----------	---	---	---

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。

4.3.2 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

报告期内代表转型方向的成长股上涨明显，创业板综指上涨 92.23%，上证综指上涨 32.23%。上涨的核心逻辑是改革，通过改革调整经济结构，培养新引擎，而新引擎的代表是建设信息高速公路。在改革的过程中，第一是去产能，用“一带一路”带动落后产能的转移，带动基建、钢铁水泥、煤炭等产业的去产能和产业升级。第二是新技术，以“互联网+”带动培育新兴产业的发展，通过新技术培育新经济，鼓励大众创业，释放民营活力。第三个是新制度，以国有企业改革重塑国家资产负债表，国有企业改革包括央企的国企改革与地方上的国企改革，改革方式包括资产证券化、混合所有制引进战略投资者、员工持股、大国企合并等，其本质是重塑国家资产负债表、地方资产负债表。而六月份开始创业板和主板同时面临股灾式暴跌，由于监管部门严厉禁止场外配资导致平仓盘的出现，波及到场内融资融券，个股普遍跌幅在 60%左右。很多个股已经进入价值投资区间。

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 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.759 元，本报告期份额净值增长率为 25.73%，同期业绩基准增长率为 25.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年央行实施的宽松的货币环境确实对实体经济的下滑起到了一定的支撑作用，但“宽货币”向实体经济的传导效果较差，有效投资不足，难以拉动内需。我们预计下半年依然会保持宽松的货币政策；同时，财政政策更加积极。通缩压力较大，CPI 连续多个月份低于 2%，PPI 已经连续 40 个月为负数。预计下半年通缩压力有所减缓，CPI 将保持低位，原材料价格反弹，PPI 跌幅收窄。预计下半年经济环比增速回升，三、四季度 GDP 分别增长 7.0%和 7.1%。

二季度末场外配资去杠杆导致股市的暴跌，之后波及到场内融资。管理层密集出台一系列救护股市的重磅政策，未来几个月将是市场的绝佳黄金时间窗口：1) IPO 暂停，暂时没有新股抽血的压力；2) 上市公司不得减持公司的股票，同时“五选一”的方案强制要求上市公司采取维护股

价的措施，如控股股东增持或者高管增持等；3）央行证金公司提供无限流动性背书，由证金公司直接在二级市场购买股票或者通过基金公司购买股票的方式稳定市场；3）联合公安部打击恶意做空行为，鼓励做多；4）其他救市的措施已经公布或等待公布。这这些措施明显在 3800-4000 点构成政策底，然而市场信心的修复需要漫长的过程，在信心修复之后市场在下半年将迎来绝好的价值投资时光。下半年个股分化会很严重，优选选择那种有估值、具有较强安全边际，同时基本面良好的成长股和蓝筹股。

4.6 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验。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

无。

§ 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合规守信、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

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半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 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		1,329,878.04	1,784,681.22
结算备付金		14,279.08	2,655.50
存出保证金		-	-
交易性金融资产		21,214,385.08	25,511,914.88
其中：股票投资		21,214,385.08	25,511,914.88
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		-	28,168.53
应收利息		306.73	440.66
应收股利		-	-
应收申购款		104,811.86	96,837.95
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		22,663,660.79	27,424,698.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		54,102.24	12,089.79
应付赎回款		26,927.19	198,797.10
应付管理人报酬		16,722.27	16,960.60
应付托管费		3,135.42	3,180.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		30,225.10	16,230.37
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		126,934.09	295,279.66
负债合计		258,046.31	542,537.65
所有者权益:			
实收基金		12,734,603.04	19,209,333.83
未分配利润		9,671,011.44	7,672,827.26
所有者权益合计		22,405,614.48	26,882,161.09
负债和所有者权益总计		22,663,660.79	27,424,698.74

6.2 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

一、收入		6,763,808.70	-2,066,247.59
1.利息收入		6,394.83	8,902.47
其中：存款利息收入		6,394.83	8,902.47
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）		8,817,406.01	-818,540.31
其中：股票投资收益		8,660,514.69	-1,190,216.75
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		156,891.32	371,676.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-2,238,166.97	-1,266,584.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		178,174.83	9,975.23
减：二、费用		363,141.93	367,410.75
1. 管理人报酬		101,439.55	132,957.50
2. 托管费		19,019.92	24,929.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		61,616.27	26,943.69
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		181,066.19	182,580.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,400,666.77	-2,433,658.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,400,666.77	-2,433,658.34

6.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	19,209,333.83	7,672,827.26	26,882,161.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	6,400,666.77	6,400,666.77
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）	-6,474,730.79	-4,402,482.59	-10,877,213.38
其中：1. 基金申购款	8,360,374.43	5,029,863.66	13,390,238.09
2. 基金赎回款	-14,835,105.22	-9,432,346.25	-24,267,451.47
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）	12,734,603.04	9,671,011.44	22,405,614.48
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
项目	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）	40,457,169.79	-3,015,889.76	37,441,280.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-2,433,658.34	-2,433,658.34
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）	-5,149,492.26	703,084.38	-4,446,407.88
其中：1. 基金申购款	713,430.45	-79,636.03	633,794.42
2. 基金赎回款	-5,862,922.71	782,720.41	-5,080,202.30
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）	35,307,677.53	-4,746,463.72	30,561,213.81

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：

_____ 杨桐	_____ 杨桐	_____ 乔鋈池
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%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则(2006)、中国证券业协会于 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。此外,本财务报表同时符合如会计报表附注 6.4.4 所

列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无差错事项。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、[2001]61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[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》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84 号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作, 本基金适用的主要税项列示如下:

- 1、以发行基金方式募集资金, 不属于营业税征收范围, 不征收营业税;
- 2、基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税;
- 3、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税;
- 4、对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入, 由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税, 自 2005 年 6 月 13 日起, 对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按 50%计算个人所得税;
- 5、自 2005 年 1 月 24 日起, 基金买卖 A 股、B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税。自 2007 年 5 月 30 日起, 该税率上调至 0.3%。自 2008 年 4 月 24 日

起, 根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定, 调整证券(股票)交易印花税税率, 由 0.3% 降至 0.1%。自 2008 年 9 月 19 日起, 根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定, 证券交易印花税改为单边征收, 即仅对卖出 A 股、B 股股权按 0.1% 的税率征收, 对受让方不再征税;

6、对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入, 暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

本报告期内与本基金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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
--	------	--------------	------	--------------

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给关联方的佣金。

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	101,439.55	132,957.50
其中：支付销售机构的客户维护费	13,746.19	-

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$ ，H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日的基金资产净值。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,019.92	24,929.51

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ ，H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日的基金资产净值。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未与关联方进行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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	10,001,250.00
期初持有的基金份额	10,001,250.00	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	10,001,250.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	52.0600%	28.3300%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换换出份

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。

3、基金管理人以上述固有资金作为本基金的发起资金，自本基金基金合同生效之日起，所认购的基金份额持有期限不低于三年。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未有除基金管理人之外的其他关联方持有本基金份额。

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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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
中信银行	1,329,878.04	6,167.78	2,401,185.23	8,835.47

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均无其他关联方交易事项。

6.4.9 期末（2015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

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 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
000024	招商地产	2015年4月3日	临时停牌	31.64	-	-	3,752	69,818.23	118,713.28	-
600886	国投电力	2015年6月24日	临时停牌	14.87	-	-	5,757	25,703.99	85,606.59	-
000778	新兴	2015年	临时	12.96	-	-	5,825	29,140.55	75,492.00	-

	铸管	6月15日	停牌								
600153	建发股份	2015年6月30日	临时停牌	17.51	-	-	3,700	25,421.70	64,787.00	-	
000917	电广传媒	2015年5月28日	临时停牌	42.89	-	-	1,430	21,979.95	61,332.70	-	
002375	亚厦股份	2015年6月17日	临时停牌	29.21		2015年7月20日	26.29	1,820	29,806.31	53,162.20	-
000709	河北钢铁	2015年6月30日	临时停牌	7.00	-	-	-	7,294	25,749.44	51,058.00	-
000878	云南铜业	2015年6月8日	临时停牌	24.50	-	-	-	1,772	29,568.13	43,414.00	-
002353	杰瑞股份	2015年5月27日	临时停牌	44.35	-	-	-	900	33,581.76	39,915.00	-
601633	长城汽车	2015年6月19日	临时停牌	42.76	-	-	-	921	44,170.66	39,381.96	-
000963	华东医药	2015年6月26日	临时停牌	71.48	-	-	-	346	15,048.50	24,732.08	-
002001	新和成	2015年6月30日	临时停牌	17.09		2015年7月13日	18.49	814	10,025.25	13,911.26	-

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

截至本报告期末，本基金未持有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

截至本报告期末，本基金未持有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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层级：

第一层级：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层级：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 21,214,385.08 元，无属于第二层级、第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于其进行估值调整之日起从第一层级转入第二层级或第三层级，于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层级或第三层级转入第一层级。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层级转入第一层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	21,214,385.08	93.61
	其中：股票	21,214,385.08	93.61
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	1,344,157.12	5.93
7	其他各项资产	105,118.59	0.46
8	合计	22,663,660.79	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采矿业	1,064,649.93	4.75
C	制造业	7,028,386.31	31.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	748,849.53	3.34
E	建筑业	913,599.07	4.08
F	批发和零售业	314,560.43	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	752,844.25	3.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,260,181.41	5.62
J	金融业	7,205,622.65	32.16
K	房地产业	1,078,387.40	4.81
L	租赁和商务服务业	227,100.67	1.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	234,348.54	1.05
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	204,739.07	0.91
S	综合	-	-

	合计	21,033,269.26	93.86
--	----	---------------	-------

7.2.2 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	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
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	181,115.82	0.81
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	181,115.82	0.81

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.1 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	601318	中国平安	9,633	789,328.02	3.52
2	600036	招商银行	29,539	552,970.08	2.47
3	600016	民生银行	46,491	462,120.54	2.06

4	600030	中信证券	16,086	432,874.26	1.93
5	601166	兴业银行	22,806	393,403.50	1.76
6	600000	浦发银行	23,082	391,470.72	1.75
7	600837	海通证券	16,642	362,795.60	1.62
8	601766	中国南车	19,220	352,879.20	1.57
9	600519	贵州茅台	1,149	296,039.85	1.32
10	601988	中国银行	58,516	286,143.24	1.28

7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600446	金证股份	1,467	181,115.82	0.81

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600446	金证股份	661,071.00	2.46
2	300059	东方财富	464,362.00	1.73
3	601988	中国银行	341,804.00	1.27
4	601318	中国平安	337,847.00	1.26
5	600030	中信证券	331,957.00	1.23
6	601766	中国南车	317,536.35	1.18
7	600837	海通证券	307,161.00	1.14
8	300168	万达信息	294,094.32	1.09
9	601633	长城汽车	288,883.00	1.07
10	600570	恒生电子	269,035.00	1.00
11	600016	民生银行	262,580.00	0.98
12	601166	兴业银行	241,830.00	0.90
13	601169	北京银行	236,548.00	0.88
14	601231	环旭电子	198,450.00	0.74
15	600369	西南证券	197,228.00	0.73

16	600050	中国联通	195,842.00	0.73
17	601186	中国铁建	191,177.00	0.71
18	600109	国金证券	177,999.00	0.66
19	601688	华泰证券	175,210.00	0.65
20	600271	航天信息	173,530.00	0.65

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	757,623.87	2.82
2	600016	民生银行	629,317.82	2.34
3	600446	金证股份	560,281.48	2.08
4	600030	中信证券	558,800.47	2.08
5	600036	招商银行	461,760.29	1.72
6	600837	海通证券	460,101.91	1.71
7	601166	兴业银行	429,827.64	1.60
8	600588	用友网络	410,024.52	1.53
9	600000	浦发银行	406,158.83	1.51
10	601633	长城汽车	403,928.69	1.50
11	601186	中国铁建	377,180.59	1.40
12	002065	东华软件	337,349.47	1.25
13	300168	万达信息	313,025.41	1.16
14	601766	中国南车	310,497.48	1.16
15	000002	万科A	303,261.62	1.13
16	601668	中国建筑	302,311.98	1.12
17	002475	立讯精密	293,413.63	1.09
18	601390	中国中铁	270,122.70	1.00
19	600369	西南证券	264,104.47	0.98
20	300059	东方财富	258,784.63	0.96

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。

7.4.3 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	16,303,128.57
卖出股票收入（成交）总额	27,023,006.09

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本期，本基金持有的中国平安控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）于2014年12月8日受到证监会的处罚，其原因系“平安证券在推荐海联讯IPO过程中未勤勉尽责，未按规定对海联讯IPO申请文件进行审慎核查，从而未能发现海联讯虚构收回应收账款和虚增收入的事实，其所出具的保荐书存在虚假记载”。处分措施为给予平安证券警告，没收保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2,867万元，并处以440万元罚款。

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	306.73
5	应收申购款	104,811.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,118.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
253	50,334.40	10,031,950.00	78.78%	2,702,653.04	21.22%

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	韦翠凤	57,800.00	20.80%
2	平安证券有限责任公司	30,700.00	11.05%
3	马兴云	25,100.00	9.03%
4	郝瑞青	20,001.00	7.20%
5	杨志军	15,850.00	5.70%
6	赵立民	15,000.00	5.40%
7	翼建成	7,200.00	2.59%
8	韩志锋	7,000.00	2.52%
9	曾亭曦	5,800.00	2.09%
10	谷玉坤	5,700.00	2.05%

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	0.00	0.0000%

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的情况

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.5 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	78.54	10,001,250.00	78.54	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	78.54	10,001,250.00	78.54	-

§ 9 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	19,209,333.83
本报告期基金总申购份额	8,360,374.43
减：本报告期基金总赎回份额	14,835,105.22
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	12,734,603.04

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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）报告期内基金管理人重大人事变动

2015年4月22日，经华宸未来基金管理有限公司第一届董事会第二十一次会议决议通过，阙水深先生不再担任公司总经理职务。

2015年4月26日，华宸未来基金管理有限公司召开第十一次股东会，选举产生公司第二届董事会。第二届董事会董事为于建琳女士、刘玉瀛先生、钱小鸣先生、辛炯官先生、王温先生、陈湘义先生、高书生先生。其中，于建琳女士、刘玉瀛先生、钱小鸣先生为新当选董事，王温先生、陈湘义先生、高书生先生为新当选独立董事。向旭平先生、甄学军先生、阙水深先生、汪新先生不再担任董事，谭向东先生、康书生先生、胡奕明女士不再担任独立董事。

2015年4月26日，经华宸未来基金管理有限公司第二届董事会第一次会议决议通过，向旭平先生不再担任公司董事长职务。

（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，本基金托管人未发生重大人事变动。

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，原华宸 300 基金经理王宇与基金管理人因劳动关系纠纷发生争议，经过仲裁、一审判决后，基金管理人于 2015 年 1 月 23 日收到终审判决：基金管理人应支付王宇相关工资差额、并办理相关退工手续。管理人已经按照判决内容与王宇解除劳动关系。

除此之外，无其他涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为基金进行审计的会计师事务所。

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，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。

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	
民生证券	1	30,417,234.19	71.49%	21,608.79	71.49%	-
中信证券	2	12,128,622.77	28.51%	8,616.31	28.51%	-

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

注：本报告期内本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华宸未来基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日