

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】半年度报告摘要

整。

6.1资产净值表
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:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币			
银行存款		2,401,185.23	2,380,962.24
结算备付金		-	65,544.43
存出保证金		-	-
交易性金融资产		28,401,876.42	35,281,271.25
其中:股票投资		28,401,876.42	35,281,271.25
基金投资		-	-
资产支持证券		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		483.93	590.83
应收股利		-	-
应收申购款		-	592.88
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		30,803,539.58	37,377,961.63
负债和所有者权益	附注号	2014年6月30日	2013年12月31日
负债:			
应付账款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,609.00	26,389.44
应付托管费		3,762.93	4,948.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费		6,672.79	20,344.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
负债总计		21,821.05	245,000.00
所有者权益		242,528.77	296,641.60
所有者权益:			
实收基金		35,307,677.53	40,457,169.79
未分配利润		-4,746,463.72	-3,015,889.76
所有者权益合计		30,561,213.81	37,441,280.03
负债和所有者权益总计		30,803,539.58	37,377,961.63

项目	附注号	本期 2014年6月30日	上年度 2013年12月31日
公允价值			
衍生金融资产		-	-
衍生金融负债		-	-
衍生金融资产		-	-
要回金融资产资产		-	-
衍生金融资产		-	-
应付管理人报酬		20,609.00	26,389.44
应付托管费		3,762.93	4,948.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费		6,672.79	20,344.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
负债总计		21,821.05	245,000.00
所有者权益		242,528.77	296,641.60
所有者权益:			
实收基金		35,307,677.53	40,457,169.79
未分配利润		-4,746,463.72	-3,015,889.76
所有者权益合计		30,561,213.81	37,441,280.03
负债和所有者权益总计		30,803,539.58	37,377,961.63

6.2 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-2,066,247.59	-4,196,552.11
1.利息收入		8,902.47	1,075,771.58
其中:存款利息收入		8,902.47	882,636.71
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		-	493,134.87
其他利息收入		-	-
2.股息收入		-	-
3.投资收益(损失以“-”号填列)		-418,540.31	-2,477,459.48
其中:股票投资收益		-1,190,216.75	-2,398,205.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
利息收入		371,624.64	220,746.43
投资收益		-1,266,384.98	-2,871,922.82
3.公允价值变动损益(损失以“-”号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		9,975.23	277,058.61
减:管理费用		367,410.75	477,998.71
1.管理人报酬		132,957.50	265,395.21
2.托管费		24,929.51	49,761.60
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		26,943.69	63,547.61
5.其他费用		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		182,580.05	99,294.29
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,433,658.34	-4,674,550.82

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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.4 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.5 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.6 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.7 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.8 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.9 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.10 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.11 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.12 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.13 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.14 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.15 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		40,457,169.79	37,441,280.03
本期增减变动金额(本期净损益)		-2,433,658.34	-4,674,550.82
二、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
其中:1.基金申购款		713,404.45	633,794.42
2.本期赎回款(含基金赎回和基金转换)		-5,862,922.71	-7,428,275.84
三、本期基金净值变动(基金净值变动)		-5,149,492.26	-6,794,461.42
四、期末所有者权益(基金净值)		35,307,677.53	30,646,818.61

6.16 利润分配表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	
----	-----	--