

信息披露 Disclosure

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

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
公告送达日期：2015年3月31日
1.1 重要提示
基金管理人的董事、监事及高级管理人员保证公告内容真实、准确、完整，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，并由基金经理签署。

基金托管人中信银行股份有限公司承诺，于2015年3月26日核对了本基金的财务指标、净值情况、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核意见不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺，诚信经营，勤勉尽责，严格履行运用基金财产，但不保证基金一定盈利。

本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。

本报告期为2014年1月1日起至2014年12月31日。

§ 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)
场内简称 华宸300
基金主代码 167901
基金运作方式 指数型开放式(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

报告期末基金总资产 19,209,333.83
基金份额总额 19,209,333.83

基金类型 不定期
基金合同存续期间 深圳证券交易所
上市日期 2013-04-03
2.2 基金产品说明

本基金主要投资于股票、债券等金融工具，力求为投资者提供稳定的资本增值和收入。

投资目标 通过指数化投资方法，结合量化分析的指数化投资策略及风险管理，追求沪深300指数的长期增值。

投资策略 本基金为指数增强型基金，以“指数化投资为主，根据宏观经济形势、行业景气变化适时调整投资比例，力争实现超额收益”的投资目标，追求沪深300指数的长期增值。

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 本基金是一只投资于指数增强型基金，相较于沪深300指数，预期风险相对较高，预期收益相对较高的基金，风险收益特征与沪深300指数增强型基金相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

名称 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

办公地址 郑州路
姓名 方刚
信息披露负责人 联系电话 021-26660909
电子邮箱 xingpu@hcnavsfund.com
客户服务电话 4009200699
传真 021-68870287
住所 010-65508082

2.4 信息披露方式

基金年度报告登载在基金管理人互联网网址 http://www.hcnavsfund.com

基金年度报告备置地 基金管理人和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

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)至2014年12月31日 2012年

本期已实现收益 1,164,474.59 -340,220.46 -

本期可供分配利润 10,679,161.68 -3,402,220.46 -

本期利润增长率为 3.089% -0.404% -

本期基金份额净值 51.24% -7.50% -

3.1.2 期末数据和指标 2014年末 2013年末 2012年末

本期可供分配利润 0.0144 -0.0745 -

本期基金份额净值 26,882,161.09 37,441,280.03 -

本期份额变动率 1.399 -0.925 -

注：1. 上述财务指标采用的计算公式，详见中国证监会监督委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则》。
2. 本期利润为本期利息收入、公允价值变动收益(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额，本期利润为期末收益减去本期平均分配收益。
3. 上述基金财务指标不包括持有人认购或申购基金所产生的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等)，计入费用实际收入水平要低于所列数字。
3.2 累计净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益的比较

阶段 份级净值增长率 阶段标准差 业绩比较基准 业绩比较基准收益率差额 累计净值差额

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%

过去三年 39.90% 1.08% 40.91% 1.21% -1.01% -0.13%

注：本基金业绩比较基因为沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%；
2. 本基金于2013年4月26日，即基金合同生效日，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同期业绩比较基准收益的比较

注：本基金成立以来，基金每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益的比较

3.3 过往三年基金的利润分配情况

注：本基金本报告期未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的基本情况

华宸未来基金管理有限公司经中国证监会[2012]37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、致旺华宸电子有限公司组成，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“规范运作价值、创新驱动成长”的经营理念，贯彻以人为本、专业至上、长期价值投资理念，努力做到“细分市场的经营战略、执行机制、企业文化建设和团队建设等方面构建公司核心竞争力，努力做到“优中求精、专得下去不浮夸”，将公司打造成为受尊敬的资产管理人。

截至目前，本公司管理的基金资产规模约100亿元人民币，旗下管理基金包括华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金(LOF)。

4.1.1 基金经理(或基金经理助理)及基金经理助理简介

姓名 职务 从事业务经验 说明

蔡文 本基金基金经理 2010年10月14日 -

夏宇 本基金基金经理 2013年10月24日 2014年12月15日 8

申雷 本基金基金经理 2014年1月8日 -

胡建文 本基金基金经理 2014年4月26日 2014年4月30日 14

王宇 本基金基金经理 2014年4月26日 2014年4月30日 14

胡建文 本基金基金经理 2014年8月1日 -

注：1. 本基金业绩比较基因为沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%；
2. 本基金于2013年4月26日，即基金合同生效日，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同期业绩比较基准收益的比较

注：本基金成立以来，基金每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益的比较

3.3 过往三年基金的利润分配情况

注：本基金本报告期未发生利润分配。

4.2 管理人报告

4.2.1 本报告期内基金管理人对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.1 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.2 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.3 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.4 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.5 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.6 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.7 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.8 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.9 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.10 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.11 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.12 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.13 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.14 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.15 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.16 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.17 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.18 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.19 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.20 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.21 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.22 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.23 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.24 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.25 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.26 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.27 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.28 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.29 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.30 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.31 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.32 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.33 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.34 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.35 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.36 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.37 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.38 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.39 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.40 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.41 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.42 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.43 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.44 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.45 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.46 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.47 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.48 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.49 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.50 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.51 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.52 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.53 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.54 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.55 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.56 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.57 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.58 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.59 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.60 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.61 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.62 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.63 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明

4.2.1.64 公司对宏观经济、行业政策及市场情况的专项说明