

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:2014年08月25日

华宸未来沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(LOF)

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺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法律责任。

Table with 2 columns: Item (基金简称, 场内简称, etc.) and Value (华宸 300, 华宸 300, etc.)

2.1 基金基本情况
基金简称: 华宸 300
场内简称: 华宸 300
基金主代码: 167901

Table with 2 columns: Item (名称, 基金管理人, etc.) and Value (华宸未来基金管理有限公司, 中信银行股份有限公司, etc.)

2.2 基金产品说明
投资目标: 本基金为指数增强型股票基金,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主动的资产配置与风险控制。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称: 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

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间报告指标
报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

Table with 2 columns: Item (本期期末余额, 期初余额) and Value (-1,167,073.36, -2,433,688.34, etc.)

3.1.2 基金净值表现
报告期内基金份额净值增长率: -4.38%

Table with 5 columns: Period (过去一个月, 过去三个月, etc.), Object (沪深 300 指数), and Value (1.05%, 0.22%, etc.)

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

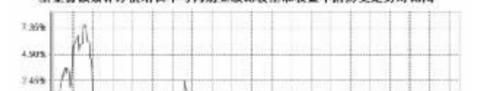


图 1: 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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+5%。
2.本基金成立于 2013 年 4 月 26 日,净值归一日期为 2013 年 4 月 26 日。本基金成立以来净值已实现正增长。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人基本情况
华宸未来基金管理有限公司经证监会证监许可[2012]1270 号文批准于 2012 年 6 月 20 日成立。

Table with 5 columns: Name, Position, Start Date, End Date, and Description.

4.1.2 基金基金经理情况
姓名: 职务: 任期起始日期: 离任日期: 证券从业资格: 说明

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人根据《基金合同》及《基金招募说明书》的约定,严格执行了基金合同约定的投资策略。

4.3 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.4 报告期内基金的业绩表现
截至 2014 年 6 月 30 日,本基金基金份额净值为 0.866,较期初增长率为 -4.38%。

4.5 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.6 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.7 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.8 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.9 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.10 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.11 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.12 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.13 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.14 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.15 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.16 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.17 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

4.18 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末,本基金投资组合资产配置情况如下:
股票: 40.45%; 债券: -3.01%; 货币: 37.41%; 其他: 1.83%

Table with 5 columns: Item (债券投资, 资产支持证券投资, etc.) and Value (--, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (公允价值变动收益, 其他综合收益, etc.) and Value (371,676.44, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (所有者权益, 实收基金, etc.) and Value (35,307,677.53, 40,457,169.79, etc.)

Table with 5 columns: Item (负债和所有者权益, 负债, etc.) and Value (2014年1月1日, 2014年6月30日, etc.)

Table with 5 columns: Item (短期借款, 交易性金融负债, etc.) and Value (--, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付债券, 应付利息, etc.) and Value (20,069.00, 3,762.93, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (公允价值变动收益, 其他综合收益, etc.) and Value (371,676.44, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (所有者权益, 实收基金, etc.) and Value (35,307,677.53, 40,457,169.79, etc.)

Table with 5 columns: Item (负债和所有者权益, 负债, etc.) and Value (2014年1月1日, 2014年6月30日, etc.)

Table with 5 columns: Item (短期借款, 交易性金融负债, etc.) and Value (--, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付债券, 应付利息, etc.) and Value (20,069.00, 3,762.93, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (应付利息, 应付股利, etc.) and Value (483.93, --, etc.)

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4 报告期内股指期货投资情况
7.4.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况

Table with 5 columns: Item (序号, 股票代码, etc.) and Value (1, 002049, etc.)

7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 买入股指期货合约基本情况
7.4.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 买入股指期货合约基本情况