

华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（LOF）2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 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

送出日期：2015 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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 2015 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 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.....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50
7.8 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.....	50
7.9 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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50

§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 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
场内简称	-
基金主代码	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
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	12,734,603.04 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	杨桐	方韡
	联系电话	021-26066888	010-89936330
	电子邮箱	yangt@hcmirae.com	fangwei@citicibank.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9号东方文化大厦北楼
邮政编码		200085	100027
法定代表人		向旭平	常振明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hcmirae.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	8,638,833.74
本期利润	6,400,666.77
加权平均基金份额本期利润	0.4059
本期加权平均净值利润率	24.97%
本期基金份额净值增长率	25.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	7,148,093.17

期末可供分配基金份额利润	0.5613
期末基金资产净值	22,405,614.48
期末基金份额净值	1.759
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	75.90%

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。

3、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。

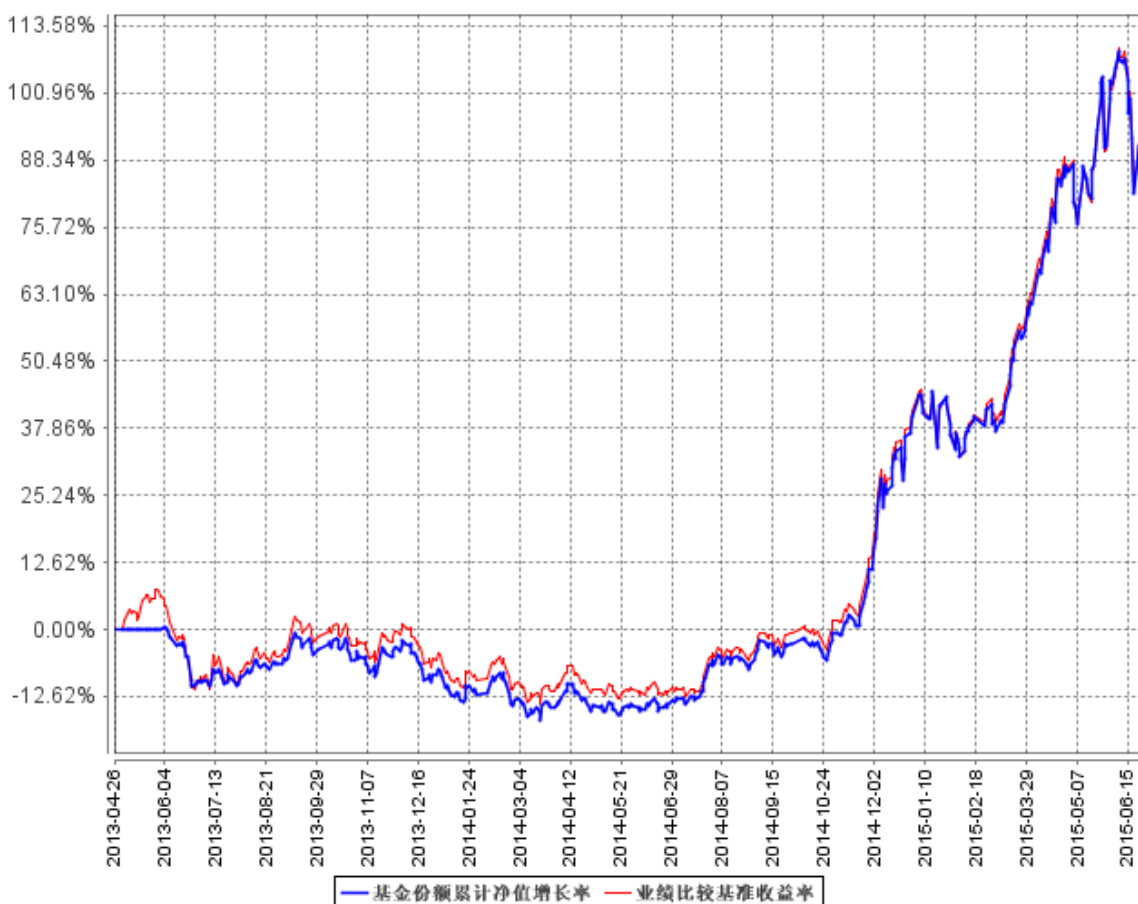
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-7.91%	3.32%	-7.18%	3.32%	-0.73%	0.00%
过去三个月	10.56%	2.47%	9.98%	2.48%	0.58%	-0.01%
过去六个月	25.73%	2.15%	25.29%	2.15%	0.44%	0.00%
过去一年	103.12%	1.75%	99.67%	1.75%	3.45%	0.00%
自基金合同生效起至今	75.90%	1.39%	76.55%	1.47%	-0.65%	-0.08%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 6 月 30 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		
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
王宇	本基金基金经理	2013 年 4 月 26 日	2014 年 4 月 30 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。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	2014年12月15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。
蔡建文	本基金基金经理助理	2014年1月8日	-	4	厦门大学投资学硕士，具有基金从业资格，通过期货从业资格考试。2011年7月至2012年11月，曾任日信证券金融工程研究员。2012年11月加入华宸未来基金，历任金融工程研究员、基金经理助理。

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合规守信情况的说明

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不公平交易的情况。

4.3.2 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

报告期内代表转型方向的成长股上涨明显，创业板综指上涨 92.23%，上证综指上涨 32.23%。上涨的核心逻辑是改革，通过改革调整经济结构，培养新引擎，而新引擎的代表是建设信息高速公路。在改革的过程中，第一是去产能，用“一带一路”带动落后产能的转移，带动基建、钢铁水泥、煤炭等产业的去产能和产业升级。第二是新技术，以“互联网+”带动培育新兴产业的发展，通过新技术培育新经济，鼓励大众创业，释放民营活力。第三个是新制度，以国有企业改革重塑国家资产负债表，国有企业改革包括央企的国企改革与地方上的国企改革，改革方式包括资产证券化、混合所有制引进战略投资者、员工持股、大国企合并等，其本质是重塑国家资产负债表、地方资产负债表。而六月份开始创业板和主板同时面临股灾式暴跌，由于监管部门严厉禁止场外配资导致平仓盘的出现，波及到场内融资融券，个股普遍跌幅在 60%左右。很多个股已经进入价值投资区间。

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 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.759 元，本报告期份额净值增长率为 25.73%，同期业绩基准增长率为 25.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年央行实施的宽松的货币环境确实对实体经济的下滑起到了一定的支撑作用，但“宽货币”向实体经济的传导效果较差，有效投资不足，难以拉动内需。我们预计下半年依然会保持宽松的货币政策；同时，财政政策更加积极。通缩压力较大，CPI 连续多个月份低于 2%，PPI 已经连续 40 个月为负数。预计下半年通缩压力有所减缓，CPI 将保持低位，原材料价格反弹，PPI 跌幅收窄。预计下半年经济环比增速回升，三、四季度 GDP 分别增长 7.0%和 7.1%。

二季度末场外配资去杠杆导致股市的暴跌，之后波及到场内融资。管理层密集出台一系列救护股市的重磅政策，未来几个月将是市场的绝佳黄金时间窗口：1) IPO 暂停，暂时没有新股抽血的压力；2) 上市公司不得减持公司的股票，同时“五选一”的方案强制要求上市公司采取维护股

价的措施，如控股股东增持或者高管增持等；3) 央行证金公司提供无限流动性背书，由证金公司直接在二级市场购买股票或者通过基金公司购买股票的方式稳定市场；3) 联合公安部打击恶意做空行为，鼓励做多；4) 其他救市的措施已经公布或等待公布。这这些措施明显在 3800-4000 点构成政策底，然而市场信心的修复需要漫长的过程，在信心修复之后市场在下半年将迎来绝好的价值投资时光。下半年个股分化会很严重，优选选择那种有估值、具有较强安全边际，同时基本面良好的成长股和蓝筹股。

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验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议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进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,329,878.04	1,784,681.22
结算备付金		14,279.08	2,655.50
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	21,214,385.08	25,511,914.88
其中：股票投资		21,214,385.08	25,511,914.88
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	28,168.53
应收利息	6.4.7.5	306.73	440.66
应收股利		-	-
应收申购款		104,811.86	96,837.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		22,663,660.79	27,424,698.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		54,102.24	12,089.79
应付赎回款		26,927.19	198,797.10
应付管理人报酬		16,722.27	16,960.60
应付托管费		3,135.42	3,180.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	30,225.10	16,230.37
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	126,934.09	295,279.66
负债合计		258,046.31	542,537.65
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	12,734,603.04	19,209,333.83
未分配利润	6.4.7.10	9,671,011.44	7,672,827.26
所有者权益合计		22,405,614.48	26,882,161.09
负债和所有者权益总计		22,663,660.79	27,424,698.74

6.2 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年6月30日
一、收入		6,763,808.70	-2,066,247.59
1.利息收入		6,394.83	8,902.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,394.83	8,902.47
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,817,406.01	-818,540.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,660,514.69	-1,190,216.75

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	156,891.32	371,676.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,238,166.97	-1,266,584.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	178,174.83	9,975.23
减：二、费用		363,141.93	367,410.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	101,439.55	132,957.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,019.92	24,929.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	61,616.27	26,943.69
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	181,066.19	182,580.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,400,666.77	-2,433,658.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,400,666.77	-2,433,658.34

6.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	19,209,333.83	7,672,827.26	26,882,161.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,400,666.77	6,400,666.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-6,474,730.79	-4,402,482.59	-10,877,213.38

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	8,360,374.43	5,029,863.66	13,390,238.09
2.基金赎回款	-14,835,105.22	-9,432,346.25	-24,267,451.47
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)	12,734,603.04	9,671,011.44	22,405,614.48
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	40,457,169.79	-3,015,889.76	37,441,280.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,433,658.34	-2,433,658.34
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)	-5,149,492.26	703,084.38	-4,446,407.88
其中：1.基金申购款	713,430.45	-79,636.03	633,794.42
2.基金赎回款	-5,862,922.71	782,720.41	-5,080,202.30
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)	35,307,677.53	-4,746,463.72	30,561,213.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨桐

杨桐

乔鋈池

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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: $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率 (税后)}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则(2006)、中国证券业协会于 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求, 真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。此外, 本财务报表同时符合如会计报表附注 6.4.4 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度, 即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。

其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

(a) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(i) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(ii) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不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)。

认购新发行的分离交易可转债于获配日按支付的全部价款确认为债券投资，于权证实际取得日按附注 6.4.4.4 (a) (iii) 所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出债券于卖出交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按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。

获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(b) 应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。

(c) 其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

其他金融负债按公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，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，应采用最近交易市价确定公允价值。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且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，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

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。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同

的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值，另外对金融资产的特殊情况处理如下：

(a) 股票投资

(i) 对因特殊事项长期停牌的股票，如该停牌股票对基金资产净值产生重大影响，则采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。即在估值日，以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率计算该股票当日的公允价值。

(ii) 送股、转增股、配股和公开增发新股等未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

(iii) 首次公开发行未上市的股票，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，按成本估值。

(iv) 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，按交易所上市的同一种股票的收盘价估值。

(v) 非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一种股票的收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所上市的同一种股票的收盘价估值；若在证券交易所上市的同一种股票的收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，其两者之间的差价按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例确认为估值增值。

(b) 债券投资

(i) 交易所上市实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的收盘价估值，交易所上市未实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的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。

(ii) 首次公开发行未上市的债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，按成本估值。

(iii) 全国银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(iv) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(c) 权证投资

(i) 首次公开发行未上市的权证，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，按成本估值。

(ii) 配售及认购分离交易可转债所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估

值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

(iii) 因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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价格估值。

(d) 股指期货投资

基金投资的股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。实际成本与估值的差异计入“公允价值变动损益”科目。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

本报告期，本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换，本基金金融工具的公允价值的估值技术并未发生改变。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵消债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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认列。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现

损益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进行确认和计量，并于期末全额转入“未分配利润”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于卖出交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)于卖出债券交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按处置衍生工具成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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于除权除息日确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理费根据《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》的规定，按前一日基金资产净值 0.8%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费根据《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》的规定，按前一日基金资产净值 0.15%的年费率逐日计提。

本基金的标的指数许可使用费根据《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》的规定，计费时间从本基金合同生效日开始计算；标的指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的 0.016%/年，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元时按照 5 万元收取）。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

除上述项目以外的其他费用，根据相关法规及协议的规定，按费用支出金额列入或摊入当期基金费用。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

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；

6、本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在制定媒体公告并报中国证监会备案；

7、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无差错事项。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、[2001]61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[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》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84 号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作, 本基金适用的主要税项列示如下:

- 1、以发行基金方式募集资金, 不属于营业税征收范围, 不征收营业税;
- 2、基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税;
- 3、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税;
- 4、对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入, 由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税, 自 2005 年 6 月 13 日起, 对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按 50%计算个人所得税;
- 5、自 2005 年 1 月 24 日起, 基金买卖 A 股、B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税。自 2007 年 5 月 30 日起, 该税率上调至 0.3%。自 2008 年 4 月 24 日起, 根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定, 调整证券(股票)交易印花税率, 由 0.3%降至 0.1%。自 2008 年 9 月 19 日起, 根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定, 证券交易印花税改为单边征收, 即仅对卖出 A 股、B 股股权按 0.1%的税率征收, 对受让方不再征税;
- 6、对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入, 暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	1, 329, 878. 04
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计:	1,329,878.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,102,250.41	21,214,385.08	6,112,134.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	15,102,250.41	21,214,385.08	6,112,134.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	296.15
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	4.18
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	306.73

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	30,225.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	30,225.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	70.63
预提费用	126,863.46
合计	126,934.09

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,209,333.83	19,209,333.83
本期申购	8,360,374.43	8,360,374.43
本期赎回(以“-”号填列)	-14,835,105.22	-14,835,105.22
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	12,734,603.04	12,734,603.04

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	276,720.18	7,396,107.08	7,672,827.26
本期利润	8,638,833.74	-2,238,166.97	6,400,666.77
本期基金份额交易产生的变动数	-1,767,460.75	-2,635,021.84	-4,402,482.59
其中：基金申购款	1,710,481.18	3,319,382.48	5,029,863.66
基金赎回款	-3,477,941.93	-5,954,404.32	-9,432,346.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,148,093.17	2,522,918.27	9,671,011.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	6,167.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	222.91
其他	4.14
合计	6,394.83

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	27,023,006.09
减：卖出股票成本总额	18,362,491.40
买卖股票差价收入	8,660,514.69

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	156,891.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	156,891.32

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,238,166.97
——股票投资	-2,238,166.97
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-2,238,166.97

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	178,174.83
合计	178,174.83

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	61,616.27
银行间市场交易费用	-
合计	61,616.27

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
其他	1,728.63
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	2,474.10
合计	181,066.19

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至2015年6月30日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	101,439.55	132,957.50
其中：支付销售机构的客户维护费	13,746.19	-

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$ ，H为每日应计提的基金管理费，E为前一日的基金资产净值。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日

当期发生的基金应支付的托管费	19,019.92	24,929.51
----------------	-----------	-----------

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ ，H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日的基金资产净值。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	10,001,250.00
期初持有的基金份额	10,001,250.00	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	10,001,250.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	52.0600%	28.3300%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、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。

3、基金管理人以上述固有资金作为本基金的发起资金，自本基金基金合同生效之日起，所认购的基金份额持有期限不低于三年。

6.4.10.4.2 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：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未有除基金管理人之外的其他关联方持有本基金份额。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30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	1,329,878.04	6,167.78	2,401,185.23	8,835.47

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 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
000024	招商地产	2015年4月3日	临时停牌	31.64	-	-	3,752	69,818.23	118,713.28	-
600886	国投电力	2015年6月24日	临时停牌	14.87	-	-	5,757	25,703.99	85,606.59	-
000778	新兴铸管	2015年6月15日	临时停牌	12.96	-	-	5,825	29,140.55	75,492.00	-
600153	建发股份	2015年6月30日	临时停牌	17.51	-	-	3,700	25,421.70	64,787.00	-
000917	电广	2015年	临时	42.89	-	-	1,430	21,979.95	61,332.70	-

	传媒	5月28日	停牌							
002375	亚厦股份	2015年6月17日	临时停牌	29.21	2015年7月20日	26.29	1,820	29,806.31	53,162.20	-
000709	河北钢铁	2015年6月30日	临时停牌	7.00	-	-	7,294	25,749.44	51,058.00	-
000878	云南铜业	2015年6月8日	临时停牌	24.50	-	-	1,772	29,568.13	43,414.00	-
002353	杰瑞股份	2015年5月27日	临时停牌	44.35	-	-	900	33,581.76	39,915.00	-
601633	长城汽车	2015年6月19日	临时停牌	42.76	-	-	921	44,170.66	39,381.96	-
000963	华东医药	2015年6月26日	临时停牌	71.48	-	-	346	15,048.50	24,732.08	-
002001	新和成	2015年6月30日	临时停牌	17.09	2015年7月13日	18.49	814	10,025.25	13,911.26	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理，对公司建立风险管理体系和

维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，协助董事会进行风险管理，风险管理委员会负责起草公司风险管理战略，审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。经理层负责落实董事会拟定的风险管理政策，并对风险控制的有效执行承担责任。经理层下设风险控制委员会，协助经理层进行风险控制，风险控制委员会负责组织风险管理体系的建设，确定风险管理原则、目标和方法，审议风险管理制度和流程，指导重大风险事件的处理。督察长负责监督检查公司风险管理工作的执行情况，评价公司内部风险控制制度的合法性、合规性和有效性，并向董事会报告。公司各部门是风险控制措施的执行部门，负责识别和控制业务活动中潜在风险，做好风险的事先防范与控制，作为一线责任人将风险控制在最小范围内。同时，公司设立监察稽核部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控与分析，并向经理层汇报。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持有的金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自基金份额持有人随时可以赎回其持有的份额，另一方面来自于投资品种所处的市场交易不活跃所带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此本期末本基金持有的证券均能及时变

现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、部分应收申购款及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,329,878.04	-	-	-	-	-	1,329,878.04
结算备付金	14,279.08	-	-	-	-	-	14,279.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-21,214,385.08	21,214,385.08
应收利息	-	-	-	-	-	306.73	306.73
应收申购款	-	-	-	-	-	104,811.86	104,811.86
资产总计	1,344,157.12	-	-	-	-	-21,319,503.67	22,663,660.79
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	54,102.24	54,102.24
应付赎回款	-	-	-	-	-	26,927.19	26,927.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	16,722.27	16,722.27
应付托管费	-	-	-	-	-	3,135.42	3,135.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	30,225.10	30,225.10
其他负债	-	-	-	-	-	126,934.09	126,934.09
负债总计	-	-	-	-	-	258,046.31	258,046.31
利率敏感度缺口	1,344,157.12	-	-	-	-	-21,061,457.36	22,405,614.48
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,784,681.22	-	-	-	-	-	1,784,681.22
结算备付金	2,655.50	-	-	-	-	-	2,655.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-25,511,914.88	25,511,914.88
应收证券清算款	-	-	-	-	-	28,168.53	28,168.53
应收利息	-	-	-	-	-	440.66	440.66
应收申购款	-	-	-	-	-	96,837.95	96,837.95

资产总计	1,787,336.72	-	-	-	-25,637,362.02	27,424,698.74
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	12,089.79	12,089.79
应付赎回款	-	-	-	-	198,797.10	198,797.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	16,960.60	16,960.60
应付托管费	-	-	-	-	3,180.13	3,180.13
应付交易费用	-	-	-	-	16,230.37	16,230.37
其他负债	-	-	-	-	295,279.66	295,279.66
负债总计	-	-	-	-	542,537.65	542,537.65
利率敏感度缺口	1,787,336.72	-	-	-	-25,094,824.37	26,882,161.09

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 1 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1、基准点利率增加 1 个基点	0.00	0.00
	2、基准点利率减少 1 个基点	0.00	0.00

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格

风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	21,214,385.08	94.68	25,511,914.88	94.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,214,385.08	94.68	25,511,914.88	94.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金所投资证券的贝塔系数紧密相关； 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	1、业绩比较基准减少1%	-205,925.68	-258,988.73
2、业绩比较基准增加1%	205,925.68	258,988.73	

注：1、本基金管理人运用资本-资产定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响；

2、本期末时间为2015年6月30日；

3、资产负债表日基金资产净值的影响金额单位为人民币元。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。	
假设	1. 置信区间 -

	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2015 年 6 月 30 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层级：

第一层级：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层级：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 21,214,385.08 元，无属于第二层级、第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于其进行估值调整之日起从第一层级转入第二层级或第三层级，于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层级或第三层级转入第一层级。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层级转入第一层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	21,214,385.08	93.61
	其中：股票	21,214,385.08	93.61
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	1,344,157.12	5.93
7	其他各项资产	105,118.59	0.46
8	合计	22,663,660.79	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,064,649.93	4.75
C	制造业	7,028,386.31	31.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	748,849.53	3.34
E	建筑业	913,599.07	4.08
F	批发和零售业	314,560.43	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	752,844.25	3.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,260,181.41	5.62
J	金融业	7,205,622.65	32.16
K	房地产业	1,078,387.40	4.81
L	租赁和商务服务业	227,100.67	1.01

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	234,348.54	1.05
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	204,739.07	0.91
S	综合	-	-
	合计	21,033,269.26	93.86

7.2.2 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（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	181,115.82	0.81
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	181,115.82	0.81

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

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	601318	中国平安	9,633	789,328.02	3.52
2	600036	招商银行	29,539	552,970.08	2.47
3	600016	民生银行	46,491	462,120.54	2.06
4	600030	中信证券	16,086	432,874.26	1.93
5	601166	兴业银行	22,806	393,403.50	1.76
6	600000	浦发银行	23,082	391,470.72	1.75
7	600837	海通证券	16,642	362,795.60	1.62
8	601766	中国南车	19,220	352,879.20	1.57
9	600519	贵州茅台	1,149	296,039.85	1.32
10	601988	中国银行	58,516	286,143.24	1.28
11	000002	万科A	18,602	270,101.04	1.21
12	300059	东方财富	4,197	264,788.73	1.18
13	601169	北京银行	19,578	260,778.96	1.16
14	601328	交通银行	31,130	256,511.20	1.14
15	601668	中国建筑	30,186	250,845.66	1.12
16	000651	格力电器	3,861	246,717.90	1.10
17	600887	伊利股份	12,716	240,332.40	1.07
18	601989	中国重工	15,758	233,218.40	1.04
19	600048	保利地产	19,033	217,356.86	0.97
20	601288	农业银行	55,554	206,105.34	0.92
21	601390	中国中铁	14,179	194,110.51	0.87
22	601818	光大银行	36,057	193,265.52	0.86
23	601601	中国太保	6,334	191,160.12	0.85
24	000001	平安银行	12,223	177,722.42	0.79
25	600050	中国联通	23,617	173,112.61	0.77
26	600795	国电电力	24,605	171,496.85	0.77
27	600999	招商证券	6,306	166,856.76	0.74
28	000333	美的集团	4,352	162,242.56	0.72
29	600104	上汽集团	6,885	155,601.00	0.69
30	600900	长江电力	10,772	154,578.20	0.69
31	601336	新华保险	2,439	148,925.34	0.66
32	601688	华泰证券	6,374	147,430.62	0.66
33	600570	恒生电子	1,315	147,345.75	0.66

34	601006	大秦铁路	9,586	134,587.44	0.60
35	000069	华侨城 A	10,342	134,239.16	0.60
36	601628	中国人寿	3,911	122,492.52	0.55
37	600015	华夏银行	7,954	120,980.34	0.54
38	600690	青岛海尔	3,918	118,832.94	0.53
39	000024	招商地产	3,752	118,713.28	0.53
40	002415	海康威视	2,557	114,553.60	0.51
41	000776	广发证券	5,046	114,291.90	0.51
42	600271	航天信息	1,764	114,148.44	0.51
43	601398	工商银行	21,203	111,951.84	0.50
44	601901	方正证券	9,345	111,112.05	0.50
45	000503	海虹控股	2,217	108,633.00	0.48
46	600276	恒瑞医药	2,391	106,495.14	0.48
47	000728	国元证券	2,752	104,520.96	0.47
48	600583	海油工程	6,267	104,408.22	0.47
49	600893	中航动力	1,956	103,961.40	0.46
50	601939	建设银行	14,341	102,251.33	0.46
51	601899	紫金矿业	19,857	101,667.84	0.45
52	600028	中国石化	14,251	100,612.06	0.45
53	600703	三安光电	3,214	100,598.20	0.45
54	000625	长安汽车	4,712	99,658.80	0.44
55	600115	东方航空	8,000	98,560.00	0.44
56	601377	兴业证券	7,144	97,801.36	0.44
57	000063	中兴通讯	4,101	97,644.81	0.44
58	601186	中国铁建	6,236	97,468.68	0.44
59	600011	华能国际	6,887	96,624.61	0.43
60	601857	中国石油	8,491	96,203.03	0.43
61	600518	康美药业	5,352	94,890.96	0.42
62	600089	特变电工	6,372	94,369.32	0.42
63	000783	长江证券	6,764	94,357.80	0.42
64	600029	南方航空	6,400	93,056.00	0.42
65	000166	申万宏源	5,673	92,186.25	0.41
66	600010	包钢股份	17,499	90,819.81	0.41
67	600340	华夏幸福	2,980	90,741.00	0.40
68	600111	北方稀土	4,969	90,137.66	0.40
69	600415	小商品城	5,882	89,876.96	0.40
70	600019	宝钢股份	10,236	89,462.64	0.40
71	601788	光大证券	3,300	88,935.00	0.40
72	601009	南京银行	3,899	88,897.20	0.40

73	000100	TCL 集团	15,438	87,224.70	0.39
74	600100	同方股份	4,147	87,045.53	0.39
75	600352	浙江龙盛	6,108	86,550.36	0.39
76	600383	金地集团	6,835	86,462.75	0.39
77	600886	国投电力	5,757	85,606.59	0.38
78	000858	五 粮 液	2,597	82,324.90	0.37
79	601555	东吴证券	3,996	81,798.12	0.37
80	000538	云南白药	948	81,783.96	0.37
81	600109	国金证券	3,341	81,520.40	0.36
82	600804	鹏 博 士	2,729	81,487.94	0.36
83	002202	金风科技	4,184	81,462.48	0.36
84	000768	中航飞机	1,859	81,015.22	0.36
85	300024	机器人	1,015	78,418.90	0.35
86	600535	天 士 力	1,564	77,824.64	0.35
87	600009	上海机场	2,442	77,411.40	0.35
88	600649	城投控股	8,135	76,062.25	0.34
89	600118	中国卫星	1,334	75,984.64	0.34
90	000778	新兴铸管	5,825	75,492.00	0.34
91	601888	中国国旅	1,136	75,316.80	0.34
92	600688	上海石化	6,989	74,991.97	0.33
93	000157	中联重科	9,171	74,376.81	0.33
94	600588	用友网络	1,616	74,142.08	0.33
95	000402	金 融 街	5,238	74,012.94	0.33
96	000725	京东方 A	14,012	72,722.28	0.32
97	002304	洋河股份	1,042	72,273.12	0.32
98	601618	中国中冶	9,959	72,003.57	0.32
99	601669	中国电建	6,318	71,646.12	0.32
100	601808	中海油服	2,558	71,470.52	0.32
101	600085	同 仁 堂	1,972	70,814.52	0.32
102	600663	陆 家 嘴	1,415	70,382.10	0.31
103	002450	康得新	2,282	69,829.20	0.31
104	601600	中国铝业	7,456	69,564.48	0.31
105	600839	四川长虹	7,069	69,558.96	0.31
106	600674	川投能源	5,550	69,430.50	0.31
107	600637	百 视 通	1,648	69,347.84	0.31
108	600196	复星医药	2,388	69,108.72	0.31
109	600958	东方证券	2,400	68,688.00	0.31
110	600256	广汇能源	6,604	68,681.60	0.31
111	600406	国电南瑞	3,215	66,518.35	0.30

112	601018	宁波港	7,442	65,787.28	0.29
113	601088	中国神华	3,123	65,114.55	0.29
114	600705	中航资本	2,806	64,958.90	0.29
115	600741	华域汽车	3,041	64,925.35	0.29
116	600153	建发股份	3,700	64,787.00	0.29
117	601866	中海集运	6,666	63,327.00	0.28
118	002008	大族激光	2,155	61,891.60	0.28
119	600005	武钢股份	8,800	61,864.00	0.28
120	000423	东阿阿胶	1,132	61,694.00	0.28
121	601607	上海医药	2,765	61,576.55	0.27
122	000917	电广传媒	1,430	61,332.70	0.27
123	600066	宇通客车	2,956	60,745.80	0.27
124	600060	海信电器	2,462	60,540.58	0.27
125	600027	华电国际	5,392	59,959.04	0.27
126	601727	上海电气	4,000	59,720.00	0.27
127	600221	海南航空	9,339	59,676.21	0.27
128	000039	中集集团	1,825	58,947.50	0.26
129	002673	西部证券	2,068	58,669.16	0.26
130	600547	山东黄金	2,370	58,539.00	0.26
131	000568	泸州老窖	1,784	58,176.24	0.26
132	600315	上海家化	1,337	58,025.80	0.26
133	300070	碧水源	1,187	57,913.73	0.26
134	600309	万华化学	2,380	57,548.40	0.26
135	601333	广深铁路	6,971	57,301.62	0.26
136	300251	光线传媒	2,300	57,270.00	0.26
137	601933	永辉超市	4,929	57,127.11	0.25
138	600031	三一重工	5,818	56,376.42	0.25
139	600317	营口港	8,800	55,440.00	0.25
140	002230	科大讯飞	1,581	55,240.14	0.25
141	600585	海螺水泥	2,569	55,105.05	0.25
142	601800	中国交建	3,134	55,033.04	0.25
143	002594	比亚迪	981	54,180.63	0.24
144	601998	中信银行	6,977	53,792.67	0.24
145	002375	亚厦股份	1,820	53,162.20	0.24
146	000629	攀钢钒钛	9,918	53,160.48	0.24
147	600372	中航电子	1,494	52,185.42	0.23
148	600369	西南证券	2,600	51,090.00	0.23
149	000709	河北钢铁	7,294	51,058.00	0.23
150	002241	歌尔声学	1,415	50,798.50	0.23

151	600068	葛洲坝	4,301	50,278.69	0.22
152	600867	通化东宝	2,277	49,934.61	0.22
153	600157	永泰能源	7,165	49,295.20	0.22
154	601168	西部矿业	4,465	48,757.80	0.22
155	601898	中煤能源	4,267	48,729.14	0.22
156	600362	江西铜业	2,253	48,462.03	0.22
157	002475	立讯精密	1,425	48,179.25	0.22
158	600642	申能股份	4,810	48,148.10	0.21
159	600373	中文传媒	2,003	47,991.88	0.21
160	600018	上港集团	6,030	47,697.30	0.21
161	600332	白云山	1,374	47,348.04	0.21
162	300124	汇川技术	980	47,040.00	0.21
163	002081	金螳螂	1,654	46,626.26	0.21
164	000338	潍柴动力	1,452	45,970.32	0.21
165	600252	中恒集团	1,995	45,885.00	0.20
166	600489	中金黄金	3,514	45,225.18	0.20
167	601098	中南传媒	1,969	45,109.79	0.20
168	600660	福耀玻璃	3,154	45,039.12	0.20
169	002142	宁波银行	2,097	44,351.55	0.20
170	601179	中国西电	4,294	44,013.50	0.20
171	600827	百联股份	2,109	43,888.29	0.20
172	002465	海格通信	1,360	43,778.40	0.20
173	601258	庞大集团	8,014	43,756.44	0.20
174	002065	东华软件	1,519	43,671.25	0.19
175	000060	中金岭南	2,344	43,574.96	0.19
176	600718	东软集团	2,001	43,481.73	0.19
177	000878	云南铜业	1,772	43,414.00	0.19
178	002456	欧菲光	1,280	43,187.20	0.19
179	002236	大华股份	1,351	43,123.92	0.19
180	002007	华兰生物	970	42,961.30	0.19
181	000826	桑德环境	1,085	42,195.65	0.19
182	300058	蓝色光标	2,535	40,078.35	0.18
183	601231	环旭电子	2,348	39,939.48	0.18
184	002353	杰瑞股份	900	39,915.00	0.18
185	601633	长城汽车	921	39,381.96	0.18
186	600208	新湖中宝	4,944	38,167.68	0.17
187	600316	洪都航空	1,080	37,346.40	0.17
188	000792	盐湖股份	1,314	37,291.32	0.17
189	600549	厦门钨业	1,476	37,283.76	0.17

190	000831	五矿稀土	1,423	36,400.34	0.16
191	002146	荣盛发展	2,911	36,387.50	0.16
192	601992	金隅股份	2,961	35,383.95	0.16
193	600875	东方电气	1,680	34,389.60	0.15
194	600497	驰宏锌锗	2,322	33,877.98	0.15
195	600348	阳泉煤业	3,161	32,400.25	0.14
196	600633	浙报传媒	1,610	31,556.00	0.14
197	601699	潞安环能	3,246	31,388.82	0.14
198	002385	大北农	2,311	31,244.72	0.14
199	601991	大唐发电	3,900	31,122.00	0.14
200	000686	东北证券	1,598	31,113.06	0.14
201	000983	西山煤电	3,191	30,250.68	0.14
202	600873	梅花生物	2,811	29,346.84	0.13
203	002129	中环股份	1,462	28,932.98	0.13
204	603000	人民网	553	28,827.89	0.13
205	000581	威孚高科	917	28,417.83	0.13
206	600166	福田汽车	3,058	27,002.14	0.12
207	600150	中国船舶	522	26,883.00	0.12
208	000970	中科三环	1,283	26,442.63	0.12
209	600038	中直股份	419	25,957.05	0.12
210	601958	金钼股份	2,111	24,867.58	0.11
211	000963	华东医药	346	24,732.08	0.11
212	000400	许继电气	970	24,405.20	0.11
213	000425	徐工机械	1,819	24,138.13	0.11
214	000800	一汽轿车	941	23,412.08	0.10
215	002410	广联达	985	23,049.00	0.10
216	601928	凤凰传媒	1,334	22,811.40	0.10
217	002051	中工国际	753	22,424.34	0.10
218	002344	海宁皮城	1,112	21,828.56	0.10
219	000729	燕京啤酒	2,008	20,883.20	0.09
220	000895	双汇发展	955	20,370.15	0.09
221	002038	双鹭药业	347	19,657.55	0.09
222	300002	神州泰岳	1,260	19,202.40	0.09
223	600998	九州通	836	18,692.96	0.08
224	002570	贝因美	944	18,323.04	0.08
225	000598	兴蓉投资	1,848	17,685.36	0.08
226	000999	华润三九	546	16,592.94	0.07
227	002422	科伦药业	380	15,215.20	0.07
228	600809	山西汾酒	536	15,136.64	0.07

229	600597	光明乳业	627	14,421.00	0.06
230	601158	重庆水务	1,322	14,198.28	0.06
231	000898	鞍钢股份	1,934	14,118.20	0.06
232	002001	新和成	814	13,911.26	0.06
233	002653	海思科	373	10,071.00	0.04
234	600600	青岛啤酒	204	9,504.36	0.04

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600446	金证股份	1,467	181,115.82	0.81

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600446	金证股份	661,071.00	2.46
2	300059	东方财富	464,362.00	1.73
3	601988	中国银行	341,804.00	1.27
4	601318	中国平安	337,847.00	1.26
5	600030	中信证券	331,957.00	1.23
6	601766	中国南车	317,536.35	1.18
7	600837	海通证券	307,161.00	1.14
8	300168	万达信息	294,094.32	1.09
9	601633	长城汽车	288,883.00	1.07
10	600570	恒生电子	269,035.00	1.00
11	600016	民生银行	262,580.00	0.98
12	601166	兴业银行	241,830.00	0.90
13	601169	北京银行	236,548.00	0.88
14	601231	环旭电子	198,450.00	0.74
15	600369	西南证券	197,228.00	0.73
16	600050	中国联通	195,842.00	0.73
17	601186	中国铁建	191,177.00	0.71

18	600109	国金证券	177,999.00	0.66
19	601688	华泰证券	175,210.00	0.65
20	600271	航天信息	173,530.00	0.65

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	757,623.87	2.82
2	600016	民生银行	629,317.82	2.34
3	600446	金证股份	560,281.48	2.08
4	600030	中信证券	558,800.47	2.08
5	600036	招商银行	461,760.29	1.72
6	600837	海通证券	460,101.91	1.71
7	601166	兴业银行	429,827.64	1.60
8	600588	用友网络	410,024.52	1.53
9	600000	浦发银行	406,158.83	1.51
10	601633	长城汽车	403,928.69	1.50
11	601186	中国铁建	377,180.59	1.40
12	002065	东华软件	337,349.47	1.25
13	300168	万达信息	313,025.41	1.16
14	601766	中国南车	310,497.48	1.16
15	000002	万科A	303,261.62	1.13
16	601668	中国建筑	302,311.98	1.12
17	002475	立讯精密	293,413.63	1.09
18	601390	中国中铁	270,122.70	1.00
19	600369	西南证券	264,104.47	0.98
20	300059	东方财富	258,784.63	0.96

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。

7.4.3 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	16,303,128.57
卖出股票收入（成交）总额	27,023,006.09

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	306.73
5	应收申购款	104,811.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,118.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 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情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
253	50,334.40	10,031,950.00	78.78%	2,702,653.04	21.22%

8.2 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	韦翠凤	57,800.00	20.80%
2	平安证券有限责任公司	30,700.00	11.05%
3	马兴云	25,100.00	9.03%
4	郝瑞青	20,001.00	7.20%
5	杨志军	15,850.00	5.70%
6	赵立民	15,000.00	5.40%
7	翼建成	7,200.00	2.59%
8	韩志锋	7,000.00	2.52%
9	曾亭曦	5,800.00	2.09%
10	谷玉坤	5,700.00	2.05%

8.3 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	0.00	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

8.5 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	78.54	10,001,250.00	78.54	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	78.54	10,001,250.00	78.54	-

§ 9 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	19,209,333.83
本报告期基金总申购份额	8,360,374.43
减:本报告期基金总赎回份额	14,835,105.22
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	12,734,603.04

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2015年4月22日，经华宸未来基金管理有限公司第一届董事会第二十一次会议决议通过，阙水深先生不再担任公司总经理职务。

2015年4月26日，华宸未来基金管理有限公司召开第十一次股东会，选举产生公司第二届董事会。第二届董事会董事为于建琳女士、刘玉瀛先生、钱小鸣先生、辛炯官先生、王温先生、陈湘义先生、高书生先生。其中，于建琳女士、刘玉瀛先生、钱小鸣先生为新当选董事，王温先生、陈湘义先生、高书生先生为新当选独立董事。向旭平先生、甄学军先生、阙水深先生、汪新先生不再担任董事，谭向东先生、康书生先生、胡奕明女士不再担任独立董事。

2015年4月26日，经华宸未来基金管理有限公司第二届董事会第一次会议决议通过，向旭平先生不再担任公司董事长职务。

(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，本基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 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，原华宸 300 基金经理王宇与基金管理人因劳动关系纠纷发生争议，经过仲裁、一审判决后，基金管理人于 2015 年 1 月 23 日收到终审判决：基金管理人应支付王宇相关工资差额、并办理相关退工手续。管理人已经按照判决内容与王宇解除劳动关系。

除此之外，无其他涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为基金进行审计的会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
民生证券	1	30,417,234.19	71.49%	21,608.79	71.49%	-
中信证券	2	12,128,622.77	28.51%	8,616.31	28.51%	-

10.7.2 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
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：本报告期内本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）代销机构并开通基金定投业务及参与费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年6月23日
2	关于新增上海好买基金销售有限公司为华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）代销机构并开通基金定投业务及参与费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年6月11日
3	华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2015年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年6月4日
4	华宸未来基金管理有限公司关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年5月28日
5	关于新增广州证券股份有限公司为华宸未来沪深300指数增强型发起式投资基金（LOF）代销机构并参与费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年4月30日
6	华宸未来沪深300指数增强型发起	中国证券报、上海证	2015年4月21日

	式证券投资基金(LOF)2015年第1季度报告	券报、证券时报及本公司网站	
7	华宸未来基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年4月1日
8	华宸未来基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年3月31日
9	华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金(LOF)2014年度报告及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年3月31日
10	华宸未来基金管理有限公司关于旗下基金参与齐鲁证券有限公司网上交易申购(含定投)费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年3月18日
11	关于华宸未来基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年2月9日
12	关于新增上海天天基金销售有限公司为华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金(LOF)代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年1月30日
13	华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金(LOF)2014年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年1月22日
14	华宸未来基金管理有限公司关于旗下证券投资基金2014年12月31日基金资产净值和基金份额净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站	2015年1月5日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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、基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 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 8 月 29 日