华夏经典配置混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏经典混合
基金主代码	288001
交易代码	288001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年3月15日
报告期末基金份额总额	2,148,423,999.38份
投资目标	在长期投资的基础上,将战略资产配置与时机选择相结合,积极主动地精选证券,并充分利用短期金融工具作为动态配置的有效缓冲及收益补充,实施全流程的风险管理,力求在风险可控、获取稳定收益的基础上,追求资本最大可能的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动管理,遵循积极主动的投资理念,对股票和债券、短期金融工具的比例进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为60%×中信标普300指数+20%×中信标普全债指数+20%×一年期定期存款利率。
风险收益特征	追求资产配置动态平衡、收益和长期资本增值平衡,风险适中。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日–2014年6月30日)
1.本期已实现收益	29,634,198.44
2.本期利润	45,017,913.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0209
4.期末基金资产净值	2,337,794,791.90
5.期末基金份额净值	1.088

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。

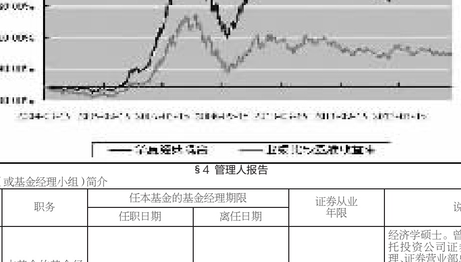
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	1.87%	0.97%	1.30%	0.52%	0.57%	0.45%

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

华夏经典配置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
(2004年3月15日至2014年6月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王海雄	本基金的基金经理、公司首席投资官	2011–03–17	–	21年	经济学硕士。曾任海南省国际信托投资公司证券总部总经理助理、证券营业部总经理,金元证券证券营业部总经理、投资管理总部总经理、公司副总裁等。2010年12月加入华夏基金管理有限公司,曾任华夏基金(香港)有限公司副行政总裁等。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本基金出现3次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,为ETF基金因被动跟踪标的指数和本基金发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2季度,国际方面,以美国为主的外围经济进一步复苏,美股主要指数经过调整后重创新高。国内方面,宏观经济增速逐步下滑,房地产产业环比下滑,政府进行政策微调,采取了"定向降准"等相对宽松的货币政策。市场方面,在新的发行制度下,新股发行有节奏地重启。A股主要指数窄幅波动,创业板指数在经过前期的大幅调整后重新企稳。

报告期内,本基金坚持长期投资为主,以价值加成长、"自下而上"精选个股的投资模式,重点投资处于转型期的、有长期发展空间的成长个股,积极关注实体经济在转型期各个细分领域的成长机会,主要投资于互联网相关领域、新能源汽车领域、医药行业、医疗服务和医疗器械、营销、软件等行业的个股,增持了新能源汽车行业和医药行业个股,减持了游戏行业个股和部分预期业绩不确定的中小盘个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为1.088元,本报告期份额净值增长率为1.87%,同期业绩比较基准增长率为1.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望3季度,整体经济格局不会发生大变化,未来利率水平是否上升可能不再是市场的主要关注点,市场将重点关注房地产市场能否实现"软着陆"。受宏观经济影响,A股上市公司整体盈利增速向上的趋势尚未出现,市场不会出现趋势性大幅上涨的机会,仍将只有行业投资和个股投资的机会。

3季度,本基金将坚持持有互联网、新能源汽车、医药、医疗设备及医疗器械、营销、软件等领域的核心成长股,积极关注检测、消防、海工等小的细分行业可能出现的投资机会,关注实体经济领域出现积极变化所带来的投资机会。

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,745,186,410.73	73.72
	其中:股票	1,745,186,410.73	73.72
2	固定收益投资	399,803,681.00	16.89
	其中:债券	399,803,681.00	16.89
	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	–	–
	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	205,875,052.56	8.70
7	其他各项资产	16,590,923.13	0.70
8	合计	2,367,456,067.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,033,626,710.17	44.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,305,835.20	1.42
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	87,522.80	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	419,018,345.31	17.92
J	金融业	23,495,928.80	1.01
K	房地产业	16,335,770.05	0.70
L	租赁和商务服务业	127,482,764.52	5.45
M	科学研究和技术服务业	60,257,018.13	2.58
N	水利、环境和公共设施管理业	31,576,515.75	1.35
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	1,745,186,410.73	74.65

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300104	乐视网	2,680,000	117,652,000.00	5.03
2	002551	尚荣医疗	3,250,000	111,670,000.00	4.78
3	002400	省广股份	3,900,000	95,862,000.00	4.10
4	002594	比亚迪	1,887,265	89,626,214.85	3.83
5	600406	国电南瑞	5,889,827	78,511,393.91	3.36
6	600690	青岛海尔	5,022,899	74,137,989.24	3.17
7	300295	三六五网	699,779	70,047,877.90	3.00
8	002690	美亚光电	1,885,030	66,485,008.10	2.84
9	300012	华测检测	3,075,907	60,257,018.13	2.58
10	600699	均胜电子	2,361,803	59,352,109.39	2.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	45,360,000.00	1.94
2	央行票据	–	–
3	金融债券	241,478,000.00	10.33
	其中:政策性金融债	241,478,000.00	10.33
4	企业债券	91,966,075.00	3.93
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	20,999,606.00	0.90
8	其他	–	–
9	合计	399,803,681.00	17.10

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140410	14农发10	800,000	80,240,000.00	3.43
2	130317	13进出17	800,000	79,928,000.00	3.42
3	122051	10石化01	519,550	51,695,225.00	2.21
4	140201	14国开01	500,000	51,310,000.00	2.19
5	010107	21国债(7)	450,000	45,360,000.00	1.94

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	906,330.91
2	应收证券清算款	5,468,914.45
3	应收股利	–
4	应收利息	7,712,689.08
5	应收申购款	2,502,988.69
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	16,590,923.13

5.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	16,537,260.00	0.71
2	113001	中行转债	4,051,242.00	0.17
3	110023	民生转债	411,104.00	0.02

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002551	尚荣医疗	111,670,000.00	4.78	筹划重大事项
2	300295	三六五网	70,047,877.90	3.00	有需要进一步核实的重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,160,431,247.06
本报告期基金总申购份额	139,554,694.51
减:本报告期基金总赎回份额	151,561,942.19
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	2,148,423,999.38

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内披露的主要事项

2014年4月30日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海浦东发展银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告。

2014年5月16日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

2014年5月22日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告。

2014年5月23日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

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

8.2 其他相关信息

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

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

在客户服务方面,2季度,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户资金管理便利性:(1)在华夏基金微信公众服务平台增加扫码绑定功能,投资者扫码即可开通基金的微信交易和微信查询,提高投资者使用的便利性;(2)在网上查询系统、客服热线自助语音系统中新增百度金融及微信理财通平台数据,投资者可以通过本公司网站或客服电话查询相关信息,满足投资者多渠道查询的需求。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会核准基金募集的文件;

9.1.2《华夏经典配置混合型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏经典配置混合型证券投资基金托管协议》;

9.1.4 法律意见书;

9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司
二〇一四年七月十九日

华夏货币市场基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏货币	
基金主代码	288101	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年4月20日	
报告期末基金份额总额	5,323,591,804.27份	
投资目标	在保持安全性、高流动性的前提下获得高于业绩比较基准的回报。	
投资策略	结合货币市场利率的预测与现金需求安排,采取现金流管理策略进行货币市场工具投资,以便在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。	
业绩比较基准	本基金以中国人民银行公布的一年期定期存款税后收益率作为业绩比较基准。	
风险收益特征	本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华夏货币A	华夏货币B
下属两级基金的交易代码	288101	288201
报告期末下属两级基金的份额总额	3,069,639,301.34份	2,253,952,502.93份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日–2014年6月30日)	
	华夏货币A	华夏货币B
1.本期已实现收益	37,046,049.90	37,939,682.77
2.本期利润	37,046,049.90	37,939,682.77
3.期末基金资产净值	3,069,639,301.34	2,253,952,502.93

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏货币A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.1700%	0.0026%	0.7479%	0.0000%	0.4221%	0.0026%

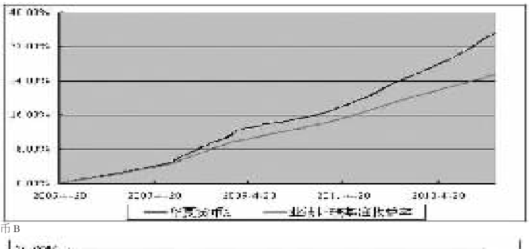
华夏货币B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.2305%	0.0026%	0.7479%	0.0000%	0.4826%	0.0026%

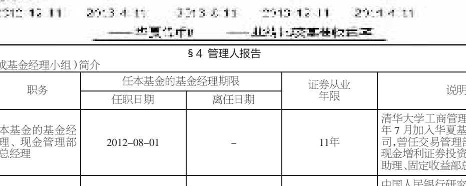
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏货币市场基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年4月20日至2014年6月30日)

华夏货币A



华夏货币B



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲波	本基金的基金经理、现金管理部总经理	2012–08–01	–	11年	清华大学工商管理学硕士。2003年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任交易管理部交易员、华夏现金增利证券投资基金基金经理助理、固定收益部总经理助理等。
柳万军	本基金的基金经理	2013–12–31	–	7年	中国人民银行研究生部金融学硕士。曾任中国人民银行上海总部副主任科员、泰康资产固定收益部投资经理、交银施罗德基金固定收益部基金经理助理等。2013年6月加入华夏基金管理有限公司,曾任固定收益部研究员等。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2季度,政府连续出台加快基建投资和定向降准等"微刺激"政策,工业出现短期企稳迹象,经济增速下滑速度趋缓,但房地产市场依然较差。央行货币政策维持中性偏松,加之经济转弱背景下货币信贷增长放缓,货币市场利率处于平稳低位。尽管2季度末IPO开闸,但对市场流动性冲击有限,同业存款利率继续下行。

报告期内,本基金保持了一定比例的短期存款配置,并新增以短期融资券和1年期政策性金融债为重点的配置方向,组合总体流动性较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,华夏货币A本报告期份额净值收益率为1.1700%;华夏货币B本报告期份额净值收益率为1.2305%。同期业绩比较基准收益率为0.7479%,本基金的业绩比较基准为一年期定期存款的税后收益率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望3季度,货币政策仍将维持中性偏松。从类别来看,国债和短期央票由于绝对利率较低,吸引力不大;政策性金融债有一定的波段操作空间;中高等级短期融资券到期收益率较上半年将有明显下行,但整体投资价值仍较好;同业存款由于流动性好,仍可作为货币基金投资的重要选择之一。

3季度,本基金将继续做好期限匹配,在保证流动性的前提下争取获得较好的投资收益。

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,127,388,589.18	54.80
	其中:债券	3,127,388,589.18	54.80
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	48,500,192.75	0.85
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	2,450,287,089.19	42.94
4	其他各项资产	80,579,516.84	1.41
5	合计	5,706,755,387.96	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.05	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	379,409,490.29	7.13
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

报告期债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	163
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	165
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

在本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	5.58	7.13
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.85	–
2	30天(含)—60天	16.32	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.73	–
3	60天(含)—90天	34.17	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.99	–
4	90天(含)—180天	8.45	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天(含)	41.16	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
6	合计	105.68	7.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	826,878,700.37	15.53
	其中:政策性金融债	826,878,700.37	15.53
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	2,260,810,873.50	42.47
6	中期票据	39,699,015.31	0.75
7	其他	–	–
8	合计	3,127,388,589.18	58.75
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	296,667,722.86	5.57

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	140207	14国开07	4,000,000	400,243,270.69	7.52
2	071402005	14国泰君安CP005	1,700,000	169,980,591.80	3.19
3	041451037	14酒钢CP001	1,700,000	169,915,377.08	3.19
4	011405001	14联通SCP001	1,500,000	150,000,071.60	2.82
5	041459042	14包钢集CP002	1,400,000	140,070,082.58	2.63
6	041456014	14中铝业CP002	1,200,000	120,772,803.39	2.27
7	041459007	14国电集CP001	1,200,000	119,876,934.43	2.25
8	041460050	14湘高速CP002	1,100,000	110,098,335.51	2.07
9	100236	10国开36	1,100,000	109,257,488.86	2.05
10	011496001	14东风SCP001	1,000,000	99,996,880.84	1.88

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)–0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.24%
报告期内偏离度的最低值	0.12%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.19%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

鉴于货币市场基金的特性,本基金采用摊余成本法计算基金资产净值,即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价,以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人采用"影子定价",即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估,当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

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

5.8.4 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	7,484.37
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	47,595,594.12
4	应收申购款	32,976,438.35
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	80,579,516.84

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.5.1 本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.8.5.2 由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华夏货币A	华夏货币B
本报告期期初基金份额总额	3,147,748,450.18	2,112,463,686.82
本报告期基金总申购份额	3,398,429,776.96	4,093,382,864.00
减:本报告期基金总赎回份额	3,476,538,925.80	3,951,894,047.89
本报告期期末基金份额总额	3,069,639,301.34	2,253,952,502.93

注:上述"本报告期基金总申购份额"、"本报告期基金总赎回份额"包含A级基金份额、B级基金份额间转换的基金份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内披露的主要事项

2014年4月2日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购湖南省高速公路建设开发总公司2014年度第一期短期融资券的公告。

2014年4月4日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购中国建材股份有限公司2014年度第三期超短期融资券的公告。

2014年4月8日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购广发证券股份有限公司2014年度第五期短期融资券的公告。

2014年4月21日发布关于华夏货币市场基金暂停申购、转换转入业务及恢复后继续限制申购业务的公告。

2014年5月15日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购国泰君安证券股份有限公司2014年第五期短期融资券的公告。

2014年5月16日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

2014年5月21日发布关于华夏货币市场基金暂停申购、转换转入业务及恢复后继续限制申购业务的公告。

2014年5月23日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

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

8.2 与子公司的关联交易

报告期内,华夏资本管理有限公司赎回华夏货币B基金40,000,000份。

8.3 其他相关信息

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

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

在客户服务方面,2季度,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户资金管理便利性:(1)在华夏基金微信公众服务平台增加扫码绑定功能,投资者扫码即可开通基金的微信交易和微信查询,提高投资者使用的便利性;(2)在网上查询系统、客服热线自助语音系统中新增百度金融及微信理财通平台数据,投资者可以通过本公司网站或客服电话查询相关信息,满足投资者多渠道查询的需求。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会核准基金募集的文件;

9.1.2《华夏货币市场基金基金合同》;

9.1.3《华夏货币市场基金托管协议》;

9.1.4 法律意见书;

9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司
二〇一四年七月十九日

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏蓝筹混合(LOF)
基金主代码	160311
交易代码	160311
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2007年4月24日
报告期末基金份额总额	9,070,063,667.86份
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	本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基准收益率=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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日–2014年6月30日)
1.本期已实现收益	23,651,414.15
2.本期利润	60,979,709.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066
4.期末基金资产净值	7,503,992,531.64
5.期末基金份额净值	0.827

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。

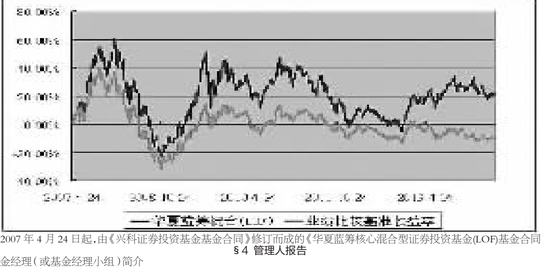
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	0.73%	0.81%	1.00%	0.52%	–0.27%	0.29%

3.2.2 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

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
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
(2007年4月24日至2014年6月30日)



注: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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王怡欢	本基金的基金经理	2011–02–22	–	10年	北京大学经济学硕士。2004年6月加入华夏基金管理有限公司,曾任行业研究员、行业研究主管、基金经理助理等。
董阳阳	本基金的基金经理	2013–03–11	–	6年	美国波士顿学院金融学硕士、工商管理学硕士。曾任中国国际金融有限公司投行业务部经理。2009年8月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理、投资经理等。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2季度,国际方面,全球宏观经济仍较为平稳,美联储表明将按计划退出量化宽松政策,美联储大概率将在2015年启动加息;欧央行继续维持宽松的利率环境;日本经济在短期亢奋后有回落苗头。国内方面,政府及时进行"微刺激",宏观经济自5月份开始出现企稳迹象,但房地产行业的调整仍是经济走势的核心焦点。

市场方面,创业板继深幅调整后于5月中旬触底反弹,主板市场继续以2050点为中枢窄幅震荡。市场的行情主线不十分明确,短期的热点和主题切换速度较快,虽然系统性风险不大,但赚钱效应仍不明显,交易量有所萎缩。

报告期内,本基金维持了均衡的配置思路,通信、汽车、软件等行业中精选的个股为组合带来正贡献,而食品饮料、医药、电力设备等传统成长股行业的估值剧烈收缩一定程度拖累了组合的业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为0.827元,本报告期份额净值增长率为0.73%,同期业绩比较基准增长率为1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望3季度,我们对经济仍存在担忧,主要风险在于地产。本轮地产调整的持续时间可能会很长,加之面对地方政府债务、产能过剩等结构性问题,政府可能会展现出更大的改革决心和更强的执行力。我们认为政府未来有可能动用目前尚未采用的全面降准、降息、取消一线城市限购等刺激政策。

市场的方向和风格方面,我们认为需要以时间来验证以创业板为代表的中小成长股的持续的成长性,并消化其过高的估值。流动性的波动将推动股价宽幅震荡,过于乐观和过于悲观均不可取,逆向操作可能取得不错效果。在经济真正企稳之前,依靠地产、基建等拉动的行业较难出现大幅表现机会,但其大幅下跌的风险也较小。

3季度,本基金一方面将继续坚持"自下而上"的选股原则,提高甄选标准,去伪存真;另一方面将继续关注宏观经济和政策的走向,不断谨慎评估估值差以及市场的预期,关注由此带来的潜在投资机会或风险。同时,本基金将有意加强逆向操作的力度。

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,688,227,446.43	75.23
	其中:股票	5,688,227,446.43	75.23
2	固定收益投资	718,412,066.81	9.50
	其中:债券	718,412,066.81	9.50
	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	720,000,195.00	9.52
	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	204,722,805.40	2.71
7	其他各项资产	230,051,733.30	3.04
8	合计	7,561,414,246.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	64,674,268.64	0.86
B	采矿业	6,341,885.00	0.08
C	制造业	3,371,253,540.22	44.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	347,865,501.76	4.64
E	建筑业	56,637,165.00	0.75
F	批发和零售业	67,195,140.18	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	44,533,823.15	0.59
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	382,651,719.48	5.10
J	金融业	627,935,581.29	8.37
K	房地产业	248,112,947.11	3.31
L	租赁和商务服务业	118,009,975.76	1.57
M	科学研究和技术服务业	26,752,000.00	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	324,441,319.64	4.32
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	1,822,579.20	0.02
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	5,688,227,446.43	75.80

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	13,386,225	443,351,772.00	5.91
2	600036	招商银行	24,044,269	246,213,314.56	3.28
3	601166	兴业银行	22,651,891	227,198,466.73	3.03
4	600886	国投电力	40,800,000	208,080,000.00	2.77
5	601633	长城汽车	7,839,107	198,329,407.10	2.64
6	000625	长安汽车	15,700,000	193,267,000.00	2.58
7	300070	碧水源	5,470,632	160,015,986.00	2.13
8	600690	青岛海尔	10,000,000	147,600,000.00	1.97
9	600016	民生银行	23,280,000	144,568,800.00	1.93
10	000333	美的集团	7,349,899	142,000,048.68	1.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	410,727,000.00	5.47
	其中:政策性金融债	410,727,000.00	5.47
4	企业债券	186,197,045.80	2.48
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	38,968,000.00	0.52
7	可转债	82,520,021.01	1.10
8	其他	–	–
9	合计	718,412,066.81	9.57

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140204	14国开04	1,900,000	190,855,000.00	2.54
2	120204	12国开04	1,000,000	99,580,000.00	1.33
3	113002	工行转债	722,850	76,188,390.00	1.02
4	140430	14农发30	400,000	40,140,000.00	0.53
5	140207	14国开07	200,000	20,072,000.00	0.27

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,668,899.99
2	应收证券清算款	214,614,612.69
3	应收股利	–
4	应收利息	13,590,833.78
5	应收申购款	147,139.76
6	其他应收款	–
7	待摊费用	30,247.08
8	其他	–
9	合计	230,051,733.30

5.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	76,188,390.00	1.02
2	126729	燕京转债	5,677,375.81	0.08
3	110011	歌华转债	579,893.60	0.01
4	110007	博汇转债	74,361.60	0.00

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	9,371,424,008.36
本报告期基金总申购份额	24,797,649.26
减:本报告期基金总赎回份额	326,157,989.76
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	9,070,063,667.86

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	50,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	50,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.55

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内披露的主要事项

2014年4月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告。

2014年5月16日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

2014年5月23日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

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

8.2 其他相关信息

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

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

在客户服务方面,2季度,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户资金管理便利性:(1)在华夏基金微信公众服务平台增加扫码绑定功能,投资者扫码即可开通基金的微信交易和微信查询,提高投资者使用的便利性;(2)在网上查询系统、客服热线自助语音系统中新增百度金融及微信理财通平台数据,投资者可以通过本公司网站或客服电话查询相关信息,满足投资者多渠道查询的需求。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会核准基金兴科转型的文件;

9.1.2《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;

9.1.3《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;

9.1.4 法律意见书;

9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司
二〇一四年七月十九日