华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）

2013 年度报告摘要

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3月26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2014年3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。

本报告期自2013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
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	40,457,169.79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@hcmiraefund.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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hcmirae.com
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	2013年4月26日(基金合同生效日)-2013年12月31日	2012年	2011年
本期已实现收益	-2,387,220.46	–	–
本期利润	-3,240,360.91	–	–
加权平均基金份额本期利润	-0.0402	–	–
本期基金份额净值增长率	-7.50%	–	–
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0745	–	–
期末基金资产净值	37,441,280.03	–	–
期末基金份额净值	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、本基金成立于2013年4月26日,自基金合同生效日至本报告期末不满一年度。

3、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。

4、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。

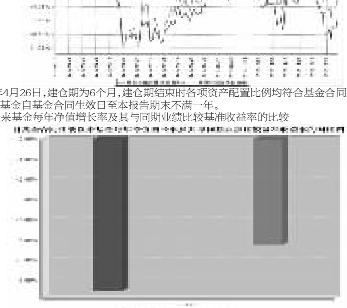
3.2 基金净值表现

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	-3.85%	1.04%	-3.10%	1.07%	-0.75%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-7.50%	0.94%	-5.23%	1.29%	-2.27%	-0.35%

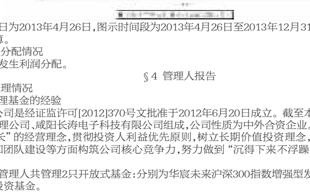
注:本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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



注:本基金成立于2013年4月26日,建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。图示时间段为2013年4月26日至2013年12月31日。本基金自基金合同生效日至本报告期末不满一年。

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



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2013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、韩国未来资产基金管理公司、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		
王宇	本基金基金经理	2013年4月26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。
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。

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。对以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交易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

2013年的中国股市,可谓"冰火两重天",结构性特征明显。涨幅最高的创业板指数,在IPO暂停、成长股供需失衡以及海外市场风险偏好等多种因素的影响下,演绎出典型的牛市行情,全年指数涨幅高达82.73%。而主板市场全年萎靡不振,除了年初在资金面较为宽松,以及政策红利预期的背景下,延续2012年底的涨势。"两会"之后随即开始震荡走低,尤其是6月底开始的"钱荒",在下半年几乎成为一种常态,市场利率始终处于相对高位,季末年初也愈演愈烈。全年,上证指数和沪深300指数跌幅分别为6.75%和7.65%,与创业板指数形成强烈反差。

本基金于2013年4月26日成立,建仓期过后,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2013 年12 月31 日,本基金份额净值为0.925元,本报告期份额净值增长率为-7.5%,同期沪深300 指数增长率为-5.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对于十八届三中全会后全面深化改革所带来的中期影响,相对乐观。但短期来看,影响A股市场波动的因素还有很多,我们对短期市场保持相对谨慎的态度。

一方面,资金面持续偏紧,同时暂停一年半的新股IPO重新开闸,股票供给大幅增加,市场整体估值承压。另一方面,从海外市场来看,利率市场化过程中,市场利率大部分都是先升后降的。预计只有在后期市场利率出现下降后,股市的估值才能得到持续的提升。海外方面,美国QE的逐步退出在2014年已经成为确定性事件,预计资金也会逐步从新兴市场流出,对A股市场也会有一定的冲击。另外,2014年是全面推进改革的第一年,可能带来的短期阵痛,也使得2014年的经济增长存在较大的不确定性。

在对整体市场偏谨慎的背景下,我们相对看好大众消费、医疗保健以及具有长期成长性的TMT行业相关个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会(委员包括运营部以及投资部、研究部、监察稽核部等部门负责人及相关业务骨干),负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务;估值委员会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。

§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(2014)第130260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2013年12月31日的资产负债表和2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间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2013年12月31日的财务状况以及2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	高 飞	陈道瑾
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	2014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:2013年12月31日 单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		2,389,962.24	–
结算备付金		65,544.43	–
存出保证金		–	–
交易性金融资产		35,281,271.25	–
其中:股票投资		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		–	–
应收利息		590.83	–
应收股利		–	–
应收申购款		592.88	–
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		37,737,961.63	–
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		26,389.44	–
应付托管费		4,948.02	–
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		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		245,000.00	–
负债合计		296,681.60	–
所有者权益:			
实收基金		40,457,169.79	–
未分配利润		-3,015,889.76	–
所有者权益合计		37,441,280.03	–
负债和所有者权益总计		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:2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日 单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		-2,115,625.59	–
1.利息收入		1,131,133.80	–
其中:存款利息收入		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)		-3,273,009.96	–
其中:股票投资收益		-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		449,635.11	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-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)		879,391.02	–
减:二、费用		1,124,735.32	–
1.管理人报酬		435,509.33	–
2.托管费		81,658.08	–
3.销售服务费		–	–
4.交易费用		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		468,908.40	–
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)		-3,240,360.91	–
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-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:2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日 单位:人民币元

项目	本期 2013年4月26日(基金合同生效日)至2013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)	272,952,491.85	–	272,952,491.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	-3,240,360.91	-3,240,360.91
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)	-232,495,322.06	224,471.15	-232,270,850.91
其中:1.基金申购款	1,355,185.58	-85,975.69	1,269,209.89
2.基金赎回款	-233,850,507.64	310,446.84	-233,540,060.80
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)	40,457,169.79	-3,015,889.76	37,441,280.03

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	–	–	–
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	–	–
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)	–	–	–
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
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)	–	–	–

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2013]49号文的核准,由基金管理人华宸未来基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于2013年4月26日正式生效,首次设立募集规模为272,952,491.85份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股、备选成份股、非成份股票、新股(含首次公开发行和增发)、债券、债券回购、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金所持有的有价证券市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%-95%,投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金投资业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

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2013年12月31日的财务状况以及2013年全年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历1月1日至12月31日止。本报告会计报表实际编制期间为2013年4月26日至2013年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资);

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次,第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1)股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,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,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

B.首次公开发行的股票,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,按其成本价计算;

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,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,按中国证监会相关规定处理;

2)债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,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,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)证券交易所市场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。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日债券收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,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,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,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,按成本进行后续计量;

(4)在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;

3)权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,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,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市流通的权证,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,按成本计量;

(3)因持有股票而享有的配股权证,采用估值技术确定公允价值进行估值;

4)分离交易可转债

分离交易可转债,上市日前,采用估值技术分别对债券和权证进行估值;自上市日起,上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值;

5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,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方法估值;

(2)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.8%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率逐日计提;

(3) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同自2013年4月26日起生效,无上年度可比期间。

债券交易

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同自2013年4月26日起生效,无上年度可比期间。

债券回购交易

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金合同自2013年4月26日起生效,无上年度可比期间。

7.4.8.1.2 权证交易

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同自2013年4月26日起生效,无上年度可比期间。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。本基金合同自2013年4月26日起生效,无上年度可比期间。

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 2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	435,509.33	–
其中:支付销售机构的客户维护费	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 2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	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 2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	–
期初持有的基金份额	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	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.72%	–

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。

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 2013年4月26日(基金合同生效日)至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	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(2013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
000625	长安汽车	–	临时停牌	11.45	2014年1月3日	11.55	13,635	137,020.23	156,120.75	–
601901	方正证券	–	临时停牌	5.91	2014年1月13日	6.01	19,355	128,778.99	114,388.05	–
600547	山东黄金	–	临时停牌	17.25	2014年1月2日	18.05	4,532	98,007.74	78,177.00	–
000562	宏源证券	–	临时停牌	8.22	–	–	8,800	72,928.00	72,336.00	–
600058	五矿发展	–	临时停牌	13.56	2014年1月6日	14.92	1,776	25,570.48	24,082.56	–

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。

7.4.9.3 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	35,281,271.25	93.49
	其中:股票	35,281,271.25	93.49
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	2,455,506.67	6.51
7	其他各项资产	1,183.71	0.00
8	合计	37,737,961.63	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	276,207.28	0.74
B	采矿业	2,078,352.69	5.55
C	制造业	12,908,865.94	34.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,084,212.45	2.90
E	建筑业	1,135,080.62	3.03
F	批发和零售业	1,107,190.14	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	745,751.22	1.99
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,090,026.70	2.91
J	金融业	12,012,875.50	32.08
K	房地产业	1,508,516.07	4.03
L	租赁和商务服务业	241,421.08	0.64
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	293,851.44	0.78
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	162,935.11	0.44
S	综合	338,985.01	0.91
	合计	34,984,271.25	93.44

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	297,000.00	0.79
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	297,000.00	0.79

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	600036	招商银行	118,883	1,294,635.87	3.46
2	600016	民生银行	158,313	1,222,176.36	3.26
3	601318	中国平安	28,552	1,191,474.96	3.18
4	601166	兴业银行	83,299	844,651.86	2.26
5	600000	浦发银行	81,417	767,762.31	2.05
6	600837	海通证券	62,549	708,054.68	1.89
7	600030	中信证券	51,987	662,834.25	1.77
8	000651	格力电器	19,071	622,858.86	1.66
9	000002	万 科A	63,354	508,732.62	1.36
10	601601	中国太保	26,303	487,394.59	1.30

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	002376	新 北 洋	27,000	297,000.00	0.79

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	3,389,299.36	9.05
2	600036	招商银行	2,888,899.57	7.72
3	601166	兴业银行	1,928,788.00	5.15
4	601318	中国平安	1,890,296.72	5.05
5	600837	海通证券	1,719,507.48	4.59
6	600000	浦发银行	1,625,023.12	4.34
7	600030	中信证券	1,503,908.28	4.02
8	000002	万 科A	1,483,714.00	3.96
9	601398	工商银行	1,407,309.00	3.76
10	601288	农业银行	1,302,986.00	3.48
11	601328	交通银行	1,256,254.61	3.36
12	600519	贵州茅台	1,134,784.34	3.03
13	000651	格力电器	973,227.05	2.60
14	000001	平安银行	944,432.65	2.52
15	601088	中国神华	904,759.00	2.42
16	601601	中国太保	833,369.24	2.23
17	601668	中国建筑	799,314.00	2.13
18	600887	伊利股份	737,555.87	1.97
19	601169	北京银行	711,751.00	1.90
20	600104	上汽集团	708,548.16	1.89

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	1,696,218.54	4.53
2	600036	招商银行	1,346,236.84	3.60
3	601398	工商银行	924,144.51	2.47
4	600837	海通证券	922,750.06	2.46
5	601166	兴业银行	895,794.15	2.39
6	601288	农业银行	871,987.31	2.33
7	600030	中信证券	813,483.83	2.17
8	600000	浦发银行	795,771.87	2.13
9	601328	交通银行	771,330.03	2.06
10	601318	中国平安	758,512.22	2.03
11	000002	万 科A	687,443.72	1.84
12	600519	贵州茅台	610,026.45	1.63
13	000001	平安银行	471,704.40	1.26
14	000651	格力电器	456,829.94	1.22
15	601088	中国神华	446,672.17	1.19
16	601668	中国建筑	423,020.45	1.13
17	601169	北京银行	395,652.77	1.06
18	600887	伊利股份	366,168.59	0.98
19	000858	五 粮 液	365,204.78	0.98
20	600104	上汽集团	345,165.41	0.92

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	79,334,895.09
卖出股票收入(成交)总额	39,754,645.04

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

注: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

注: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于2013年5月21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")于近日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《行政处罚和市场禁入事先告知书》,中国证监会对平安证券给予警告及行政处罚。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	–
3	应收股利	–
4	应收利息	590.83
5	应收申购款	592.88
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,183.71

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
589	68,687.89	10,501,250.00	25.96%	29,955,919.79	74.04%

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	王奇华	800,046.00	12.61%
2	江苏伟业安装集团有限公司	500,000.00	7.88%
3	王云	449,026.00	7.08%
4	陈方	250,007.00	3.94%
5	陈蕾颖	220,017.00	3.47%
6	孙岚	200,628.00	3.16%
7	张坚	182,005.00	2.87%
8	陈颐仙	167,011.00	2.63%
9	吴佩良	152,000.00	2.40%
10	朱汉华	150,018.00	2.37%

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	54,459.27	0.1346%

9.4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	24.72	10,001,250.00	24.72	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 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	–
本报告期基金总申购份额	1,355,185.58
减:本报告期基金总赎回份额	233,850,507.64
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	40,457,169.79

§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

2013年4月21日,经华宸未来基金管理有限公司股东会第七次会议决议通过,选举郑二薰为公司股东董事,辛炯官不再担任公司董事职务。

(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,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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,无涉及基金管理人、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,因业务发展需要,本基金改聘立信会计师事务所(特殊普通合伙)负责本基金审计业务。此事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告,并已于2013年9月6日进行了披露。

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	
光大证券	2	13,181,522.75	11.11%	9,364.37	11.11%	席位已退租
民生证券	1	41,749,817.84	35.19%	29,659.46	35.19%	–
中信证券	2	63,709,879.47	53.70%	45,259.35	53.70%	–

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
光大证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	40,200,000.00	4.48%	–	–
中信证券	–	–	857,000,000.00	95.52%	–	–

§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
2014年3月26日