

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）
（原兴科证券投资基金转型）
2007 年半年度报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇〇七年八月二十八日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 8 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、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。

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。

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)由兴科证券投资基金转型而成。依据中国证监会 2007 年 4 月 13 日证监基金字[2007]107 号文核准的兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议，兴科证券投资基金由封闭式基金转为上市开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)”。自 2007 年 4 月 24 日起，由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。

本报告中财务资料未经审计。华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）报告期自 2007 年 4 月 24 日起至 2007 年 6 月 30 日止，原兴科证券投资基金报告期自 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 4 月 23 日止。

目 录

一、基金简介.....	1
二、主要财务指标和基金净值表现.....	3
（一）主要会计数据和财务指标.....	3
（二）华夏蓝筹基金净值表现.....	3
（三）基金兴科净值表现.....	4
三、管理人报告.....	5
四、托管人报告.....	9
五、华夏蓝筹财务会计报告.....	9
（一）基金会计报表.....	9
（二）会计报表附注.....	12
六、基金兴科财务会计报告.....	23
（一）基金会计报表.....	23
（二）会计报表附注.....	25
七、华夏蓝筹投资组合报告.....	33
（一）报告期末基金资产组合情况.....	33
（二）报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细.....	34
（四）报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
（五）报告期末按券种分类的债券投资组合.....	39
（六）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细.....	39
（七）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细.....	40
（八）投资组合报告附注.....	40
八、基金兴科投资组合报告.....	40
（一）报告期末基金资产组合情况.....	40
（二）报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细.....	41
（四）报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
（五）报告期末按券种分类的债券投资组合.....	45
（六）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细.....	45
（七）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细.....	46
（八）投资组合报告附注.....	46
九、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	46
（一）华夏蓝筹基金.....	46
（二）基金兴科.....	47
十、开放式基金份额变动.....	48
十一、重大事件揭示.....	48
十二、基金管理人简介.....	52
十三、备查文件目录.....	54

一、基金简介

（一）基金基本情况

1、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

基金简称：华夏蓝筹

交易代码：160311

基金运作方式：契约型上市开放式基金

基金合同生效日：2007年4月24日

报告期末基金份额总额：32,646,596,077.92份

基金合同存续期：不定期

上市交易所：深圳证券交易所

基金上市日：2007年5月28日

2、兴科证券投资基金

基金简称：基金兴科

交易代码：184708

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2000年4月8日

基金合同失效日：2007年4月24日

报告期末基金份额总额：500,000,000份

基金合同存续期：15年

上市交易所：深圳证券交易所

基金上市日：2000年7月18日

基金退市日：2007年4月24日

（二）基金产品说明

1、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

投资目标：追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。

投资策略：本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。

业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

风险收益特征：本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

2、兴科证券投资基金

基金投资目标：以新的理念去发掘投资机会，通过积极的投资策略，获取长期的资本增值。

基金投资策略：技术进步，观念更新，21 世纪带来了巨大的变化。本基金投资于那些能适应新时代发展需要的上市公司。

（三）基金管理人

基金管理人名称：华夏基金管理有限公司

CHINA ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.

注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

邮政编码：100032

法定代表人：凌新源

信息披露负责人：廖为

联系电话：（010）88066688

传真：（010）88066566

国际互联网址：www.ChinaAMC.com

电子邮箱：chinaamc@ChinaAMC.com

（四）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称“交通银行”）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

法定代表人：蒋超良

信息披露负责人：张咏东

联系电话：（021）68888917

传真：（021）58408836

国际互联网网址：<http://www.bankcomm.com>

电子邮箱：zhangyd@bankcomm.com

（五）信息披露

信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

登载半年度报告正文的管理人互联网网址：www.ChinaAMC.com

基金半年度报告置备地点：本报告在基金管理人和基金托管人的住所有置备，投资者可要求查阅、复制。

（六）其它有关资料

基金注册登记机构名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

二、主要财务指标和基金净值表现

重要提示：下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。

（一）主要会计数据和财务指标

主要会计数据和财务指标	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日	
	转型后（2007 年 4 月 24 日至 2007 年 6 月 30 日止期间）	转型前（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日止期间）
基金本期净收益	390,609,201.20 元	386,988,017.62 元
基金份额本期净收益	0.0195 元	0.7740 元
期末可供分配基金收益	12,362,966,288.62 元	721,866,174.24 元
期末可供分配基金份额收益	0.3787 元	1.4437 元
期末基金资产净值	34,164,230,348.34 元	1,397,999,526.25 元
期末基金份额净值	1.046 元	2.7960 元
期末基金累计份额净值	3.150 元	2.8970 元
基金加权平均净值收益率	1.84%	31.54%
本期基金份额净值增长率	11.58%	28.85%
基金份额累计净值增长率	11.58%	219.18%

（二）华夏蓝筹基金净值表现

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	份额净值	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准 偏差②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	1.45%	1.40%	-2.66%	1.83%	4.11%	-0.43%
自基金合同生效起至今	11.58%	1.24%	5.57%	1.59%	6.01%	-0.35%

注：份额净值增长率＝

$$\frac{\text{本期第一次分红前份额净值}}{\text{期初份额净值}} \times \frac{\text{本期第一次份额折算前份额净值}}{\text{本期第一次分红后份额净值}} \times \frac{\text{期末份额净值}}{\text{本期第一次份额折算后份额净值}} - 1$$

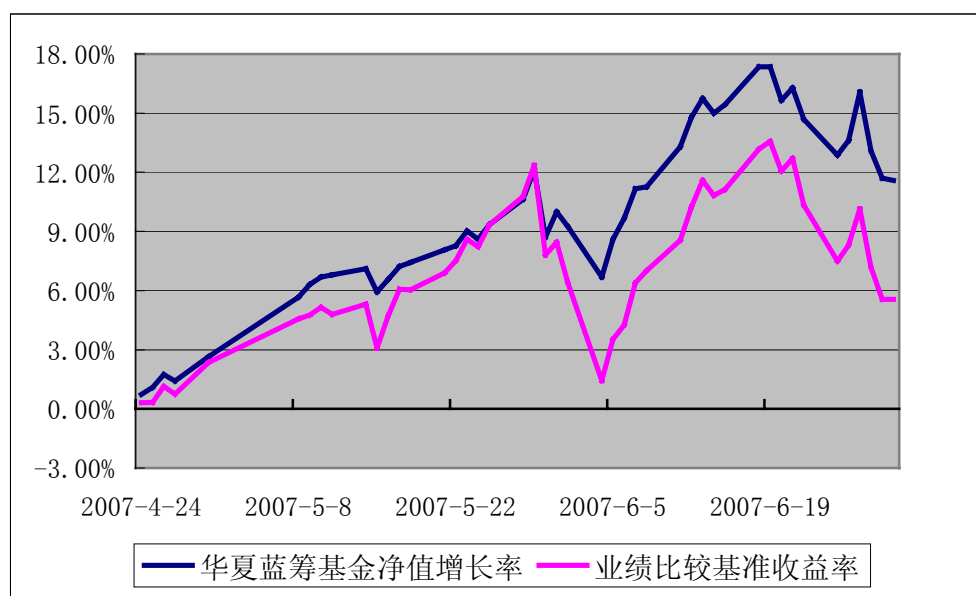
其中，本期第一次份额折算前基金份额净值＝份额折算日折算后的基金份额净值×折算比例，折算比例为 2.331861811。

2、自基金合同生效以来基金份额净值增长率及其业绩比较基准收益率的变动情况

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）累计份额净值增长率

及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2007 年 4 月 24 日至 2007 年 6 月 30 日）



注：1、华夏蓝筹基金合同于 2007 年 4 月 24 日生效，2007 年 5 月 28 日开始在深圳证券交易所上市交易，2007 年 5 月 28 日开始办理赎回业务，2007 年 5 月 30 日开始办理申购业务。自基金合同生效至本报告期末不满一年。

2、按照华夏蓝筹基金的基金合同规定，华夏蓝筹基金按规定自集中申购期结束后 1 个月内使投资组合比例符合本基金合同第十四条（二）投资范围、（八）投资禁止行为与比例限制的有关约定。

（三）基金兴科净值表现

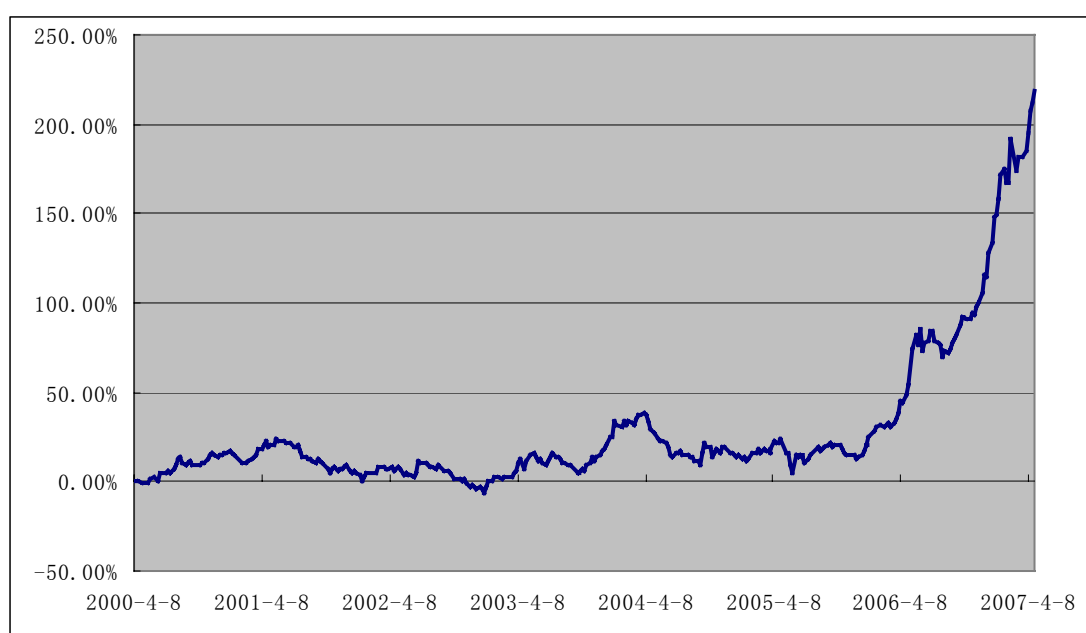
1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
2007.4.1-2007.4.23	12.10%	1.26%	-	-	-	-
2007.1.1-2007.4.23	28.85%	3.49%	-	-	-	-
2006.7.1-2007.4.23	72.66%	2.83%	-	-	-	-
2004.7.1-2007.4.23	179.46%	2.76%	-	-	-	-
2000.4.8-2007.4.23	219.18%	2.26%	-	-	-	-

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况

兴科证券投资基金累计份额净值增长率历史走势图

(2000年4月8日至2007年4月23日)



注：1、本基金无业绩比较基准

2、本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%；持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%；本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不得超过该证券的 10%；遵守中国证监会规定的其他比例限制。本基金按规定自本基金上市之日起六个月内达到上述规定的投资比例。

三、管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司。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的首批全国性基金管理公司之一，注册资本 13800 万元。公司总部设在北京，在北京、上海和深圳设有分公司。华夏基金是全国首批社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人及中国内地首只 ETF 基金管理人。华夏基金还成为国内基金公司首批获得 QDII 业务资格的基金管理公司，并且是国内唯一获得亚洲债券基金管理资格的投资管理机构。

截至 2007 年 6 月，华夏基金管理有限公司管理资产规模超过 1400 亿元人民币，管理着兴华、兴和、兴安 3 只封闭式基金，华夏成长、华夏债券、华夏回报、华夏现金增利、华夏大盘精选、50ETF、华夏红利、中小板 ETF、华夏回报二号、华夏稳增、华夏优势增长、华夏蓝筹 12 只开放式基金，以及亚洲债券基金二期中国子基金、全国社保基金投资组合和多只企业年金。

2、基金经理简介

王志华先生，经济学学士。曾任中国宝安集团中南证券深圳证券业务部调研部经理、君安证券公司证券投资部总经理助理。1999 年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员、兴安证券投资基金基金经理（2001 年 11 月至 2004 年 9 月期间）、兴科证券投资基金基金经理（2004 年 2 月至 2004 年 9 月期间、2006 年 2 月至 2007 年 4 月）。现任华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2007 年 4 月起任职）。

巩怀志先生，清华大学 MBA。曾任鹏华基金管理有限公司基金经理助理、社保股票组合基金经理。2005 年加入华夏基金管理有限公司。现任华夏成长证券投资基金基金经理（2005 年 10 月起任职）、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2007 年 5 月起任职）。

刘文动先生，硕士。曾任鹏华基金管理有限公司投资总部副总经理兼机构理财部总监，平安保险集团投资管理中心组合经理助理、平安证券有限责任公司研究员。2006 年加入华夏基金管理有限公司。现任华夏基金管理有限公司投资总监、兴安证券投资基金基金经理（2006 年 5 月起任职）、兴华证券投资基金基金经理（2007 年 2 月起任职）、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2007 年 6 月起任职）。

（二）报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

1、基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，因市场波动导致基金兴科于个别交易日国家债券投资组合合计市值占净值比低于 20%，证券投资合计市值占资产总值比低于 80%，上述指标已于合理期限内调整，未违反法律法规及基金合同的规定，也未对基金份额持有人利益造成实际影响。

2、内部监察工作报告

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的内部监察人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察报告报公司管理层。报告期内，本基金管理人内部监察工作重点加强了以下几个方面：

- （1）对业务部门进行了相关法律培训；
- （2）进一步完善了有关合同审查的制度；
- （3）制定了员工投资证券投资基金的有关制度；
- （4）加强了对投资人员的检查监督。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

（三）报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

1、本基金业绩表现

本基金转型前，截至 2007 年 4 月 23 日，基金兴科份额净值为 2.7960 元，2007 年 1 月 1 日至 4 月 23 日期间基金兴科份额净值增长率为 28.85%，同期上证综指上涨 38.70%，深圳成指上涨 60.75%。本基金转型后，截至 2007 年 6 月 30 日，华夏蓝筹基金份额净值为 1.046 元，2007 年 4 月 24 日至 6 月 30 日期间华夏蓝筹基金份额净值增长率为 11.58%，同期业绩比较基准增长率为 5.57%。

2、行情回顾及运作分析

上半年，传统的“价值投资”一度边缘化，市场整体估值大幅拉升以后，结构化的泡沫问题更显突出。在央行不断紧缩流动性、整体经济外围环境收紧、管理层对过度投机开始明确调控以后，原本就将无以为继的上涨模式受到重创，市场的偏好重新回归优质股。对于投资策略，我们从自上而下的角度对金融、地产行业的公司做了重点配置，从自下而上的角度对商业、食品等行业的优势公司做了重点投资；在基金兴科转型以后，我们在判断市场风险相对较高的情况下采取了较为谨慎的投资策略，在市场大幅下跌过程中逐步提高股票仓位，对估值优势明显的金融、地产、商业、信息技术、汽车、家电、电力设备等行业的蓝筹股进行了重点配置，取得了较好的效果。

（四）宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年典型的“新兴加转轨”的资本市场特征与居民投资意识爆发式的觉醒、市场阶段性的供求失衡以及过度预期的资产重组、资产注入有着较大关联。我们认为下半年市场将发生明显变化。整体经济将依然保持较高的增长速度，但针对性的调控措施将进一步加强，相关的产业政策有望继续出台。从流动性供给来看，央行适度从紧的货币政策取向、出口部门经营环境的变化、以及规律性的商业银行下半年信贷扩张的相对收缩都将使流动性不再像上半年一样充沛，无风险溢价将会继续上升；同时，投资者经过市场洗礼以后要求的风险溢价也将明显上升。考虑下半年股票供给的大量增加，供求关系已经开始转向，市场关注的焦点将从流动性溢价向成长性溢价转变。然而就整体而言，市场所给予的估值水平已经对业绩增长有较高的预期，相对预期以外的增长才能进一步带来股价上涨的动力，这将是我们的重点。

下一阶段，在较高的估值起点上，我们将着力选择超市场预期增长的公司。首先，在本币逐步升值、要素价格逐步提升以及整体上市的大趋势背景下，金融、地产、煤炭、钢铁、机械等行业将是我们关注的重点；其次，我们将关注国家产业政策调整对相关行业和公司盈利产生的重大影响。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，华夏蓝筹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。

四、托管人报告

2007 年上半年，托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2007 年上半年，华夏基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。托管人根据证监会的有关规定，对本基金存在国家债券投资组合合计市值占净值比例低于 20%，证券投资合计市值占资产总值比例低于 80%的情况，对基金管理人进行了提示，基金管理人根据规定进行了调整。

2007 年上半年，由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

五、华夏蓝筹财务会计报告

（一）基金会计报表

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

2007 年 6 月 30 日资产负债表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注	2007 年 6 月 30 日
资产		
银行存款	7a	12,605.99
清算备付金	7b	11,652,215,407.48
交易保证金	7b	2,572,636.60
应收证券清算款		8,289,857.83
应收股利		5,305,225.56
应收利息	7c	11,102,817.11
股票投资市值		22,052,352,024.16
其中：股票投资成本		21,032,096,099.35
债券投资市值		1,060,931,298.60
其中：债券投资成本		1,059,082,783.71
权证投资市值		-
其中：权证投资成本		-
资产总计		34,792,781,873.33

负债及持有人权益

负债

应付证券清算款		420,766,054.22
应付赎回款		124,323,597.14
应付赎回费		468,556.75
应付管理人报酬		43,480,277.70
应付托管费		7,246,712.95
应付佣金	7d	30,260,541.98
应付利息		-
其他应付款	7e	1,807,262.47
卖出回购证券款		-
预提费用	7f	198,521.78
负债合计		628,551,524.99

持有人权益

实收基金	7g	13,995,732,447.44
未实现利得	7h	7,805,531,612.28
未分配收益		12,362,966,288.62
持有人权益合计		34,164,230,348.34

(2007年6月30日每份基金份额净值：1.046元)

负债及持有人权益总计		34,792,781,873.33
-------------------	--	--------------------------

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）
2007年4月24日至2007年6月30日止期间
经营业绩表及收益分配表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注	本期数
收入		
股票差价收入	7i	375,021,682.63
债券差价收入	7j	3,916,582.94
权证差价收入		-
债券利息收入		2,388,595.17
存款利息收入		27,590,940.38
股利收入		42,977,639.69
买入返售证券收入		246,716.71
其他收入	7k	1,604,148.02
收入合计		453,746,305.54
费用		
基金管理人报酬		(54,005,038.95)

基金托管费		(9,000,839.81)
卖出回购证券支出		(54,899.00)
利息支出		-
其他费用	71	(76,326.58)
其中：上市年费		-
信息披露费		(44,712.72)
审计费		(22,356.36)
费用合计		(63,137,104.34)
基金净收益		390,609,201.20
加：未实现估值增值变动数		845,971,087.69
基金经营业绩		1,236,580,288.89
本期基金净收益		390,609,201.20
加：期初累计基金净收益		721,866,174.24
本期申购基金份额的损益平准金		11,995,738,879.33
本期赎回基金份额的损益平准金		(440,247,966.15)
可供分配基金净收益		12,667,966,288.62
减：本期已分配基金净收益		(305,000,000.00)
期末未分配基金净收益		12,362,966,288.62

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）
2007年4月24日至2007年6月30日止期间
基金净值变动表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	本期数
期初基金净值	1,397,999,526.25
本期经营活动	
基金净收益	390,609,201.20
未实现估值增值变动数	845,971,087.69
经营活动产生的基金净值变动数	1,236,580,288.89
本期基金份额交易	
基金申购款	33,092,647,635.07
其中：集中申购款	9,964,660,076.62
基金赎回款	(1,257,997,101.87)
基金份额交易产生的基金净值变动数	31,834,650,533.20
本期向基金持有人分配收益	
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	(305,000,000.00)

期末基金净值

34,164,230,348.34

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

（二）会计报表附注

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

1、基金基本情况

根据原兴科证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于兴科证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2007]107号《关于核准兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》及深圳证券交易所深证复[2007]24号《关于同意兴科证券投资基金终止上市并转型为上市开放式基金的批复》的同意，基金兴科由封闭式基金转为上市开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)”。自2007年4月24日起，由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。华夏蓝筹基金2007年4月27日向全社会开放集中申购。经德勤华永会计师事务所有限公司验资，华夏蓝筹最终有效净申购金额为9,963,757,772.09元人民币，折合基金份额9,963,757,772.09份，有效申购申请确认金额产生的银行利息共计902,304.53元人民币，折合基金份额902,304.53份。华夏蓝筹经深圳证券交易所深证上[2007]79号文核准同意，于2007年5月28日开始在深圳证券交易所上市交易。华夏蓝筹基金为契约型上市开放式基金，存续期限不定。华夏蓝筹基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，华夏蓝筹基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在金融衍生产品(如股指期货)推出后，本基金还可依据法律法规的规定运用金融衍生产品进行投资风险管理。其中，本基金股票投资占基金资产的比例范围为20%~95%，债券投资占基金资产的比

例范围为 0~80%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0~20%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0~3%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2、会计报表编制基础

本基金的会计报表按照中华人民共和国国家颁布的《企业会计准则》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

3、主要会计政策和会计估计

（1）会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2007 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2007 年 6 月 30 日。

（2）记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

（3）记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资、权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

（4）基金资产的估值原则

股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；由非公开发行形成的暂时流通受限制的股票，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于定向增发股票的初始成本，按市场交易收盘价估值，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于定向增发股票的初始成本，按两者差价在定向增发股票锁定期的摊销金额与初始成本之和估值。

债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场

交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。

银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

权证投资

从获赠确认日、买入成交确认日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

可分离债中签所获得的债券和权证，在所配权证到账日前，债券按成本估值，权证不予估值；权证到账后至债券与权证上市前，债券和权证以经中国证监会认可的外部独立估值结果进行估值；债券和权证上市后，债券按证券交易所市场流通的债券相同的估值方法估值，权证以估值日证券交易所提供的该权证收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日收盘价计算；

实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，华夏蓝筹基金的基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 证券投资基金成本计价方法

股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价时冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资，债券投资按成交日应

支付的全部价款入账；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资，债券投资按实际支付的全部价款入账。其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按本会计报表附注权证投资中所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失)；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量；买入权证于成交日确认为权证投资，相应成本按成交日应支付的全部价款入账。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失)，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(6) 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用采用直线法在受益期间内逐日摊销。

(7) 收入/(损失)的确认和计量

股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入/(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本及相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除

适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

（8）费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

待摊费用反映已经支付的、影响基金份额净值小数点后第五位，应于各受益期分摊的费用。

预提费用反映尚未支付的、影响基金份额净值小数点后第五位，应计入本期的费用。

（9）实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

（10）未实现利得/(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

（11）损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基

金净损失)。

（12）基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值转为基金份额进行再投资；若投资者未选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；收益分配时所发生的银行转账和其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账和其他手续费用时，登记结算机构可将投资者的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。

4、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项规定如下：

营业税

以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

基金买卖股票、债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征营业税。

所得税

基金买卖股票、债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征企业所得税。

基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2005 年 6 月 13 日起基金从上市公司取得的股息红利所得，暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定代扣代缴个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税和个人所得税。

印花税

自 2005 年 6 月 13 日起股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

基金买卖股票于 2007 年 5 月 30 日前按照 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2007 年 5 月 30 日起按 0.3% 的税率缴纳。

5、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6、重大关联方关系及关联交易

(1) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
西南证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构
北京证券有限责任公司	基金管理人的股东
中国科技证券有限责任公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本报告期本基金未通过关联方席位进行证券交易。

(3) 基金管理人报酬

支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金管理人报酬 54,005,038.95 元。

(4) 基金托管费

支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金托管费 9,000,839.81 元。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，并按银行同业利率计息。基

金托管人于2007年6月30日保管的银行存款余额为12,605.99元。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为192,609.52元。

(6) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易

本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

(7) 本基金关联方及基金管理公司主要股东的控制机构持有的基金份额

	2007年6月30日			
	基金份额数 (份)	占基金总份额比	本期申购份额 (份)	本期赎回份额 (份)
华夏基金管理有限公司	50,000,000	0.15%	-	66,527,148
合计	50,000,000	0.15%	-	66,527,148

以上交易适用赎回费率为0.5%。

7、基金会计报表重要项目说明

a、银行存款

	2007年6月30日
活期存款	12,605.99
定期存款	-
合计	12,605.99

b、清算备付金和交易保证金

	2007年6月30日
清算备付金	11,652,215,407.48
其中：清算备付金	11,541,152,874.31
最低备付金	111,062,533.17
交易保证金	2,572,636.60
其中：深交所交易保证金	2,471,354.55
权证保证金	101,282.05

c、应收利息

	2007年6月30日
应收清算备付金利息	5,707,969.77
应收债券利息	5,394,801.04
应收权证保证金利息	45.60
应收银行存款利息	0.70
合计	11,102,817.11

d、应付佣金

	2007年6月30日
中信建投证券有限责任公司	6,673,525.75
招商证券股份有限公司	5,731,438.63
申银万国证券股份有限公司	4,093,838.90
东方证券股份有限公司	3,904,707.13

国泰君安证券股份有限公司	2,844,819.39
中国银河证券股份有限公司	2,070,940.65
光大证券股份有限公司	1,816,446.93
国信证券有限责任公司	1,027,698.96
国元证券有限责任公司	804,882.59
长城证券有限责任公司	415,143.39
联合证券有限责任公司	361,644.50
西部证券股份有限公司	238,622.39
富成证券经纪有限公司	131,833.62
北京证券有限责任公司	114,006.97
天同证券有限责任公司	30,992.18
合计	30,260,541.98

e、其他应付款

	2007年6月30日
应付券商席位保证金	1,500,000.00
应付股利收入的个人所得税	159,386.25
应付收益	136,684.32
应付债券利息收入的个人所得税	6,560.04
其他	4,631.86
合计	1,807,262.47

f、预提费用

	2007年6月30日
信息披露费	119,014.74
审计费	59,507.04
上市费用	20,000.00
合计	198,521.78

g、实收基金

	基金份额数（份）	金额
2007年4月24日	500,000,000	500,000,000.00
报告期间因基金份额折算增加的份额	665,930,905	-
本期申购	32,661,410,268.18	14,001,959,508.38
其中：集中申购	9,964,660,076.62	4,273,263,547.86
本期赎回	(1,180,745,095.26)	(506,227,060.94)
2007年6月30日	32,646,596,077.92	13,995,732,447.44

注：本基金管理人于2007年5月10日对投资者持有的原基金兴科进行了基金份额折算。经本基金管理人计算并经本基金托管人交通银行股份有限公司确认，基金份额折算基准日折算前基金资产净值为1,165,930,905.62元，原基金兴科的基金份额按照2.331861811的折算比例进行折算，折算后基金份额净值为1.000元，折算后的基金份额总额为1,165,930,905份。

h、未实现利得

	未实现估值 增值/(减值)(1)	未实现利得 /(损失)平准金	合计

2007年4月24日	176,133,352.01	-	176,133,352.01
本期净变动数	845,971,087.69	-	845,971,087.69
本期申购基金份额	-	7,094,949,247.36	7,094,949,247.36
其中：集中申购	-	2,050,956,001.33	2,050,956,001.33
本期赎回基金份额	-	(311,522,074.78)	(311,522,074.78)
2007年6月30日	1,022,104,439.70	6,783,427,172.58	7,805,531,612.28

(1) 未实现估值增值/(减值)按投资类别分项列示如下：

	2007年6月30日
股票投资	1,020,255,924.81
债券投资	1,848,514.89
权证投资	-
合计	1,022,104,439.70

i、股票差价收入

	2007年4月24日至2007年6月30日止期间
卖出股票成交总额	3,975,876,479.83
减：应付佣金总额	(3,341,025.96)
减：卖出股票成本总额	(3,597,513,771.24)
股票差价收入	375,021,682.63

本报告期本基金无因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价。

j、债券差价收入

	2007年4月24日至2006年6月30日止期间
卖出及到期兑付债券结算金额	140,101,792.57
减：应收利息总额	(2,539,289.22)
减：卖出及到期兑付债券成本总额	(133,645,920.41)
债券差价收入	3,916,582.94

k、其他收入

	2007年4月24日至2006年6月30日止期间
赎回基金补偿收入(1)	1,572,559.44
其他	31,588.58
合计	1,604,148.02

(1) 根据《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金赎回费率为赎回总额的0.5%。赎回费由赎回人承担，其中须依法扣除所收取赎回费总额的25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

l、其他费用

	2007年4月23日至2007年6月30日止期间
信息披露费	44,712.72
审计费	22,356.36

银行费用	6,445.56
交易所回购交易费用	2,711.94
基金账户更名费	100.00
合计	76,326.58

8、收益分配

报告期内本基金收益分配事项

2007年4月24日至2007年6月30日止期间	登记日	分红率	现金形式发放	再投资形式发放	发放红利合计
第一次分红	2007-4-23	每10份基金份额6.10元	305,000,000.00	-	305,000,000.00

本基金于本报告期分配 2006 年度可分配收益。登记日为基金兴科基金合同失效前一日，即 2007 年 4 月 23 日，除息日及派现日为华夏蓝筹基金合同生效首日，即 2007 年 4 月 24 日，共计分配可分配收益 305,000,000.00 元。

9、流通受限制不能自由转让的基金资产

(1) 流通受限制不能自由转让的股票

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止未持有因股权分置改革而暂时停牌的股票。

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止持有的因申购新股获得的受限制股票情况如下：

股票名称	成功申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格	期末估价	成功申购股数	成本	市值	占净值比
获配新股									
中国远洋	2007-6-20	2007-6-26	2007-9-26	8.48	18.26	3,342,289	28,342,610.72	61,030,197.14	0.18%
安纳达	2007-5-23	2007-5-30	2007-8-30	8.08	22.81	14,784	119,454.72	337,223.04	0.00%
实益达	2007-6-4	2007-6-13	2007-9-13	10.30	47.19	25,390	261,517.00	1,198,154.10	0.00%
顺络电子	2007-6-5	2007-6-13	2007-9-13	13.60	34.31	19,675	267,580.00	675,049.25	0.00%
拓邦电子	2007-6-22	2007-6-29	2007-10-8	10.48	60.00	17,838	186,942.24	1,070,280.00	0.00%
合计							29,178,104.68	64,310,903.53	0.19%

(2) 流通受限制不能自由转让的债券

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止未持有流通受限制的债券。

(3) 估值方法

上述流通受限制不能自由转让的基金资产估值方法如前“基金资产的估值原则”所述。

六、基金兴科财务会计报告

(一) 基金会计报表

兴科证券投资基金			
2007 年 4 月 23 日资产负债表			
(除特别注明外, 金额单位为人民币元)			
	附注	2007 年 4 月 23 日	2006 年 12 月 31 日
资产			
银行存款	7a	286,546.99	3,555,967.09
清算备付金	7b	17,454,195.02	208,514,687.26
交易保证金	7b	2,580,964.16	851,399.99
应收证券清算款		-	6,627,540.07
应收股利		-	-
应收利息	7c	5,251,647.62	1,743,669.93
其他应收款		304,237,500.00	-
股票投资市值		910,349,035.49	834,332,303.02
其中: 股票投资成本		738,605,961.65	589,048,485.09
债券投资市值		278,199,257.90	222,246,942.60
其中: 债券投资成本		273,808,979.73	217,392,700.86
权证投资市值		-	-
其中: 权证投资成本		-	-
资产总计		1,518,359,147.18	1,277,872,509.96
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		18,892.53	-
应付管理人报酬		1,248,635.72	1,266,990.65
应付托管费		208,105.91	211,165.12
应付佣金	7d	7,874,371.60	5,361,798.53
应付利息		10,900.00	150,214.26
其他应付款	7e	807,262.47	806,125.11
卖出回购证券款		110,000,000.00	185,000,000.00
预提费用	7f	191,452.70	60,000.00
负债合计		120,359,620.93	192,856,293.67
持有人权益			
实收基金	7g	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	7h	176,133,352.01	250,138,059.67
未分配收益		721,866,174.24	334,878,156.62
持有人权益合计		1,397,999,526.25	1,085,016,216.29

(2007 年 4 月 23 日每份基金份额净值: 2.7960 元)

(2006 年末每份基金份额净值: 2.1700 元)

负债及持有人权益总计 1,518,359,147.18 1,277,872,509.96

兴科证券投资基金

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日止期间

经营业绩表及收益分配表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

	附注	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日止期间	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间
收入			
股票差价收入	7i	394,075,674.10	209,037,202.74
债券差价收入/(损失)	7j	93,125.81	(156,783.60)
权证差价收入/(损失)	7k	(700,895.63)	6,150,942.15
债券利息收入		2,141,094.44	1,802,251.81
存款利息收入		566,405.27	425,124.97
股利收入		128,520.00	5,077,597.13
买入返售证券收入		92,700.00	-
其他收入	7l	1,494.00	2,362.32
收入合计		396,398,117.99	222,338,697.52
费用			
基金管理人报酬		(5,695,514.18)	(4,820,177.17)
基金托管费		(949,252.31)	(803,362.84)
卖出回购证券支出		(1,647,362.74)	(200,437.59)
利息支出		-	-
其他费用	7m	(1,117,971.14)	(221,519.43)
其中: 上市年费		(20,000.00)	(29,752.78)
信息披露费		(74,302.02)	(148,765.71)
审计费		(37,150.68)	(29,752.78)
费用合计		(9,410,100.37)	(6,045,497.03)
基金净收益		386,988,017.62	216,293,200.49
加: 未实现估值增值变动数		(74,004,707.66)	67,979,359.06
基金经营业绩		312,983,309.96	284,272,559.55
本期基金净收益		386,988,017.62	216,293,200.49
加: 期初累计基金净收益/(净损失)		334,878,156.62	(10,401,761.41)
可供分配基金净收益		721,866,174.24	205,891,439.08

减：本期已分配基金净收益	-	-
期末未分配基金净收益	721,866,174.24	205,891,439.08

兴科证券投资基金
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日止期间
基金净值变动表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日止期间	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间
期初基金净值	1,085,016,216.29	525,427,996.60
本期经营活动		
基金净收益	386,988,017.62	216,293,200.49
未实现估值增值变动数	(74,004,707.66)	67,979,359.06
经营活动产生的基金净值变动数	312,983,309.96	284,272,559.55
本期向基金持有人分配收益		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-	-
期末基金净值	1,397,999,526.25	809,700,556.15

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二) 会计报表附注

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

1、基金基本情况

兴科证券投资基金(以下简称“本基金”)是按照《证券投资基金管理暂行办法》、国务院办公厅文件国办发(1999)第 28 号《国务院办公厅转发证监会原有投资基金清理规范方案的通知》、中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字(2000)第 44 号《关于兴科证券投资基金上市、扩募和续期的批复》及其他有关的规定和《兴科证券投资基金基金合同》由原陕信基金、长安基金、通信基金、常信基金、南京基金共五只基金经规范重组而成的契约型封闭式基金，由华夏基金管理有限公司及陕西证券有限公司(已重组为“西部证券股份有限公司”)担任本基金的发起人。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基

金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金在 2000 年 4 月 8 日的总份额为 226,659,366 份基金份额并于 2000 年 7 月 18 日在深圳证券交易所上市交易。本基金原存续期为 10 年至 2002 年 5 月 30 日。经中国证监会证监基金字(2000)第 44 号文件批准,本基金于 2000 年 9 月 5 日将基金总份额扩募至 5 亿份基金份额, 存续期限延长 5 年至 2007 年 5 月 30 日。

2007 年 4 月 2 日, 基金兴科基金份额持有人大会审议通过了《关于兴科证券投资基金转型有关事项的议案》, 经中国证券监督管理委员会证监基金字[2007]107 号《关于核准兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准, 基金兴科的基金管理人华夏基金管理有限公司于 2007 年 4 月 19 日发布了《兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》, 并向深圳证券交易所申请提前终止基金兴科的上市交易, 获得深圳证券交易所深证复[2007]24 号《关于同意兴科证券投资基金终止上市并转型为上市开放式基金的批复》的同意。根据《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》、《兴科证券投资基金基金合同》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等的有关规定, 基金兴科于 2007 年 4 月 23 日进行终止上市权利登记, 2007 年 4 月 24 日终止上市, 《兴科证券投资基金基金合同》自同一起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴科证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资对象为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证券监督管理委员会批准的允许基金投资的其他金融工具。

2、会计报表编制基础

本基金的会计报表按照中华人民共和国国家颁布的《企业会计准则》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

3、主要会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。本会计报表的实际编制期间为 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日。

4、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项规定如下：

营业税

以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

基金买卖股票、债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征营业税。

所得税

基金买卖股票、债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征企业所得税。

基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2005 年 6 月 13 日起基金从上市公司取得的股息红利所得，暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定代扣代缴个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税和个人所得税。

印花税

自 2005 年 6 月 13 日起股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

基金买卖股票于 2007 年 5 月 30 日前按照 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2007 年 5 月 30 日起按 0.3% 的税率缴纳。

5、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6、重大关联方关系及关联交易

(1) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
交通银行股份有限公司	基金托管人
西部证券股份有限公司(“西部证券”)	基金发起人
中信证券股份有限公司	基金管理人的股东
北京证券有限责任公司	基金管理人的股东

西南证券有限责任公司 基金管理人的股东
 中国科技证券有限责任公司 基金管理人的股东
 北京市国有资产经营有限责任公司 基金管理人的原股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本报告期本基金未通过关联方席位进行证券交易。

上年同期本基金通过关联方席位进行证券交易：

		2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日						
买卖股票成交量		买卖债券成交量		债券回购成交量		佣金		
成交量	占全年成交	成交量	占全年成交	成交量	占全年成交	佣金	占全年佣金	
人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	总量的比例	
西部证券	238,554,606.98	7.06%	20,227,214.60	20.50%	30,000,000.00	9.09%	195,140.56	7.17%
合计	238,554,606.98	7.06%	20,227,214.60	20.50%	30,000,000.00	9.09%	195,140.56	7.17%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3) 基金管理人报酬

支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
 日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金管理人报酬 5,695,514.18 元(2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间：4,820,177.17 元)。

(4) 基金托管费

支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金托管费 949,252.31 元(2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间：803,362.84 元)。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，并按银行同业利率计息。基金托管人于 2007 年 4 月 23 日保管的银行存款余额为 286,546.99 元(2006 年 6 月

30日：2,541,750.97元)。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为15,182.28元(2006年1月1日至2006年6月30日止期间：41,136.42元)。

(6) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易

本报告期与2006年1月1日至2006年6月30日止期间本基金未与关联方进行银行间市场的债券（含回购）交易。

(7) 本基金关联方及基金管理公司主要股东的控制机构持有的基金份额

	2007年4月23日			
	基金份额数 (份)	占基金总份额比	本期买入份额 (份)	本期卖出份额 (份)
华夏基金管理有限公司	49,971,721	9.99%	1,060,016	-
西部证券股份有限公司	3,229,691	0.65%	-	-
合计	53,201,412	10.64%	1,060,016	-
	2006年6月30日			
	基金份额数 (份)	占基金总份额比	2006年1月1日至2006年6月30日止期间 买入份额(份)	2006年1月1日至2006年6月30日止期间 卖出份额(份)
华夏基金管理有限公司	34,976,253	7.00%	32,476,253	-
西部证券股份有限公司	3,837,916	0.77%	-	-
合计	38,814,169.00	7.76%	32,476,253	-

本基金适用费率为0%。

7、基金会计报表重要项目说明

a、银行存款

	2007年4月23日
活期存款	286,546.99
定期存款	-
合计	286,546.99

b、清算备付金和交易保证金

	2007年4月23日
清算备付金	17,454,195.02
其中：清算备付金	8,446,694.88
最低备付金	9,007,500.14
交易保证金	2,580,964.16
其中：深交所交易保证金	2,471,354.55
权证保证金	109,609.61

c、应收利息

	2007年4月23日
应收债券利息	5,102,755.09

应收清算备付金利息	135,082.39
应收银行存款利息	13,642.52
应收权证保证金利息	167.62
合计	5,251,647.62

d、应付佣金

	2007 年 4 月 23 日
招商证券股份有限公司	2,363,797.49
申银万国证券股份有限公司	1,569,794.28
光大证券股份有限公司	970,104.49
国元证券有限责任公司	804,882.59
国泰君安证券股份有限公司	782,433.00
中信建投证券有限责任公司	616,998.68
东方证券股份有限公司	382,739.53
西部证券股份有限公司	238,622.39
北京证券有限责任公司	114,006.97
天同证券有限责任公司	30,992.18
合计	7,874,371.60

e、其他应付款

	2007 年 4 月 23 日
应付券商席位保证金	500,000.00
应付股利收入的个人所得税	159,386.25
应付收益	136,684.32
应付债券利息收入的个人所得税	6,560.04
其他	4,631.86
合计	807,262.47

f、预提费用

	2007 年 4 月 23 日
审计费	97,150.68
信息披露费	74,302.02
上市费用	20,000.00
合计	191,452.70

g、实收基金

	2007 年 4 月 23 日	
	基金份额数(份)	基金面值
发起人持有基金份额-非流通部分	2,500,000	2,500,000.00
发起人持有基金份额-可流通部分	50,701,412	50,701,412.00
社会公众持有基金份额	446,798,588	446,798,588.00
合计	500,000,000	500,000,000.00

根据中国证券监督管理委员会证监基金字[2000]44 号文以及《兴科证券投资
基金基金合同》的有关规定，基金发起人在基金扩募时认购基金总规模 1%的基

金份额。基金发起人在基金存续期内须持有不少于 0.5% 的基金份额，其余部分可在基金扩募部分上市二个月后流通。

h、未实现利得

	股票投资的未实现 估值增值/(减值)	债券投资的未 实现估值增值 /(减值)	权证投资 的未实现 估值增值 /(减值)	合计
2006 年 12 月 31 日	245,283,817.93	4,854,241.74	-	250,138,059.67
本期净变动数	(73,540,744.09)	(463,963.57)	-	(74,004,707.66)
2007 年 4 月 23 日	171,743,073.84	4,390,278.17	-	176,133,352.01

i、股票差价收入

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日止期间
卖出股票成交总额	2,734,600,668.95
减：应付佣金总额	(2,290,475.39)
减：卖出股票成本总额	(2,338,234,519.46)
股票差价收入	394,075,674.10

本报告期本基金无因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价。

j、债券差价收入/(损失)

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日止期间
卖出及到期兑付债券结算金额	21,491,708.86
减：应收利息总额	(178,497.41)
减：卖出及到期兑付债券成本总额	(21,220,085.64)
债券差价收入	93,125.81

k、权证差价收入/（损失）

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日止期间
卖出权证成交总额	9,766,511.95
减：卖出权证成本总额	(10,467,407.58)
权证差价收入	(700,895.63)

l、其他收入

本报告期末，其他收入余额均为印花税返还收入。

m、其他费用

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日止期间
基金分红手续费	910,425.00
信息披露费	74,302.02
基金兴科持有人大会律师费	50,000.00
审计费	37,150.68
上市年费	20,000.00
债券账户维护费	10,947.36

交易所回购交易费用	10,444.24
基金兴科持有人大会公正费	3,500.00
银行费用	842.29
银行间交易费用	359.55
合计	1,117,971.14

8、收益分配

本基金于本报告期分配 2006 年度可分配收益。登记日为基金兴科基金合同失效前一日，2007 年 4 月 23 日，除息日及派现日为华夏蓝筹基金合同生效首日，2007 年 4 月 24 日，共计分配可分配收益 305,000,000.00 元。

9、流通受限制不能自由转让的基金资产

(1) 流通受限制不能自由转让的股票

本基金截至 2007 年 4 月 23 日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末估值总额
方案实施阶段停牌							
000895	双汇发展	2006-6-1	31.02	2007-6-29	57.88	1,061,700	32,933,934.00
合计						1,061,700	32,933,934.00

本基金截至 2007 年 4 月 23 日止持有的因申购新股获得的股票流通受限情况

如下：

股票名称	成功申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格	期末估价	成功申购股数	成本	市值	占净值比
获配新股									
连云港	2007-4-18	2007-4-26	2007-4-26	4.98	4.98	14,000	69,720.00	69,720.00	0.01%
利欧股份	2007-4-18	2007-4-27	2007-4-27	13.69	13.69	8,000	109,520.00	109,520.00	0.01%
恒星科技	2007-4-18	2007-4-27	2007-4-27	8.00	8.00	14,000	112,000.00	112,000.00	0.01%
合计							291,240.00	291,240.00	0.02%

(2) 流通受限制不能自由转让的债券

本基金截至 2007 年 4 月 23 日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 110,000,000.00 元，于 2007 年 4 月 24 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

(3) 估值方法

上述流通受限的基金资产估值方法与上年度采用的估值方法一致。

七、华夏蓝筹投资组合报告

(报告期末为 2007 年 6 月 30 日，报告期间为 2007 年 4 月 24 日至 2007 年 6 月 30 日)

(一) 报告期末基金资产组合情况

	金额（元）	占基金总资产比例
股票	22,052,352,024.16	63.38%
债券	1,060,931,298.60	3.05%
权证	-	-
资产支持证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	11,652,228,013.47	33.49%
其他资产	27,270,537.10	0.08%
合计	34,792,781,873.33	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	股票市值（元）	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,202,886,588.77	3.52%
C	制造业	6,634,069,846.79	19.42%
C0	其中：食品、饮料	1,031,784,453.78	3.02%
C1	纺织、服装、皮毛	60,988,525.95	0.18%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	93,937,349.55	0.27%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	411,377,196.77	1.20%
C5	电子	9,833,704.01	0.03%
C6	金属、非金属	1,882,268,454.04	5.51%
C7	机械、设备、仪表	2,750,510,845.40	8.05%
C8	医药、生物制品	346,401,508.87	1.01%
C99	其他制造业	46,967,808.42	0.14%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	612,380,060.31	1.79%
E	建筑业	214,793,109.92	0.63%
F	交通运输、仓储业	1,013,076,504.35	2.97%
G	信息技术业	1,708,883,583.78	5.00%
H	批发和零售贸易	2,346,776,759.16	6.87%
I	金融、保险业	5,036,439,644.46	14.74%
J	房地产业	1,834,624,021.60	5.37%

K	社会服务业	745,556,729.34	2.18%
L	传播与文化产业	136,798,892.01	0.40%
M	综合类	566,066,283.67	1.66%
	合计	22,052,352,024.16	64.55%

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	期末市值（元）	占净值比例
1	600036	招商银行	76,611,688	1,883,115,291.04	5.51%
2	002024	苏宁电器	24,247,947	1,138,683,591.12	3.33%
3	000063	中兴通讯	20,621,845	1,121,828,368.00	3.28%
4	000002	万 科A	43,980,178	840,901,003.36	2.46%
5	600104	上海汽车	47,664,505	823,166,001.35	2.41%
6	600016	民生银行	60,676,883	693,536,772.69	2.03%
7	601166	兴业银行	18,017,809	632,244,917.81	1.85%
8	601398	工商银行	119,057,139	596,476,266.39	1.75%
9	600900	长江电力	32,670,367	493,975,949.04	1.45%
10	600383	金地集团	14,172,205	484,972,855.10	1.42%
11	600694	大商股份	7,789,927	479,470,006.85	1.40%
12	600000	浦发银行	13,006,655	475,913,506.45	1.39%
13	000825	太钢不锈	20,909,525	419,445,071.50	1.23%
14	600895	张江高科	21,610,406	373,427,815.68	1.09%
15	600019	宝钢股份	32,055,597	352,611,567.00	1.03%
16	600519	贵州茅台	2,799,496	335,043,681.28	0.98%
17	600718	东软股份	7,851,267	327,162,295.89	0.96%
18	600489	中金黄金	6,801,121	319,856,720.63	0.94%
19	000039	中集集团	10,857,144	318,331,462.08	0.93%
20	601006	大秦铁路	20,030,744	303,265,464.16	0.89%
21	000651	格力电器	7,550,242	263,503,445.80	0.77%
22	000800	一汽轿车	23,877,918	260,269,306.20	0.76%
23	600138	中青旅	10,499,948	258,193,721.32	0.76%
24	600028	中国石化	18,062,426	238,785,271.72	0.70%
25	601318	中国平安	3,286,216	234,997,306.16	0.69%
26	600015	华夏银行	19,069,573	229,597,658.92	0.67%
27	600195	中牧股份	10,593,855	223,742,217.60	0.65%
28	000937	金牛能源	13,220,439	210,998,206.44	0.62%
29	000006	深振业A	8,194,269	204,037,298.10	0.60%
30	600067	冠城大通	9,278,749	199,957,040.95	0.59%
31	600517	置信电气	5,572,414	192,192,558.86	0.56%
32	600631	百联股份	11,032,475	185,235,255.25	0.54%

33	600050	中国联通	30,627,437	179,783,055.19	0.53%
34	600004	白云机场	9,242,904	171,918,014.40	0.50%
35	000568	泸州老窖	3,998,766	168,348,048.60	0.49%
36	000069	华侨城A	3,949,565	157,192,687.00	0.46%
37	600655	豫园商城	5,849,832	152,212,628.64	0.45%
38	601919	中国远洋	8,297,289	151,508,497.14	0.44%
39	600266	北京城建	5,154,733	146,085,133.22	0.43%
40	000717	韶钢松山	19,999,956	140,999,689.80	0.41%
41	600713	南京医药	10,841,811	137,582,581.59	0.40%
42	600312	平高电气	5,975,300	136,177,087.00	0.40%
43	600456	宝钛股份	3,125,799	133,502,875.29	0.39%
44	000562	宏源证券	4,499,921	131,847,685.30	0.39%
45	600005	武钢股份	12,521,735	125,968,654.10	0.37%
46	002028	思源电气	1,958,641	123,159,346.08	0.36%
47	600054	黄山旅游	6,214,708	118,203,746.16	0.35%
48	000538	云南白药	3,299,936	118,137,708.80	0.35%
49	600009	上海机场	2,996,335	113,890,693.35	0.33%
50	601628	中国人寿	2,576,157	105,905,814.27	0.31%
51	601001	大同煤业	4,132,942	104,522,103.18	0.31%
52	600236	桂冠电力	9,269,999	101,042,989.10	0.30%
53	600717	天津港	3,990,034	100,429,155.78	0.29%
54	600037	歌华有线	3,784,273	99,072,267.14	0.29%
55	600660	福耀玻璃	3,236,806	98,787,319.12	0.29%
56	600690	青岛海尔	6,158,547	98,536,752.00	0.29%
57	600055	万东医疗	6,846,977	96,953,194.32	0.28%
58	600415	小商品城	948,050	95,753,050.00	0.28%
59	000718	苏宁环球	2,799,921	93,937,349.55	0.28%
60	000088	盐田港	5,386,701	90,442,709.79	0.26%
61	600583	海油工程	2,470,109	89,417,945.80	0.26%
62	601699	潞安环能	2,144,251	87,635,538.37	0.26%
63	000572	海马股份	4,339,512	86,877,030.24	0.25%
64	002032	苏泊尔	2,244,210	81,240,402.00	0.24%
65	000759	武汉中百	5,771,920	78,498,112.00	0.23%
66	600686	金龙汽车	3,242,214	76,192,029.00	0.22%
67	600475	华光股份	4,473,731	74,263,934.60	0.22%
68	600096	云天化	2,963,214	72,569,110.86	0.21%
69	600829	三精制药	3,357,903	72,262,072.56	0.21%
70	000090	深天健	3,287,463	68,707,976.70	0.20%
71	000027	深能源A	2,999,856	68,156,728.32	0.20%
72	600887	伊利股份	2,173,224	67,717,659.84	0.20%
73	000869	张裕A	1,099,797	67,615,519.56	0.20%

74	600348	国阳新能	1,672,217	61,805,140.32	0.18%
75	600089	特变电工	2,000,000	61,500,000.00	0.18%
76	600439	瑞贝卡	1,517,505	60,988,525.95	0.18%
77	600533	栖霞建设	2,999,915	60,358,289.80	0.18%
78	000895	双汇发展	1,031,958	59,750,368.20	0.17%
79	600299	星新材料	1,301,267	59,220,661.17	0.17%
80	000410	沈阳机床	2,460,912	59,061,888.00	0.17%
81	000402	金融街	2,000,000	58,000,000.00	0.17%
82	000983	西山煤电	1,999,926	56,457,910.98	0.17%
83	000755	山西三维	2,166,820	56,077,301.60	0.16%
84	000527	美的电器	1,819,422	55,310,428.80	0.16%
85	600307	酒钢宏兴	6,199,983	54,931,849.38	0.16%
86	000792	盐湖钾肥	1,224,196	54,329,818.48	0.16%
87	600825	新华传媒	1,553,800	53,450,720.00	0.16%
88	600816	安信信托	2,249,869	52,804,425.43	0.15%
89	000848	承德露露	1,788,199	51,857,771.00	0.15%
90	600258	首旅股份	1,300,000	50,778,000.00	0.15%
91	000024	招商地产	999,881	49,094,157.10	0.14%
92	000650	ST 仁和	3,000,000	48,090,000.00	0.14%
93	600210	紫江企业	7,599,969	46,967,808.42	0.14%
94	600693	东百集团	2,593,964	45,809,404.24	0.13%
95	002007	华兰生物	1,099,920	45,756,672.00	0.13%
96	000888	峨眉山 A	3,658,401	40,718,003.13	0.12%
97	600596	新安股份	908,975	39,258,630.25	0.11%
98	600600	青岛啤酒	1,499,930	38,833,187.70	0.11%
99	600785	新华百货	1,977,937	38,431,315.91	0.11%
100	600886	国投电力	2,460,952	38,095,536.96	0.11%
101	600880	博瑞传播	1,537,979	37,726,624.87	0.11%
102	600290	华仪电气	808,467	37,246,074.69	0.11%
103	600697	欧亚集团	1,726,850	35,072,323.50	0.10%
104	600588	用友软件	714,570	34,892,453.10	0.10%
105	600511	国药股份	886,700	34,474,896.00	0.10%
106	600628	新世界	1,718,238	33,007,351.98	0.10%
107	000768	西飞国际	1,010,971	31,208,674.77	0.09%
108	000022	深赤湾 A	1,147,353	30,347,486.85	0.09%
109	600501	航天晨光	1,832,615	29,853,298.35	0.09%
110	000042	深 长 城	1,033,242	27,866,536.74	0.08%
111	600176	中国玻纤	1,966,379	27,332,668.10	0.08%
112	600973	宝胜股份	1,000,000	27,310,000.00	0.08%
113	600062	双鹤药业	1,500,000	27,105,000.00	0.08%
114	600029	南方航空	2,973,593	25,513,427.94	0.07%

115	600835	上海机电	1,000,000	24,820,000.00	0.07%
116	600585	海螺水泥	400,054	23,587,183.84	0.07%
117	600527	江南高纤	1,604,659	23,235,462.32	0.07%
118	000031	中粮地产	1,000,196	22,624,433.52	0.07%
119	000501	鄂武商 A	1,733,007	21,645,257.43	0.06%
120	600449	赛马实业	1,925,441	21,430,158.33	0.06%
121	000617	石油济柴	666,526	20,662,306.00	0.06%
122	600320	振华港机	1,000,000	19,870,000.00	0.06%
123	600500	中化国际	1,400,000	19,754,000.00	0.06%
124	000157	中联重科	500,000	19,250,000.00	0.06%
125	000709	唐钢股份	1,499,962	19,169,514.36	0.06%
126	000858	五粮液	600,000	18,876,000.00	0.06%
127	600048	保利地产	400,000	18,372,000.00	0.05%
128	600675	中华企业	800,000	18,168,000.00	0.05%
129	600406	国电南瑞	593,944	17,907,411.60	0.05%
130	600736	苏州高新	1,358,730	17,649,902.70	0.05%
131	000046	泛海建设	500,000	17,245,000.00	0.05%
132	600685	广船国际	333,369	16,758,459.63	0.05%
133	600508	上海能源	1,144,012	15,684,404.52	0.05%
134	600309	烟台万华	286,000	15,318,160.00	0.04%
135	000652	泰达股份	500,000	14,140,000.00	0.04%
136	000401	冀东水泥	1,000,000	13,760,000.00	0.04%
137	600971	恒源煤电	533,209	13,036,960.05	0.04%
138	600649	原水股份	866,133	12,151,845.99	0.04%
139	000581	威孚高科	675,439	12,076,849.32	0.04%
140	600033	福建高速	1,517,109	11,621,054.94	0.03%
141	600361	华联综超	400,786	11,097,764.34	0.03%
142	600824	益民百货	999,950	10,889,455.50	0.03%
143	600641	万业企业	600,000	10,632,000.00	0.03%
144	000666	经纬纺机	1,199,910	10,379,221.50	0.03%
145	600858	银座股份	326,325	10,008,387.75	0.03%
146	600740	山西焦化	549,667	9,591,689.15	0.03%
147	600007	中国国贸	500,000	9,330,000.00	0.03%
148	600729	重庆百货	333,260	9,044,676.40	0.03%
149	600557	康缘药业	500,000	7,680,000.00	0.02%
150	600267	海正药业	540,372	7,565,208.00	0.02%
151	600584	长电科技	533,250	6,244,357.50	0.02%
152	600472	包头铝业	233,382	6,240,634.68	0.02%
153	002014	永新股份	399,912	5,998,680.00	0.02%
154	000978	桂林旅游	300,000	5,325,000.00	0.02%
155	600325	华发股份	155,046	4,702,545.18	0.01%

156	000933	神火股份	166,716	4,686,386.76	0.01%
157	000559	万向钱潮	532,987	4,674,295.99	0.01%
158	002033	丽江旅游	200,000	3,422,000.00	0.01%
159	000661	长春高新	199,871	2,574,338.48	0.01%
160	600372	昌河股份	366,408	2,216,768.40	0.01%
161	002139	拓邦电子	25,837	1,550,220.00	0.00%
162	002059	世博股份	166,533	1,350,582.63	0.00%
163	600879	火箭股份	47,081	1,251,883.79	0.00%
164	002137	实益达	25,390	1,198,154.10	0.00%
165	002138	顺络电子	24,511	840,972.41	0.00%
166	002136	安纳达	15,564	355,014.84	0.00%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600036	招商银行	1,636,900,100.77	4.79%
2	002024	苏宁电器	1,155,643,940.44	3.38%
3	000063	中兴通讯	1,037,421,673.39	3.04%
4	000002	万科A	916,767,051.41	2.68%
5	601398	工商银行	813,542,071.50	2.38%
6	600104	上海汽车	761,280,880.45	2.23%
7	601166	兴业银行	667,970,556.37	1.96%
8	600016	民生银行	664,391,205.66	1.94%
9	600019	宝钢股份	631,776,031.15	1.85%
10	600028	中国石化	587,446,340.73	1.72%
11	600900	长江电力	522,556,919.01	1.53%
12	000825	太钢不锈	478,665,933.34	1.40%
13	600383	金地集团	420,632,538.21	1.23%
14	600694	大商股份	411,130,626.13	1.20%
15	600000	浦发银行	368,082,937.90	1.08%
16	600050	中国联通	359,800,074.16	1.05%
17	600015	华夏银行	339,848,665.68	0.99%
18	600895	张江高科	322,495,831.43	0.94%
19	600718	东软股份	322,207,576.30	0.94%
20	000039	中集集团	301,094,977.26	0.88%

2、报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600028	中国石化	393,342,594.18	1.15%
2	000527	美的电器	266,845,152.28	0.78%
3	600739	辽宁成大	223,905,498.10	0.66%

4	600019	宝钢股份	223,877,712.20	0.66%
5	600050	中国联通	189,068,509.22	0.55%
6	601398	工商银行	165,461,699.38	0.48%
7	000002	万科A	157,394,551.34	0.46%
8	000878	云南铜业	144,215,404.22	0.42%
9	600005	武钢股份	143,326,644.25	0.42%
10	600015	华夏银行	92,577,920.65	0.27%
11	601318	中国平安	90,610,607.62	0.27%
12	601166	兴业银行	90,585,457.10	0.27%
13	000612	焦作万方	89,113,157.50	0.26%
14	600887	伊利股份	84,412,461.68	0.25%
15	600900	长江电力	73,440,639.45	0.21%
16	000960	锡业股份	66,809,384.10	0.20%
17	600631	百联股份	62,582,956.53	0.18%
18	600009	上海机场	61,442,967.57	0.18%
19	601001	大同煤业	51,575,340.54	0.15%
20	000666	经纬纺机	50,580,118.49	0.15%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
23,891,003,908.94	3,975,876,479.83

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值（元）	占净值比例
1	国 债	863,107,443.40	2.53%
2	金 融 债	-	-
3	央行票据	194,178,027.40	0.57%
4	企 业 债	-	-
5	可 转 债	3,645,827.80	0.01%
	合 计	1,060,931,298.60	3.11%

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值（元）	占净值比例
1	07 国债 09	279,888,000.00	0.82%
2	07 国债 08	248,600,000.00	0.73%
3	07 央行票据 18	145,678,027.40	0.43%
4	21 国债(3)	133,050,776.00	0.39%
5	07 国债 02	99,820,000.00	0.29%

（七）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

（八）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

3、报告期末本基金持有的权证及报告期内获得的权证

（1）报告期末本基金持有权证明细

截至本报告期末，本基金未持有权证。

（2）报告期内本基金获得权证明细

本报告期内，本基金未获得权证。

4、报告期末本基金的其他资产构成

单位：元

应收利息	11,102,817.11
证券清算款	8,289,857.83
应收股利	5,305,225.56
交易保证金	2,572,636.60
合计	27,270,537.10

5、至本报告期末，本基金持有的处于转股期的可转换债券

截至本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

八、基金兴科投资组合报告

(报告期末为 2007 年 4 月 23 日，报告期间为 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 23 日)

（一）报告期末基金资产组合情况

	金额（元）	占基金总资产比例

股票	910,349,035.49	59.96%
债券	278,199,257.90	18.32%
权证	-	-
资产支持证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	17,740,742.01	1.17%
其他资产	312,070,111.78	20.55%
合计	1,518,359,147.18	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	股票市值（元）	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	48,413,186.35	3.46%
C	制造业	318,115,795.12	22.76%
C0	其中：食品、饮料	65,929,136.29	4.72%
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	16,359,386.50	1.17%
C5	电子	296,625.00	0.02%
C6	金属、非金属	113,115,728.91	8.09%
C7	机械、设备、仪表	97,740,807.79	6.99%
C8	医药、生物制品	24,449,020.63	1.75%
C99	其他制造业	225,090.00	0.02%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	36,537,818.34	2.61%
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	52,458,809.19	3.75%
G	信息技术业	43,370,224.46	3.10%
H	批发和零售贸易	21,360,000.00	1.53%
I	金融、保险业	135,776,890.51	9.71%
J	房地产业	98,796,728.69	7.07%
K	社会服务业	49,216,587.10	3.52%
L	传播与文化产业	27,806,111.35	1.99%
M	综合类	78,496,884.38	5.61%
	合计	910,349,035.49	65.12%

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	期末市值（元）	占净值比例
----	------	------	-------	---------	-------

1	000069	华侨城 A	1,749,614	46,977,135.90	3.36%
2	600036	招商银行	2,295,559	45,497,979.38	3.25%
3	600415	小商品城	479,822	41,725,321.12	2.98%
4	600895	张江高科	2,578,651	36,771,563.26	2.63%
5	600009	上海机场	1,169,726	36,074,349.84	2.58%
6	600519	贵州茅台	349,859	32,995,202.29	2.36%
7	000895	S 双 汇	1,061,700	32,933,934.00	2.36%
8	600489	中金黄金	599,905	30,397,186.35	2.17%
9	601318	中国平安	529,980	30,129,363.00	2.16%
10	000400	许继电气	1,799,835	29,049,336.90	2.08%
11	600000	浦发银行	1,006,101	28,271,438.10	2.02%
12	600037	歌华有线	793,327	27,806,111.35	1.99%
13	000031	中粮地产	1,499,855	27,777,314.60	1.99%
14	600879	火箭股份	1,050,000	27,237,000.00	1.95%
15	000006	深振业 A	1,499,828	26,771,929.80	1.92%
16	000751	锌业股份	1,599,967	24,831,487.84	1.78%
17	600361	华联综超	890,000	21,360,000.00	1.53%
18	000063	中兴通讯	449,902	21,185,885.18	1.52%
19	600900	长江电力	1,508,385	20,725,209.90	1.48%
20	600028	中国石化	1,600,000	18,016,000.00	1.29%
21	600432	吉恩镍业	350,000	17,783,500.00	1.27%
22	000024	招商地产	499,911	17,691,850.29	1.27%
23	000878	云南铜业	699,957	17,652,915.54	1.26%
24	000559	万向钱潮	1,599,896	17,054,891.36	1.22%
25	600219	南山铝业	899,811	16,835,463.81	1.20%
26	600299	星新材料	399,985	16,359,386.50	1.17%
27	601006	大秦铁路	1,054,605	16,314,739.35	1.17%
28	600016	民生银行	1,300,000	16,172,000.00	1.16%
29	600886	国投电力	1,049,974	15,812,608.44	1.13%
30	601628	中国人寿	429,951	15,706,110.03	1.12%
31	600685	广船国际	499,907	15,282,156.99	1.09%
32	600050	中国联通	2,600,000	14,898,000.00	1.07%
33	000042	深 长 城	799,980	14,639,634.00	1.05%
34	600472	包头铝业	699,940	14,271,776.60	1.02%
35	600267	海正药业	1,199,968	14,111,623.68	1.01%
36	000060	中金岭南	399,940	13,126,030.80	0.94%
37	600383	金地集团	600,000	11,916,000.00	0.85%
38	000661	长春高新	599,965	10,337,396.95	0.74%
39	600372	昌河股份	1,099,866	9,007,902.54	0.64%
40	600459	贵研铂业	199,966	8,502,554.32	0.61%
41	600406	国电南瑞	239,998	7,286,339.28	0.52%

42	002059	世博股份	199,951	2,239,451.20	0.16%
43	002129	中环股份	17,500	296,625.00	0.02%
44	002130	沃尔核材	4,500	225,090.00	0.02%
45	002132	恒星科技	14,000	112,000.00	0.01%
46	002131	利欧股份	8,000	109,520.00	0.01%
47	601008	连云港	14,000	69,720.00	0.01%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600050	中国联通	97,323,917.80	8.97%
2	000063	中兴通讯	83,990,139.84	7.74%
3	000002	万 科 A	75,425,410.39	6.95%
4	600019	宝钢股份	64,523,531.13	5.95%
5	600000	浦发银行	62,116,532.83	5.72%
6	600900	长江电力	60,784,101.76	5.60%
7	600036	招商银行	58,985,179.53	5.44%
8	000898	鞍钢股份	56,676,652.23	5.22%
9	600016	民生银行	56,016,497.01	5.16%
10	000768	西飞国际	49,052,078.15	4.52%
11	600895	张江高科	47,625,498.36	4.39%
12	600456	宝钛股份	47,269,179.30	4.36%
13	000623	吉林敖东	44,614,071.09	4.11%
14	600009	上海机场	39,788,333.31	3.67%
15	601006	大秦铁路	39,681,846.89	3.66%
16	600879	火箭股份	39,567,698.29	3.65%
17	600028	中国石化	39,022,089.53	3.60%
18	000878	云南铜业	38,947,318.98	3.59%
19	600616	第一食品	38,649,873.66	3.56%
20	600415	小商品城	37,916,996.14	3.49%
21	601398	工商银行	37,007,785.99	3.41%
22	000400	许继电气	35,765,341.74	3.30%
23	000709	唐钢股份	35,554,632.07	3.28%
24	000858	五 粮 液	35,308,190.65	3.25%
25	000039	中集集团	35,079,429.84	3.23%
26	600489	中金黄金	34,131,378.11	3.15%
27	000666	经纬纺机	29,422,029.27	2.71%
28	000006	深振业 A	27,935,021.55	2.57%
29	600005	武钢股份	27,804,607.34	2.56%
30	601318	中国平安	26,622,162.34	2.45%

31	600033	福建高速	26,429,542.47	2.44%
32	601111	中国国航	25,769,680.83	2.38%
33	600219	南山铝业	25,285,852.77	2.33%
34	600320	振华港机	24,698,214.03	2.28%
35	600886	国投电力	24,385,704.61	2.25%
36	000751	锌业股份	24,340,976.49	2.24%
37	600748	上实发展	24,337,629.14	2.24%
38	601628	中国人寿	24,156,276.21	2.23%
39	600100	同方股份	23,462,587.72	2.16%
40	000900	现代投资	23,033,493.42	2.12%
41	600361	华联综超	22,059,845.76	2.03%
42	000031	中粮地产	21,910,334.69	2.02%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000002	万 科 A	146,716,248.20	13.52%
2	600050	中国联通	110,985,763.27	10.23%
3	600036	招商银行	97,202,232.87	8.96%
4	600016	民生银行	94,472,579.68	8.71%
5	600019	宝钢股份	85,805,955.98	7.91%
6	000858	五 粮 液	80,557,298.86	7.42%
7	600000	浦发银行	75,720,811.37	6.98%
8	600005	武钢股份	63,578,813.59	5.86%
9	000063	中兴通讯	56,605,170.82	5.22%
10	000898	鞍钢股份	54,673,064.41	5.04%
11	002024	苏宁电器	53,874,318.29	4.97%
12	000768	西飞国际	51,666,965.83	4.76%
13	600123	兰花科创	48,238,351.09	4.45%
14	600900	长江电力	46,894,260.56	4.32%
15	600456	宝钛股份	45,595,321.92	4.20%
16	000623	吉林敖东	45,455,047.33	4.19%
17	601006	大秦铁路	44,933,143.90	4.14%
18	600028	中国石化	43,098,758.80	3.97%
19	600631	百联股份	41,988,620.44	3.87%
20	600616	第一食品	40,363,036.39	3.72%
21	000709	唐钢股份	40,137,623.80	3.70%
22	601398	工商银行	39,609,136.30	3.65%
23	600895	张江高科	39,038,261.39	3.60%
24	000039	中集集团	37,092,839.83	3.42%
25	600015	华夏银行	35,180,674.39	3.24%
26	600694	大商股份	34,018,975.57	3.14%
27	600489	中金黄金	30,290,441.05	2.79%

28	000666	经纬纺机	29,801,017.08	2.75%
29	000024	招商地产	29,792,073.61	2.75%
30	601111	中国国航	29,505,176.37	2.72%
31	600161	天坛生物	26,687,926.37	2.46%
32	600033	福建高速	26,463,362.12	2.44%
33	600048	保利地产	26,394,621.99	2.43%
34	600748	上实发展	26,128,730.04	2.41%
35	600320	振华港机	25,718,668.31	2.37%
36	000900	现代投资	24,497,969.48	2.26%
37	600428	中远航运	24,013,685.91	2.21%
38	000878	云南铜业	23,457,116.85	2.16%
39	000046	泛海建设	22,991,797.51	2.12%
40	000807	云铝股份	22,233,934.62	2.05%
41	600100	同方股份	21,838,196.04	2.01%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
2,487,791,996.02	2,734,600,668.95

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值（元）	占净值比例
1	国 债	278,199,257.90	19.90%
2	金 融 债	-	-
3	央行票据	-	-
4	企 业 债	-	-
5	可 转 债	-	-
	合 计	278,199,257.90	19.90%

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值（元）	占净值比例
1	20 国债(10)	89,169,860.00	6.38%
2	02 国债(14)	84,855,672.00	6.07%
3	20 国债(4)	53,421,108.40	3.82%
4	21 国债(3)	38,959,017.50	2.79%
5	02 国债(10)	11,793,600.00	0.84%

（七）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

（八）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

3、报告期末本基金持有的权证及报告期内获得的权证

（1）报告期末本基金持有权证明细

截至本报告期末，本基金未持有权证。

（2）报告期内本基金获得权证明细

	权证名称	数量（份）	成本总额（元）
主动持有权证	邯钢 JTB1	1,800,000	4,683,755.48
	五粮 YGC1	291,600	5,422,302.40
因认购新债获配权证	武钢 CWB1	155,976	361,349.70

4、报告期末本基金的其他资产构成

单位：元

其他应收款	304,237,500.00
应收利息	5,251,647.62
交易保证金	2,580,964.16
合计	312,070,111.78

5、至本报告期末，本基金持有的处于转股期的可转换债券

截至本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

九、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）华夏蓝筹基金

截至 2007 年 6 月 30 日华夏蓝筹基金持有人情况如下：

1、报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数	1,831,539 户
报告期末平均每户持有基金份额	17,824.68 份

2、报告期末基金份额持有人结构

	持有份额（份）	占基金总份额比例
机构投资者持有的基金份额	651,692,705.49	2.00%
个人投资者持有的基金份额	31,994,903,372.43	98.00%
合 计	32,646,596,077.92	100.00%

3、报告期末本基金场内基金份额前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有份额（份）	占基金总份额比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司	204,260,760.00	0.63%
2	泰康人寿保险股份有限公司	53,487,289.00	0.16%
3	华夏基金管理有限公司	50,000,000.00	0.15%
4	招商证券—招行—招商证券基金宝集合资产管理计划	40,000,000.00	0.12%
5	CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	13,068,738.00	0.04%
6	中国再保险（集团）公司	12,814,334.00	0.04%
7	国泰君安—花旗—DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	10,848,320.00	0.03%
8	生命人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	8,022,523.00	0.02%
9	广发证券—招行—广发增强型基金优选集合资产管理计划	6,691,110.00	0.02%
10	荷兰银行有限公司	6,496,800.00	0.02%

4、报告期末本基金管理人基金从业人员持有本基金情况

本基金管理人基金从业人员持有基金份额	3,798.70 份
本基金管理人基金从业人员持有基金份额占总份额比例	0.00%

（二）基金兴科

截至 2007 年 4 月 23 日基金兴科持有人情况如下：

1、报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数	16,140 户
报告期末平均每户持有基金份额	30,979 份

2、报告期末基金份额持有人结构

	持有份额（份）	占基金总份额比例
机构投资者持有的基金份额	372,620,479	74.52%
个人投资者持有的基金份额	127,379,521	25.48%
合 计	500,000,000	100.00%

3、前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占基金总份额比例
1	华夏基金管理有限公司	49,971,721	9.99%
2	中国人寿保险（集团）公司	47,803,705	9.56%
3	中国人寿保险股份有限公司	44,646,053	8.93%
4	新华人寿保险股份有限公司	38,564,360	7.71%
5	泰康人寿保险股份有限公司	22,937,590	4.59%
6	招商证券－招行－招商证券基金宝集合资产管理计划	21,579,235	4.32%
7	中国平安保险（集团）股份有限公司	20,911,576	4.18%
8	中信信托投资有限责任公司－财富二号信托产品	11,145,497	2.23%
9	国际金融－建行－中金股票策略集合资产管理计划	9,975,298	2.00%
10	银河－渣打－CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	9,068,976	1.81%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人名册编制。

十、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	500,000,000.00
期初基金份额总额	500,000,000.00
报告期间因基金份额折算增加的份额	665,930,905.00
报告期间基金总申购份额	32,661,410,268.18
报告期间基金总赎回份额	1,180,745,095.26
报告期末基金份额总额	32,646,596,077.92

十一、重大事件揭示

（一）2007年4月2日，兴科证券投资基金基金份额持有人大会在北京召开，大会讨论通过了基金兴科转型议案，内容包括基金兴科由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。依据中国证监会2007年4月16日证监基金字[2007]107号文核准，持有人大会决议生效。依据持有人大会决议，基金管理人向深证证券交易所申请基金终止上市，自2007年4月24日基金兴科终止上市之日起，原《兴科证券投资基金基金合同》失效，《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为无限期，基金投资目标、范

围和策略调整，同时基金更名为“华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）”，并依托深圳证券交易所的 LOF 平台，在进行申购、赎回的同时继续进行上市交易。

（二）本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

（三）本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

（四）本报告期本基金收益分配事项：

根据 2007 年 4 月 19 日本基金的收益分配公告，本基金向 2007 年 4 月 23 日下午交易结束后在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人按每 10 份基金单位派发 6.10 元的现金红利。

（五）本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

（六）本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本期内未受到任何处分。

（七）选择证券经营机构交易席位的情况

为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- 1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- 2、公司财务状况良好；
- 3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- 4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- 5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

券商专用席位选择程序：

- 1、对席位候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据席位选择标准对席位候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易席位的券商。

- 2、协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订席位租用协议，并通知基金托管人。

根据以上标准，本基金分别选择了西部证券、东吴证券、招商证券、国泰君安证券、申银万国证券、中信建投证券、东方证券、长城证券、富成证券、光大

证券、国信证券、国元证券、联合证券、中国银河证券共计 14 个交易席位。本报告期新增加了长城证券、富成证券、光大证券、国信证券、联合证券的席位。席位佣金为股票成交金额的 1%扣除应由券商负担的交易手续费、证管费及结算风险金。

各席位交易量及佣金提取情况如下：

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日租用各券商席位的数量、股票交易量及佣金情况如下：

单位：元

序号	券商名称	租用该券商席位的数量	股票交易量	占股票交易总量比例	应付佣金	占应付佣金总量比例
1	中信建投证券	1	7,744,100,722.95	23.51%	6,346,125.26	23.87%
2	招商证券	1	5,984,311,906.95	18.17%	4,898,562.39	18.43%
3	申银万国证券	1	4,390,767,449.05	13.33%	3,435,804.44	12.92%
4	东方证券	1	4,295,354,596.68	13.04%	3,521,967.60	13.25%
5	国泰君安证券	1	3,096,011,725.40	9.40%	2,536,430.93	9.54%
6	中国银河证券	1	2,646,541,849.98	8.04%	2,070,940.65	7.79%
7	光大证券	1	1,765,753,322.91	5.36%	1,381,712.91	5.20%
8	国信证券	1	1,313,344,398.32	3.99%	1,027,698.96	3.87%
9	国元证券	1	560,097,889.94	1.70%	457,928.29	1.72%
10	长城证券	1	530,529,242.64	1.61%	415,143.39	1.56%
11	联合证券	1	441,029,373.63	1.34%	361,644.50	1.36%
12	富成证券	1	168,476,440.36	0.51%	131,833.62	0.50%
	合计	12	32,936,318,918.81	100.00%	26,585,792.96	100.00%

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日各券商债券、回购交易量情况如下：

单位：元

序号	券商名称	债券交易量	占债券交易总量比例	回购交易量	占回购交易总量比例
1	招商证券	317,482,575.30	52.12%	1,466,900,000.00	59.13%
2	中信建投证券	148,537,578.30	24.38%	504,000,000.00	20.32%
3	国泰君安证券	109,879,285.10	18.04%	265,000,000.00	10.68%
4	东方证券	20,916,473.00	3.43%	-	-
5	国元证券	12,335,656.70	2.03%	245,000,000.00	9.88%
	合计	609,151,568.40	100.00%	2,480,900,000.00	100.00%

（八）其他重大事件

1、本基金管理人于 2007 年 6 月 28 日发布关于华夏蓝筹核心混合型证券投资

资基金（LOF）暂停申购业务的第一次提示性公告；

2、本基金管理人于 2007 年 6 月 14 日发布华夏基金管理有限公司关于运用固有资金进行基金投资的公告；

3、本基金管理人于 2007 年 6 月 12 日发布华夏基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告，增聘刘文动先生担任华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理；

4、本基金管理人于 2007 年 6 月 5 日发布关于更换信息披露负责人的公告，廖为女士担任华夏基金管理有限公司信息披露负责人；

5、本基金管理人于 2007 年 5 月 31 日发布华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）暂停申购业务及相关事项的公告；

6、本基金管理人于 2007 年 5 月 28 日发布华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告；

7、本基金管理人于 2007 年 5 月 24 日发布华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购业务的提示性公告；

8、本基金管理人于 2007 年 5 月 23 日发布华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）上市交易公告书暨开放日常赎回公告；

9、本基金管理人于 2007 年 5 月 12 日发布关于原兴科证券投资基金基金份额折算结果的公告；

10、本基金管理人于 2007 年 5 月 11 日发布华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）集中申购结果公告；

11、本基金管理人于 2007 年 5 月 9 日发布华夏基金管理有限公司关于增聘华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告，增聘巩怀志先生担任华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理；

12、本基金管理人于 2007 年 5 月 8 日发布华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）集中申购申请确认比例结果的公告；

13、本基金管理人于 2007 年 4 月 28 日发布华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）提前结束集中申购的公告；

14、本基金管理人于 2007 年 4 月 27 日发布开通广东发展银行借记卡基金网上交易的公告；

15、本基金管理人于 2007 年 4 月 24 日发布华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）集中申购期基金份额发售公告；

16、本基金管理人于 2007 年 4 月 23 日发布兴科证券投资基金终止上市的提示性公告；

17、本基金管理人于 2007 年 4 月 20 日发布兴科证券投资基金终止上市公告；

18、本基金管理人于 2007 年 4 月 19 日发布兴科证券投资基金 2006 年年度收益分配公告；

19、本基金管理人于 2007 年 4 月 19 日发布兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告；

20、本基金管理人于 2007 年 4 月 13 日发布关于旗下基金投资基金管理人非控股股东承销“深圳市沃尔核材股份有限公司首次公开发行 A 股”的公告；

21、本基金管理人于 2007 年 4 月 3 日发布关于兴科证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告；

22、本基金管理人于 2007 年 3 月 31 日发布兴科证券投资基金 2006 年年度收益分配预告；

23、本基金管理人于 2007 年 3 月 23 日发布兴科证券投资基金召开基金份额持有人大会第二次提示性公告；

24、本基金管理人于 2007 年 3 月 16 日发布兴科证券投资基金召开基金份额持有人大会第一次提示性公告；

25、本基金管理人于 2007 年 3 月 2 日发布兴科证券投资基金召开基金份额持有人大会公告；

投资者可通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 www.ChinaAMC.com 查阅上述公告。

十二、基金管理人简介

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、上海和深圳设有分公司。华夏基金是全国首批社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人及中国内地首只 ETF 基金管理人。华夏基金还成为国内基金公司首批获得

QDII 业务资格的基金管理公司，并且是国内唯一获得亚洲债券基金管理资格的投资管理机构。

截至 2007 年 6 月，华夏基金管理有限公司管理资产规模超过 1400 亿元人民币，累计分红超过 194 亿元人民币，是国内基金业管理资产规模最大的基金公司之一，也是为投资人分红最多的基金公司之一。

华夏基金旗下共有 12 只开放式基金，3 只封闭式基金，1 只亚洲债券独立组合以及多只全国社保基金投资组合和企业年金。从低风险的货币市场基金到高收益的股票型基金，华夏基金已经初步建立了完善的产品线，可以满足各类风险偏好投资者的需求，是国内管理基金数目最多的基金管理公司之一。

华夏基金始终坚持维护持有人利益，不断提高客户服务水平。今年上半年：

- 华夏基金通过电话线路扩容、网站稳定性改造等手段，进一步提高人工电话接通率，为客户提供稳定、便捷的网站服务。继续通过网站热点问题、服务提示、电子邮件、短信服务等方式加强主动服务工作，提高服务质量。
- 华夏基金的网上交易目前可支持建行卡、农行卡、兴业卡、广发卡、招行卡、ChinaPay CD 卡等多种银行卡支付，方便投资人进行网上交易。

为帮助投资人培养健康、理性的基金投资观念，今年上半年华夏基金在投资者教育方面做了大量工作：

- 华夏基金成立了投资者教育工作领导小组及投资者教育工作办公室。
- 华夏基金在网站开辟投资者教育专区，制作专题页面，并开展“我的基金理财故事”有奖征文活动。
- 华夏基金编辑出版了 50 万册投资者教育丛书《基金投资百问百答》，在六家媒体开设“投资者教育专栏”，并举办投资者教育系列活动“华夏基金理财大讲堂”。

今年以来，华夏基金获多家中介机构评选的多种奖项：

- 2007 年 1 月，在《中国证券报》主办的“第四届中国基金金牛奖”评选中，华夏基金获“2006 年度十大金牛基金公司奖”。
- 2007 年 1 月 26 日，华夏基金获得由《21 世纪经济报道》评选的“中国

基金管理公司综合实力奖”。

- 2007年1月27日，公司获得由和讯网评选出的“2006年度中国十大品牌基金公司奖”和“2006年度中国基金业杰出创新奖”。
- 2007年2月，在香港《亚洲资产管理》杂志2006年评选活动中，华夏基金获得了“亚洲地区最佳客户服务奖”及“中国最佳社会服务奖”。
- 2007年4月，在《上海证券报》主办的“第四届中国最佳基金公司评选”活动中，成为唯一一家荣获“中国最佳基金公司TOP大奖”的基金管理公司。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《兴科证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴科证券投资基金托管协议》；
- 4、《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)合同》；
- 5、《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- 6、法律意见书；
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 8、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）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。

（三）查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。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
二〇〇七年八月二十八日