

华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金 (LOF)

2014 年度 报告 摘要

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向股市的资产配置入市,同时沪港通和深港通的开通将助力沪港双向资金流动和沪港双向的大盘主导;市场资金充裕、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倍以上PE向PB估值,过去两个半月的时间使得很多大盘蓝筹股上2-3倍,估值已经趋于合理,在改革的驱动下,代表新兴产业的创业板分化、创业板龙头、机械作为基本配置,而逐步优选和增配“安全、智能、绿色、品质”趋势下的新兴产业,如互联网金融、移动医疗、信息安全、农业信息化、智能家居等,同时紧抓创新驱动发展的主题,重点关注国企改革。

4.6 管理人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估值程序,日常估值由基金管理人估值系统估值,基金估值系统由基金管理人完成估值,经基金估值系统确认后由基金管理人对外公布。月末,由中银国际估值系统对基金估值系统的核对同时相符。

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。估值委员会成员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,基金管理人不会介入日常估值业务,估值委员会决议之前会与涉及基金的基本管理进行充分沟通,运用估值委员会履行估值委员会的职责的估值政策及决议。

4.7 管理人报告期内基金净值变动的说明

本基金管理人报告期内基金净值变动的原因,主要系报告期内本基金管理人严格执行估值委员会决议,基金管理人估值系统估值,基金估值系统由基金管理人完成估值,经基金估值系统确认后由基金管理人对外公布。月末,由中银国际估值系统对基金估值系统的核对同时相符。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人或基金资产净值变动情况的说明

5. 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

自2014年4月26日报告期末沪深300指数增强型发起式证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)成立以来,作为本基金的基金托管人,中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银国际”)严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》及相关法律法规的要求,认真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 托管人对本基金报告期内基金净值变动的说明

报告期内,本托管人按照相关法律法规、基金合同约定及托管协议要求,对基金管理人——华宸未来基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)提供的基金净值变动数据进行了复核,对基金净值变动数据的计算、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基金净值变动数据存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

5.3 托管人对本报告期内基金净值变动情况的说明

由中银国际基金托管人——华宸未来基金管理有限公司编制,并经过基金管理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。

5.4 审计报告

第2条《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编报规则》第4号《证券投资基金信息披露编报规则》及其其他中国证监会颁布的相关规定,本年度报告按照上述规定编制,并经会计师事务所审计,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年全年的经营成果和净值变动情况。

7.4.2 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。

7.4.3 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.4 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.6 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.7 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.8 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.9 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.10 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.11 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.12 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.13 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.14 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.15 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.16 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.17 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.18 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.19 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.20 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.21 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.22 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.23 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.24 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.25 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.26 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.27 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.28 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.29 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.30 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.31 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.32 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.33 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.34 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.35 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.36 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.37 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.38 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.39 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.40 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.41 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.42 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.43 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.44 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.45 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.46 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.47 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.48 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.49 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.50 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.51 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.52 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.53 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.54 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.55 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.56 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.57 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.58 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.59 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.60 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.61 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.62 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.63 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.64 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.65 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.66 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.67 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.68 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.69 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.70 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.71 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.72 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.73 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.74 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.75 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.76 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.77 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.78 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.79 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.80 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.81 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.82 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.83 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.84 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.85 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.86 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.87 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.88 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.89 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.90 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.91 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.92 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.93 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.94 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.95 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.96 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.97 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.98 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.99 本报告期无会计估计变更的说明

7.4.100 本报告期无会计估计变更的说明

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	14,562	1,987,027.02	4.05
2	600016	民生银行	82,898	903,920.24	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	544,584.56	2.03
8	601668	中国重工	39,298	431,674.88	1.61
9	600052	广 电 A	80,895	429,482.20	1.60
10	601338	交通银行	47,385	323,218.00	1.29

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	601091	华能水电	11,569	79,594.72	0.30

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	029499	南方富农	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	600858	五粮液	212,940.00	0.57	
7	000826	桑德环境	202,630.00	0.54	
8	602575	正海磁材	182,105.74	0.49	
9	600263	天龙集团	180,000.00	0.48	
10	600288	津滨发展	173,124.00	0.48	
11	300070	碧水源	163,990.00	0.44	
12	600340	华鲁恒升	150,350.00	0.40	
13	601186	中国铁建	149,120.00	0.40	
14	002063	东方明珠	144,184.03	0.39	
15	600519	贵州茅台	138,720.00	0.37	
16	601668	中国重工	133,426.00	0.36	
17	600583	海通证券	130,410.00	0.35	
18	002400	明胶股份	124,571.00	0.33	
19	600959	汇川技术	122,974.00	0.32	
20	601158	美利纸业	119,800.00	0.32	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	029499	南方富农	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	600858	五粮液	212,940.00	0.57	
7	000826	桑德环境	202,630.00	0.54	
8	602575	正海磁材	182,105.74	0.49	
9	600263	天龙集团	180,000.00	0.48	
10	600288	津滨发展	173,124.00	0.48	
11	300070	碧水源	163,990.00	0.44	
12	600340	华鲁恒升	150,350.00	0.40	
13	601186	中国铁建	149,120.00	0.40	
14	002063	东方明珠	144,184.03	0.39	
15	600519	贵州茅台	138,720.00	0.37	
16	601668	中国重工	133,426.00	0.36	
17	600583	海通证券	130,410.00	0.35	
18	002400	明胶股份	124,571.00	0.33	
19	600959	汇川技术	122,974.00	0.32	
20	601158	美利纸业	119,800.00	0.32	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	14,562	1,987,027.02	4.05
2	600016	民生银行	82,898	903,920.24	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	544,584.56	2.03
8	601668	中国重工	39,298	431,674.88	1.61
9	600052	广 电 A	80,895	429,482.20	1.60
10	601338	交通银行	47,385	323,218.00	1.29

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	029499	南方富农	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	600858	五粮液	212,940.00	0.57	
7	000826	桑德环境	202,630.00	0.54	
8	602575	正海磁材	182,105.74	0.49	
9	600263	天龙集团	180,000.00	0.48	
10	600288	津滨发展	173,124.00	0.48	
11	300070	碧水源	163,990.00	0.44	
12	600340	华鲁恒升	150,350.00	0.40	
13	601186	中国铁建	149,120.00	0.40	
14	002063	东方明珠	144,184.03	0.39	
15	600519	贵州茅台	138,720.00	0.37	
16	601668	中国重工	133,426.00	0.36	
17	600583	海通证券	130,410.00	0.35	
18	002400	明胶股份	124,571.00	0.33	
19	600959	汇川技术	122,974.00	0.32	
20	601158	美利纸业	119,800.00	0.32	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	029499	南方富农	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	600858	五粮液	212,940.00	0.57	
7	000826	桑德环境	202,630.00	0.54	
8	602575	正海磁材	182,105.74	0.49	
9	600263	天龙集团	180,000.00	0.48	
10	600288	津滨发展	173,124.00	0.48	
11	300070	碧水源	163,990.00	0.44	
12	600340	华鲁恒升	150,350.00	0.40	
13	601186	中国铁建	149,120.00	0.40	
14	002063	东方明珠	144,184.03	0.39	
15	600519	贵州茅台	138,720.00	0.37	
16	601668	中国重工	133,426.00	0.36	
17	600583	海通证券	130,410.00	0.35	
18	002400	明胶股份	124,571.00	0.33	
19	600959	汇川技术	122,974.00	0.32	
20	601158	美利纸业	119,800.00	0.32	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	029499	南方富农	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	600858	五粮液	212,940.00	0.57	
7	000826	桑德环境	202,630.00	0.54	
8	602575	正海磁材	182,105.74	0.49	
9	600263	天龙集团	180,000.00	0.48	
10	600288	津滨发展	173,124.00	0.48	
11	300070	碧水源	163,990.00	0.44	
12	600340	华鲁恒升	150,350.00	0.40	
13	601186	中国铁建	149,120.00	0.40	
14	002063	东方明珠	144,184.03	0.39	
15	600519	贵州茅台	138,720.00	0.37	
16	601668	中国重工	133,426.00	0.36	
17	600583	海通证券	130,410.00	0.35	
18	002400	明胶股份	124,571.00	0.33	
19	600959	汇川技术	122,974.00	0.32	
20	601158	美利纸业	119,800.00	0.32	

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