

大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)

【2014】半年度报告摘要

本基金管理人严格按照本基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

5.1 报告期内本基金管理人遵守信守情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司2014年1月1日至2014年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,从事任何有损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
本托管人认为,大成基金管理有限公司在本基金的投资运作,基金资产净值的计算,基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等事项上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人认为,大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资报告等信息真实、准确、完整,未发现有所损害基金份额持有人利益的行为。

5.6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

资产主体:大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货 币:		
银行存款	127,226,347.80	303,412,201.13
结算备付金	1,053,396.97	2,804,484.53
存出保证金	1,211,295.30	1,118,301.63
交易性金融资产	5,780,550,100.04	6,633,449,045.28
其中:股票投资	5,042,457,544.04	6,103,137,862.98
基金投资	—	—
债券投资	738,092,556.00	530,311,182.30
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收货币资金	258,300,768.65	—
应收证券清算款	20,073,958.97	88,293,125.67
应收利息	7,866,694.38	1,978,924.58
应收股利	—	—
应收申购款	5,099.36	9,617.20
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	6,196,267,652.47	7,091,065,700.02
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	—	—
应付证券清算款	7,105,392.01	48,269,732.94
应付赎回款	2,613,816.90	3,247,511.56
应付管理人报酬	7,559,660.58	9,050,250.84
应付托管费	1,259,944.44	1,508,575.16
应付销售服务费	—	—
应付交易费	1,284,074.89	2,282,501.92
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	780,255.95	1,265,102.06
负债合计	20,063,143.77	65,823,474.48
所有者权益:		
实收基金	7,991,704,038.55	8,469,239,781.88
未分配利润	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
所有者权益合计	6,175,684,508.70	7,025,442,225.54
负债和所有者权益总计	6,196,267,652.47	7,091,065,700.02

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.606元,基金份额总额8,882,659,027.74份。

6.2 利润表

会计主体:大成创新成长混合型证券投资基金(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	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	-411,308,752.09	-588,557,468.06
1.利息收入	4,254,827.11	12,538,619.85
其中:存款利息收入	1,400,280.12	3,248,867.05
债券利息收入	2,752,382.03	1,354,373.44
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	102,164.96	2,935,379.36
其他利息收入	-235,309,117.35	7,497,639.86
2.投资收益(含公允价值变动)	-286,712,621.12	-58,575,330.85
其中:股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	-4,497,399.13
债券投资收益	—	1,032,884.84
资产支持证券投资损益	—	—
其他金融工具投资收益	—	—
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	55,900,501.90	65,040,086.87
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,270,257.41	-378,390,680.87
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7,814.96	17,016.10
减:公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	64,601,080.95	81,147,415.14
1.管理人报酬	47,558,352.70	55,915,968.78
2.托管费	7,559,660.58	9,050,250.84
3.销售服务费	—	—
4.其他费用	8,531,387.26	15,555,011.28
5.利息支出	—	—
其中:卖出回购金融资产支出	—	—
6.其他费用	354,912.22	357,506.06
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-475,019,813.64	-639,485,220.20
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-475,019,813.64	-639,485,220.20

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成创新成长混合型证券投资基金(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	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)	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-475,019,813.64	-639,485,220.20
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)	-477,553,743.33	103,607,840.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	7,991,704,038.55	6,175,684,508.70

6.4 本报告期末及上年度末公允价值计量属性及其公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.5 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.6 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.7 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.8 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.9 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.10 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.11 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.12 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.13 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.14 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.15 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.16 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.17 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.18 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.19 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.20 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.21 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.22 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.23 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.24 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.25 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013年1月1日至2013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、以公允价值计量的金融资产	8,469,239,781.88	-1,443,797,556.34
二、以公允价值计量的金融负债	-1,816,019,529.85	-1,443,797,556.34
三、以公允价值计量的金融资产和金融负债	6,653,260,252.03	-2,887,553,112.68

6.26 公允价值变动的说明

项 目	本期 2013
-----	------------