华宸未来基金管理有限公司
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

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

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2013年1月18日证监许可〔2013〕49号文核准募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金为发起式基金，在基金募集时，基金管理人将运用公司固有资金认购本基金的金额不低于1000万元，认购的基金份额持有期限不低于三年。但发起资金（本公司固有资金）对本基金的发起认购，并不代表对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证，发起资金也并不用于对投资者投资亏损的补偿，投资人及发起份额认购人均自行承担投资风险。基金成立之日起三年后的对应日，若本基金的资产规模低于2亿元，基金合同将自动终止，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

一、绪言

《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》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“基金法”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“运作办法”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“销售办法”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“信息披露办法”）、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》和其他有关法律法规的规定以及《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》（以下简称“基金合同”或“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由华宸未来基金管理有限公司负责解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）

2、基金管理人：指华宸未来基金管理有限公司

3、基金托管人：指中信银行股份有限公司

4、基金合同：指《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》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《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》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《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》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施并于2012年6月19日发布修订后的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

17、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

19、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

20、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

21、销售机构：指直销机构及代销机构

22、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

23、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。注册登记机构为华宸未来基金管理有限公司或接受其委托代为办理登记业务的机构。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

24、基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

25、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

26、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

27、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

28、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

29、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

30、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

31、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

32、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

33、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

34、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

35、《业务规则》：指《深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》及后续修订版本和销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则

36、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

37、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

38、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

39、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有由基金管理人管理的某一基金的基金的全部或部分份额转换为基金管理人管理的，由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

40、转托管：指系统内转托管及跨系统转登记的总称

41、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

42、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%

43、元：指人民币元

44、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

45、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

46、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

47、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

48、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

49、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

50、上市交易：基金合同生效后投资人通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

51、场外：通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

52、场内：通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

53、注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

54、证券登记结算系统：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

55、场外份额：登记在注册登记系统下的基金份额

56、场内份额：登记在证券登记结算系统下的基金份额

57、系统内转托管：基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为

58、跨系统转托管：基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为

59、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

60、发起式基金：指符合法律法规规定，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金

61、发起资金：指符合相关法律法规规定，由基金公司股东资金、公司固有资金，或公司高级管理人员、基金经理等投资管理人员出资认购发起式基金份额的资金总额

62、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构

63、发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

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、办公地址：上海市虹口区四川北路859号中信广场16层

4、法定代表人：刘晓兵

5、设立时间：2012年6月20日

6、批准设立机关及批准设立文号：证监许可〔2012〕370号

7、组织形式：有限责任公司

8、注册资本：2亿元人民币

9、联系人：王颖

10、电话：021-26066999

11、传真：021-65870287

12、客户服务电话：400-920-0699

13、公司网址：www.hcmirae.com

14、股权结构：华宸信托有限责任公司（以下简称“华宸信托”）、韩国未来资产基金管理公司和咸阳步长医药科技发展有限公司

（二）主要人员情况

1、董事会成员

刘晓兵：董事长，男，民盟党员，北京大学中国经济研究中心高级经理工商管理硕士（EMBA）毕业。现任华宸信托有限责任公司董事长，历任湘财证券常务副总经理、上海仪电控股董事长助理、华鑫证券代理总经理、东方信能执行总裁、南方建材独立董事、湖南华菱钢铁总经理助理。

甄学军：董事，男，中共党员，先后毕业于内蒙古农业大学、大连理工大学，经济学和法学双学士。现任华宸信托总经理，曾任内蒙古农业大学农经系教师、团总支书记，1991年11月起，就职于华宸信托有限责任公司，历任业务二部副经理、信贷管理部副经理、经理、公司副总经理。

阙水深：董事，男，中共党员，厦门大学经济学（金融学）博士。先后任光大证券固定收益总部总经理、财富证券副总裁、湘財三星基金管理有限公司筹备组组长等。

辛炯官：董事，男，韩国籍，具有十九年的国内外投资等业务经验，自1992年12月起2008年1月为止在韩国第一大机构投资者三星人寿从事企业贷款、项目融资、社会基础设施投资、资产配资、国内外私募股权投资、国内外风险投资及海外战略事宜等金融资本市场核心业务。而自2008年起迄今在韩国未来资产基金管理公司负责中国市场开拓业务。1995和2006年参加过由韩国金融研修院、韩国债券研究所、首尔大学经营研究所等主办的深层的专业人员及高管人员所需要的投资及金融专业培训。

谭向东：独立董事，男，中共党员，经济学（金融学）博士。先后任北京证券总裁；联合证券常务副总裁；宝盈基金管理公司董事长；城市国际信托投资公司董事长等。

康书生：独立董事，男，中共党员，厦门大学经济学（金融学）博士，教授，博士生导师。现任河北大学副校长。

胡奕明：独立董事，女，博士学位，1991年起先后任厦门大学会计系副教授、厦门大学工商管理中心副教授、上海财经大学会计学院教授、研究院副院长；2005年起任上海交通大学安泰经济与管理学院财务研究中心主任。2006年参加中国证监会组织的证券公司董事及高管培训；2008年参加上海证券交易所组织的上市公司独立董事任职资格培训。

2、公司高管人员

刘晓兵：董事长，男，北京大学中国经济研究中心高级经理工商管理硕士（EMBA）毕业。现任华宸信托有限责任公司董事长，历任湘財证券常务副总经理、上海仪电控股董事长助理、华鑫证券代理总经理、东方信能执行总裁、南方建材独立董事、湖南华菱钢铁总经理助理。

阙水深：总经理，男，中共党员，厦门大学经济学（金融学）博士。先后任光大证券固定收益总部总经理、财富证券副总裁、湘財三星基金管理有限公司筹备组组长等。

兰飞燕：督察长，男，东北财经大学经济学硕士。具有15年金融证券行业工作经历，历任联合证券投资银行部项目经理、深圳发展银行公司业务部高级经理、南方证券研究员、中国建银投资证券高级研究员等职务。

3、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。

4、投资决策委员会成员

本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

主任委员：公司总经理阙水深；委员：投资副总监兼研究总监宋磊，金融工程部总监兼基金经理王宇，基金经理王骏。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照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收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、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者实施其他法律行为；

12、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规行为的发生。

2、基金管理人承诺防止以下禁止性行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；

（3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

（2）独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

（3）相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

（4）有效性原则。公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过对工作流程的控制，进而实现对各项经营风险的控制。

（5）防火墙原则。公司的投资管理、基金运作、计算机技术系统等相关部门，在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序和监督处罚措施。

（6）适时性原则。公司内部风险控制制度的制定，应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

2、内部控制的主要内容

（1）控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。本公司在董事会下设立了审计与风险控制委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估，对公司监察稽核制度的有效性进行评价，监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评价公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和运行的会计标准。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会，就基金投资等发表专业意见及建议。另外，在公司高级管理层下设立了风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行研究，制定相应的控制制度，并实行相关的风险控制措施。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

（2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

（3）操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

（4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

（5）监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行监督、稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

成立时间：1987年4月7日

组织形式：股份有限公司

注册资本：467.873亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函〔1987〕14号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字〔2004〕125号

联系人：托管中心

电话/传真：010-65550832

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

中信银行（601998.SH，0998.HK）成立于1987年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而重声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于2005年8月，正式更名“中信银行”。2006年12月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。经过二十年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009年，中信银行通过了美国SAS70内部控制审订并获得无保留意见的SAS70审订报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

2、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，中信银行总行资产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。

3、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。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中信银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行警示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

名称：华宸未来基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区四川北路859号中信广场16层

办公地址：上海市虹口区四川北路859号中信广场16层

法定代表人：刘晓兵

联系人：王颖

电话：021-26066999

传真：021-65870287

客户服务电话：400-920-0699

2、代销机构

名称：中信银行股份有限公司

注册地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

本基金的其他代销机构详见发售公告。

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：金颖

办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层

电话：010-58598853

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

联系人：廖海

经办律师：刘佳、张兰

联系电话：021-51150298

传真：021-51150398

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：天职国际会计师事务所

住所：上海市浦东新区陆家嘴东路161号招商局大厦35层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路161号招商局大厦35层

法定代表人：陈永宏

联系人：张坚

联系电话：021-51028018

传真：021-51028018

经办注册会计师：杨力生、张坚

六、基金的募集

（一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。

本基金募集申请已经中国证监会2013年1月18日证监许可〔2013〕49号文核准。

（二）基金类型

发起式股票型证券投资基金

（三）基金的运作方式

上市开放式（LOF）

（四）基金存续期间

不定期

（五）基金的面值

本基金每份基金份额的初始发售面值为人民币1.00元

（六）募集方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购2种方式。网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

（七）募集期限

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。

如果在此期间届满时未达到本招募说明书规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

（八）募集对象

本基金的募集对象为个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

（九）募集场所

本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点向投资者公开发售。

具体募集场所见基金份额发售公告。基金管理人可以根据情况增加其他代销机构，并另行公告。

（十）基金份额的现金认购-网下现金认购

本节内容仅适用于基金份额的场外认购—网下现金认购，通过此种方式认购的基金份额登记在注册登记系统中。

1、募集场所

本基金的场外认购—网下现金认购通过基金场外销售机构各网点（包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点，具体名单见本基金份额发售公告）进行。

销售机构办理本基金场外认购业务的网点的具体情况和联系方法，请参见本基金份额发售公告。

2、基金份额的初始面值、认购费用、认购价格及计算公式

（1）基金份额初始面值：本基金份额初始面值为1.00元人民币。

（2）认购费率

本基金场外认购费率如下表：

认购金额（含认购费）	认购费率
100万元以下	1.00%
100万元以上（含）-200万元以下	0.60%
200万元以上（含）-500万元以下	0.20%
500万元以上（含）	1000元/笔

本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期发生的各项费用。

（3）场外认购份额的计算

本基金场外认购采用金额认购的方式。

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额面值

场外认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资10,000元通过场外认购本基金，假设这10,000元在募集期间产生的利息为10.11元，则其可得到的基金份数计算如下：

净认购金额=10,000/（1+1%）=9,900.99元

认购费用=10,000-9,900.99=99.01元

认购份额=（9,900.99+10.11）/1.00=9,911.10份

即投资者投资10,000元认购本基金，则加上募集期间利息后一共可以得到9,911.10份基金份额。

3、投资人对基金份额的场外认购

（1）认购时间安排

投资人可在募集期内前往本基金销售机构的网点办理基金份额认购手续，具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

（2）投资人认购应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

（3）认购的方式及确认

①投资人认购前，需按销售机构规定的方式备足认购的金额。

②基金募集期内，投资人可多次认购基金份额，但已受理的认购不允许撤销。

③投资人在T日规定时间内提交的认购申请，通常应在T+2日到原认购网点查询认购申请的受理情况。

④销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以基金合同生效后基金管理人的确认结果为准。

（4）认购的限额

本基金代销网点每个基金账户单笔最低认购金额为1,000元。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购金额不设限制。

4、募集资金利息的处理方式

若本基金的基金合同生效，则认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息及利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

（十一）基金份额的现金认购—网上现金认购

本节内容仅适用于基金份额的场内认购—网上现金认购，通过此种方式认购后基金份额登记在证券登记结算系统中。

1、募集场所

本基金通过深圳证券交易所（以下简称“深交所”）上网定价发售，销售渠道为具有基金代销资格的深交所场内会员单位（具体名单见基金份额发售公告）。本基金募集期结束前获得基金代销业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。尚未取得基金代销业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的交易。

2、基金份额的初始面值、认购费用、认购价格及计算公式

（1）本基金份额的初始面值为1.00元人民币，挂牌价格为基金份额初始面值。投资人认购采用全额缴款的认购方式。

（2）投资人场内认购需缴纳认购费用。本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期发生的各项费用。

（3）本基金的场内认购费率由销售机构比照场外认购费率执行。

（4）场内认购金额和利息折算的份额的计算

本基金场内认购采用份额认购的方式。

认购金额=挂牌价格×认购份额×（1+发售费率）

（注：对于适用固定金额认购费的认购，认购金额=挂牌价格×认购份额+固定认购费金额）

发售费用=挂牌价格×认购份额×发售费率

（注：对于适用固定金额认购费的认购，发售费用=固定认购费金额）

净认购金额=挂牌价格×认购份额

利息折算的份额=利息/挂牌价格

场内认购金额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入。利息折算的份额保留至整数位（最小单位为1份），余额计入基金财产。

例：某投资者投资通过场内认购10,000份本基金，如果认购期内认购资金获得的利息为8元，若会员单位设定的认购费率为1%，则其可得到的基金份额计算如下：

挂牌价格=1.00元

认购金额=1.00×10,000×（1+1%）=10,100.00元

利息折算的份额=8/1.00=8份

认购份额总额=10,000+8=10,008份

即投资者投资通过场内认购10,000份本基金，需缴纳10,100元，加上认购资金在认购期内获得的利息，基金发售结束后，投资者经确认的基金份额为10,008份。

3、投资人对基金份额的场内认购

（1）认购时间安排

场内认购时间为深圳证券交易所交易日交易时间，具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

（2）投资人认购应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理