

华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 25 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 2014 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
7.7 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.....	40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末上市基金前十名持有人	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	43
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 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
场内简称	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	35,307,677.53 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.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》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,167,073.36
本期利润	-2,433,658.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0632
本期加权平均净值利润率	-7.27%
本期基金份额净值增长率	-6.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-4,746,463.72
期末可供分配基金份额利润	-0.1344
期末基金资产净值	30,561,213.81
期末基金份额净值	0.866
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-13.40%

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。

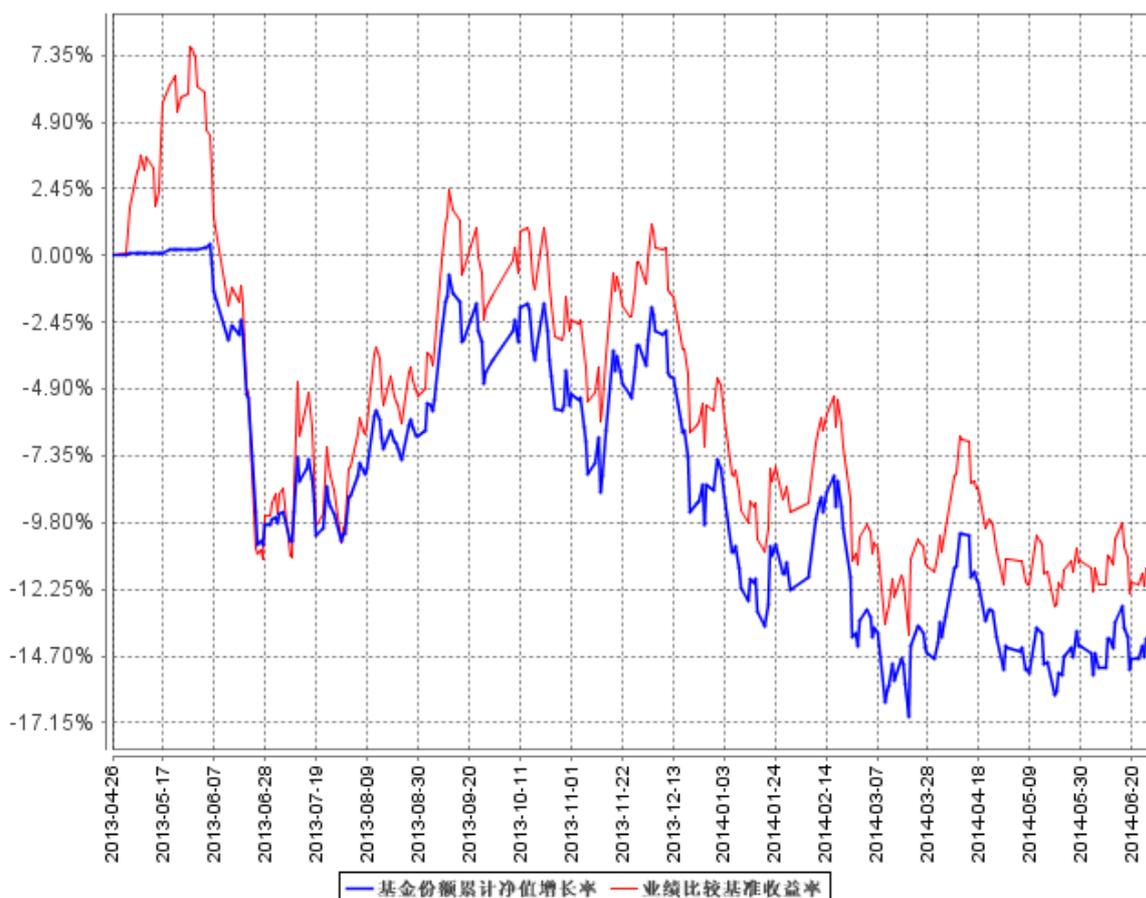
3.2 基金净值表现

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	1.05%	0.72%	0.39%	0.74%	0.66%	-0.02%
过去三个月	1.64%	0.81%	0.85%	0.83%	0.79%	-0.02%
过去六个月	-6.38%	0.96%	-6.70%	0.99%	0.32%	-0.03%
过去一年	-3.88%	0.96%	-1.44%	1.11%	-2.44%	-0.15%
自基金合同生效起至今	-13.40%	0.95%	-11.58%	1.17%	-1.82%	-0.22%

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 2014 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		
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。
蔡建文	本基金基金经理助理	2014 年 1 月 8 日	-	3	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。
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, 现任华宸未来基金管理有限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。

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合规守信情况的说明

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非公平交易的情况。

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

2014 年上半年，国际方面，美联储继续缩减 QE 规模，随着美国经济数据持续向好，股市不断走高。国内方面，在促进经济转型的指导思想下，经济短期下滑速度超出市场预期，股市表现不佳。经济增速向区间下限逼近催生了稳增长政策的出台，央行宣布扩大人民币汇率波动幅度，人民币贬值有利于出口的改善，并且央行连续两次对符合要求的金融机构定向降准。基建方面，加快了棚户区改造、铁路基建以及能源水利项目的推出。近期的经济数据显示，微刺激政策初见成效，经济逐步改善。上半年上证指数下跌 3.2%，深成指下跌 9.59%，创业板上涨 7.69%。

报告期内，本基金申购赎回情况较为平稳，以既定的指数化投资策略紧密跟踪标的指数，在控制跟踪误差的基础上，追求适度超越目标指数的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.866 元，本报告期份额净值增长率为 -6.38%，同期沪深 300 指数增长率为 -7.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年的经济增长目标定在 7.5%，由于一季度 GDP 的下滑以及二季度逐步企稳，上半年的经济增速可能低于预期，预期下半年会有更多的政策出台以保证经济的稳步运行，对下半年持相对乐观的态度。

房地产方面，许多地方政府基于土地财政的考虑，已经通过隐性放松限购等方式托底房地产市场。中央也强调了首套房需求，对地方政府放松限购等措施采取默许态度，房地产领域的风险已经有所缓解。

资金方面，下半年 A 股市场计划发行上市新股 100 家左右，平均每周 4 家，不会对存量资金形成较大的利空影响，从第一批上市公司来看，新股发行价格和募集规模受到较为严格的控制，参与新股发行的收益确定性较高，新股效应显著。而保险资金运用比例的放松、优先股和沪港通试点等政策的出台引进了长期资金，有利于明显低估的股票估值修复。

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

本基金于本报告期内未进行利润分配。

§ 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: 2014 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	2,401,185.23	2,389,962.24
结算备付金		-	65,544.43
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	28,401,870.42	35,281,271.25
其中: 股票投资		28,401,870.42	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	483.93	590.83
应收股利		-	-
应收申购款		-	592.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		30,803,539.58	37,737,961.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
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		20,069.00	26,389.44
应付托管费		3,762.93	4,948.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,672.79	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	6.4.7.8	211,821.05	245,000.00
负债合计		242,325.77	296,681.60
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	35,307,677.53	40,457,169.79
未分配利润	6.4.7.10	-4,746,463.72	-3,015,889.76
所有者权益合计		30,561,213.81	37,441,280.03
负债和所有者权益总计		30,803,539.58	37,737,961.63

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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2014年1月1日至 2014年6月30日	2013年4月26日(基金 合同生效日)至2013年6

			月 30 日
一、收入		-2,066,247.59	-4,196,552.11
1.利息收入		8,902.47	1,075,771.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,902.47	582,636.71
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		-	493,134.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-818,540.31	-2,677,459.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,190,216.75	-2,898,205.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	371,676.44	220,746.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,266,584.98	-2,871,922.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	9,975.23	277,058.61
减：二、费用		367,410.75	477,998.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	132,957.50	265,395.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,929.51	49,761.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	26,943.69	63,547.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	182,580.05	99,294.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,433,658.34	-4,674,550.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,433,658.34	-4,674,550.82

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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	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
项目	上年度可比期间 2013 年 4 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2013 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-4,674,550.82	-4,674,550.82
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)	51,788,379.27	-445,122.70	51,343,256.57
其中: 1.基金申购款	272,993,028.93	-3,382.93	272,989,646.00
2.基金赎回款	-221,204,649.66	-441,739.77	-221,646,389.43
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)	51,788,379.27	-5,119,673.52	46,668,705.75

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：

_____	_____	_____
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

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: $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率 (税后)}$ 。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	2,401,185.23
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	2,401,185.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,521,595.85	28,401,870.42	-2,119,725.43
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	30,521,595.85	28,401,870.42	-2,119,725.43

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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为零。

6.4.7.4.2 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通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	483.91
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	-
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	483.93

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,672.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,672.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	211,821.05
合计	211,821.05

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	40,457,169.79	40,457,169.79
本期申购	713,430.45	713,430.45
本期赎回(以“-”号填列)	-5,862,922.71	-5,862,922.71
- 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	35,307,677.53	35,307,677.53

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	-2,466,177.18	-549,712.58	-3,015,889.76
本期利润	-1,167,073.36	-1,266,584.98	-2,433,658.34
本期基金份额交易产生的变动数	388,347.25	314,737.13	703,084.38
其中：基金申购款	-49,911.54	-29,724.49	-79,636.03
基金赎回款	438,258.79	344,461.62	782,720.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,244,903.29	-1,501,560.43	-4,746,463.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	67.00
其他	-
合计	8,902.47

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,475,398.03
减：卖出股票成本总额	12,665,614.78
买卖股票差价收入	-1,190,216.75

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	371,676.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	371,676.44

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,266,584.98
——股票投资	-1,266,584.98
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

合计	-1,266,584.98
----	---------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,975.23
合计	9,975.23

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	26,943.69
银行间市场交易费用	-
合计	26,943.69

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	64,464.96
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	759.00
合计	182,580.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 债券交易

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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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。

6.4.10.1.4 权证交易

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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 4 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的管理费	132,957.50	265,395.21
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 4 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,929.51	49,761.60

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注: 本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 4 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2013 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	28.3300%	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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2013 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	2,401,185.23	8,835.47	4,429,465.14	578,008.36

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：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。

6.4.12.2 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

600637	百视通	2014年5月28日	重大事项	32.03	-	-	3,816	134,034.75	122,226.48	备注 1
600832	东方明珠	2014年5月28日	重大事项	10.98	-	-	9,985	72,029.47	109,635.30	备注 1
000009	中国宝安	2014年5月27日	重大事项	10.21	-	-	7,463	79,493.47	76,197.23	备注 1
000562	宏源证券	2013年10月30日	重大事项	8.22	-	-	8,800	72,928.00	72,336.00	备注 1
601669	中国电建	2014年5月12日	重大事项	2.79	-	-	22,231	69,336.24	62,024.49	备注 1
002570	贝因美	2014年6月18日	重大事项	14.36	-	-	3,385	72,987.34	48,608.60	备注 1
000960	锡业股份	2014年5月5日	重大事项	12.44	-	-	2,621	37,394.20	32,605.24	备注 1
000878	云南铜业	2014年4月16日	重大事项	7.61	-	-	4,071	43,132.31	30,980.31	-
000536	华映科技	2014年5月22日	重大事项	23.10	-	-	793	19,424.97	18,318.30	备注 1

注：因股票未恢复交易，截至本报告期末 6 月 30 日，复牌日期及复牌开盘单价未知。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.5 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。

6.4.12.6 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。

6.4.12.7 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。

6.4.12.7.1 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。

6.4.12.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,401,185.23	-	-	-	-	-	2,401,185.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-28,401,870.42	28,401,870.42
应收利息	-	-	-	-	-	483.93	483.93
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,401,185.23	-	-	-	-	-28,402,354.35	30,803,539.58
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,069.00	20,069.00
应付托管费	-	-	-	-	-	3,762.93	3,762.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,672.79	6,672.79
其他负债	-	-	-	-	-	211,821.05	211,821.05
负债总计	-	-	-	-	-	242,325.77	242,325.77
利率敏感度缺口	2,401,185.23	-	-	-	-	-28,160,028.58	30,561,213.81
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	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

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.7.1.2 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取的风险管理活动；		
	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（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	1、基准点利率增加 1 个基点	0.00	0.00
2、基准点利率减少 1 个基点	0.00	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。

6.4.12.7.2 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。

6.4.12.7.3 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。

6.4.12.7.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	28,401,870.42	92.93	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	28,401,870.42	92.93	35,281,271.25	94.23

6.4.12.7.3.2 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（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	1、业绩比较基准减少 1%	-278,821.51	-182,434.35
	2、业绩比较基准增加 1%	278,821.51	182,434.35

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 2014 年 6 月 30 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。

6.4.13 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 2014 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 28,401,870.42 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	28,401,870.42	92.20
	其中：股票	28,401,870.42	92.20
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	2,401,185.23	7.80
7	其他各项资产	483.93	0.00
8	合计	30,803,539.58	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	81,677.27	0.27
B	采矿业	1,584,039.27	5.18
C	制造业	10,377,813.93	33.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,026,768.50	3.36
E	建筑业	826,594.67	2.70
F	批发和零售业	719,567.26	2.35
G	交通运输、仓储和邮政业	669,604.52	2.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,162,625.57	3.80
J	金融业	9,484,851.70	31.04
K	房地产业	1,368,887.76	4.48
L	租赁和商务服务业	295,497.89	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	303,968.41	0.99
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	246,962.50	0.81
S	综合	227,120.21	0.74
	合计	28,375,979.46	92.85

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（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	25,890.96	0.08
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	-	-
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	25,890.96	0.08

7.3 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

7.3.1 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	601318	中国平安	28,375	1,116,272.50	3.65
2	600036	招商银行	93,455	956,979.20	3.13
3	600016	民生银行	144,858	899,568.18	2.94
4	601166	兴业银行	62,763	629,512.89	2.06
5	600000	浦发银行	63,997	579,172.85	1.90
6	600030	中信证券	47,895	548,876.70	1.80
7	000002	万科 A	65,546	542,065.42	1.77
8	000651	格力电器	15,482	455,944.90	1.49
9	600837	海通证券	47,247	432,310.05	1.41
10	601288	农业银行	145,118	365,697.36	1.20

11	600519	贵州茅台	2,545	361,339.10	1.18
12	000001	平安银行	34,685	343,728.35	1.12
13	601088	中国神华	23,055	335,219.70	1.10
14	601328	交通银行	86,215	334,514.20	1.09
15	600104	上汽集团	20,983	321,039.90	1.05
16	601398	工商银行	94,512	320,395.68	1.05
17	601601	中国太保	17,645	313,904.55	1.03
18	600887	伊利股份	9,209	305,002.08	1.00
19	601818	光大银行	109,100	277,114.00	0.91
20	601668	中国建筑	95,708	269,896.56	0.88
21	600383	金地集团	26,818	238,412.02	0.78
22	601169	北京银行	29,241	235,682.46	0.77
23	600111	包钢稀土	11,740	230,691.00	0.75
24	600048	保利地产	46,400	230,144.00	0.75
25	601006	大秦铁路	34,932	220,420.92	0.72
26	601939	建设银行	52,978	218,799.14	0.72
27	000333	美的集团	11,205	216,480.60	0.71
28	601857	中国石油	27,410	206,671.40	0.68
29	600585	海螺水泥	12,826	201,624.72	0.66
30	600015	华夏银行	24,369	199,825.80	0.65
31	600900	长江电力	32,023	199,183.06	0.65
32	601989	中国重工	40,223	193,874.86	0.63
33	000858	五粮液	10,471	187,745.03	0.61
34	002024	苏宁云商	28,187	184,906.72	0.61
35	600028	中国石化	32,649	172,060.23	0.56
36	000776	广发证券	17,435	170,863.00	0.56
37	000538	云南白药	3,192	166,622.40	0.55
38	600196	复星医药	8,125	164,043.75	0.54
39	600089	特变电工	18,905	160,503.45	0.53
40	600050	中国联通	49,609	160,237.07	0.52
41	000625	长安汽车	12,640	155,598.40	0.51
42	600011	华能国际	27,446	155,344.36	0.51
43	600276	恒瑞医药	4,616	153,066.56	0.50
44	600256	广汇能源	21,499	150,922.98	0.49
45	600690	青岛海尔	10,085	148,854.60	0.49
46	002241	歌尔声学	5,512	146,949.92	0.48
47	600518	康美药业	9,691	144,880.45	0.47
48	000725	京东方 A	66,481	144,263.77	0.47
49	600999	招商证券	14,196	143,521.56	0.47

50	600535	天士力	3,690	143,061.30	0.47
51	002594	比亚迪	2,987	141,852.63	0.46
52	000063	中兴通讯	10,527	138,114.24	0.45
53	600703	三安光电	5,744	134,581.92	0.44
54	601766	中国南车	29,678	133,551.00	0.44
55	000895	双汇发展	3,680	131,707.20	0.43
56	601899	紫金矿业	58,714	127,996.52	0.42
57	600886	国投电力	25,063	127,821.30	0.42
58	600795	国电电力	58,809	127,615.53	0.42
59	600637	百视通	3,816	122,226.48	0.40
60	600018	上港集团	27,446	122,134.70	0.40
61	601901	方正证券	22,457	121,941.51	0.40
62	600739	辽宁成大	7,983	121,581.09	0.40
63	601688	华泰证券	16,100	121,072.00	0.40
64	002415	海康威视	7,033	119,139.02	0.39
65	600406	国电南瑞	8,921	118,916.93	0.39
66	601628	中国人寿	8,737	118,910.57	0.39
67	600804	鹏博士	8,224	118,754.56	0.39
68	600019	宝钢股份	28,672	117,555.20	0.38
69	000157	中联重科	26,247	116,274.21	0.38
70	002008	大族激光	6,700	116,178.00	0.38
71	000338	潍柴动力	6,507	115,759.53	0.38
72	601299	中国北车	24,805	112,614.70	0.37
73	000069	华侨城 A	23,789	111,570.41	0.37
74	600832	东方明珠	9,985	109,635.30	0.36
75	600352	浙江龙盛	6,712	108,398.80	0.35
76	000100	TCL 集	47,445	108,174.60	0.35
77	601336	新华保险	5,106	107,889.78	0.35
78	601390	中国中铁	41,756	107,730.48	0.35
79	002456	欧菲光	4,973	106,571.39	0.35
80	600583	海油工程	14,390	106,054.30	0.35
81	000581	威孚高科	3,884	104,751.48	0.34
82	002450	康得新	4,534	103,148.50	0.34
83	000423	东阿阿胶	2,917	97,194.44	0.32
84	600332	白云山	3,868	96,274.52	0.32
85	600315	上海家化	2,622	96,096.30	0.31
86	600109	国金证券	4,802	95,415.74	0.31
87	600066	宇通客车	5,793	93,499.02	0.31
88	601988	中国银行	36,591	93,307.05	0.31

89	600309	万华化学	6,121	92,794.36	0.30
90	002236	大华股份	3,442	92,761.90	0.30
91	000783	长江证券	9,653	92,668.80	0.30
92	002304	洋河股份	1,815	92,111.25	0.30
93	600340	华夏幸福	3,628	91,316.76	0.30
94	600031	三一重工	18,106	91,254.24	0.30
95	601009	南京银行	11,363	90,904.00	0.30
96	002353	杰瑞股份	2,219	89,314.75	0.29
97	601186	中国铁建	18,735	86,368.35	0.28
98	000831	五矿稀土	4,109	86,206.82	0.28
99	600674	川投能源	7,324	85,983.76	0.28
100	000503	海虹控股	4,400	85,800.00	0.28
101	600547	山东黄金	5,501	85,155.48	0.28
102	002202	金风科技	8,862	84,100.38	0.28
103	000793	华闻传媒	7,154	84,059.50	0.28
104	000402	金融街	15,332	83,559.40	0.27
105	600150	中国船舶	3,952	83,229.12	0.27
106	000061	农产品	8,985	82,931.55	0.27
107	000826	桑德环境	3,622	82,762.70	0.27
108	601168	西部矿业	15,000	82,050.00	0.27
109	600893	航空动力	3,145	81,046.65	0.27
110	000963	华东医药	1,500	81,000.00	0.27
111	600489	中金黄金	10,617	80,689.20	0.26
112	002230	科大讯飞	3,016	80,225.60	0.26
113	600079	人福医药	2,653	79,192.05	0.26
114	600010	包钢股份	21,741	78,702.42	0.26
115	002475	立讯精密	2,400	78,672.00	0.26
116	002400	省广股份	3,200	78,656.00	0.26
117	000970	中科三环	6,610	78,526.80	0.26
118	002081	金螳螂	5,517	78,120.72	0.26
119	600549	厦门钨业	3,065	77,851.00	0.25
120	601377	兴业证券	8,938	77,045.56	0.25
121	002065	东华软件	3,827	76,999.24	0.25
122	000768	中航飞机	7,277	76,626.81	0.25
123	000060	中金岭南	11,221	76,302.80	0.25
124	600362	江西铜业	6,218	76,294.86	0.25
125	000009	中国宝安	7,463	76,197.23	0.25
126	002038	双鹭药业	1,691	75,367.87	0.25
127	600600	青岛啤酒	1,874	75,072.44	0.25

128	002465	海格通信	4,700	74,871.00	0.24
129	600009	上海机场	5,777	74,523.30	0.24
130	601998	中信银行	17,447	74,498.69	0.24
131	603000	人民网	1,870	73,285.30	0.24
132	600839	四川长虹	23,634	72,792.72	0.24
133	000562	宏源证券	8,800	72,336.00	0.24
134	600660	福耀玻璃	8,594	72,189.60	0.24
135	000024	招商地产	6,894	71,835.48	0.24
136	601607	上海医药	5,760	71,596.80	0.23
137	601808	中海油服	4,020	70,711.80	0.23
138	000039	中集集团	5,210	70,126.60	0.23
139	600085	同仁堂	4,016	69,998.88	0.23
140	600705	中航投资	4,312	69,293.84	0.23
141	000623	吉林敖东	4,441	68,924.32	0.23
142	000917	电广传媒	4,500	68,535.00	0.22
143	600100	同方股份	7,609	67,796.19	0.22
144	600372	中航电子	2,982	67,601.94	0.22
145	000629	攀钢钒钛	32,344	67,275.52	0.22
146	601117	中国化学	12,911	67,266.31	0.22
147	601933	永辉超市	10,625	67,150.00	0.22
148	601098	中南传媒	4,631	66,871.64	0.22
149	601991	大唐发电	18,703	66,582.68	0.22
150	601600	中国铝业	21,667	65,867.68	0.22
151	600649	城投控股	10,440	65,772.00	0.22
152	600252	中恒集团	5,574	65,383.02	0.21
153	600177	雅戈尔	9,291	65,315.73	0.21
154	600271	航天信息	3,120	65,114.40	0.21
155	600642	申能股份	14,742	63,685.44	0.21
156	601929	吉视传媒	5,500	62,920.00	0.21
157	000983	西山煤电	11,863	62,518.01	0.20
158	600118	中国卫星	3,379	62,443.92	0.20
159	601633	长城汽车	2,468	62,440.40	0.20
160	601669	中国电建	22,231	62,024.49	0.20
161	000400	许继电气	3,088	61,914.40	0.20
162	600867	通化东宝	4,700	61,241.00	0.20
163	600741	华域汽车	6,244	61,066.32	0.20
164	600718	东软集团	4,435	59,828.15	0.20
165	600221	海南航空	35,682	59,588.94	0.19
166	002422	科伦药业	1,489	59,336.65	0.19

167	600369	西南证券	6,856	58,618.80	0.19
168	002142	宁波银行	6,361	58,521.20	0.19
169	600597	光明乳业	3,593	57,631.72	0.19
170	000728	国元证券	6,087	57,461.28	0.19
171	000568	泸州老窖	3,482	57,035.16	0.19
172	600153	建发股份	10,207	55,628.15	0.18
173	000012	南玻 A	7,998	54,626.34	0.18
174	600166	福田汽车	10,704	54,590.40	0.18
175	601800	中国交建	14,376	54,053.76	0.18
176	000598	兴蓉投资	11,241	53,619.57	0.18
177	600027	华电国际	17,353	53,273.71	0.17
178	601699	潞安环能	6,931	52,606.29	0.17
179	002385	大北农	4,625	52,540.00	0.17
180	601018	宁波港	23,055	52,334.85	0.17
181	000792	盐湖股份	3,466	52,232.62	0.17
182	600068	葛洲坝	13,973	51,839.83	0.17
183	600267	海正药业	3,463	51,356.29	0.17
184	600880	博瑞传播	4,300	50,912.00	0.17
185	000729	燕京啤酒	7,811	50,771.50	0.17
186	000425	徐工机械	7,371	50,491.35	0.17
187	601333	广深铁路	19,838	50,388.52	0.16
188	601888	中国国旅	1,525	50,386.00	0.16
189	002410	广联达	1,900	50,236.00	0.16
190	600827	友谊股份	4,549	49,948.02	0.16
191	601618	中国中冶	28,827	49,294.17	0.16
192	601555	东吴证券	6,852	48,786.24	0.16
193	002007	华兰生物	1,867	48,728.70	0.16
194	002570	贝因美	3,385	48,608.60	0.16
195	601898	中煤能源	11,956	48,182.68	0.16
196	600029	南方航空	20,637	47,671.47	0.16
197	600588	用友软件	3,372	47,444.04	0.16
198	600348	阳泉煤业	8,367	47,189.88	0.15
199	600863	内蒙华电	12,439	46,895.03	0.15
200	600008	首创股份	7,567	46,764.06	0.15
201	000800	一汽轿车	4,867	46,723.20	0.15
202	600060	海信电器	4,749	45,827.85	0.15
203	600208	新湖中宝	15,679	45,782.68	0.15
204	600655	豫园商城	6,219	45,771.84	0.15
205	002129	中环股份	2,400	45,768.00	0.15

206	000999	华润三九	2,487	45,735.93	0.15
207	600108	亚盛集团	8,269	45,727.57	0.15
208	601928	凤凰传媒	4,862	45,119.36	0.15
209	600316	洪都航空	2,630	44,946.70	0.15
210	002001	新和成	3,594	44,529.66	0.15
211	600688	上海石化	13,364	43,967.56	0.14
212	000778	新兴铸管	11,760	43,629.60	0.14
213	601866	中海集运	20,162	42,541.82	0.14
214	600648	外高桥	1,576	41,984.64	0.14
215	600415	小商品城	8,320	41,849.60	0.14
216	002344	海宁皮城	3,342	41,674.74	0.14
217	000709	河北钢铁	22,093	41,092.98	0.13
218	000876	新希望	3,604	40,689.16	0.13
219	600875	东方电气	3,380	40,120.60	0.13
220	600497	驰宏锌锗	4,306	39,658.26	0.13
221	000686	东北证券	5,501	39,442.17	0.13
222	600873	梅花生物	7,578	38,875.14	0.13
223	601179	中国西电	10,600	37,842.00	0.12
224	600143	金发科技	8,562	37,758.42	0.12
225	000839	中信国安	4,897	37,217.20	0.12
226	601992	金隅股份	6,608	37,136.96	0.12
227	601118	海南橡胶	5,855	35,949.70	0.12
228	000960	锡业股份	2,621	32,605.24	0.11
229	000878	云南铜业	4,071	30,980.31	0.10
230	000536	华映科技	793	18,318.30	0.06
231	600277	亿利能源	2,400	15,600.00	0.05
232	002269	美邦服饰	1,706	14,176.86	0.05

7.3.2 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	002069	獐子岛	1,852	25,890.96	0.08

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	002049	同方国芯	478,008.05	1.28
2	000002	万 科 A	418,550.00	1.12
3	002052	同洲电子	354,000.00	0.95
4	601818	光大银行	274,932.00	0.73
5	601318	中国平安	239,953.00	0.64
6	000858	五 粮 液	212,940.00	0.57
7	600261	阳光照明	180,000.00	0.48
8	600519	贵州茅台	138,720.00	0.37
9	600383	金地集团	128,600.00	0.34
10	600340	华夏幸福	124,505.00	0.33
11	002008	大族激光	110,751.00	0.30
12	600018	上港集团	90,668.00	0.24
13	000831	五矿稀土	87,784.00	0.23
14	000503	海虹控股	86,548.00	0.23
15	600030	中信证券	82,944.00	0.22
16	601088	中国神华	79,970.00	0.21
17	601168	西部矿业	78,600.00	0.21
18	002456	欧 菲 光	77,679.00	0.21
19	002475	立讯精密	75,504.00	0.20
20	002400	省广股份	74,912.00	0.20

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	002049	同方国芯	425,051.00	1.14
2	000002	万 科 A	416,840.66	1.11
3	002052	同洲电子	374,700.00	1.00
4	002376	新 北 洋	348,300.00	0.93
5	600016	民生银行	282,932.27	0.76

6	600036	招商银行	263,590.18	0.70
7	601818	光大银行	261,220.73	0.70
8	601318	中国平安	242,717.54	0.65
9	000858	五粮液	233,655.39	0.62
10	601166	兴业银行	199,002.58	0.53
11	600519	贵州茅台	192,164.38	0.51
12	600000	浦发银行	183,453.83	0.49
13	600383	金地集团	179,321.71	0.48
14	000876	新希望	174,057.78	0.46
15	600261	阳光照明	164,007.00	0.44
16	600837	海通证券	159,407.95	0.43
17	601601	中国太保	149,377.26	0.40
18	600340	华夏幸福	143,397.60	0.38
19	600030	中信证券	133,091.84	0.36
20	000001	平安银行	116,522.00	0.31

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	7,052,798.93
卖出股票收入（成交）总额	11,475,398.03

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 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

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

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于 2013 年 10 月 15 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”）近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（〔2013〕48 号）。中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）决定责令平安证券改正及给予警告，没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐业务许可 3 个月。

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	483.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	483.93

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
513	68,825.88	10,501,250.00	29.74%	24,806,427.53	70.26%

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	王奇华	800,046.00	15.54%
2	江苏伟业安装集团有限公司	500,000.00	9.71%
3	王云	449,026.00	8.72%
4	陈方	250,007.00	4.86%
5	孙岚	200,628.00	3.90%
6	孙坚	182,005.00	3.54%
7	陈颐仙	167,001.00	3.24%
8	朱汉华	150,018.00	2.91%
9	刘筱	150,014.00	2.91%
10	陈蕾颖	132,017.00	2.56%

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	54,459.27	0.1542%

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、基金投资和研发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	28.33	10,001,250.00	28.33	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	28.33	10,001,250.00	28.33	-
----	---------------	-------	---------------	-------	---

§ 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	40,457,169.79
本报告期基金总申购份额	713,430.45
减：本报告期基金总赎回份额	5,862,922.71
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	35,307,677.53

§ 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人于 2014 年 2 月 27 日发布任免公告，刘勇先生不再担任中信银行资产托管部总经理，任命刘泽云先生为中信银行资产托管部副总经理，主持资产托管部相关工作。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产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	10,905,471.76	58.91%	7,747.24	58.91%	-
中信证券	2	7,605,593.25	41.09%	5,403.08	41.09%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 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	华宸未来基金管理有限公司关于旗下证券投资基金 2013 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014 年 1 月 2 日
2	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 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014 年 1 月 20 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 年度报告&年报摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014 年 3 月 26 日
4	华宸未来沪深 300 指数增强型发起	中国证监会指定报	2014 年 4 月 22 日

	式证券投资基金 (LOF) 2014 年第 1 季度报告	刊及本公司网站	
5	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014 年 4 月 30 日
6	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 (2014 年第 1 号)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014 年 5 月 30 日
7	华宸未来基金管理有限公司关于基金经理申蕾休假由他人代为履行职责的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 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 8 月 25 日