

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

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

登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2013 年 6 月 3 日

公告时间：2013 年 5 月 29 日

目录

一、重要声明与提示	2
二、基金概览	2
三、基金份额的募集与上市交易	4
四、持有人户数、持有人结构和前十名持有人	6
五、基金主要当事人简介	7
六、基金合同摘要	11
七、基金财务状况	33
八、基金投资组合	34
九、重大事件揭示	35
十、基金管理人承诺	36
十一、基金托管人承诺	36
十二、备查文件目录	36

一、重要声明与提示

华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）上市交易公告书根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市交易规则》等规定编制。本基金管理人的董事会和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责任。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2013 年 3 月 21 日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及华宸未来基金管理有限公司网站（<http://www.hcmirae.com>）上的《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》。

二、基金概览

- 1、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
场内简称：华宸 300
- 2、交易代码：167901
- 3、基金份额总额：272,952,491.85 份
- 4、基金份额净值：1.002 元（截至 2013 年 5 月 27 日）
- 5、本次上市交易份额：206,853,521.00 份
- 6、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 7、上市交易日期：2013 年 6 月 3 日
- 8、基金管理人：华宸未来基金管理有限公司

9、基金托管人：中信银行股份有限公司

10、上市推荐人：无

三、基金份额的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：经 2013 年 1 月 24 日中国证监会证监许可[2013]49 号文批准募集

2、基金运作方式：上市契约型开放式（LOF）

3、基金合同期限：不定期

4、本基金发售日期：2013 年 3 月 25 日至 2013 年 4 月 19 日

5、份额发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售

6、发售价格：1.00 元人民币

7、发售机构（排名不分先后）

（1）场外销售机构

直销机构：华宸未来基金管理有限公司

代销银行：中信银行、平安银行

代销券商：东方证券、齐鲁证券、国海证券、国泰君安证券、海通证券、天源证券、申银万国证券、信达证券、银河证券、中信建投证券、中信万通证券、中信证券、中信证券（浙江）、日信证券、国信证券、光大证券、兴业证券、民生证券、厦门证券

其他代销机构：天相投资顾问有限公司、众禄基金、数米基金

（2）场内销售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证

券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

8、验资机构名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的有效认购总户数为 1,587 户，净认购金额（不含认购费）为 272,931,718.21 元人民币，有效认购款项在基金合同生效前产生的利息为 20,773.64 元人民币，共计 272,952,491.85 元人民币。本次募集所有资金已于 2013 年 4 月 25 日全额划入本基金在基金托管人中信银行股份有限公司开立的基金托管账户。

10、基金合同生效日：2013 年 4 月 26 日

11、基金合同生效日的基金份额总额：272,952,491.85 份

（二）本基金的日常申购、赎回

本基金管理人自 2013 年 6 月 3 日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。具体业务办理规则请见相关公告。

（三）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2013]178 号

2、上市交易日期：2013 年 6 月 3 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：华宸 300

场内简称：华宸 300

5、交易代码：167901

6、本次上市交易份额：206,853,521.00 份

7、基金资产净值的披露

本基金上市交易后，基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传送给深圳证券交易所，深圳证券交易所于次日通过行情系统揭示。根据《基金法》，本基金的基金会计责任方为基金管理人，因此基金管理人公布的基金份额净值负责。

8. 未上市交易份额的流通规定

未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下，可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统在深圳证券交易所上市交易。本基金基金份额将于 2013 年 6 月 3 日起开通跨系统转托管业务，具体业务规则按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构和前十名持有人

截至 2013 年 5 月 27 日的场内基金份额持有情况如下：

1、场内基金份额持有人户数为 989 户；平均每户持有场内基金份额 209,154 份。

2、场内机构持有人持有基金份额 52,593,560 份，占场内基金份额总数的 25.43%；场内个人持有人持有基金份额 154,259,961 份，占场内基金份额总数的 74.57%。

3、场内前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	证券账户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例（%）
1	湖北白云边置业投资有限公司	0800198397	50,001,458	24.17
2	王丽娟	0138453247	15,000,874	7.25

3	燕保庆	0055578283	15,000,020	7.25
4	陈沁	0104547832	10,000,583	4.83
5	刘先诚	0138586202	9,999,291	4.83
6	王虎林	0101110475	9,000,262	4.35
7	朱瑾	0103541972	6,300,183	3.05
8	李涛	0099218614	5,000,291	2.42
9	施群	0015340921	5,000,145	2.42
10	张圆	0120538652	4,000,116	1.93
合计			129,303,223	62.51

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：华宸未来基金管理有限公司
- 2、注册地址：上海市虹口区四川北路859号中信广场16层
- 3、法定代表人：刘晓兵
- 4、总经理：阙水深
- 5、设立日期：2012年6月20日
- 6、注册资本：2亿元人民币
- 7、设立批准文号：中国证监会证监许可[2012]370号
- 8、工商登记注册的法人营业执照文号：100000400012241
- 9、经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务
- 10、存续期间：持续经营
- 11、股东及出资比例：华宸信托有限责任公司（40%）、韩国未来资产基金管

理公司 (25%) 和咸阳步长医药科技发展有限公司 (35%)

12、内部组织结构及职能

本基金管理人公司治理结构完善, 经营运作规范, 能够切实维护基金投资人的利益。股东会为公司权力机构, 由全体股东组成, 决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利, 不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构, 对股东会负责, 并向股东会汇报。公司董事会由 8 名董事组成, 其中 3 名为独立董事。根据公司章程的规定, 董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设执行监事 1 名, 向股东会负责, 主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营由总经理负责。公司根据经营运作需要设置综合管理部、投资研究部、固定收益部、运营部、市场部、国际业务部、金融工程部、专户理财部、风险管理部、监察稽核部十个职能部门。此外, 公司还设有投资决策委员会和风险管理委员会。

13、人员情况

截至 2013 年 5 月 27 日, 公司共有员工 50 人, 所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

14、信息披露负责人及咨询电话

王颖 021-26066999

15、基金管理业务情况简介

截至 2012 年 12 月 31 日, 本基金管理人未开展公募基金及特定客户资产管理业务。

16、本基金基金经理

王宇 FRM, 毕业于美国加州州立大学获金融学硕士学位, 十二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部高级研究员, 友邦华泰基金管理有限公司业务发展部高级产

品经理，国海富兰克林基金管理有限公司业务发展部副总经理，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。现任华宸未来基金管理有限公司金融工程部总监，具有中国证券从业人员资格，中国期货从业人员资格。2013年4月26日起任华宸未来沪深300指数增强发起式证券投资基金（LOF）基金经理。

（二）基金托管人

- 1、名称：中信银行股份有限公司（简称：中信银行）
- 2、成立日期：1987年4月7日
- 3、注册地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
- 4、办公地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
- 5、注册资本：467.873亿元人民币
- 6、法定代表人：田国立
- 7、基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号
- 8、联系人：托管中心
- 9、电话/传真：010-65550832
- 10、主要人员情况：

朱小黄博士，中信银行行长，高级经济师。1982年2月至1993年9月，历任中国建设银行办公室法规处干部、副处长、处长；1993年9月至2001年5月，历任中国建设银行办公室副主任、信贷一部副主任、信贷管理部副总经理、辽宁省分行副行长、营业部总经理；2001年5月至2004年10月，任中国建设银行广东省分行行长；2004年10月至2006年3月，任中国建设银行公司业务部总经理；2006年3月至2006年4月，任中国建设银行风险管理与内控委员会常务副主任；2006年4月至2008年6月，任中国建设银行首席风险官；2008年6月至2010年7月，任中国建设银行副行长兼首席风险官；2010年7月至2011年2月，任中国建设银行执行董事、副行长兼首席风险官；2011年2月至2012年8月，任中国建设银行执行董事、副行长；2012年8月至2012年9月，任中国中信股份有限公司副总经理；2012年9月，任中国中信股份有限公司副总经理、中信银行行长。朱小黄先生是高级经济师，并是中国政府特殊津贴获得者，1982年湖北财经学院基建财务与信用专业大学本科毕业，1985年北京大学经济法专业专科毕业，2006年中山大学世界经济专业博士毕业。

苏国新先生，中信银行副行长，分管托管业务。曾担任中信集团办公厅副主任、同时兼任中信集团董事长及中信银行董事长秘书。1997年6月开始担任中信集团董事长秘书。1991年8月至1993年10月，在中国外交部工作。1993年10至1997年5月在中信集团负责外事工作。1996年1月至1997年1月，在瑞士银行SBC和瑞士联合银行UBS等金融机构工作。

刘勇先生，中信银行托管中心总经理。男，1965年出生，中共党员，硕士研究生。曾任中信银行贸易结算部副总经理，中信银行总行营业部国际业务部总经理，中信银行国际业务管理部总经理，中信银行上海分行行长助理兼风险主管，中信银行国际业务部副总经理。2007年6月至今，任中信银行托管中心总经理，负责全行托管业务。

11、基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2012年12月31日，中信银行已托管20只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，总托管规模逾7251亿元。

（三）基金上市推荐人的信息

无

（四）基金验资机构

- 1、名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）
- 2、住所：北京市西城区北三环中路 29 号院茅台大厦 28 层
- 3、办公地址：北京市西城区北三环中路 29 号院茅台大厦 28 层
- 4、法定代表人：朱建弟
- 5、联系人：刘国强
- 6、联系电话：010-56730088
- 7、传真：010-56730000
- 8、经办注册会计师：祁涛、张帆

六、基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利与义务

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

1) 依法募集基金；

2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

4) 销售基金份额；

5) 召集基金份额持有人大会；

6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

9) 担任或委托其他符合条件的机构担任注册登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

17) 法律法规和《基金合同》规定的其它权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2) 办理基金备案手续；

3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7) 依法接受基金托管人的监督；

8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人

分配基金收益；

14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；

17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26) 建立并保存基金份额持有人名册；

27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

2、基金托管人的权利与义务

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规

定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

12) 建立并保存基金份额持有人名册；

13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利与义务

每份基金份额具有同等的合法权益。

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权

利包括但不限于：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- 9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- 1) 认真阅读并遵守《基金合同》；
- 2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- 3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- 4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项或对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- 5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- 6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- 7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- 8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

1、召开事由

（1）当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止《基金合同》；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式；
- 5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- 6) 变更基金类别；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- 9) 变更基金份额持有人大会程序；
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 12) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- 13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（2）以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- 4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则

发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

(4) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(5) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和

权益登记日。

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

（1）召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

（2）采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

（3）如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- 1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持

有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4) 上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

5、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（2）议事程序

1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

（1）现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代

表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

三、基金收益分配原则、执行方式

1、收益分配原则

（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。

2、收益分配方案

金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

3、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）基金上市费用；
- （9）指数许可使用费；
- （10）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起前 3 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人

复核后于 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

（2）基金托管人的托管费

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起前 3 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，经基金托管人复核后于 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

（3）指数许可使用费用

本基金管理人与指数许可方签订书面协议，约定指数许可使用的费用及支付方式。指数许可使用基点费是指基金设立后每个季度按照基金资产规模的一定比例收取的费用，列入基金费用。根据与指数许可方签署的相关协议，在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值。

自基金合同生效日起，指数许可使用基点费每季度支付一次，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支取。指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 5 万元整（即不足 5 万元时按照 5 万元收取）。当年基金合同生效不足一个季度的，按照一个季度收费。如果上述指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采

用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒体进行公告。

（4）除管理费、托管费和指数许可使用基点费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金财产的投资方向和投资限制

1、投资范围

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。

基金的投资组合比例为：本基金所持有的有价值证券市值和买入、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。

2、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 在任何交易日日终，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%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；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%；

2) 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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

3) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；但完全按照标的指数的构成比例进行证券投资不受此限制；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，本基金符合中国证监会有关要求的指数化投资部分不计入该限制；

5) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；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%；

6) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

7) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的

20%；

11) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

12) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

13) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

14) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

16) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。对于因上述（5）、（6）项情形导致无法投资标的指数成份股或备选成份股的，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，将结合使用其他合理方法进行适当替代。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值计算方法

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价格；

2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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的，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，确定公允价格；

3) 交易所上市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；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价格；

4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券, 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, 按成本估值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股, 按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值; 该日无交易的, 以最近一日的市价(收盘价)估值;

2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证, 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, 按成本估值;

3) 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, 按交易所上市的同一股票的估值方法估值; 非公开发行有明确锁定期的股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 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。

(4) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 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价格估值。

(5) 金融衍生品的估值

1) 上市流通金融衍生品按估值日其所在证券交易所的结算价估值; 估值日无交易的, 以最近交易日的结算价估值;

2) 未上市金融衍生品按成本价估值, 如成本价不能反映公允价值, 则采用估值模型确定公允价值。

(6) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。

根据有关法律法规, 基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任, 因此, 就与本基金有关的会计问题, 如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致的意见, 按照

基金管理人对外公布基金资产净值的计算结果。

2、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止的；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- （3）《基金合同》约定的其他情形；
- （4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

2、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（4）基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报

告出具法律意见书；

6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

7) 对基金财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

4、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构

的办公场所和营业场所查阅。

七、基金财务状况

1、本基金募集期间相关费用明细及节余情况

深圳证券交易所本基金募集期间至上市交易公告书公告前未收取任何费用。各基金销售机构根据本基金《招募说明书》设定的认购费率收取认购费。

2、本基金合同生效后至本公告书公告前的重要财务事项

本基金合同生效后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

3、华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）截至 2013 年 5 月 27 日资产负债表如下（除特别注明外，金额单位为人民币元）：

项 目	2013 年 5 月 27 日
资 产	
银行存款	84,932.26
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	
其中：股票投资	
债券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	257,200,000.00
应收证券清算款	16,423,551.57
应收利息	
其他资产	67,245.19
资产总计	273,775,729.02
负债和所有者权益	
负债	
应付管理人报酬	185,655.40
应付托管费	34,810.40
应付交易费用	
其他负债	48,402.54

负债合计	268,868.34
所有者权益	
实收基金	272,952,491.85
未分配利润	554,368.83
所有者权益合计	273,506,860.68
负债和所有者权益总计	273,775,729.02
基金份额总额(份)	272,952,491.85
基金份额净值	1.002

八、基金投资组合

截止到 2013 年 5 月 27 日，华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	257,200,000.00	93.95
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	84,932.26	0.03
6	其他资产	16,490,796.76	6.02
7	合计	273,775,729.02	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金截至 2013 年 5 月 27 日未持有股票。

8.3 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

本基金截至 2013 年 5 月 27 日未持有股票。

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金截至 2013 年 5 月 27 日未持有债券。

8.5 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

本基金截至 2013 年 5 月 27 日未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金截至 2013 年 5 月 27 日未持有资产支持证券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金截至 2013 年 5 月 27 日未持有权证。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.8.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	16,423,551.57
3	应收股利	-
4	应收利息	46,471.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	20,773.64
7	其他	-
8	合计	16,490,796.76

8.8.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金截至 2013 年 5 月 27 日未持有处于转股期的可转换债券。

8.8.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金截至 2013 年 5 月 27 日前十名股票中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

截至 2013 年 5 月 27 日，本基金暂无其他对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的住所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

（一）中国证监会《关于核准华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）募集的批复》；

（二）《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》；

（三）《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》；

（四）《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》；

（五）关于华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）募集之法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

华宸未来基金管理有限公司

二〇一三年五月二十九日