

(上接B1版)

国海富兰克林研究精选	B51	国泰黄金交易	B281
国海富兰克林中国收益	B57	国泰基金	B43
国海富兰克林中大盘	B60	国泰金鼎价值精选	B297
国金通用鑫鑫	A14	国泰金马稳健回报	B296
国金通用沪深 300	A15	国泰金牛创新	B294
国联安保本混合	B271	国泰金鹏蓝筹	B277
国联安德盛安心成长	B272	国泰金鹰增长	B298
国联安德盛精选	B274	国泰民安增利	B284
国联安德盛稳健	B273	国泰目标收益	B280
国联安德盛小盘	B256	国泰纳斯达克 100	B286
国联安德盛优势	B270	国泰区位优势	B306
国联安德盛增利	B269	国泰上证 5 年期	B287
国联安货币	B260	国泰上证 5 年期联接	B288
国联安上证大宗	B261	国泰事件驱动	B285
国联安上证大宗联接	B262	国泰信用互利	B291
国联安双佳信用	B266	国泰信用债券	B302
国联安双力中小板	B257	国泰中国企业	B283
国联安双禧中证 100	B267	国泰中小板 300	B289
国联安信心增长	B258	国泰中小板 300 联接	B290
国联安信心增益	B263	国泰核心中盘	B295
国联安优选行业	B259	国投瑞银策略精选	B92
国联安中债	B265	国投瑞银成长优选股票	B104
国联安中证股债	B264	国投瑞银创新动力股票	B105
国联安中证医药	B275	国投瑞银纯债债券	B98
国联安主题驱动	B268	国投瑞银核心企业股票	B107
国泰 6 个月短期	B282	国投瑞银沪深 300 金融	B91
国泰成长优选	B293	地产	B93
国泰大宗商品	B301	国投瑞银沪深 300 金融	B93
国泰估值优势	B278,B279	地产联接	B93
国泰国证房地产	B292	国投瑞银货币	B87
国泰国证医药	B276	国投瑞银景气行业混合	B88
国泰沪深 300	B299	国投瑞银沪深 300 联接	B89

海富通现金管理	B201
海富通养老收益	B200
海富通一年定期	B199
海富通中大盘	B212
海富通中证 100	B213
海富通中证内地低碳	B202
华安 7 日鑫	B163
华安 MSC1	B152
华安安顺	B191
华安安心收益	B166
华安安信	B153,B154
华安宝利	B151
华安保本混合	B161
华安标普全球石油	B173
华安策略优选	B150
华安创新	B149
华安纯债债券	B162
华安大中华	B176
华安动态灵活	B188
华安核心优选	B190
华安宏利	B189
华安沪深 300	B171
华安沪深 300 指数分级	B46
华安基金	B4
华安季季鑫	B168
华安科技动力	B172
华安可转债	B177
华安纳斯达克 100	B155
华安逆向策略	B167
华安强化收益	B185
华安日日鑫	B164
华安上证 180ETF	B187

华安上证 180ETF 联接	B186
华安上证龙头企业	B182
华安上证龙头企业联接	B181
华安深证 300	B169
华安升级主题	B178
华安双债添利	B160
华安稳定收益	B180
华安稳固收益	B179
华安现金富利	B175
华安香港精选	B183
华安信用四季红	B174
华安信用增强	B165
华安行业轮动	B184
华安易富黄金	B157
华安易富黄金联接	B156
华安月安鑫	B158
华安月月鑫	B170
华安中小盘	B159
华宝宝康灵活	B67
华宝宝康消费品	B82
华宝宝康债券	B79
华宝上证 180 成长 ETF	B78
华宝上证 180 成长 ETF 联接	B78
华宝兴业	B39
华宝兴业标普石油	B74
华宝兴业大盘	B83
华宝兴业动力	B61
华宝兴业多策略	B62
华宝兴业服务优选	B68
华宝兴业海外	B63
华宝兴业可转债	B76
华宝兴业上证 180 价值	B72

华宝兴业上证 180 价值联接	B71
华宝兴业收益	B64
华宝兴业先进	B65
华宝兴业现金宝	B66
华宝兴业现金添益	B70
华宝兴业新兴产业	B77
华宝兴业行业	B84
华宝兴业医药生物	B81
华宝兴业中证 100	B80
华宝兴业中证短融	B69
华宝兴业资源优选	B75
华宸未来信用增利	B2
华泰柏瑞	B43
华夏基金	B11
汇添富	B38
交银施罗德	A16
摩根士丹利华鑫	B31
南方基金	B3
融通基金	B3
上海产权	A11
泰达宏利	B12
泰信基金	B3
天弘基金	B12
信诚幸福消费	B13,B14,B15,B16
信达澳银	A16
易方达	A16
银华基金	B40
浙商基金	A16
中加货币市场	B316
中银基金	B3
中邮创业	A11

华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的发行已获中国证券监督管理委员会证监许可[2013]177号核准。自2013年7月25日起至2013年8月14日通过销售机构公开发售。本基金为契约型开放式基金。本基金的基金合同于2013年8月20日正式生效。

【重要提示】  
本基金于2013年2月19日经中国证监会证监许可[2013]177号核准募集。本基金的基金合同于2013年8月20日正式生效。

本招募说明书依据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务关系的基本法律文件。基金投资人认购基金即视为对基金合同的承认和接受,并视同《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金的基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本招募说明书中基金投资组合资产配置比例,由基金管理人根据基金合同的规定,并不表明其对基金的投资价值或收益作出实质性判断或保证,也不表明其对基金没有风险。

投资者阅读本招募说明书时应认真阅读本招募说明书。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人大量赎回基金份额产生的流动性风险,基金管理人运用基金资产进行证券投资决策而产生的投资风险,本基金的特有风险等。

本基金为证券投资基金。在募集时,基金管理人运用公司固有资金认购本基金的金额1,000万元,认购的基金份额持有期限不低于三年。基金管理人认购的基金份额持有期限满三年后,基金管理人将根据自身情况决定是否继续持有,届时,基金管理人有可能赎回认购的本基金份额。另外,在基金成立之日起三年后的对应日,如果本基金的资产规模低于2亿元,基金合同将自动终止,投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

本基金为债券型基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金,混合基金,高于货币市场基金。本基金将承担较高的系统性风险,以及因个别债券违约所形成的信用风险。因本基金的固定收益类资产主要投资于信用债,若信用债发行人出现违约,信用状况严重恶化或破产清算等情况,发行人有可能无法及时偿还本金及利息,进而而造成投资者资产与收益出现损失,因此信用债市场的波动对基金份额净值影响较大。

投资者在作出投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》、《基金托管协议》等法律文件。本招募说明书所载内容截止日为2014年2月20日,有关财务数据和净值表现截止日为2013年12月31日(未经审计)。

一、资产管理人  
(一)基金管理人概况

1.名称:华宸未来基金管理有限责任公司  
2.住所:上海市虹口区四川北路859号中信广场16楼  
3.办公地址:上海市虹口区四川北路859号中信广场16楼(200085)  
4.法定代表人:刘晓兵  
5.成立时间:2012年6月20日  
6.电话:021-20660999-6815  
7.联系人:王翼  
8.注册资本:2亿元人民币  
9.股权结构:华宸信托有限责任公司(以下简称“华宸信托”),韩国未来资产管理公司和咸阳长电电子科技开发有限公司,分别持有本基金管理人40%、25%和35%的股权。

(二)基金主要人员情况

1.董事会:董事长,男,民盟党员,北京大学工商管理硕士。现任华宸信托董事长,历任湘财证券常务副总裁,华鑫证券代理总裁等职务。

2.监事会:董事,男,中共党员,先后毕业于内蒙古农业大学、大连理工大学,经济学和法学双学士学位。现任华宸信托总经理,曾任内蒙古农业大学教师,团总支书记,1994年11月起,就职于华宸信托有限公司,历任人力资源部副经理、信贷管理部副经理、经理、公司副总经理。

3.高级管理人员:董事长,男,中共党员,厦门大学经济学(金融学)博士。历任光大证券固定收益部总经理,财富证券副董事长等职务。现任华宸未来基金管理有限责任公司董事、总经理,兼任深圳华宸未来资产管理(有限合伙)董事长。

4.独立董事:男,韩国籍,韩国成均馆大学中国语言文学士。先后在韩国现代证券国际金融、M&A、投融资、资产流动化等工作,历任现代证券上海代表处首席代表,未来资产管理(有限合伙)首席代表等职务。

5.独立董事:男,中共党员,经济金融(金融学)博士,先后任北京证券总裁,联合证券常务副总裁,宝盈基金管理公司董事长,城市国际信托投资公司董事长等。

6.独立董事:男,中共党员,厦门大学经济学(金融学)博士,教授,博士生导师。现任河北大学校长。

7.独立董事:女,博士学位,1991年起先后任厦门大学会计系副教授,厦门大学工商管理中心副教授,上海财经大学会计学院教授,研究院副院长;2005年起任上海交通大学安泰经济与管理学院财务研究中心主任。

8.独立董事:男,大学专科。先后担任黑龙江鸡西矿务局科长,陕西步长集团副总,黑龙江新医药集团有限公司董事长,现任北京天极计算机股份有限公司董事,浙江康莱特集团副总裁,西藏龙业矿业公司经理。

9.高级管理人员:刘晓兵,男,北京理工大学工商管理硕士。现任华宸信托董事长,历任湘财证券常务副总裁,华鑫证券代理总裁等职务。

10.基金经理:王翼,厦门大学经济学(金融学)博士。历任光大证券固定收益总部总经理,财富证券副董事长等职务,现任华宸未来基金管理有限责任公司董事、总经理,兼任深圳华宸未来资产管理(有限合伙)董事长。

11.基金经理:曹长军,男,东北财经大学经济学硕士。具有15年金融从业经历,历任安信证券投资银行部副经理,中国建设银行证券投资高级研究员等职务。

12.基金经理:李陈安,基金从业资格,基金经理,西安交通大学经济与金融学院,金融学学士。具有10年以上证券从业经历,历任光大证券资产管理部债券交易员,昆仑证券基金研究所宏观经济与债券研究员,西部证券固定收益部债券投资经理,财富证券固定收益部债券投资部副经理等职务。

13.投资决策委员会成员  
本基金投资决策委员会决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:  
主任委员:公司投资管理负责人  
委员:投资副总监兼研究总监宋磊,固定收益部总经理兼基金基金经理王翼,研究部高级研究员黄晓峰。

14.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、名称托管人  
(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司  
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号  
成立时间:1984年1月1日  
法定代表人:姜建清  
注册资本:人民币1,545,827亿元  
联系电话:010-66105799  
联系人:赵会军

(二)主要人员情况  
截至2013年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工146人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系,规范的管理模式,先进的运营系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、基金资产管理机构和企事业单位提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中丰富、成熟的经营经验,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2012年6月,中国工商银行共托管证券投资基金252只,其中封闭式7只,开放式245只。自2003年以来,本行连续八年获得香港《亚洲货币》英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等海内外权威财经媒体评选的30项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的认可和好评。

三、相关服务机构  
(一)基金份额发售机构

1.直销机构  
名称:华宸未来基金管理有限责任公司  
注册地址:上海市虹口区四川北路859号中信广场16楼  
办公地址:上海市虹口区四川北路859号中信广场16楼(200085)  
法定代表人:刘晓兵  
电话:021-20660999  
传真:021-65870256  
联系人:唐艳华

2.代销机构  
(1)中国工商银行股份有限公司  
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

## 华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要 (2014年第1号)

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号  
法定代表人:姜建清  
电话:010-66105799  
联系人:赵会军

(2)齐鲁证券有限公司  
住所:山东省济南市经七路86号  
法定代表人:李玮  
客户服务热线:95538  
传真:0531-68891357  
公司网站:www.qlzq.com.cn

(3)国海证券股份有限公司  
住所:广西桂林市辅政路13号  
法定代表人:张维铭  
联系电话:0771-5539262  
传真:0771-5539033

(4)申银万国证券股份有限公司  
住所:上海市浦东新区世纪大道160号  
法定代表人:储晓明  
电话:021-54033333  
传真:021-54035888  
公司网站:www.sw2000.com.cn

(5)信达证券股份有限公司  
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
法定代表人:高冠斌  
联系电话:010-63081000  
传真:010-63080979  
客服电话:400-800-8899

公司网站: http://www.cindasc.com  
(6)中原证券股份有限公司  
住所:郑州市郑东新区东大街66号4号楼  
法定代表人:王常营  
开放式基金咨询电话:4008888108  
开放式基金业务传真:010-85130577  
公司网站: http://www.cc108.com

(7)中信万通证券股份有限公司  
住所:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层  
法定代表人:杨宝林  
客户服务电话:96577  
传真:(0532)85022605  
公司网站: http://www.zwtz.com.cn

(8)华安证券股份有限公司  
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座  
法定代表人:李东方  
统一客服电话:95588  
公司网站: http://www.ha.cn

(9)中国中投证券(浙江)有限责任公司  
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层  
法定代表人:沈强  
统一客服电话:0571-96598  
公司网站: http://www.chinainv.com.cn

(10)光大证券股份有限公司  
注册地址:上海市静安区新闻路1508号  
办公地址:上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人:徐浩光  
注册资本:34,812万元  
组织形式:股份有限公司  
存续期间:持续经营  
电话:021-22169999  
传真:021-22169134  
客服电话:95525  
网址: http://www.ebscn.com

(11)兴业证券股份有限公司  
注册地址:福州市湖东路268号  
办公地址:上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20楼  
法定代表人:兰荣  
注册资本:22亿元  
组织形式:股份有限公司  
存续期间:持续经营  
电话:0591-38507679  
传真:0591-38507538  
客服电话:95562  
网址: www.xyzq.com.cn

(12)中国中投证券(上海)有限公司  
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
法定代表人:陈有安  
客户服务热线:400-8888-888  
电话:010-66568430  
联系人:田薇

公司网站: http://www.chinastock.com.cn  
(13)中信证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区益田路4068号  
法定代表人:孔杰  
联系人:文思婷  
联系电话:010-83991737  
传真:010-66412537  
客服电话:400-660-9839  
网址: http://www.citicsq.com.cn

(14)杭州数米基金销售有限公司  
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路2号  
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法定代表人:陈雁峰  
联系人:周晓雯  
联系电话:0571-28829790,021-60897869  
客服电话:4000-766-123  
传真:0571-26089533  
网址: www.fund123.com

(15)浙江同花顺基金销售有限公司  
注册地址:浙江省杭州市文二路9号元茂大厦903  
办公地址:浙江省杭州市文二路9号元茂大厦903  
法定代表人:李骁  
联系人:李骁  
联系电话:0571-86736666  
客服电话:400-0767666  
网址: www.ijij.com.cn

(16)上海长量基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区高路路526号2幢220室  
办公地址:上海市浦东新区高路路526号2幢220室  
法定代表人:张跃伟  
联系人:陈静  
联系电话:021-58786788-8201  
客服电话:400-089-1289  
网址: www.chinifund.com

(17)国泰君安证券股份有限公司  
住所:上海市浦东新区商城路618号  
法定代表人:丁建华  
电话:021-38676666  
传真:021-38676666  
网址: www.gtja.com.cn  
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构  
名称:华宸未来基金管理有限责任公司

住所:上海市虹口区四川北路859号中信广场16楼  
法定代表人:刘晓兵  
电话:021-20660999-6915  
传真:021-65870256  
联系人:唐艳华

(二)出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海锦泰律师事务所  
住所:上海市浦东新区南汇路256号华夏银行大厦1405室  
负责人:唐艳华  
电话:021-51150298  
传真:021-51150398

经办律师:刘佳、张兰  
联系人:张兰  
(四)审计会计师事务所的会计师事务所  
名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海黄浦区南京东路61号四楼  
电话:021-63391588  
经办注册会计师:孙涛、张帆

四、基金的投资  
一、基金的投资目标  
本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

二、基金的投资范围  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的国债、金融债、次级债、央行票据、银行存款、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离债、国债回购、权证、股指期货、货币市场基金以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他固定收益品种(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不从事二级市场买入股票,不参与一级市场股票首次公开发行或增发,但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票,因持有股票被派发的权证,因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票、权证,本基金应在其可交易之日起的10个工作日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,其中,投资于短期融资券及信用评级为AA+级(含)以上的其他信用债资产的比例不低于固定收益类资产的80%;本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

三、基金的投资策略  
资产配置策略。本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念,采用价值分析方法,在分析和判断财政政策、货币政策、宏观经济运行指标的基础上,自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的持仓目标,长期结构配置及资产配置;同时,采用“自下而上”的方法,在深入研究分析信用风险、流动性风险、收益水平、市场环境等因素基础上,自下而上的精选投资品种。

普通债券投资策略。本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值策略等管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各期限品种的利率进行预测,相机而动,积极调整。

附息债券投资策略。附息债券指对债券发行主体授予某种期权,或者赋予债券投资者某种期权,从而使债券发行或投资者有了某种灵活的选择余地,从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性,也增强了对各类投资者的吸引力。当前附息债券的主要种类有可转换公司债券、分离交易可转债公司债券以及含赎回或回售选择权的债券等。

回购投资策略。在运用回购和融资融券等工具,把信用产品和回购交易结合起来,管理人根据自身的信用评估,在信用风险和融资融券控制的前提下,或者通过回购融资来赚取超额收益,或者通过回购的不断滚动来获取信用收益和资金成本的利差。

九、基金的投资风险控制  
中债综合全价指数  
若上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,或在市场发生变化导致上述基准不再适用或有更合适基准的情况下,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的基金投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,并及时在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、基金的风险收益特征  
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于股票型和混合型基金。

十一、基金的投资组合报告  
华宸未来基金管理有限责任公司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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2014年3月5日复核了本报告中基金的投资组合、净值表现和投资组合报告等内容,保证本报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本报告中基金投资组合部分,本投资组合报告所载数据截至2013年12月31日。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	114,783,359.20	87.00
	其中:债券	114,783,359.20	87.00
3	买入返售金融资产	-	-
4	银行存款和结算备付金合计	10,738,814.86	8.14
5	其他资产	6,413,920.90	4.86
6	合计	131,935,195.96	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合  
本基金本报告期末未持有股票投资。

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  
本基金本报告期末未持有股票投资。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	99,370,559.20	76.75
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	15,412,800.00	11.90
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	114,783,359.20	88.65

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124363	13国债(20)	300,000	31,200,000.00	24.10
2	124346	13国债(20)	200,000	20,900,000.00	15.52
3	124364				