

**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年半年度报告**

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：二〇一四年八月二十五日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

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及其更新。

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 1 月 1 日起至 2014 年 5 月 29 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	4
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
§5 托管人报告.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 华夏兴和混合型证券投资基金.....	13
6.1.1 资产负债表.....	13
6.1.2 利润表.....	15
6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.1.4 报表附注.....	16
6.2 原兴和证券投资基金.....	35
6.2.1 资产负债表.....	35
6.2.2 利润表.....	37
6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	38
6.2.4 报表附注.....	39
§7 投资组合报告.....	54
7.1 华夏兴和混合型证券投资基金.....	54
7.1.1 期末基金资产组合情况.....	54
7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
7.1.3 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.....	55
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
7.1.6 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.....	59
7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
7.1.8 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贵金属投资明细.....	59
7.1.9 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.....	59
7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.1.12 投资组合报告附注.....	60
7.2 原兴和证券投资基金.....	61
7.2.1 期末基金资产组合情况.....	61
7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	61
7.2.3 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.....	62
7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
7.2.6 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.....	69
7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	69
7.2.8 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贵金属投资明细.....	69
7.2.9 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.....	69
7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	69

7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.2.12 投资组合报告附注	70
§8 基金份额持有人信息	71
8.1 华夏兴和混合型证券投资基金	71
8.2 原兴和证券投资基金	71
§9 开放式基金份额变动	72
§10 重大事件揭示	72
§11 备查文件目录	76

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 华夏兴和混合型证券投资基金

基金名称	兴和证券投资基金
基金简称	华夏兴和混合
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
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
报告期末基金份额总额	3,049,712,611.25 份
基金合同存续期	不定期

2.1.2 原兴和证券投资基金

基金名称	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
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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999年7月30日

2.2 基金产品说明

2.1.1 华夏兴和混合型证券投资基金

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。
--------	---

2.1.2 原兴和证券投资基金

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	崔雁巍	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		杨明辉	王洪章

2.4 信息披露方式

2.4.1 华夏兴和混合型证券投资基金

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.4.2 原兴和证券投资基金

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	上海浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦36层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	转型后 报告期（2014年5月30日至 2014年6月30日）	转型前 报告期（2014年1月1日至 2014年5月29日）
本期已实现收益	-133,494,492.56	63,925,646.93
本期利润	16,544,338.26	-114,348,899.28
加权平均基金份额本期利润	0.0055	-0.0381
本期加权平均净值利润率	0.58%	-4.01%
本期基金份额净值增长率	0.60%	-3.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2014年6月30日）	报告期末（2014年5月29日）
期末可供分配利润	-220,306,046.98	-214,731,445.91
期末可供分配基金份额利润	-0.0722	-0.0716
期末基金资产净值	3,075,699,637.60	2,785,268,554.09
期末基金份额净值	1.009	0.9284
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2014年6月30日）	报告期末（2014年5月29日）
基金份额累计净值增长率	0.60%	290.74%

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期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

④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

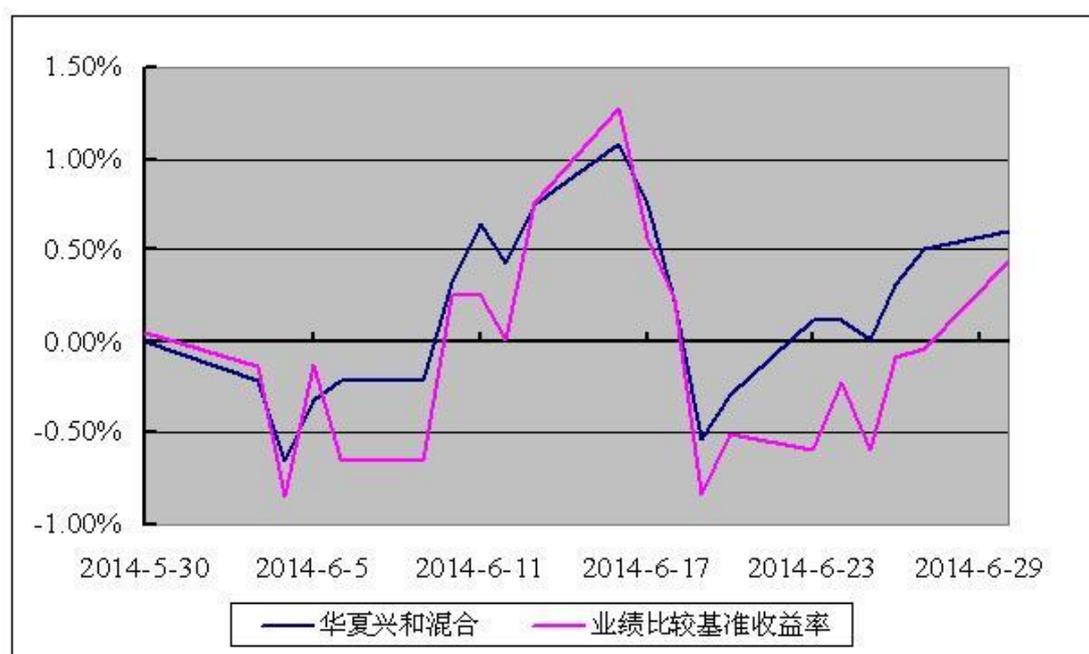
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.60%	0.35%	0.39%	0.55%	0.21%	-0.20%
自基金转型起至今	0.60%	0.34%	0.45%	0.53%	0.15%	-0.19%

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，原兴和证券投资基金转型为华夏兴和混合型证券投资基金。

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	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
过去一个月	0.36%	0.61%	-	-	-	-
过去三个月	-2.99%	1.17%	-	-	-	-
过去六个月	-7.06%	1.42%	-	-	-	-
过去一年	-8.35%	1.59%	-	-	-	-
过去三年	-8.94%	1.85%	-	-	-	-
自基金合同生效起至转型前	290.74%	2.47%	-	-	-	-

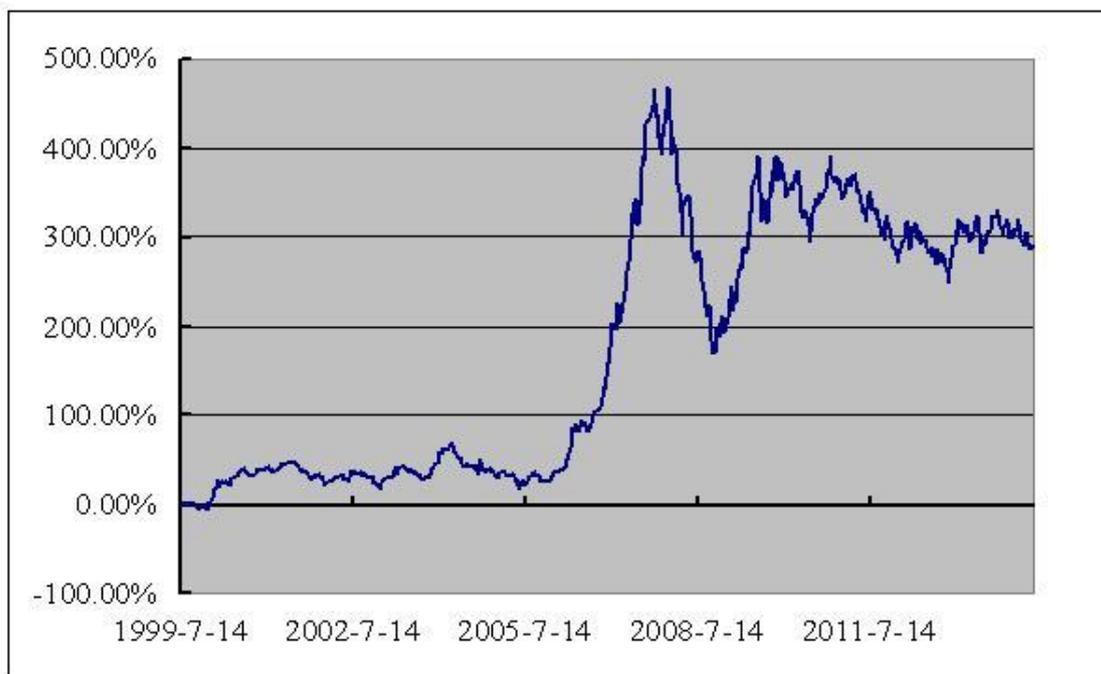
注：原兴和证券投资基金未规定业绩比较基准。

3.2.2 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

(1999年7月14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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 年上半年，在《中国证券报》主办的“第十一届中国基金业金牛奖”评选中，华夏基金荣获年度“金牛基金管理公司奖”，所管理的基金荣获 6 个单项奖；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；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，上半年，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）华夏财富宝货币在微信理财通开通了申购和赎回等业务，方便投资者进行现金管理；（2）华夏现金增利货币在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额变化实时可见，且可见即可用，提高投资者的交易效率；（3）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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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。
刘振华	本基金的基金经理	2012-6-4	2014-2-21	14年	中国人民大学MBA。2000年9月加入华夏基金管理有限公司，曾任交易员、研究员、风险管理部副总经理、交易总监等。2012年6月4日至2014年2月21日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。

③根据本基金管理人于2014年2月22日发布的《华夏基金管理有限公司关于调整兴和证券投资基金基金经理的公告》，刘振华先生不再担任本基金基金经理。

④根据本基金管理人于2014年3月18日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘兴和证券投资基金基金经理的公告》，增聘林峰先生为本基金基金经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年上半年，在宏观数据疲弱、政策放松不断加码以及新股发行、人民币贬值、房地产惜贷、个别信用风险事件等因素的影响下，股票市场区间震荡，总体波动幅度很低，并延续了 2013 年的结构分化局面。

报告期内，本基金调整了结构，降低了仓位。1 季度，本基金结合市场风格转换做了较大调整，对于组合中的积极投资部分，减持了几乎所有创业板股票以及缺乏弹性的大盘蓝筹股，重点布局符合经济转型方向的中低估值、中高业绩增长的中盘成长股。2 季度，本基金由封闭式基金转型为开放式基金，本基金对组合中的指数投资部分进行清仓，股票仓位保持在低水平，同时，进一步优化组合，少量参与了创业板股票的反弹行情。

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 1 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-3.94%，同期上证综指下跌 3.56%，深证成指下跌 9.61%。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

展望下半年，政策放松的效果将逐渐显现，宏观经济将逐步企稳，但政策意图是“只托不举”，一旦宏观经济企稳，政策放松力度就会骤减。对股市而言，拟施行的沪港通是积极因素，而创业板放开再融资则是负面因素，市场仍将处于存量资金博弈状态，整体性机会仍未到来。市场将有结构性机会，但也存在局部风险。沪深 300 估值合理，而小盘股尤其创业板股票估值较高，随着企业中期及下半年业绩不达预期，可能面临“戴维斯双杀效应”的风险。

下半年，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，主要投资中盘成长股，回避高估值伪成长小盘股，结合沪港通项目精选大盘蓝筹股。在仓位控制上以逆向操作为主，趋势投资为辅。行业方面，重点关注风电、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分投资和每一份信任，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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，近三分之二的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益

冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 华夏兴和混合型证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：华夏兴和混合型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	6.1.4.7.1	64,222,574.30
结算备付金		7,142,129.06
存出保证金		581,523.65
交易性金融资产	6.1.4.7.2	1,557,946,380.17

其中：股票投资		984,484,424.17
基金投资		-
债券投资		573,461,956.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	1,499,701,970.00
应收证券清算款		515,980.19
应收利息	6.1.4.7.5	10,234,112.25
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.6	5,000.00
资产总计		3,140,349,669.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		40,181,724.07
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,550,487.12
应付托管费		591,747.86
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.1.4.7.7	18,306,170.14
应交税费		930,642.68
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.1.4.7.8	1,089,260.15
负债合计		64,650,032.02
所有者权益：		
实收基金	6.1.4.7.9	3,296,005,684.58
未分配利润	6.1.4.7.10	-220,306,046.98
所有者权益合计		3,075,699,637.60

负债和所有者权益总计		3,140,349,669.62
------------	--	------------------

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报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.009元，基金份额总额3,049,712,611.25份。

6.1.2 利润表

会计主体：华夏兴和混合型证券投资基金

本报告期：2014年5月30日（基金合同生效日）至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
一、收入		23,921,548.67
1.利息收入		4,727,887.08
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	383,932.15
债券利息收入		2,047,308.46
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,296,646.47
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-130,845,403.48
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	-131,120,427.50
基金投资收益		-
债券投资收益	6.1.4.7.13	-1,266,805.26
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.1.4.7.14	-
股利收益	6.1.4.7.15	1,541,829.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.16	150,038,830.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.17	234.25
减：二、费用		7,377,210.41
1.管理人报酬		3,779,391.32
2.托管费		629,898.56
3.销售服务费		-
4.交易费用	6.1.4.7.18	2,951,357.76
5.利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	6.1.4.7.19	16,562.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,544,338.26
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,544,338.26

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏兴和混合型证券投资基金

本报告期：2014年5月30日（基金合同生效日）至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30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）	3,000,000,000.00	-214,731,445.91	2,785,268,554.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,544,338.26	16,544,338.26
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）	296,005,684.58	-22,118,939.33	273,886,745.25
其中：1.基金申购款	296,005,684.58	-22,118,939.33	273,886,745.25
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向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）	3,296,005,684.58	-220,306,046.98	3,075,699,637.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4 财务报表由下列负责人签署：

 杨明辉 崔雁巍 崔雁巍
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

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），兴和证券投资基金基金份额持有人大会决议生效，并获得上海证券交易所自律监管决定书 [2014]232 号《关于终止兴和证券投资基金上市的决定》的同意，基金兴和于 2014 年 5 月 29 日进行终止上市权利登记，2014 年 5 月 30 日终止上市。原《兴和证

券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《华夏兴和混合型证券投资基金基金合同》于同一起生效，同时基金兴和更名为华夏兴和混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华夏兴和混合型证券投资基金招募说明书》和《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》的有关规定，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2014 年 6 月 20 日为基金份额折算基准日。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算前基金份额净值为 0.925 元，精确到小数点后第 9 位为 0.925282871 元（第 10 位舍去），本基金管理人按照 0.925282871 的折算比例对原兴和证券投资基金进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为 1.000 元，折算后的基金份额为折算前的基金份额乘以折算比例，采用截尾法保留到整数位，所产生的误差归入基金财产。折算前原兴和证券投资基金份额总额为 30 亿份，折算后基金份额总额为 2,775,825,866 份。华夏基金管理有限公司已根据上述折算比例向登记结算机构中国证券登记结算有限责任公司提出基金份额的变更登记申请，登记结算机构中国证券登记结算有限责任公司已于 2014 年 6 月 23 日对各基金份额持有人持有的基金份额予以变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2014 年 6 月 3 日至 2014 年 6 月 17 日期间内开放集中申购，最终确认的有效净申购金额为 273,841,508.26 元人民币，有效申购申请确认金额产生的银行利息共计 45,236.99 元人民币，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（14）第 0615 号验资报告予以验证。本次集中申购有效申购户数为 3,740 户，按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，本次集中申购有效净申购资金及其产生的利息结转的基金份额共计 273,886,745.25 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏兴和混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票）、债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法

规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.1.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 5 月 30 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

6.1.4.4.1 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。

6.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融

资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实

际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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。

6.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现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累计未实现损益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利润。

6.1.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.1.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的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非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3、在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的

通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.1.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、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。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。
- 4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- 5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	64,222,574.30
定期存款	-
其他存款	-
合计	64,222,574.30

6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	977,014,256.36	984,484,424.17	7,470,167.81	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	53,711,173.77	50,611,956.00	-3,099,217.77
	银行间市场	541,041,538.08	522,850,000.00	-18,191,538.08
	合计	594,752,711.85	573,461,956.00	-21,290,755.85
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,571,766,968.21	1,557,946,380.17	-13,820,588.04	

6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.1.4.7.4 买入返售金融资产

6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	979,701,970.00	-
交易所市场买入返售金融资产	520,000,000.00	-

合计	1,499,701,970.00	-
----	------------------	---

6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	95,582.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,214.70
应收债券利息	9,127,144.19
应收买入返售证券利息	1,007,908.68
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	261.70
合计	10,234,112.25

6.1.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
其他应收款	5,000.00
待摊费用	-
合计	5,000.00

6.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	18,303,700.14
银行间市场应付交易费用	2,470.00
合计	18,306,170.14

6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	1,000,000.00
应付赎回费	-
预提费用	89,260.15
合计	1,089,260.15

6.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
2014年6月20日基金份额折算调整	-224,174,134.00	-
2014年6月20日未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
2014年6月20日集中申购募集资金本金及利息	273,886,745.25	296,005,684.58
2014年6月20日基金拆分和集中申购完成后	3,049,712,611.25	3,296,005,684.58
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,049,712,611.25	3,296,005,684.58

6.1.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-50,872,027.05	-163,859,418.86	-214,731,445.91
本期利润	-133,494,492.56	150,038,830.82	16,544,338.26
本期基金份额交易产生的变动数	-18,293,577.23	-3,825,362.10	-22,118,939.33
其中：基金申购款	-18,293,577.23	-3,825,362.10	-22,118,939.33
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-202,660,096.84	-17,645,950.14	-220,306,046.98

6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
	活期存款利息收入

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,559.69
其他	812.43
合计	383,932.15

6.1.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	1,213,258,067.23
减：卖出股票成本总额	1,344,378,494.73
买卖股票差价收入	-131,120,427.50

6.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	80,874,305.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	80,381,400.42
减：应收利息总额	1,759,710.36
债券投资收益	-1,266,805.26

6.1.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.1.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,541,829.28
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,541,829.28

6.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	150,038,830.82

——股票投资	146,271,450.96
——债券投资	3,767,379.86
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	150,038,830.82

6.1.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	234.25
合计	234.25

注：本基金的赎回费根据基金合同及招募说明书（更新）的有关规定收取，赎回费率随赎回基金份额持有时间递减，所收取赎回费总额不低于25%归入基金资产。

6.1.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	2,950,857.76
银行间市场交易费用	500.00
合计	2,951,357.76

6.1.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
审计费用	8,767.04
信息披露费	7,013.76
银行费用	781.97
合计	16,562.77

6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.1.4.9 关联方关系

6.1.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.1.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2014 年 2 月 12 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、山东省农村经济开发投资公司（比例 10%）、POWER CORPORATION OF CANADA（出资比例 10%）、青岛海鹏科技投资有限公司（出资比例 10%）、南方工业资产管理有限责任公司（出资比例 7.8%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.1.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 5 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	659,632,633.81	39.28%

6.1.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.1.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 5 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	7,641,692.50	19.52%

6.1.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年5月30日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
中信证券	600,529.74	39.28%	608,381.09	3.32%

注：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证管费、经手费和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。

6.1.4.10.2 关联方报酬

6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,779,391.32
其中：支付销售机构的客户维护费	17,564.47

注：①支付基金管理人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。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月30日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	629,898.56

注：①支付基金托管人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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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。

6.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2014年5月30日至2014年6月30日
基金合同生效日（2014年5月30日）持有的基金份额	165,089,737.00
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-12,335,032.00
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	152,754,705.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.01%

6.1.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.1.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2014年5月30日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	64,222,574.30	372,560.03

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末通过关联方购买其承销的证券。

6.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.1.4.12 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.1.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603168	莎普爱思	2014-06-24	2014-07-02	新发流通受限	21.85	21.85	9,892	216,140.20	216,140.20	-
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-02	新发流通受限	12.20	12.20	34,975	426,695.00	426,695.00	-

6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600418	江淮汽车	2014-04-14	筹划重大资产重组事项	10.20	2014-07-11	11.22	3,449,923	35,582,073.13	35,189,214.60	-
300323	华灿光电	2014-04-28	筹划重大资产重组事项	18.68	2014-07-28	11.21	487,684	9,217,826.22	9,109,937.12	-
000852	江钻股份	2014-05-28	筹划重大事项	15.80	-	-	317,742	5,914,658.42	5,020,323.60	-
000562	宏源证券	2013-10-31	筹划重大资产重组事项	8.22	2014-07-28	8.93	360,000	3,357,371.00	2,959,200.00	-
601669	中国电建	2014-05-13	筹划重大资产重组事项	2.79	-	-	1,000,000	3,578,627.96	2,790,000.00	-
002100	天康生物	2014-05-27	筹划重大资产重组事项	9.82	-	-	10,000	84,372.25	98,200.00	-

6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.1.4.13 金融工具风险及管理

6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律监察部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.1.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	64,222,574.30	-	-	64,222,574.30
结算备付金	7,142,129.06	-	-	7,142,129.06
结算保证金	581,523.65	-	-	581,523.65
债券投资	230,472,324.00	-	342,989,632.00	573,461,956.00
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,499,701,970.00	-	-	1,499,701,970.00
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。	
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 (2014 年 6 月 30 日)
	利率下降 25 个基点	5,782,942.61
	利率上升 25 个基点	-5,672,820.15

6.1.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票

资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	984,484,424.17	32.01
衍生金融资产-权证投资	-	-
合计	984,484,424.17	32.01

6.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假 设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。	
	3、Beta 系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。	
分 析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 (2014 年 6 月 30 日)
	+5%	43,425,607.95
	-5%	-43,425,607.95

6.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.1.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层级：

第一层级：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确

定公允价值。

第三层级：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.1.4.14.2 各层级金融工具公允价值

截至2014年6月30日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为1,035,096,380.17元，第二层级的余额为522,850,000.00元，第三层级的余额为0元。

6.1.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

6.1.4.14.4 第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

6.2 原兴和证券投资基金

6.2.1 资产负债表

会计主体：原兴和证券投资基金

报告截止日：2014年5月29日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年5月29日	上年度末 2013年12月31日
资产：			
银行存款	6.2.4.7.1	229,664,602.32	80,753,561.25
结算备付金		8,355,400.40	1,577,657.60
存出保证金		469,703.55	499,689.61
交易性金融资产	6.2.4.7.2	2,285,902,168.41	2,620,908,706.14
其中：股票投资		1,715,918,121.85	2,020,110,785.06
基金投资		-	-
债券投资		569,984,046.56	600,797,921.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	240,000,000.00	160,000,000.00
应收证券清算款		27,701,001.60	43,806,135.44

应收利息	6.2.4.7.5	16,514,755.44	13,308,804.20
应收股利		127,964.60	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.6	5,000.00	5,000.00
资产总计		2,808,740,596.32	2,920,859,554.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年5月29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	6.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,752,555.44	3,100,056.99
应付托管费		550,511.09	620,011.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.2.4.7.7	18,039,853.67	15,246,889.78
应交税费		930,642.68	930,642.68
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.8	1,198,479.35	1,344,500.00
负债合计		23,472,042.23	21,242,100.87
所有者权益：			
实收基金	6.2.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	6.2.4.7.10	-214,731,445.91	-100,382,546.63
所有者权益合计		2,785,268,554.09	2,899,617,453.37
负债和所有者权益总计		2,808,740,596.32	2,920,859,554.24

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报告截止日 2014 年 5 月 29 日，基金份额净值 0.9284 元，基金份额总额 3,000,000,000 份。

6.2.2 利润表

会计主体：原兴和证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年5月29日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年5月29日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
一、收入		-91,148,262.81	-27,522,494.55
1.利息收入		13,886,588.66	12,250,687.01
其中：存款利息收入	6.2.4.7.11	776,197.25	953,116.84
债券利息收入		10,535,405.36	11,095,973.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,574,986.05	201,596.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		73,239,694.74	-20,220,438.35
其中：股票投资收益	6.2.4.7.12	62,674,965.51	-41,792,283.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.2.4.7.13	-111,725.57	-1,054,067.07
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.2.4.7.14	-	-
股利收益	6.2.4.7.15	10,676,454.80	22,625,912.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.16	-178,274,546.21	-19,552,743.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.17	-	-
减：二、费用		23,200,636.47	28,982,014.69
1.管理人报酬		14,559,523.55	17,948,113.05
2.托管费		2,911,904.71	3,589,622.64
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.2.4.7.18	5,511,838.06	6,932,221.67
5.利息支出		9,504.44	300,351.06
其中：卖出回购金融资产支出		9,504.44	300,351.06
6.其他费用	6.2.4.7.19	207,865.71	211,706.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-114,348,899.28	-56,504,509.24
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-114,348,899.28	-56,504,509.24
-------------------	--	-----------------	----------------

6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：原兴和证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年5月29日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年5月29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）	3,000,000,000.00	-100,382,546.63	2,899,617,453.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-114,348,899.28	-114,348,899.28
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向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）	3,000,000,000.00	-214,731,445.91	2,785,268,554.09
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）	3,000,000,000.00	-211,897,563.64	2,788,102,436.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-56,504,509.24	-56,504,509.24
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向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）	3,000,000,000.00	-268,402,072.88	2,731,597,927.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4 财务报表由下列负责人签署：

 杨明辉 崔雁巍 崔雁巍
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.2.4 报表附注

6.2.4.1 基金基本情况

兴和证券投资基金（以下简称“本基金”）经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 1999[19]号文《关于同意设立兴和证券投资基金的批复》核准，由中信建投证券有限责任公司（原华夏证券有限公司）、北京证券有限责任公司、华夏基金管理有限公司共三家发起人，依照《证券投资基金管理暂行办法》（于 2004 年 9 月 16 日废止，由《中华人民共和国证券投资基金法》取代）、《开放式证券投资基金试点办法》（已废止）等有关规定和《兴和证券投资基金基金契约》（于 2004 年 10 月 16 日改为《兴和证券投资基金基金合同》）发起，于 1999 年 7 月 14 日募集成立。本基金为契约型封闭式基金，存续期为 15 年，发行规模为 30 亿份基金份额，业经北京京都会计师事务所有限责任公司京都验字（1999）第 078 号的验资报告予以验证。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证上字（99）第 51 号文审核同意，于 1999 年 7 月 30 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴和证券投资基金基金合同》、中国证监会证监基金字[1999]19 号批文的规定及本基金管理人于 2007 年 2 月 15 日发布的《华夏基金管理有限公司关于修改兴和证券投资基金基金合同中指数化投资部分参照指标等条款的公告》，本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，其中主要投资于国内依法公开发行、上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金为优化型指数基金。基金的投资分为指数化股票投资、积极股票投资和债券投资三大部分。本基

金净资产的 50% 进行指数化投资，以中证 100 指数为参照指标（最低可降至 30%）；另外 30% 进行积极投资，主要投资于成长型股票（最高可达 50%）；其余 20% 投资于债券。

6.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.2.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 5 月 29 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 5 月 29 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.2.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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。

2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

3、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。

4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年5月29日
活期存款	229,664,602.32
定期存款	-
其他存款	-
合计	229,664,602.32

6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年5月29日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,854,719,405.00	1,715,918,121.85	-138,801,283.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	94,446,654.19	89,728,046.56	-4,718,607.63
	银行间市场	500,595,528.08	480,256,000.00	-20,339,528.08
	合计	595,042,182.27	569,984,046.56	-25,058,135.71
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,449,761,587.27	2,285,902,168.41	-163,859,418.86

6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.2.4.7.4 买入返售金融资产

6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 5 月 29 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场买入返售金融资产	240,000,000.00	-
合计	240,000,000.00	-

6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 5 月 29 日
应收活期存款利息	202,409.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	32,810.41
应收债券利息	16,203,778.28
应收买入返售证券利息	74,332.47
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,424.32
合计	16,514,755.44

6.2.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年5月29日
其他应收款	5,000.00
待摊费用	-
合计	5,000.00

6.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年5月29日
交易所市场应付交易费用	18,039,853.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	18,039,853.67

6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年5月29日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00
应付赎回费	-
预提费用	198,479.35
合计	1,198,479.35

6.2.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年5月29日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00

6.2.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-114,797,673.98	14,415,127.35	-100,382,546.63
本期利润	63,925,646.93	-178,274,546.21	-114,348,899.28
本期基金份额交易产生的变	-	-	-

动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-50,872,027.05	-163,859,418.86	-214,731,445.91

6.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 29 日
活期存款利息收入	729,744.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	43,601.12
其他	2,851.90
合计	776,197.25

6.2.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 29 日
卖出股票成交总额	1,863,806,685.87
减：卖出股票成本总额	1,801,131,720.36
买卖股票差价收入	62,674,965.51

6.2.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 29 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	184,243,572.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	178,931,727.77
减：应收利息总额	5,423,569.86
债券投资收益	-111,725.57

6.2.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.2.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 29 日
股票投资产生的股利收益	10,676,454.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,676,454.80

6.2.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 29 日
1.交易性金融资产	-178,274,546.21
——股票投资	-197,019,621.38
——债券投资	18,745,075.17
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-178,274,546.21

6.2.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.2.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 29 日
交易所市场交易费用	5,511,163.06
银行间市场交易费用	675.00
合计	5,511,838.06

6.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 29 日
审计费用	40,821.53
信息披露费	32,657.82
上市费	25,000.00
银行间账户维护费	4,500.00
银行费用	2,486.36

其他	102,400.00
合计	207,865.71

6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.2.4.9 关联方关系

6.2.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.2.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2014 年 2 月 12 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、山东省农村经济开发投资公司（比例 10%）、POWER CORPORATION OF CANADA（出资比例 10%）、青岛海鹏科技投资有限公司（出资比例 10%）、南方工业资产管理有限责任公司（出资比例 7.8%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 29 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中信证券	8,624,212.74	0.24%	751,625,221.47	16.67%

6.2.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.2.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.2.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年5月29日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
中信证券	7,851.35	0.24%	7,851.35	0.04%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
中信证券	684,277.99	16.80%	684,277.99	3.69%

注：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证管费、经手费和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。

6.2.4.10.2 关联方报酬

6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年5月29日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,559,523.55	17,948,113.05

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%，超出部分不计提基金管理费。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.25% / 当年天数。

6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年5月29日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
当期发生的基金应支付的 托管费	2,911,904.71	3,589,622.64

注：①支付基金托管人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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至 2014年5月29日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
期初持有的基金份额	165,089,737.00	165,089,737.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	165,089,737.00	165,089,737.00
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	5.50%	5.50%

6.2.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.2.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至 2014年5月29日		上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	229,664,602.32	729,744.23	156,409,791.51	913,787.42

活期存款				
------	--	--	--	--

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

6.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.2.4.12 期末（2014年5月29日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600418	江淮汽车	2014-04-14	筹划重大资产重组事项	10.20	2014-07-11	11.22	3,449,923	35,582,073.13	35,189,214.60	-
002063	远光软件	2014-03-11	筹划发行股份购买资产事项	21.25	2014-06-24	20.30	999,861	21,255,777.81	21,247,046.25	-
300323	华灿光电	2014-04-28	筹划重大资产重组事项	18.68	2014-07-28	11.21	487,684	9,217,826.22	9,109,937.12	-
000852	江钻股份	2014-05-28	筹划重大事项	15.80	-	-	317,742	5,914,658.42	5,020,323.60	-
000562	宏源证券	2013-10-31	筹划重大资产重组事项	8.22	2014-07-28	8.93	360,000	3,357,371.00	2,959,200.00	-
601669	中国电建	2014-05-13	筹划重大资产重组事项	2.79	-	-	1,000,000	3,578,627.96	2,790,000.00	-
002100	天康生物	2014-05-27	筹划重大资产重组事	9.94	-	-	10,000	84,372.25	99,400.00	-

			项							
--	--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 5 月 29 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 5 月 29 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.2.4.13 金融工具风险及管理

6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律监察部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法

迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.2.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

6.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 5 月 29 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	229,664,602.32	-	-	229,664,602.32
结算备付金	8,355,400.40	-	-	8,355,400.40
结算保证金	469,703.55	-	-	469,703.55
债券投资	198,281,646.56	-	371,702,400.00	569,984,046.56
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	240,000,000.00	-	-	240,000,000.00
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	80,753,561.25	-	-	80,753,561.25
结算备付金	1,577,657.60	-	-	1,577,657.60
结算保证金	499,689.61	-	-	499,689.61
债券投资	237,313,921.08	-	363,484,000.00	600,797,921.08
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	160,000,000.00	-	-	160,000,000.00

应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2014 年 5 月 29 日）	上年度末 （2013 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	5,982,383.03	6,250,237.27
	利率上升 25 个基点	-5,865,590.35	-6,126,500.31

6.2.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 5 月 29 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 （%）	公允价值	占基金资产 净值比例 （%）
交易性金融资产-股票投资	1,715,918,121.85	61.61	2,020,110,785.06	69.67
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	1,715,918,121.85	61.61	2,020,110,785.06	69.67

6.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、Beta 系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2014 年 5 月 29 日）	上年度末 （2013 年 12 月 31 日）
	+5%	41,971,357.26	88,672,762.91
	-5%	-41,971,357.26	-88,672,762.91

6.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.2.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层级：

第一层级：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层级：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.2.4.14.2 各层级金融工具公允价值

截至2014年5月29日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为1,805,646,168.41元，第二层级的余额为480,256,000.00元，第三层级的余额为0元。（截至2013年12月31日止：第一层级的余额为2,116,034,706.14元，第二层级的余额为504,874,000.00元，第三层级的余额为0元。）

6.2.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于其进行估值调整之日起从第一层级转入第二层级或第三层级，于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层级或第三层级转入第一层级。对于持有的非公开发行股票，本基

金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层级转入第一层级。

6.2.4.14.4 第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 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）

7.1.1 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

7.1.2 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

7.1.3 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

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
11	600418	江淮汽车	3,449,923	35,189,214.60	1.14
12	600155	宝硕股份	4,667,953	34,496,172.67	1.12
13	000998	隆平高科	1,227,412	33,729,281.76	1.10
14	002063	远光软件	1,499,842	30,671,768.90	1.00
15	600028	中国石化	4,000,000	21,080,000.00	0.69
16	002454	松芝股份	1,586,158	19,969,729.22	0.65
17	600497	驰宏锌锗	1,999,963	18,419,659.23	0.60
18	300138	晨光生物	1,999,930	17,599,384.00	0.57
19	002416	爱施德	1,099,915	16,333,737.75	0.53

20	002553	南方轴承	1,349,814	15,900,808.92	0.52
21	000060	中金岭南	1,999,938	13,599,578.40	0.44
22	600717	天津港	1,499,961	11,969,688.78	0.39
23	601088	中国神华	749,943	10,904,171.22	0.35
24	002094	青岛金王	899,928	10,259,179.20	0.33
25	600362	江西铜业	800,000	9,816,000.00	0.32
26	600535	天士力	247,962	9,613,486.74	0.31
27	300323	华灿光电	487,684	9,109,937.12	0.30
28	000726	鲁泰 A	989,873	8,700,983.67	0.28
29	000592	平潭发展	999,964	8,379,698.32	0.27
30	000975	银泰资源	999,970	7,969,760.90	0.26
31	002311	海大集团	708,583	7,801,498.83	0.25
32	002146	荣盛发展	731,887	6,930,969.89	0.23
33	600019	宝钢股份	1,499,917	6,149,659.70	0.20
34	000876	新希望	499,753	5,642,211.37	0.18
35	000581	威孚高科	199,665	5,384,965.05	0.18
36	000852	江钻股份	317,742	5,020,323.60	0.16
37	002508	老板电器	168,026	4,750,095.02	0.15
38	002615	哈尔斯	150,000	3,136,500.00	0.10
39	000562	宏源证券	360,000	2,959,200.00	0.10
40	000895	双汇发展	79,933	2,860,802.07	0.09
41	600649	城投控股	451,183	2,842,452.90	0.09
42	601669	中国电建	1,000,000	2,790,000.00	0.09
43	600997	开滦股份	613,200	2,673,552.00	0.09
44	600761	安徽合力	240,000	2,361,600.00	0.08
45	002032	苏泊尔	149,976	2,053,171.44	0.07
46	002532	新界泵业	199,858	1,918,636.80	0.06
47	002299	圣农发展	149,905	1,737,398.95	0.06
48	600737	中粮屯河	349,902	1,672,531.56	0.05
49	601933	永辉超市	239,802	1,515,548.64	0.05
50	600276	恒瑞医药	32,960	1,092,953.60	0.04
51	600750	江中药业	49,940	782,559.80	0.03
52	002041	登海种业	28,000	779,520.00	0.03
53	600261	阳光照明	75,000	741,000.00	0.02
54	600660	福耀玻璃	80,000	672,000.00	0.02
55	300126	锐奇股份	74,876	579,540.24	0.02
56	600066	宇通客车	35,000	564,900.00	0.02

57	002436	兴森科技	20,000	504,000.00	0.02
58	002448	中原内配	40,000	489,200.00	0.02
59	000932	华菱钢铁	250,000	482,500.00	0.02
60	002727	一心堂	34,975	426,695.00	0.01
61	002073	软控股份	40,000	382,800.00	0.01
62	600887	伊利股份	10,000	331,200.00	0.01
63	000651	格力电器	10,000	294,500.00	0.01
64	002594	比亚迪	4,914	233,365.86	0.01
65	002385	大北农	19,918	226,268.48	0.01
66	603168	莎普爱思	9,892	216,140.20	0.01
67	002008	大族激光	9,920	172,012.80	0.01
68	603006	联明股份	9,081	129,858.30	0.00
69	002138	顺络电子	5,000	104,300.00	0.00
70	002100	天康生物	10,000	98,200.00	0.00
71	601866	中海集运	5,500	11,605.00	0.00

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600340	华夏幸福	55,156,929.94	1.79
2	600149	廊坊发展	49,905,886.11	1.62
3	600155	宝硕股份	34,996,086.92	1.14
4	600028	中国石化	20,723,880.43	0.67
5	300002	神州泰岳	20,041,789.89	0.65
6	600787	中储股份	19,457,428.58	0.63
7	600497	驰宏锌锗	18,282,615.10	0.59
8	000998	隆平高科	17,979,504.66	0.58
9	002416	爱施德	16,361,803.35	0.53
10	002553	南方轴承	15,960,980.54	0.52
11	002040	南京港	14,971,422.07	0.49
12	600279	重庆港九	14,971,026.26	0.49
13	600717	天津港	11,997,423.14	0.39
14	000060	中金岭南	11,501,948.92	0.37
15	601088	中国神华	11,001,635.66	0.36
16	600688	上海石化	10,275,769.02	0.33
17	002094	青岛金王	10,224,580.70	0.33

18	002146	荣盛发展	9,998,444.59	0.33
19	002063	远光软件	9,984,502.48	0.32
20	002501	利源精制	9,972,547.22	0.32

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	54,126,484.89	1.76
2	600016	民生银行	47,395,853.99	1.54
3	600036	招商银行	42,765,782.44	1.39
4	600887	伊利股份	38,281,682.55	1.24
5	600522	中天科技	36,889,949.02	1.20
6	600519	贵州茅台	33,249,785.51	1.08
7	600674	川投能源	31,710,473.03	1.03
8	601668	中国建筑	31,235,872.92	1.02
9	601166	兴业银行	29,313,480.25	0.95
10	600000	浦发银行	28,831,079.85	0.94
11	600837	海通证券	26,741,496.92	0.87
12	002415	海康威视	23,539,334.70	0.77
13	000002	万科 A	20,632,760.87	0.67
14	601328	交通银行	19,796,179.95	0.64
15	600787	中储股份	19,593,631.81	0.64
16	300002	神州泰岳	19,259,315.05	0.63
17	002040	南京港	18,959,811.58	0.62
18	000001	平安银行	18,339,444.19	0.60
19	000651	格力电器	17,849,375.73	0.58
20	601288	农业银行	17,779,248.70	0.58

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	466,673,346.09
卖出股票收入（成交）总额	1,213,258,067.23

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）

填列，不考虑相关交易费用。

7.1.5 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

7.1.6 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

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.1.9 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。

7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.10.1 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。

7.1.10.2 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。

7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1 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。

7.1.11.2 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。

7.1.11.3 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。

7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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。

7.1.12.2 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。

7.1.12.3 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

7.1.12.4 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

7.1.12.5 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。

7.1.12.6 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。

7.2 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1月1日至2014年5月29日）

7.2.1 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

7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1 指数投资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	-	-
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

7.2.2.2 积极投资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	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

7.2.3 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

7.2.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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
11	601328	交通银行	5,202,041	19,871,796.62	0.71
12	000001	平安银行	1,600,000	18,400,000.00	0.66
13	601288	农业银行	7,140,000	17,778,600.00	0.64
14	000651	格力电器	550,000	16,995,000.00	0.61
15	600015	华夏银行	1,704,481	14,113,102.68	0.51
16	000538	云南白药	240,000	13,756,800.00	0.49
17	601601	中国太保	800,000	13,360,000.00	0.48
18	600276	恒瑞医药	394,726	12,777,280.62	0.46
19	601088	中国神华	851,222	12,215,035.70	0.44
20	600104	上汽集团	829,894	12,157,947.10	0.44
21	600535	天士力	309,953	11,694,526.69	0.42
22	600900	长江电力	1,903,119	11,609,025.90	0.42
23	601668	中国建筑	3,800,000	11,438,000.00	0.41
24	000895	双汇发展	312,653	10,752,136.67	0.39
25	600690	青岛海尔	699,945	10,527,172.80	0.38
26	601006	大秦铁路	1,565,456	10,488,555.20	0.38
27	000333	美的集团	570,843	9,887,000.76	0.35
28	600585	海螺水泥	577,401	9,313,478.13	0.33
29	600028	中国石化	1,702,077	8,697,613.47	0.31
30	600048	保利地产	1,635,000	8,338,500.00	0.30
31	000858	五粮液	493,088	8,278,947.52	0.30
32	601818	光大银行	3,271,804	8,081,355.88	0.29
33	600050	中国联通	2,522,464	8,021,435.52	0.29
34	601857	中国石油	1,007,700	7,688,751.00	0.28
35	002024	苏宁云商	1,130,000	7,638,800.00	0.27

36	600406	国电南瑞	569,800	7,572,642.00	0.27
37	000776	广发证券	749,989	7,522,389.67	0.27
38	600795	国电电力	3,046,516	6,976,521.64	0.25
39	600011	华能国际	1,190,792	6,620,803.52	0.24
40	000063	中兴通讯	485,454	6,310,902.00	0.23
41	600518	康美药业	400,000	6,132,000.00	0.22
42	600999	招商证券	590,000	6,094,700.00	0.22
43	600256	广汇能源	842,936	6,043,851.12	0.22
44	002594	比亚迪	125,554	5,811,894.66	0.21
45	601989	中国重工	1,300,000	5,785,000.00	0.21
46	601169	北京银行	729,840	5,751,139.20	0.21
47	600111	包钢稀土	300,000	5,748,000.00	0.21
48	601398	工商银行	1,608,433	5,742,105.81	0.21
49	601628	中国人寿	400,000	5,616,000.00	0.20
50	600019	宝钢股份	1,335,558	5,288,809.68	0.19
51	002241	歌尔声学	199,944	5,266,524.96	0.19
52	002236	大华股份	199,956	5,260,842.36	0.19
53	000157	中联重科	1,150,000	5,209,500.00	0.19
54	601988	中国银行	1,900,000	5,111,000.00	0.18
55	600309	万华化学	300,000	5,073,000.00	0.18
56	600018	上港集团	1,115,000	5,050,950.00	0.18
57	601299	中国北车	1,050,000	4,630,500.00	0.17
58	000069	华侨城 A	919,701	4,488,140.88	0.16
59	002304	洋河股份	80,000	4,484,000.00	0.16
60	601688	华泰证券	570,000	4,468,800.00	0.16
61	600031	三一重工	850,000	4,437,000.00	0.16
62	601899	紫金矿业	2,000,000	4,380,000.00	0.16
63	601633	长城汽车	149,922	4,313,255.94	0.15
64	601766	中国南车	1,000,000	4,240,000.00	0.15
65	000338	潍柴动力	239,782	4,208,174.10	0.15
66	601117	中国化学	700,000	3,913,000.00	0.14
67	002353	杰瑞股份	63,952	3,842,236.16	0.14
68	601186	中国铁建	810,000	3,653,100.00	0.13
69	000024	招商地产	199,977	3,563,590.14	0.13
70	601390	中国中铁	1,329,776	3,404,226.56	0.12
71	601991	大唐发电	850,000	3,034,500.00	0.11
72	000562	宏源证券	360,000	2,959,200.00	0.11

73	000568	泸州老窖	180,000	2,851,200.00	0.10
74	601669	中国电建	1,000,000	2,790,000.00	0.10
75	600362	江西铜业	226,033	2,757,602.60	0.10
76	600010	包钢股份	740,000	2,715,800.00	0.10
77	002142	宁波银行	297,890	2,701,862.30	0.10
78	000792	盐湖股份	171,158	2,663,218.48	0.10
79	601018	宁波港	1,100,000	2,519,000.00	0.09
80	600547	山东黄金	160,000	2,472,000.00	0.09
81	601600	中国铝业	801,408	2,420,252.16	0.09
82	600150	中国船舶	124,000	2,348,560.00	0.08
83	601808	中海油服	138,060	2,348,400.60	0.08
84	000629	攀钢钒钛	1,130,000	2,316,500.00	0.08
85	601618	中国中冶	1,370,000	2,315,300.00	0.08
86	600489	中金黄金	250,000	1,920,000.00	0.07
87	601699	潞安环能	239,900	1,866,422.00	0.07
88	601111	中国国航	500,000	1,650,000.00	0.06
89	000983	西山煤电	312,623	1,644,396.98	0.06
90	601898	中煤能源	400,000	1,632,000.00	0.06
91	601958	金钼股份	240,000	1,543,200.00	0.06
92	601158	重庆水务	269,956	1,349,780.00	0.05
93	601800	中国交建	310,000	1,153,200.00	0.04
94	600188	兖州煤业	140,000	950,600.00	0.03
95	601336	新华保险	44,990	920,945.30	0.03
96	000937	冀中能源	150,000	874,500.00	0.03
97	600348	阳泉煤业	99,950	571,714.00	0.02

7.2.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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
6	002701	奥瑞金	1,959,712	41,996,628.16	1.51
7	600340	华夏幸福	1,499,839	40,045,701.30	1.44
8	600522	中天科技	2,899,870	36,770,351.60	1.32

9	600418	江淮汽车	3,449,923	35,189,214.60	1.26
10	000988	华工科技	4,099,780	34,356,156.40	1.23
11	600674	川投能源	2,699,908	31,426,929.12	1.13
12	002454	松芝股份	2,066,275	31,262,740.75	1.12
13	002501	利源精制	2,041,629	24,662,878.32	0.89
14	002063	远光软件	999,861	21,247,046.25	0.76
15	601668	中国建筑	6,699,932	20,166,795.32	0.72
16	300138	晨光生物	2,199,930	19,051,393.80	0.68
17	600649	城投控股	2,850,000	18,867,000.00	0.68
18	600697	欧亚集团	999,862	18,307,473.22	0.66
19	600089	特变电工	1,999,860	17,538,772.20	0.63
20	601311	骆驼股份	1,512,645	15,625,622.85	0.56
21	000998	隆平高科	549,931	14,094,731.53	0.51
22	002157	正邦科技	1,589,623	11,159,153.46	0.40
23	002285	世联行	1,225,247	10,206,307.51	0.37
24	601333	广深铁路	3,999,924	10,079,808.48	0.36
25	601186	中国铁建	2,200,000	9,922,000.00	0.36
26	300323	华灿光电	487,684	9,109,937.12	0.33
27	300039	上海凯宝	599,949	7,499,362.50	0.27
28	000726	鲁泰 A	789,966	6,943,801.14	0.25
29	300274	阳光电源	201,542	5,487,988.66	0.20
30	000852	江钻股份	317,742	5,020,323.60	0.18
31	002146	荣盛发展	450,000	4,923,000.00	0.18
32	000581	威孚高科	199,665	4,742,043.75	0.17
33	002508	老板电器	126,926	3,859,819.66	0.14
34	002311	海大集团	308,603	3,064,427.79	0.11
35	002615	哈尔斯	150,000	2,977,500.00	0.11
36	000895	双汇发展	79,933	2,748,895.87	0.10
37	000876	新希望	199,753	2,413,016.24	0.09
38	600761	安徽合力	200,000	2,406,000.00	0.09
39	002532	新界泵业	199,858	1,872,669.46	0.07
40	600261	阳光照明	100,000	1,591,000.00	0.06
41	002299	圣农发展	149,905	1,548,518.65	0.06
42	601933	永辉超市	239,802	1,498,762.50	0.05
43	000651	格力电器	40,000	1,236,000.00	0.04
44	600276	恒瑞医药	32,960	1,066,915.20	0.04
45	600887	伊利股份	30,000	1,031,400.00	0.04

46	600750	江中药业	49,940	787,553.80	0.03
47	600660	福耀玻璃	80,000	652,800.00	0.02
48	600066	宇通客车	35,000	548,100.00	0.02
49	300126	锐奇股份	74,876	526,378.28	0.02
50	002448	中原内配	40,000	468,800.00	0.02
51	002436	兴森科技	20,000	467,800.00	0.02
52	000932	华菱钢铁	250,000	432,500.00	0.02
53	000898	鞍钢股份	150,000	421,500.00	0.02
54	002073	软控股份	40,000	336,800.00	0.01
55	002594	比亚迪	4,914	227,469.06	0.01
56	002385	大北农	19,918	223,081.60	0.01
57	002008	大族激光	9,920	165,564.80	0.01
58	002100	天康生物	10,000	99,400.00	0.00
59	002138	顺络电子	5,000	83,550.00	0.00
60	601866	中海集运	5,500	11,660.00	0.00

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利地产	69,768,596.60	2.41
2	300072	三聚环保	68,019,326.54	2.35
3	002202	金风科技	59,268,582.10	2.04
4	600138	中青旅	52,398,662.84	1.81
5	600271	航天信息	51,567,210.80	1.78
6	000988	华工科技	48,815,744.16	1.68
7	600109	国金证券	47,574,182.43	1.64
8	600406	国电南瑞	45,471,662.54	1.57
9	600552	方兴科技	41,092,640.70	1.42
10	600135	乐凯胶片	41,060,909.53	1.42
11	002701	奥瑞金	40,336,106.60	1.39
12	600482	风帆股份	39,515,430.02	1.36
13	600522	中天科技	36,932,117.73	1.27
14	600418	江淮汽车	35,582,073.13	1.23
15	600787	中储股份	34,753,197.04	1.20
16	600729	重庆百货	33,955,755.37	1.17
17	600340	华夏幸福	33,894,183.27	1.17

18	002454	松芝股份	30,986,182.78	1.07
19	600674	川投能源	30,789,797.99	1.06
20	600240	华业地产	30,674,191.53	1.06

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.2.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300147	香雪制药	135,321,756.99	4.67
2	600887	伊利股份	111,579,657.41	3.85
3	600690	青岛海尔	61,709,799.74	2.13
4	002444	巨星科技	52,816,870.96	1.82
5	002604	龙力生物	52,225,427.86	1.80
6	002241	歌尔声学	51,014,570.86	1.76
7	600109	国金证券	42,373,468.24	1.46
8	600271	航天信息	41,459,636.98	1.43
9	002019	鑫富药业	41,040,419.32	1.42
10	600135	乐凯胶片	40,473,736.57	1.40
11	600637	百视通	39,140,118.59	1.35
12	002207	准油股份	38,914,808.93	1.34
13	600552	方兴科技	37,347,352.16	1.29
14	600787	中储股份	36,030,983.48	1.24
15	002229	鸿博股份	34,996,276.65	1.21
16	600482	风帆股份	34,022,009.35	1.17
17	002475	立讯精密	33,274,699.46	1.15
18	600518	康美药业	32,521,795.38	1.12
19	002152	广电运通	32,314,740.59	1.11
20	300168	万达信息	30,678,545.02	1.06

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,693,958,678.53
卖出股票收入（成交）总额	1,863,806,685.87

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.2.5 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

7.2.6 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

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.2.9 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。

7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.10.1 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。

7.2.10.2 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。

7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1 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。

7.2.11.2 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。

7.2.11.3 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。

7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 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。

7.2.12.2 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。

7.2.12.3 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

7.2.12.4 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

7.2.12.5.1 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。

7.2.12.5.2 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。

7.2.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 华夏兴和混合型证券投资基金

8.1.1 基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
51,840	58,829.33	2,178,494,155.04	71.43%	871,218,456.21	28.57%

8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	148.29	0.00%

8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总额区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.2 原兴和证券投资基金

8.2.1 基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
51,998	57,694.53	2,337,915,222	77.93%	662,084,778	22.07%

8.2.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险（集团）公司	360,172,877	12.01%
2	中国人寿保险股份有限公司	299,898,744	10.00%
3	幸福人寿保险股份有限公司一分红	160,685,572	5.36%
4	华夏基金管理有限公司	160,089,737	5.34%
5	泰康人寿保险股份有限公司一分红—个人分红—019L—FH002 沪	149,421,635	4.98%
6	新华人寿保险股份有限公司	111,183,343	3.71%
7	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	100,696,611	3.36%
8	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	88,790,075	2.96%
9	阳光人寿保险股份有限公司一分红保险产品	85,333,810	2.84%
10	宝钢集团有限公司	84,293,564	2.81%

8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	-	-

§9 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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2014 年 4 月 25 日，兴和证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式在北京召开，会议审议通过了《关于兴和证券投资基金转型有关事项的议案》。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），兴和证券投资基金基金份额持有人大会决议生效。根据上海证券交易所《关于终止兴和证券投资基金

上市的决定》（上海证券交易所自律监管决定书[2014]232 号），兴和证券投资基金于 2014 年 5 月 30 日终止上市。自终止上市之日起，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，存续期调整为无限期，基金投资目标、投资范围和投资策略调整，转型后的基金名称为华夏兴和混合型证券投资基金。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本基金托管人于 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

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），兴和证券投资基金基金份额持有人大会决议生效。自 2014 年 5 月 30 日起，兴和证券投资基金转型为开放式基金，调整基金投资策略并修改基金合同相应条款。调整后的投资策略可查阅《华夏兴和混合型证券投资基金基金合同》。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

10.7.1.1 华夏兴和混合型证券投资基金

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	659,632,633.81	39.28%	600,529.74	39.28%	-
国泰君安证券	2	497,909,891.19	29.65%	453,296.29	29.65%	-

中信建投证券	3	323,627,626.91	19.27%	294,629.73	19.27%	-
招商证券	1	198,028,251.88	11.79%	180,284.49	11.79%	-

10.7.1.2 原兴和证券投资基金

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	2	1,533,832,162.72	43.11%	1,396,394.23	43.11%	-
招商证券	1	830,344,971.77	23.34%	755,945.44	23.34%	-
中信建投证券	3	612,417,024.56	17.21%	557,543.46	17.21%	-
华泰证券	1	572,546,992.61	16.09%	521,247.50	16.09%	-
中信证券	1	8,624,212.74	0.24%	7,851.35	0.24%	-

注：①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：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 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。

v 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。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元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交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 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交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了光大证券、兴业证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

10.7.2.1 华夏兴和混合型证券投资基金

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易
------	------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	7,641,692.50	19.52%	-	-
国泰君安证券	31,142,368.90	79.56%	3,251,600,000.00	100.00%
招商证券	357,365.70	0.91%	-	-

10.7.2.2 原兴和证券投资基金

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
国泰君安证券	-	-	2,901,700,000.00	70.06%
华泰证券	8,820,002.20	100.00%	1,240,000,000.00	29.94%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-02-12
2	华夏基金管理有限公司关于调整兴和证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-02-22
3	华夏基金管理有限公司关于增聘兴和证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-18
4	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公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-20
5	华夏基金管理有限公司关于兴和证券投资基金停牌的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-24
6	华夏基金管理有限公司关于兴和证券投资基金停牌的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-26
7	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一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-31
8	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	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-11
9	兴和证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-26
10	兴和证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-20
11	兴和证券投资基金中止上市公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-26
12	兴和证券投资基金中止上市的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-28

13	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	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-29
14	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	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-30
15	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	中国证监会指定报刊及网站	2014-06-04
16	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	中国证监会指定报刊及网站	2014-06-11
17	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	中国证监会指定报刊及网站	2014-06-24

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会核准基金兴和募集的文件；
- 11.1.2 中国证监会核准基金兴和转型的文件；
- 11.1.3 《华夏兴和混合型证券投资基金基金合同》；
- 11.1.4 《华夏兴和混合型证券投资基金托管协议》；
- 11.1.5 《兴和证券投资基金基金合同》；
- 11.1.6 《兴和证券投资基金托管协议》；
- 11.1.7 法律意见书；
- 11.1.8 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11.1.9 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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
二〇一四年八月二十五日