

**华夏兴和混合型证券投资基金  
(原兴和证券投资基金转型)  
2014年第2季度报告**

**2014年6月30日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年七月十九日

## §1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

华夏兴和混合型证券投资基金由兴和证券投资基金转型而成。依据2014年5月14日中国证监会《关于兴和证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（证券基金机构监管部部函[2014]239号），基金份额持有人大会决议生效。自2014年5月30日（原基金兴和终止上市日）起，原《兴和证券投资基金基金合同》失效，《华夏兴和混合型证券投资基金基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“华夏兴和混合型证券投资基金”。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

华夏兴和混合型证券投资基金报告期自2014年5月30日起至2014年6月30日止，原兴和证券投资基金报告期自2014年4月1日起至2014年5月29日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 华夏兴和混合型证券投资基金

基金简称	华夏兴和混合（场内简称：基金兴和）
基金主代码	519918
交易代码	519918
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 30 日
报告期末基金份额总额	3,049,712,611.25 份
投资目标	通过深入研究，发掘经济发展过程中受益于内需增长的优质公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析以及对市场趋势的判断，结合各类资产的风险收益水平，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并适时进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

### 2.2 原兴和证券投资基金

基金简称	华夏兴和封闭（场内简称：基金兴和）
基金主代码	500018
交易代码	500018
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 7 月 14 日

报告期末基金份额总额	3,000,000,000 份
投资目标	通过运用指数化投资方法和积极的投资运作，力求基金收益率超越我国证券市场的指数增长率（以中证 100 指数为参考），谋求基金资产长期增值。
投资策略	本基金资产在指数化投资、积极投资、债券投资中进行适当分配,谋求较低风险下的稳定收益。
业绩比较基准	本基金未规定业绩比较基准。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中高风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和混合基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	转型后	转型前
	报告期（2014年5月30日-2014年6月30日）	报告期（2014年4月1日-2014年5月29日）
1.本期已实现收益	-133,494,492.56	-38,128,424.57
2.本期利润	16,544,338.26	-7,412,083.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0055	-0.0025
4.期末基金资产净值	3,075,699,637.60	2,785,268,554.09
5.期末基金份额净值	1.009	0.9284

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③自 2014 年 5 月 30 日起，由《兴和证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏兴和混

合型证券投资基金基金合同》生效。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 华夏兴和混合型证券投资基金

##### 3.2.1.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

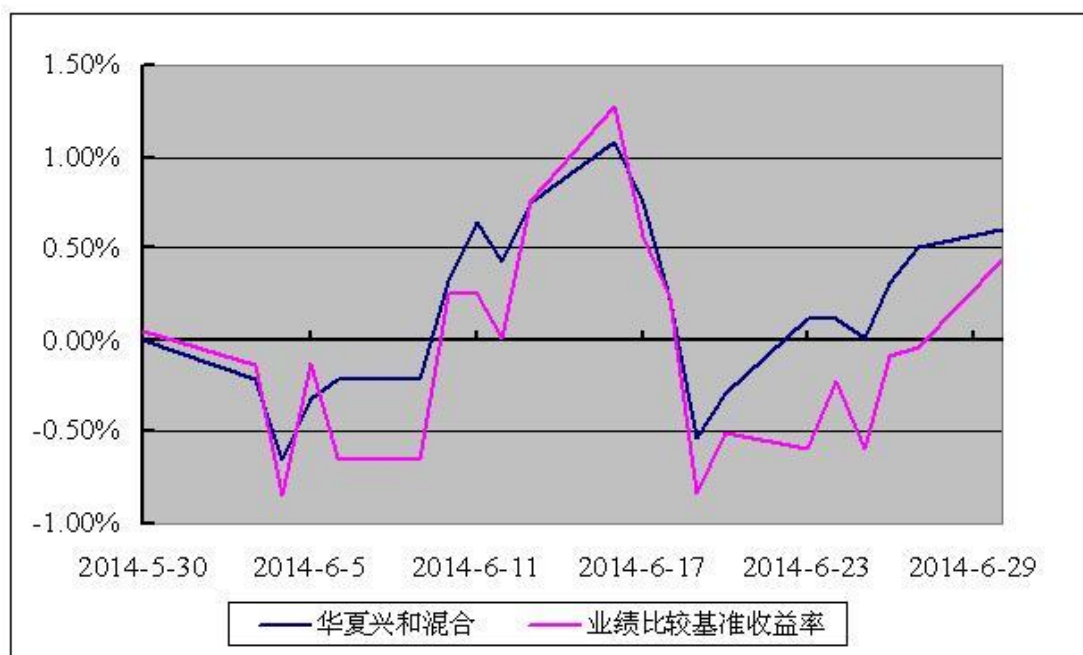
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014年5月30日-2014年6月30日	0.60%	0.34%	0.45%	0.53%	0.15%	-0.19%

##### 3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏兴和混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014年5月30日至2014年6月30日）



注：①自2014年5月30日起，由《兴和证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏兴和混合型证券投资基金基金合同》生效。

②根据华夏兴和混合型证券投资基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

### 3.2.2 原兴和证券投资基金

#### 3.2.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014年4月1日-2014年5月29日	-0.27%	1.35%	-	-	-	-

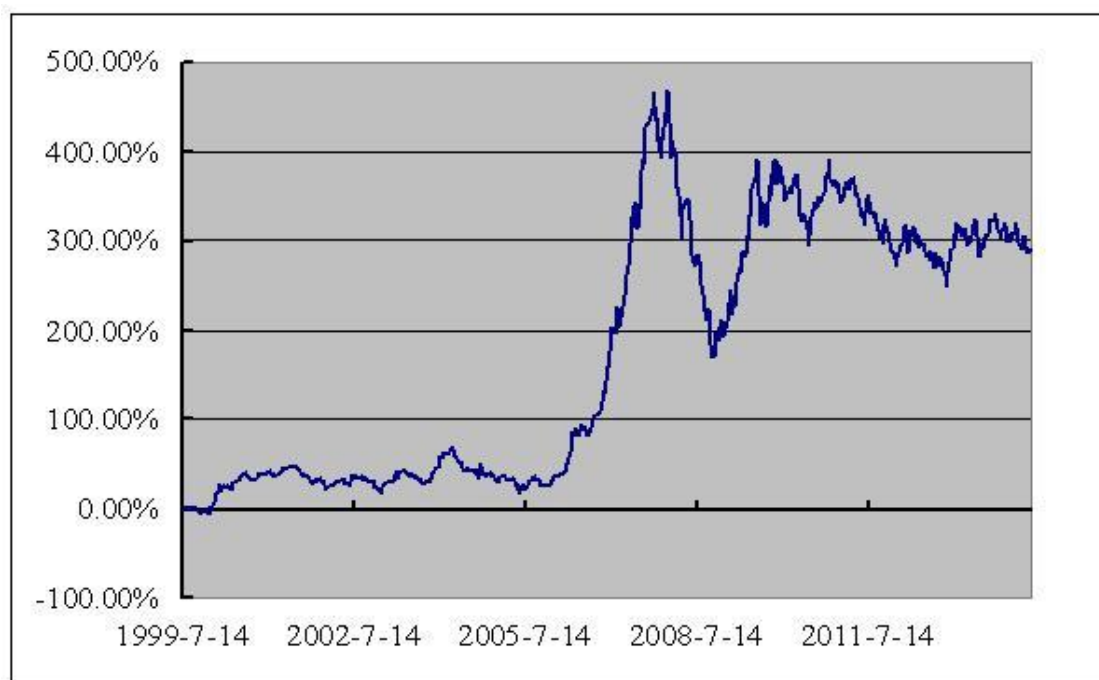
注：原兴和证券投资基金未规定业绩比较基准。

#### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

##### 原兴和证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014年4月1日至2014年5月29日）



注：原兴和证券投资基金未规定业绩比较基准。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

林峰	本基金的 基金经理	2014-5-30	-	13年	复旦大学经济学硕士。曾任西部证券投资经理，中国人民保险公司投资管理部、中国人保资产管理股份有限公司投资经理，中国人寿资产管理有限公司投资经理等。2013年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员等。2014年3月17日至2014年5月29日期间，任本基金转型前的兴和证券投资基金基金经理。
彭一博	本基金的 基金经理	2014-5-30	-	6年	北京大学经济学硕士。2008年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理等。2012年1月12日至2014年5月29日期间，任本基金转型前的兴和证券投资基金基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相

应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2 季度，宏观经济仍然不振，政策放松不断加码，放松的效果尚需观察。市场总体处于区间震荡。上证指数不断试探 2000 点，创业板指数一度出现调整并创出新低，但在新股发行数量明确之后又企稳反弹。

报告期内，本基金由封闭式基金转型为开放式基金，本基金将指数投资部分全部清仓，股票仓位保持在低水平。同时，重点布局符合转型方向的中低估值、中高业绩增长的中盘成长股，并少量参与了优质创业板股票的反弹行情，进一步优化组合。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金转型前，截至 2014 年 5 月 29 日，华夏兴和封闭基金份额净值为 0.9284 元，2014 年 4 月 1 日至 2014 年 5 月 29 日期间华夏兴和封闭基金份额净值增长率为 -0.27%，同期上证综指上涨 0.36%，深证成指上涨 2.11%。本基金转型后，截至 2014 年 6 月 30 日，华夏兴和混合基金份额净值为 1.009 元，2014 年 5 月 30 日至 6 月 30 日期间华夏兴和混合基金份额净值增长率为 0.60%，同期业绩比较基准增长率为 0.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 3 季度，政策放松的效果将逐渐显现，宏观经济将逐步企稳，但由于政策的意图是“只托不举”，一旦宏观经济企稳，政策放松力度就会骤减。市场仍处于存量资金博弈状态，整体性机会仍未到来，市场有结构性机会，但也存在局部风险。沪深 300 指数成份股估值合理，而小盘股尤其创业板股票估值较高，随着企业中报公布业绩不达预期，可能面临“戴维斯双杀效应”的风险。



3季度，本基金将聚焦“转型”这个大主题，在传统经济转型过程中寻找受益于“改革”和“创新”的成长股，主要在市盈率（PE）10倍至20倍、市值100亿左右的范围内选择中盘成长股进行投资，回避高估值伪成长小盘股，慎选缺乏弹性的大盘蓝筹股。行业方面，重点关注如风电、高铁、节能环保、新能源汽车等受宏观经济影响较小的拐点行业，旅游业等消费行业，轻工行业中的包装子行业等类消费行业，房地产、有色金属等早周期行业，并关注京津冀协同发展的主题投资。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

## §5 投资组合报告

### 5.1 华夏兴和混合型证券投资基金

（报告期末为2014年6月30日，报告期间为2014年5月30日至2014年6月30日）

#### 5.1.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	984,484,424.17	31.35
	其中：股票	984,484,424.17	31.35
2	固定收益投资	573,461,956.00	18.26
	其中：债券	573,461,956.00	18.26
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,499,701,970.00	47.76
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	71,364,703.36	2.27
7	其他各项资产	11,336,616.09	0.36
8	合计	3,140,349,669.62	100.00

#### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

A	农、林、牧、渔业	44,625,899.03	1.45
B	采矿业	58,373,591.35	1.90
C	制造业	498,031,144.59	16.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,790,000.00	0.09
F	批发和零售业	18,275,981.39	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	11,981,293.78	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,180,239.00	2.44
J	金融业	2,959,200.00	0.10
K	房地产业	163,325,126.12	5.31
L	租赁和商务服务业	56,120,090.40	1.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	52,821,858.51	1.72
	合计	984,484,424.17	32.01

## 5.1.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600340	华夏幸福	3,602,873	90,684,313.41	2.95
2	300072	三聚环保	3,749,202	74,946,547.98	2.44
3	002202	金风科技	6,631,500	62,932,935.00	2.05
4	600048	保利地产	12,674,877	62,867,389.92	2.04
5	600138	中青旅	2,576,680	56,120,090.40	1.82
6	600149	廊坊发展	4,162,479	52,821,858.51	1.72
7	600406	国电南瑞	3,338,970	44,508,470.10	1.45
8	002701	奥瑞金	1,959,712	39,527,391.04	1.29
9	000988	华工科技	4,099,780	38,496,934.20	1.25
10	002501	利源精制	2,821,929	38,350,015.11	1.25

## 5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	50,605,632.00	1.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	522,850,000.00	17.00
	其中：政策性金融债	522,850,000.00	17.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,324.00	0.00
8	其他	-	-
9	合计	573,461,956.00	18.64

### 5.1.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120413	12 农发 13	1,600,000	149,264,000.00	4.85
2	120410	12 农发 10	1,000,000	94,080,000.00	3.06
3	100236	10 国开 36	900,000	90,198,000.00	2.93
4	140436	14 农发 36	700,000	70,112,000.00	2.28
5	010107	21 国债(7)	502,040	50,605,632.00	1.65

### 5.1.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.1.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资策略

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.1.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	581,523.65
2	应收证券清算款	515,980.19
3	应收股利	-
4	应收利息	10,234,112.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	5,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,336,616.09

5.1.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113002	工行转债	6,324.00	0.00

5.1.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 5.2 原兴和证券投资基金

（报告期末为2014年5月29日，报告期间为2014年4月1日至2014年5月29日）

### 5.2.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,715,918,121.85	61.09
	其中：股票	1,715,918,121.85	61.09
2	固定收益投资	569,984,046.56	20.29
	其中：债券	569,984,046.56	20.29
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	240,000,000.00	8.54
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	238,020,002.72	8.47
7	其他各项资产	44,818,425.19	1.60
8	合计	2,808,740,596.32	100.00

### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	15,643,250.18	0.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	463,890,838.75	16.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,426,929.12	1.13
E	建筑业	30,088,795.32	1.08
F	批发和零售业	19,806,235.72	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	10,091,468.48	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,621,957.55	2.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	144,803,881.51	5.20
L	租赁和商务服务业	55,089,418.40	1.98
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	836,462,775.03	30.03

## 5.2.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	51,121,133.75	1.84
C	制造业	315,126,224.42	11.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,590,631.06	1.06
E	建筑业	28,666,826.56	1.03
F	批发和零售业	7,638,800.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	19,708,505.20	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,594,077.52	0.56
J	金融业	368,449,189.93	13.23
K	房地产业	33,027,966.38	1.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,488,140.88	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	6,043,851.12	0.22
	合计	879,455,346.82	31.58

## 5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

## 5.2.3.1 指数投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,363,059	54,495,098.82	1.96
2	600016	民生银行	6,377,260	47,319,269.20	1.70
3	600036	招商银行	4,210,936	42,741,000.40	1.53
4	600887	伊利股份	1,168,902	40,186,850.76	1.44
5	600519	贵州茅台	217,883	33,617,168.07	1.21
6	601166	兴业银行	2,996,703	29,547,491.58	1.06
7	600000	浦发银行	3,021,688	29,068,638.56	1.04
8	600837	海通证券	2,901,917	26,784,693.91	0.96
9	002415	海康威视	1,301,260	23,383,642.20	0.84
10	000002	万科A	2,473,756	21,125,876.24	0.76

5.2.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600048	保利地产	13,874,877	70,761,872.70	2.54
2	300072	三聚环保	3,749,202	65,761,003.08	2.36
3	002202	金风科技	6,631,500	62,004,525.00	2.23
4	600138	中青旅	2,576,680	55,089,418.40	1.98
5	600406	国电南瑞	3,338,970	44,374,911.30	1.59

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	81,680,400.00	2.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	480,256,000.00	17.24
	其中：政策性金融债	480,256,000.00	17.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,047,646.56	0.29
8	其他	-	-
9	合计	569,984,046.56	20.46

5.2.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120413	12农发13	1,600,000	147,952,000.00	5.31
2	120410	12农发10	1,000,000	93,260,000.00	3.35
3	100236	10国开36	900,000	90,036,000.00	3.23
4	010107	21国债(7)	810,000	81,680,400.00	2.93
5	110238	11国开38	500,000	48,810,000.00	1.75

5.2.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.2.10.1 本期国债期货投资策略

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.2.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日



前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.2.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.2.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	469,703.55
2	应收证券清算款	27,701,001.60
3	应收股利	127,964.60
4	应收利息	16,514,755.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	5,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,818,425.19

5.2.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113005	平安转债	7,683,130.80	0.28
2	127002	徐工转债	358,404.76	0.01
3	113002	工行转债	6,111.00	0.00

5.2.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.2.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	3,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	273,886,745.25
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-224,174,134.00
本报告期末基金份额总额	3,049,712,611.25

注：自2014年5月30日起，由《兴和证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏兴和混合型证券投资基金基金合同》生效。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 华夏兴和混合型证券投资基金

#### 7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	165,089,737.00
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-12,335,032.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	152,754,705.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.01

#### 7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 原兴和证券投资基金

#### 7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	165,089,737
报告期初至转型前买入总份额	-
报告期初至转型前卖出总份额	-
转型前最后一日管理人持有的封闭式基金份额	165,089,737
转型前最后一日持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	5.50

#### 7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内披露的主要事项

2014年4月11日发布华夏基金管理有限公司关于召开兴和证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

2014年4月26日发布关于兴和证券投资基金基金份额持有人大会表决结果

的公告。

2014年5月20日发布兴和证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告。

2014年5月26日发布兴和证券投资基金中止上市公告。

2014年5月28日发布兴和证券投资基金中止上市的提示性公告。

2014年5月29日发布华夏基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告。

2014年5月30日发布华夏兴和混合型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告。

2014年6月4日发布华夏基金管理有限公司关于华夏兴和混合型证券投资基金新增代销机构的公告。

2014年6月11日发布华夏基金管理有限公司关于华夏兴和混合型证券投资基金新增安信证券股份有限公司为代销机构的公告。

2014年6月24日发布华夏兴和混合型证券投资基金集中申购结果暨原兴和证券投资基金基金份额折算结果的公告。

## 8.2 其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2014年4月，在《上海证券报》主办的“第十一届中国金基金奖”评选中，华夏基金荣获“金基金·TOP公司大奖”，所管理的基金荣获5个单项奖，为获奖最多的基金公司。2014年6月，在《证券时报》主办的“2013年度中国基金业明星基金奖”评选中，华夏基金荣获“五年持续回报明星基金公司奖”和“2013年度十大明星基金公司奖”，所管理的基金荣获3个单项奖。

在客户服务方面，2季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户资金管理便利性：（1）在华夏基金微信公众服务平台增加扫码绑定功能，投资者扫码即可开通基金的微信交易和微信查询，提高投资者使用的便利性；（2）

在网上查询系统、客服热线自助语音系统中新增百度金融及微信理财通平台数据，投资者可以通过本公司网站或客服电话查询相关信息，满足投资者多渠道查询的需求。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会核准基金兴和募集的文件；
- 9.1.2 中国证监会核准基金兴和转型的文件；
- 9.1.3 《华夏兴和混合型证券投资基金基金合同》；
- 9.1.4 《华夏兴和混合型证券投资基金托管协议》；
- 9.1.5 《兴和证券投资基金基金合同》；
- 9.1.6 《兴和证券投资基金托管协议》；
- 9.1.7 法律意见书；
- 9.1.8 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 9.1.9 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一四年七月十九日