

兴全保本混合型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有3年以上相关工作经验,具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据《基金法》、《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内,本基金未实施利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

5 托管人报告

5.1 托管人依据《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》与《兴全保本混合型证券投资基金托管协议》,自2014年03月31日起执行兴全保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的托管职责。
报告期内,托管人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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,托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人和本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本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的真实、准确和完整发表意见
本托管人认真复核了本半年度报告中的财务信息、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资报告报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

5.4 半年度财务信息披露情况

6.1 资产负债表
本报告期内,兴全保本混合型证券投资基金基金合同于2014年6月30日
单位:人民币元

资产	附注	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
银行存款		185,850,516.64	1,809,205.51
结算备付金		1,986,040.32	140,993.18
存出保证金		217,579.52	513,789.29
交易性金融资产		373,951,874.20	536,601,634.59
其中:股票投资		7,435,000.00	21,342,885.98
基金投资		—	—
债券投资		366,516,874.20	517,288,748.61
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产		—	—
买入返售金融资产		—	3,000,000.00
应收证券清算款		3,779,661.96	—
应收利息		12,520,326.75	8,162,796.10
应收股利		—	—
应收申购款		36,622.38	3,072.28
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		578,144,451.75	552,083,490.92
负债和所有者权益	附注	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		88,899,840.35	5,500,000.00
应付证券清算款		—	1,724,273.21
应付赎回款		839,471.86	1,389,211.04
应付管理人报酬		524,024.96	613,107.13
应付托管费		86,619.22	94,324.18
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		11,001.56	83,703.33
应交税费		—	—
应付利息		29,954.39	716.83
应付股利		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		176,316.88	333,369.54
负债合计		90,561,229.22	9,738,705.17
所有者权益:			
实收基金		422,206,847.32	497,152,292.30
未分配利润		65,376,375.21	542,344,785.75
所有者权益合计		487,583,222.53	542,344,785.75
负债和所有者权益总计		578,144,451.75	552,083,490.92

项目	附注	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		35,631,438.11	44,098,079.98
1.利息收入		12,616,550.49	12,407,715.21
其中:存款利息收入		3,041,288.45	4,097,073.26
债券利息收入		9,535,844.90	11,875,189.85
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		24,417.14	93,452.10
其他利息收入		—	—
2.其他收入(损失以“-”填列)		14,706,768.17	56,371,891.64
其中:公允价值变动收益		15,249,714.43	18,280,266.44
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)		1,457,053.74	37,418,370.34
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益		—	333,254.86
股利收益		—	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)		—	-25,224,705.88
4.其他收入(损失以“-”填列)		199,269.65	543,179.01
其中:公允价值变动收益		6,032,022.06	7,449,796.34
5.其他收入(损失以“-”填列)		2,299,658.00	5,080,164.98
二、费用		507,639.62	781,563.85
1.销售服务费		—	—
2.其他费用		518,161.67	1,251,123.09
3.其他费用		1,550,460.95	161,825.32
其中:卖出回购金融资产支出		1,550,460.95	161,825.32
4.其他费用		157,001.84	166,113.12
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		29,598,516.05	36,657,289.64
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		29,598,516.05	36,657,289.64

注:本报告期末2014年6月30日,基金份额净值1.1548元,基金份额总额422206847.32份。
6.2 利润表
会计主体:兴全保本混合型证券投资基金
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	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		35,631,438.11	44,098,079.98
1.利息收入		12,616,550.49	12,407,715.21
其中:存款利息收入		3,041,288.45	4,097,073.26
债券利息收入		9,535,844.90	11,875,189.85
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		24,417.14	93,452.10
其他利息收入		—	—
2.其他收入(损失以“-”填列)		14,706,768.17	56,371,891.64
其中:公允价值变动收益		15,249,714.43	18,280,266.44
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		1,457,053.74	37,418,370.34
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益		—	333,254.86
股利收益		—	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		—	-25,224,705.88
4.其他收入(损失以“-”号填列)		199,269.65	543,179.01
其中:公允价值变动收益		6,032,022.06	7,449,796.34
5.其他收入(损失以“-”号填列)		2,299,658.00	5,080,164.98
二、费用		507,639.62	781,563.85
1.销售服务费		—	—
2.其他费用		518,161.67	1,251,123.09
3.其他费用		1,550,460.95	161,825.32
其中:卖出回购金融资产支出		1,550,460.95	161,825.32
4.其他费用		157,001.84	166,113.12
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		29,598,516.05	36,657,289.64
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		29,598,516.05	36,657,289.64

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:兴全保本混合型证券投资基金
本报告期: 2014年1月1日至2014年6月30日
单位:人民币元

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	本期 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)	497,152,292.20	45,492,493.55	542,344,785.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期增加)	—	29,598,516.05	29,598,516.05
三、本期基金投资资产产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-74,945,444.88	-9,414,634.39	-84,360,079.27
其中:1.基金申购款	17,551,881.08	2,362,496.55	19,914,307.41
2.基金赎回款	-92,497,255.74	-11,777,130.94	-104,274,386.68
四、本期所有者权益(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)	422,206,847.32	65,376,375.21	487,583,222.53
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	852,011,602.31	20,127,119.85	872,138,722.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期增加)	—	36,657,289.64	36,657,289.64
三、本期基金投资资产产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-194,339,347.78	-11,896,685.51	-206,236,033.29
其中:1.基金申购款	8,066,067.05	445,880.00	8,509,947.05
2.基金赎回款	-202,403,414.83	-12,342,565.51	-214,745,980.34
四、本期所有者权益(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)	—	—	—