

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

华夏永福养老理财混合型证券投资基金

2013 年度报告摘要

2013年12月31日

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;当终止确认金融资产时,将金融资产账面价值与公允价值之间的差额计入当期损益。

本基金会持有的股权投资、债券投资、资产支持证券投资等均以公允价值进行估值。

1.存在活跃市场的金融工具按其公允价值进行估值;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公允价值的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2.不存在活跃市场的金融工具,采用估值技术确定公允价值;估值技术选用的参数应当具有可观察性,且公允价值计量所使用的输入值中的重大假设尽可能与公允价值计量中所采用的可观察输入值一致。

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。

4.金融资产和金融负债的抵销

本基金会持有的资产和金融负债基本为金融资产和金融负债,当本基金依法享有抵销债权和债务且交易双方准备按净额结算,金融资产和金融负债抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.1.7 买入返售

买入返售为对外发行基金份额所募集的总额在扣除准备平准金分摊部分后的余额,由于申购赎回赎回引起的买入返售变动额为“基金份额持有人买入及赎回金额”与“基金赎回款”的差额。上述申购赎回款分别包括基金赎回引起申购基金的买入返售增加和赎回基金的买入返售减少。

7.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括买入返销平准金和未实现平准金,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分配的已实现收益及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分配的已实现收益及基金净值比例计算的金额,损益平准金于基金申购赎回日或基金份额赎回日确认,并于期末未确认平准金分配。

7.4.1.9 收入(损失)的确认和计量

债券投资持有期间取得的利息和股利收入,按照权责发生制原则确认;股权投资持有期间取得的现金股利,按照被投资单位宣告发放的现金股利确认;资产支持证券持有期间取得的资产支持证券持有期间的利息收入,按照被投资单位宣告发放的资产支持证券持有期间的利息收入确认。

7.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用基础按照基金合同约定的费率和方法进行确认。

7.4.1.11 基金的收益分配政策

每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将现金红利或现金红利再投资转换为基金份额,基金份额持有人选择将现金红利再投资转换为基金份额的,基金管理人将按基金份额持有人选择的再投资日期,将未分配利润再投资于基金份额,未分配利润再投资于基金份额的,基金管理人将按基金份额持有人选择的再投资日期,将未分配利润再投资于基金份额。

7.4.1.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金会持有的金融资产和金融负债,其公允价值按照公允价值进行估值,本基金会确定以下类别的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》对重大影响金融资产净值估值。

2.对于停牌股票,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》对重大影响金融资产净值估值。

3.在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会公告[2007]15号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务的通知》,本基金会按照公允价值进行估值,本基金会持有的银行间同业市场交易债券品种的公允价值按照公允价值进行估值,具体估值模型、参数及数据来源由中央国债登记结算有限责任公司提供。

7.4.2 差错更正的说明

7.4.3 关联方关系

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、基金服务机构

中信建投证券股份有限公司 基金管理人、基金销售机构

南方工业资产管理有限责任公司 基金管理人、基金销售机构

山东鲁信农业经济开发投资公司 基金管理人、基金销售机构

POWER CORPORATION OF CANADA 基金管理人、基金销售机构

青岛鼎信科技股份有限公司 基金管理人、基金销售机构

无錫农村商业银行股份有限公司 基金管理人、基金销售机构

注:根据华夏基金管理有限公司于2013年9月25日发布的公告,经中国证监会核准,华夏基金管理有限公司股东变更为中信证券股份有限公司(出资比例99%)、南方工业资产管理有限责任公司(出资比例1%)、山东鲁信农业经济开发投资公司(出资比例10%)、POWER CORPORATION OF CANADA(出资比例10%)、青岛鼎信科技股份有限公司(出资比例10%)。

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2%)、山东鲁信农业经济开发投资公司(出资比例10%)、POWER CORPORATION OF CANADA(出资比例10%)、青岛鼎信科技股份有限公司(出资比例8%)、南方工业资产管理有限责任公司(出资比例18%)。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

7.4.4.1.2 权证交易

7.4.4.1.3 债券交易

7.4.4.1.4 债券回购交易

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

7.4.4.2.2 基金托管费

7.4.4.2.3 基金销售服务费

7.4.4.2.4 基金业绩报酬

7.4.4.2.5 基金业绩报酬

7.4.4.2.6 基金业绩报酬

7.4.4.2.7 基金业绩报酬

7.4.4.2.8 基金业绩报酬

7.4.4.2.9 基金业绩报酬

7.4.4.2.10 基金业绩报酬

7.4.4.2.11 基金业绩报酬

7.4.4.2.12 基金业绩报酬

7.4.4.2.13 基金业绩报酬

7.4.4.2.14 基金业绩报酬

7.4.4.2.15 基金业绩报酬

7.4.4.2.16 基金业绩报酬

7.4.4.2.17 基金业绩报酬

7.4.4.2.18 基金业绩报酬

7.4.4.2.19 基金业绩报酬

7.4.4.2.20 基金业绩报酬

7.4.4.2.21 基金业绩报酬

7.4.4.2.22 基金业绩报酬

7.4.4.2.23 基金业绩报酬

7.4.4.2.24 基金业绩报酬

7.4.4.2.25 基金业绩报酬

7.4.4.2.26 基金业绩报酬

7.4.4.2.27 基金业绩报酬

7.4.4.2.28 基金业绩报酬

7.4.4.2.29 基金业绩报酬

7.4.4.2.30 基金业绩报酬

7.4.4.2.31 基金业绩报酬

7.4.4.2.32 基金业绩报酬

7.4.4.2.33 基金业绩报酬

7.4.4.2.34 基金业绩报酬

7.4.4.2.35 基金业绩报酬

7.4.4.2.36 基金业绩报酬

7.4.4.2.37 基金业绩报酬

7.4.4.2.38 基金业绩报酬

7.4.4.2.39 基金业绩报酬

7.4.4.2.40 基金业绩报酬

7.4.4.2.41 基金业绩报酬

7.4.4.2.42 基金业绩报酬

7.4.4.2.43 基金业绩报酬

7.4.4.2.44 基金业绩报酬

7.4.4.2.45 基金业绩报酬

7.4.4.2.46 基金业绩报酬

7.4.4.2.47 基金业绩报酬

7.4.4.2.48 基金业绩报酬

7.4.4.2.49 基金业绩报酬

7.4.4.2.50 基金业绩报酬

7.4.4.2.51 基金业绩报酬

7.4.4.2.52 基金业绩报酬

7.4.4.2.53 基金业绩报酬

7.4.4.2.54 基金业绩报酬

7.4.4.2.55 基金业绩报酬

7.4.4.2.56 基金业绩报酬

7.4.4.2.57 基金业绩报酬

7.4.4.2.58 基金业绩报酬

7.4.4.2.59 基金业绩报酬

7.4.4.2.60 基金业绩报酬

7.4.4.2.61 基金业绩报酬

7.4.4.2.62 基金业绩报酬

7.4.4.2.63 基金业绩报酬

7.4.4.2.64 基金业绩报酬

7.4.4.2.65 基金业绩报酬

7.4.4.2.66 基金业绩报酬

7.4.4.2.67 基金业绩报酬

7.4.4.2.68 基金业绩报酬

7.4.4.2.69 基金业绩报酬

7.4.4.2.70 基金业绩报酬

7.4.4.2.71 基金业绩报酬

7.4.4.2.72 基金业绩报酬

7.4.4.2.73 基金业绩报酬

7.4.4.2.74 基金业绩报酬

7.4.4.2.75 基金业绩报酬

7.4.4.2.76 基金业绩报酬

7.4.4.2.77 基金业绩报酬

7.4.4.2.78 基金业绩报酬

7.4.4.2.79 基金业绩报酬

7.4.4.2.80 基金业绩报酬

7.4.4.2.81 基金业绩报酬

7.4.4.2.82 基金