华宝兴业品质生活股票型证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月21日

§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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月21日(基金合同生效日)起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝品质生活股票
基金主代码	000867
交易代码	000867
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月21日
报告期末基金份额总额	1,426,370,409.71份
投资目标	本基金主要投资那些致力于提升大众生活品质的相关公司股票,在控制风险的前提下,力争为投资者带来长期、稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过投资于那些符合生活品质主题且具有较强竞争优势的上市公司,把握中国经济增长和居民消费升级过程中的投资机会。本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券,投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向,预测未来利率变动走势,自上而下地确定投资组合久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品,基金管理人可根据法律法规及监管机构的规定及本基金的投资目标,制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的预期风险和预期收益都较高的品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月21日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	35,810,876.55
2.本期利润	145,843,078.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.0835
4.期末基金资产净值	1,547,886,218.23
5.期末基金份额净值	1.085

注:1.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。

2.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,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 本报告期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	净值增长率①	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	8.50%	0.47%	15.46%	1.19%	-6.96%	-0.72%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

(2015年1月21日至2015年3月31日)

注:1、本基金基金合同生效于2015年1月21日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡戈游	本基金基金经理、华宝兴业宝康消费品基金基金经理、华宝兴业宝康配置混合基金经理	2015年1月21日	-	10年	硕士,拥有CFA资格。2005年2月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任金融工程部数量分析师、国内投资部基金经理助理的职务,2009年5月至2010年6月任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2010年1月至2012年1月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。2011年2月起任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理。2015年1月兼任华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业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,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生所有投资组合参与的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%。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度市场整体行情向好,各指数均有较好表现。期间上证指数上涨15.87%,深圳成指涨19.48%,沪深300上涨14.64%,中小板指数上涨46.60%,创业板指数上涨58.66%。在全社会对"互联网+"的转型期待下,计算机、传媒、通信等板块表现较好,传统行业中积极转型的公司普遍也有较好表现。

报告期间,我们仍处在建仓期,在此期间我们采取逐步建仓的策略,精选了一些优质公司,取得一定收益。但基金仓位处于逐步提升中,截止报告期末仓位水平依然不高,基金净值涨幅相对较少。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年一季度末,本基金净值涨幅为8.50%,基金基准涨幅为15.46%,基金表现落后基准6.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计经济仍处于触底企稳的过程中,固定资产投资和房地产难出现大规模的增长,经济增长整体增速放缓的态势不变。但在政策调控下,经济结构已经在逐步转型:一方面通过一带一路,高铁、核电投资等对冲国内房地产投资的下滑,另一方面通过各种措施逐步降低企业融资成本,解决传统行业去杠杆的难题。这些措施在2014年已经初见成效,预计也会成为未来经济的助推剂。鉴于中国经济长期增长的潜力还比较大,我们预计经济将在较长的时间内维持平稳增长。

展望未来,我们看好中国经济由投资驱动向消费驱动转型。基于人口结构的变化和新兴消费的趋势,我们持续看好以下几个领域的投资机会:受益互联网盛宴数字营销、在线旅游、软件服务、汽车后市场、互联网金融、智能家居等各个板块;受益于消费升级的休闲娱乐和大众快消品;长期稳定增长的医疗服务业;政策推动的新能源汽车等。我们会在这几个行业中优中选优,继续寻找和持有优质公司。

感谢持有人一直以来对我们的支持,在后续投资中,我们将继续总结经验,勤勉尽责,努力实现品质生活基金的良好表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	792,341,545.84	48.42
	其中:股票	792,341,545.84	48.42
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	841,143,890.48	51.40
7	其他资产	2,895,792.03	0.18
8	合计	1,636,381,228.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	356,486,041.58	23.03
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	102,738,617.35	6.64
G	交通运输、仓储和邮政业	16,849,785.00	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,370,925.87	2.16
J	金融业	38,738,333.16	2.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	152,387,612.14	9.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,748,000.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	85,200,886.94	5.50
R	文化、体育和娱乐业	821,343.80	0.05
S	综合	-	-
	合计	792,341,545.84	51.19

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002400	省广股份	1,708,700	70,022,526.00	4.52
2	300244	迪安诊断	699,977	57,440,112.62	3.71
3	300058	蓝色光标	1,500,101	54,678,681.45	3.53
4	002589	瑞康医药	904,202	50,454,471.60	3.26
5	002216	三全食品	1,628,145	50,049,177.30	3.23
6	600887	伊利股份	1,507,146	46,495,454.10	3.00
7	601166	兴业银行	2,109,931	38,738,333.16	2.50
8	002594	比亚迪	700,249	36,693,047.60	2.37
9	002462	嘉事堂	797,623	32,263,850.35	2.08
10	300347	泰格医药	509,559	27,760,774.32	1.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货,基金管理人将密切跟踪相关法规,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。

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	127,974.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	242,479.90
5	应收申购款	2,525,337.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,895,792.03

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年1月21日)基金份额总额	1,770,403,712.60
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	39,944,601.96
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	383,977,904.85
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,426,370,409.71

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业品质生活股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业品质生活股票型证券投资基金托管协议;

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;

基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

8.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2015年4月21日

华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金(LOF)

【2015】第一季度报告

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
报告送出日期:2015年4月21日

§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责任。

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4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宸300
场内简称	华宸300
交易代码	167901
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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
报告期末基金份额总额	14,925,704.32份
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标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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	3,458,217.29
2.本期利润	3,124,025.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.1822
4.期末基金资产净值	23,743,122.94
5.期末基金份额净值	1.591

注:1、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,包含停牌股票按公允价值调整的影响。

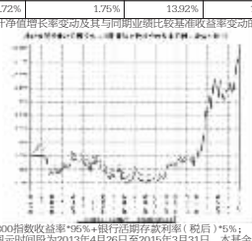
2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	13.72%	1.75%	13.92%	1.74%	-0.20%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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: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2015年3月31日。本基金自基金合同生效日至本报告期末已满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求,并通过对投资交易行为的监控和分析,确保管理人旗下各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节均得到公平对待。本报告期内,管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在经历去年年底"二八分化"极端现象之后,一季度迎来了久违的创业板大反攻。创业板综指上涨58.67%,上证综指上涨15.87%。去年年底基金排名的压力导致被迫调仓卖出创业板股票而追买大盘蓝筹,很多创业板和中小板的优质成长股被严重低估,如年初白马成长股估值在15-30倍之间,而以海康、大华等为代表的白马成长股率先打响创业板和中小板反弹的第一枪,随后互联网金融把一季度的成长股行情成功点燃,相关个股走出了翻倍的行情。随后企业互联网、电子商务、移动互联网、车联网,只要与互联网沾点边的个股也轮番上涨。

特别是两会上克强总理首次提出"互联网+"的概念,把互联网+相关个股的行情推向高潮。

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2015年3月31日,本基金份额净值为1.591元,本报告期份额净值增长率为13.72%,同期业绩基准增长率为13.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计二季度宏观经济步入筑底阶段,预计GDP增速7.0%。随着稳增长的措施在二月份陆续出台,包括加大国内基建投资和大力推进"一带一路"战略,叠加房地产政策的放松,经济增长有望在二季度出现企稳回升,二季度GDP增速将略高于一季度。截至目前央行已经宣布两次降息,稳增长的基调已定。预计二季度物价仍然低迷,未来还将有一次降息,至两次降准机会。

二季度市场风格有望切换到蓝筹板块。目前创业板和中小板的疯狂程度难以想象,从"市梦率"到"市销率",场外资金和杠杆资金的不断涌入不断推高两板块的估值。然而如此高的PE估会有回所的崩溃。当前中小市值板块的信用交易的杠杆程度普遍高于以沪深300为代表的蓝筹个股,蕴含着"戴维斯双杀"的风险。未来某些事件可能导致资金从创业板和中小板的撤出:1)深港通的提前开通,导致资金"南下"2)新三板制度的完善使得小市值股票供给加大;3)注册制的推进,新发股票供给量超预期加大;4)美国加息提前,导致资金流出新兴市场超预期;5)4月16日上证50和中证500股指期货的推出,小票做空机制的行成。这些要素都可能中断资金对创业板和中小板的追逐而导致下跌。二季度市场风格可能会切换到蓝筹板块。

市场配置看,有三条主线:1)基于稳增长和经济的企稳,配置房地产、基建、电力设备等板块;2)基于化解信用风险和融资结构的变革,配置证券、保险和银行;3)聚焦改革推进与战略新兴产业,配置国资改革、"一带一路"、自贸区扩围、"互联网+"。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,431,528.88	92.94
	其中:股票	22,431,528.88	92.94
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	1,585,208.52	6.57
7	其他资产	118,022.19	0.49
8	合计	24,134,759.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	974,385.37	4.10
C	制造业	6,993,240.10	29.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	530,156.84	2.23
E	建筑业	1,248,268.90	5.26
F	批发和零售业	353,025.09	1.49
G	交通运输、仓储和邮政业	486,407.07	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	906,446.75	3.82
J	金融业	8,790,373.59	37.02
K	房地产业	1,228,050.00	5.17
L	租赁和商务服务业	246,007.88	1.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	311,326.74	1.31
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	140,816.89	0.59
S	综合	-	-
	合计	22,207,507.22	93.53

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
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	135,481.20	0.57
J	金融业	88,540.46	0.37
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	224,021.66	0.94

5.3 报告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

5.3.1 报告期末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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	12,585	984,650.40	4.15
2	600030	中信证券	19,843	651,247.26	2.74
3	600036	招商银行	39,026	607,634.82	2.56
4	600016	民生银行	60,315	585,055.50	2.46
5	600837	海通证券	21,108	494,138.28	2.08
6	601166	兴业银行	24,149	443,375.64	1.87
7	600000	浦发银行	26,640	420,645.60	1.77
8	000002	万 科A	24,755	342,114.10	1.44
9	601601	中国太保	9,029	306,083.10	1.29
10	601668	中国建筑	38,873	298,155.91	1.26

5.3.2 报告期末积极投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	3,450	101,499.00	0.43
2	000712	锦龙股份	2,237	88,540.46	0.37
3	600446	金证股份	279	33,982.20	0.14

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货。

5.10.2 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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收回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法规,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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	339.43
5	应收申购款	117,682.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	118,022.19

5.11.4 报告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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.6 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.7 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300059	东方财富	101,499.00	0.43	临时停牌

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情况。

5.11.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	19,209,333.83
报告期期间基金总申购份额	2,379,543.26
减:报告期期间基金总赎回份额	6,663,172.76
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	14,925,704.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初基金份额总额	10,001,250.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,250.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	67.01

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 报告期末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	67.01	10,001,250.00	67.01	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	67.01	10,001,250.00	67.01	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金设立的文件;

2、《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》;

3、《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》;

4、《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》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

10.3 查阅方式

投资者可登陆基金管理人互联网站(http://www.hcmirae.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查询。

华宸未来基金管理有限公司
2015年4月21日

华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金

【2015】第一季度报告