

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

2014 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：2015 年 3 月 31 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 3 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。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	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	19,209,333.83 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	向旭平	方韡
	联系电话	021-26066909	010-89936330
	电子邮箱	xiangxp@hcmiraefund.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

## § 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	2014 年	2013 年 4 月 26 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日	2012 年
本期已实现收益	1,164,474.59	-2,387,220.46	-
本期利润	10,367,916.68	-3,240,360.91	-
加权平均基金份额本期利润	0.3089	-0.0402	-
本期基金份额净值增长率	51.24%	-7.50%	-
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0144	-0.0745	-
期末基金资产净值	26,882,161.09	37,441,280.03	-
期末基金份额净值	1.399	0.925	-

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。

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

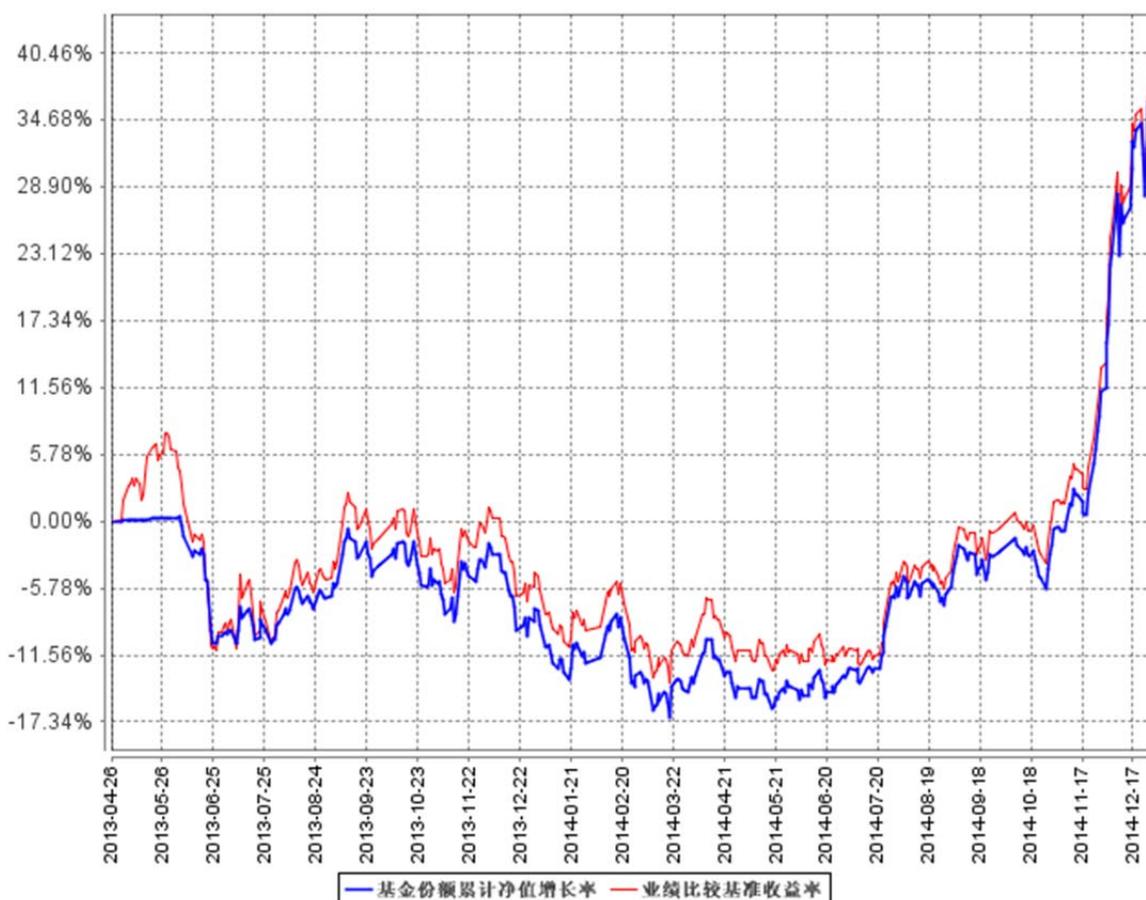
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	43.63%	1.59%	41.63%	1.56%	2.00%	0.03%
过去六个月	61.55%	1.27%	59.36%	1.26%	2.19%	0.01%
过去一年	51.24%	1.15%	48.69%	1.15%	2.55%	0.00%
自基金合同生效起至今	39.90%	1.08%	40.91%	1.21%	-1.01%	-0.13%

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



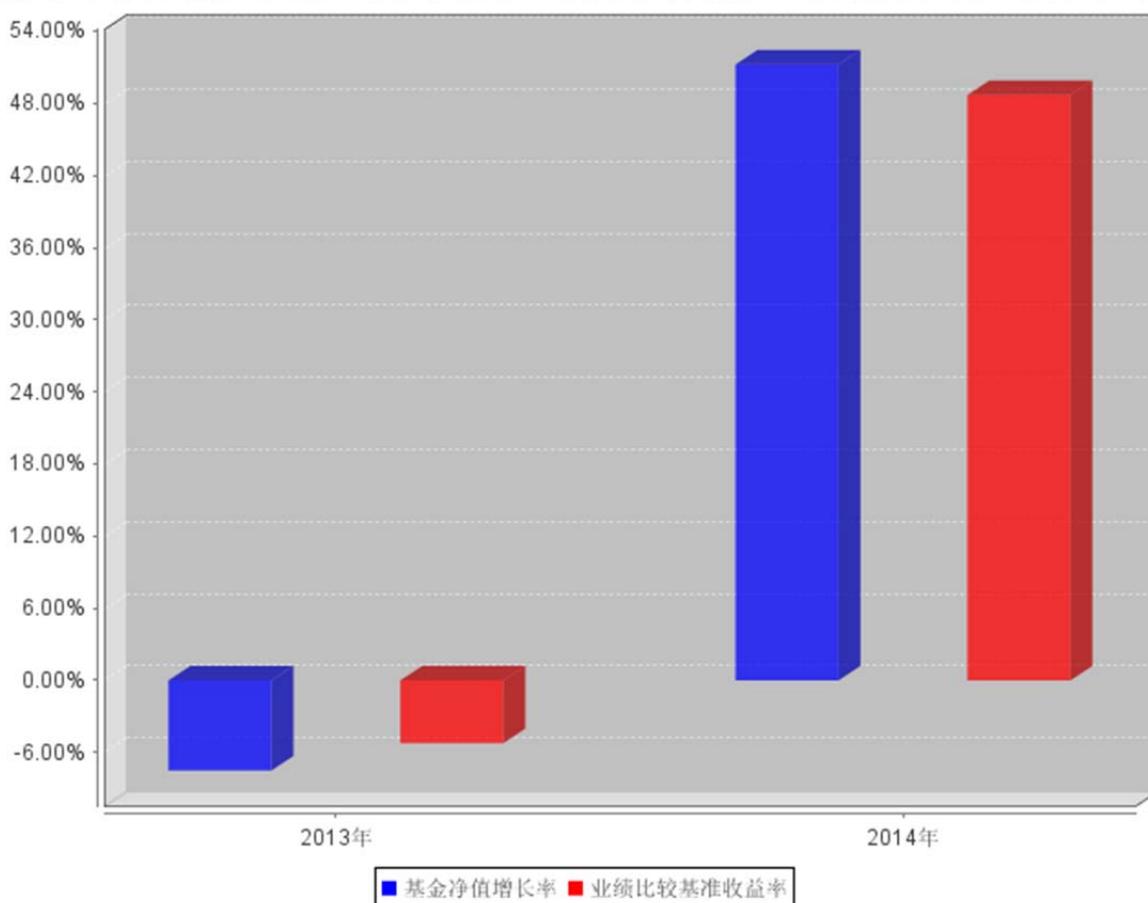
注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%；

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 12 月 31 日。

本基金自基金合同生效日至本报告期末已满一年。

### 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 2014 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		
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
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 基金基金经理。
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。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。
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。

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非公平交易的情况。

#### 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

2014 年的中国股市上半年的主角为“小盘股”，而到了下半年唱主角为“大盘股”，特别是从十月开始，出现极端的“一九现象”，即大金融、大基建等少数的大盘股加速上涨。上半年市场的结构性特征很明显，创业板综指上涨 15.31%，上证综指横盘略微下跌 3.2%。经济调结构、改革深化、并购重组等多种因素影响下，各类主题性投资板块在上半年轮番表现，然而创业板本身内部也分化严重，2013 年表现较好的创业板蓝筹在 2014 年表现较差，而创业板小市值的个股具备壳资源和重组预期，表现最为靓丽，平均涨幅在 50%以上。而到了下半年，市场的热点开始逐步转向大盘蓝筹，上证综指上涨 57.92%。受益于高铁的出口，以高铁为代表的铁路设备和基建相关个股率先引领大盘蓝筹的启动，之后随着“一带一路”战略日益清晰，国内产能过剩的产业如

钢铁、水泥、建筑企业有望通过产能输出带来业绩增量，以建筑为代表的上下游产业链个股大幅上涨；“沪港通”成为了大盘股上涨的催化剂。而自贸区的扩围又使得公路、港口等公司带来“流量”的预期；在无风险利率的下降和降息周期的开启之后，以银行、地产等利率敏感性行业将蓝筹股的行情点燃，而随着市场成交量的大幅上升，多家券商公布再融资、融资融券余额的节节攀升等多重利好的叠加，券商股的连续拉升将市场的行情推向高潮。

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 2014 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.399 元，本报告期份额净值增长率为 51.24%，同期基金业绩基准表现为 48.69%，超越业绩基准 2.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 2015 年中国经济的增速将从 7.5%左右的平台下行到 7.1%附近。经济的回落，A 股的盈利增速预计也将相应下降，预计在 7%左右。国内市场投资方面仍以基建增量来冲抵地产投资的下滑，而出口主要通过“一带一路”来转移国内过剩的传统行业的产能。中国“宽财政、宽货币”的政策组合拳已经打出，预计明年央行还将降准 2 次、降息 1 次，社会的名义利率和实际利率仍将进一步下行。

从证券市场来看，2015 年的 A 股市场将会是“均衡市”，即主板市场和创业板市场各有机会，但分化和波动会很大。增量资金的不断流入为 A 股市场带来活水。20 万亿的银行理财和 46 万亿的储蓄将因无风险收益率的下降而形成资产的再配置流入股市，同时沪港通和深港通的开通和即将开通，RQFII 和 QFII 额度的扩大也将导入市场。货币宽松、资金充裕和改革加速将是推动 2015 年市场的三大合力，市场更加均衡化，大盘蓝筹已经从 1 倍以下的 PB 修复，过去两个月的时间使得很多大盘蓝筹股上涨 2-3 倍，估值已经趋于合理。在改革的驱动下，代表新兴产业的成长股会出现明显的分化，强者恒强。

从行业配置上看，2015 年以大金融、地产、建筑、家电、汽车、机械作为基本配置，而逐步优选和增配“安全、智能、绿色、品质”趋势下的新成长行业，如互联网金融、移动医疗、信息安全、农业信息化、智能家居等。同时紧抓改革创新的大逻辑，重点关注国企改革。

#### 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发生利润分配。

#### 4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.9 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（2015）第 130238 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 2014 年 12 月 31 日的资产负债表和 2014 年度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	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。 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。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	高 飞	谢忆韞
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	2015 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：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款		1,784,681.22	2,389,962.24
结算备付金		2,655.50	65,544.43
存出保证金		-	-
交易性金融资产		25,511,914.88	35,281,271.25
其中：股票投资		25,511,914.88	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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		28,168.53	-
应收利息		440.66	590.83
应收股利		-	-
应收申购款		96,837.95	592.88
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		27,424,698.74	37,737,961.63

负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,089.79	-
应付赎回款		198,797.10	-
应付管理人报酬		16,960.60	26,389.44
应付托管费		3,180.13	4,948.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		16,230.37	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		295,279.66	245,000.00
负债合计		542,537.65	296,681.60
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		19,209,333.83	40,457,169.79
未分配利润		7,672,827.26	-3,015,889.76
所有者权益合计		26,882,161.09	37,441,280.03
负债和所有者权益总计		27,424,698.74	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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	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
<b>一、收入</b>		11,097,057.84	-2,115,625.59
1.利息收入		16,191.55	1,131,133.80
其中：存款利息收入		16,191.55	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）		1,796,710.04	-3,273,009.96

其中：股票投资收益		1,032,908.00	-3,722,645.07
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		763,802.04	449,635.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		9,203,442.09	-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）		80,714.16	879,391.02
<b>减：二、费用</b>		729,141.16	1,124,735.32
1. 管理人报酬		248,308.08	435,509.33
2. 托管费		46,557.71	81,658.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		65,115.64	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		369,159.73	468,908.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,367,916.68	-3,240,360.91
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,367,916.68	-3,240,360.91

### 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	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）	-	10,367,916.68	10,367,916.68



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2014年12月31日的财务状况以及2014年全年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 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。

#### 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 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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 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。

###### 7.4.8.1.2 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。

###### 7.4.8.1.3 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。

#### 7.4.8.1.4 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。

#### 7.4.8.1.5 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未通过关联方交易单元进行交易。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 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12月31日	2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	248,308.08	435,509.33
其中：支付销售机构的客户维护费	62,205.40	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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	46,557.71	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。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

### 7.4.8.3 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。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 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
----	----	---------

	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年4月26日(基金合同生效日)至2013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	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%	24.7200%

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。

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。

#### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	1,784,681.22	16,062.70	2,389,962.24	614,506.99

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 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。

### 7.4.9.2 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
000562	宏源证券	2014年12月9日	临时停牌	30.50	-	-	5,315	44,046.86	162,107.50	-
600649	城投控股	2014年10月31日	临时停牌	7.23	-	-	8,135	59,750.54	58,816.05	-
600332	白云山	2014年12月3日	临时停牌	27.11	2015年1月13日	29.82	2,042	66,678.23	55,358.62	-

注：1、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。

2、000562 宏源证券自 2015 年 1 月 26 日起终止上市。申万宏源换股吸收宏源证券的换股股权登记日为 2015 年 1 月 23 日，换股股权登记日收市后宏源证券的股东持有的宏源证券股票将按照 2.049382716 的比例转换为申万宏源 A 股股票，即每 1 股本宏源证券换 2.049382716 股申万宏源 A 股股票。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.9.3.2 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。

### 7.4.10 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	25,511,914.88	93.03
	其中：股票	25,511,914.88	93.03

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	1,787,336.72	6.52
7	其他各项资产	125,447.14	0.46
8	合计	27,424,698.74	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	52,860.06	0.20
B	采矿业	1,067,396.76	3.97
C	制造业	7,175,678.95	26.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	918,589.53	3.42
E	建筑业	1,517,891.79	5.65
F	批发和零售业	330,146.73	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	661,941.84	2.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	988,076.26	3.68
J	金融业	10,433,213.61	38.81
K	房地产业	1,390,713.62	5.17
L	租赁和商务服务业	246,858.04	0.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	523,705.85	1.95
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	125,247.12	0.47

S	综合	-	-
	合计	25,432,320.16	94.61

### 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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,594.72	0.30
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	79,594.72	0.30

### 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

#### 8.3.1 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	14,562	1,087,927.02	4.05
2	600016	民生银行	82,898	901,930.24	3.36
3	600036	招商银行	50,761	842,124.99	3.13
4	600030	中信证券	23,519	797,294.10	2.97
5	600000	浦发银行	37,979	595,890.51	2.22
6	601166	兴业银行	34,468	568,722.00	2.12
7	600837	海通证券	22,676	545,584.56	2.03
8	601668	中国建筑	59,296	431,674.88	1.61
9	000002	万科A	30,898	429,482.20	1.60
10	601328	交通银行	47,385	322,218.00	1.20

### 8.3.2 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	601991	大唐发电	11,569	79,594.72	0.30

### 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	000826	桑德环境	202,663.00	0.54
8	002475	立讯精密	182,105.74	0.49
9	600261	阳光照明	180,000.00	0.48
10	600588	用友软件	179,314.00	0.48
11	300070	碧水源	163,990.00	0.44

12	600340	华夏幸福	150,355.00	0.40
13	601186	中国铁建	149,121.00	0.40
14	002065	东华软件	144,184.03	0.39
15	600519	贵州茅台	138,720.00	0.37
16	601668	中国建筑	133,426.00	0.36
17	600383	金地集团	130,410.00	0.35
18	002400	省广股份	124,571.00	0.33
19	600104	上汽集团	122,974.00	0.33
20	601158	重庆水务	119,860.00	0.32

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	899,542.58	2.40
2	600036	招商银行	769,180.00	2.05
3	000002	万科A	760,088.37	2.03
4	600016	民生银行	734,835.80	1.96
5	600030	中信证券	566,486.16	1.51
6	601166	兴业银行	523,580.52	1.40
7	600000	浦发银行	518,686.18	1.39
8	600837	海通证券	516,316.16	1.38
9	000651	格力电器	444,441.82	1.19
10	002049	同方国芯	425,051.00	1.14
11	601818	光大银行	416,043.63	1.11
12	600519	贵州茅台	400,430.74	1.07
13	002052	同洲电子	374,700.00	1.00
14	601601	中国太保	353,361.48	0.94
15	002376	新北洋	348,300.00	0.93
16	000858	五粮液	325,388.61	0.87
17	000001	平安银行	321,246.13	0.86
18	600383	金地集团	297,558.45	0.79
19	002024	苏宁云商	290,238.32	0.78
20	600887	伊利股份	282,127.05	0.75

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	10,684,661.05
卖出股票收入（成交）总额	30,690,367.51

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。

### 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

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

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回收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。

### 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	28,168.53
3	应收股利	-
4	应收利息	440.66
5	应收申购款	96,837.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,447.14

### 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
311	61,766.35	10,001,250.00	52.06%	9,208,083.83	47.94%

### 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	孙岚	200,628.00	21.81%
2	陈颐仙	152,011.00	16.53%
3	刘淑英	58,710.00	6.38%
4	韦小美	34,002.00	3.70%
5	黄玮	30,001.00	3.26%
6	何赛娟	29,900.00	3.25%
7	夏超	28,400.00	3.09%
8	邓颖丽	28,000.00	3.04%
9	梁小红	20,518.00	2.23%
10	郝瑞青	20,001.00	2.17%
10	蒋雪峰	20,001.00	2.17%

### 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	0.00	0.0000%

9.4 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 究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

9.5 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	52.06	10,001,250.00	52.06	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	52.06	10,001,250.00	52.06	-

§ 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	40,457,169.79
本报告期基金总申购份额	5,936,717.80
减：本报告期基金总赎回份额	27,184,553.76
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	19,209,333.83

## § 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

2014年8月22日,经华宸未来基金管理有限公司股东会第九次会议决议通过,选举向旭平先生为公司股东董事,刘晓兵先生不再担任公司董事职务。

2014年9月19日,经华宸未来基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议决议通过,推选向旭平先生担任公司董事长,刘晓兵先生不再担任公司董事长职务。

2014年11月25日,经华宸未来基金管理有限公司第一届董事会第十七次会议决议通过,兰飞燕先生辞去公司督察长的职务。

2014年12月16日,经华宸未来基金管理有限公司第一届董事会第二十次会议决议通过,推选董事长向旭平先生代为履行督察长职务。

#### (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,本基金托管人于2014年2月27日发布任免公告,因工作需要,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。刘泽云先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券监督管理委员会备案。

### 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,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执,根据 2014 年 6 月 27 日送达的仲裁会裁决,基金管理人于 2014 年 7 月 14 日向上海市虹口区人民法院提起诉讼,并于 2014 年 10 月 31 日收到一审判决书。基金管理人已于 2014 年 11 月 11 日向上海市第二中级人民法院提起上诉,截至 2014 年 12 月 31 日,尚未收到相关判决。

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。

### 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，本基金聘请立信会计师事务所（特殊普通合伙）负责本基金审计业务。本报告期内本基金应付审计费 35,000 元。

### 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	14,895,816.13	36.02%	10,582.10	36.02%	-
民生证券	1	26,462,080.58	63.98%	18,798.59	63.98%	-

#### 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
中信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 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3月31日