华夏理财21天债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏理财21天债券	
基金主代码	001077	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月22日	
报告期末基金份额总额	99,495,875.28份	
投资目标	在力求安全性的前提下,追求稳定的绝对回报。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,在尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金属于债券型基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华夏理财21天债券A	华夏理财21天债券B
下属两级基金的交易代码	001077	001078
报告期末下属两级基金的份额总额	99,495,875.28份	–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7月1日-2014年9月30日)	
	华夏理财21天债券A	华夏理财21天债券B
1.本期已实现收益	1,106,823.58	40,050.01
2.本期利润	1,106,823.58	40,050.01
3.期末基金资产净值	99,495,875.28	–

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本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

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

华夏理财21天债券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	1.0459%	0.0068%	0.3403%	0.0000%	0.7056%	0.0068%

华夏理财21天债券B:

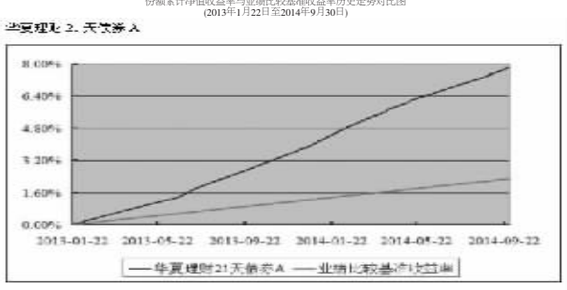
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7853%	0.0089%	0.3403%	0.0000%	0.4450%	0.0089%

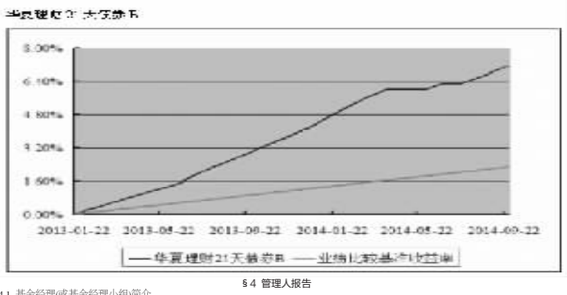
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏理财21天债券型证券投资基金

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

(2014年1月22日至2014年9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		
魏镇江	本基金的基金经理	2013-04-26	–	11年	北京大学经济学硕士。曾任德邦证券债券研究员等。2005年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任债券研究员等。
罗远航	本基金的基金经理	2014-08-20	–	3年	清华大学应用经济学硕士。2011年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任固定收益部研究员、交易管理部交易员、现金管理部研究员等。

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。

③根据本基金管理人于2014年8月21日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》,增聘罗远航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》、《公开募集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、研究活动的防内幕交易指导意见》,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

3季度,国内经济增长惯性持续显态势,信贷增长乏力,工业增加值大幅回落,货币供应M2持续走低,央行继续执行偏宽松的货币政策,采用结构性的定向工具向银行注入流动性,未因了增加支农再贷款额度和常备借贷便利(SLF)操作等措施,央行在公开市场进行净投放,同时两次降低14天正回购利率。受央行持续净投放影响,尽管存在新股发行等因素的冲击,银行间资金面总体上仍比较宽松,货币市场资金利率维持在低位。

报告期内,本基金主要滚动投资于利率较高的同业存款,增持了部分短期融资券和SHIBOR浮息债,提高了组合久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,华夏理财21天债券A本报告期份额净值收益率为1.0459%;华夏理财21天债券B本报告期份额净值收益率为0.7853%。同期业绩比较基准收益率为0.3403%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

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4季度,国内经济增长动能仍然较弱,通货膨胀水平较温和,央行仍将维持偏宽松的货币政策。考虑到央行已通过常备借贷便利操作向五大行投放了资金,且12月底还将有大量财政存款投放,4季度银行间资金供给将较为充足,资金面总体上将维持宽松。4季度新股发行等因素仍将对资金面造成扰动,但影响有限,资金利率将维持低位。

4季度,本基金将增加对短期债券的投资,维持相对较高的组合久期,在控制好流动性风险的前提下力争提高组合收益。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将继续秉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	35,013,935.24	32.19
	其中:债券	35,013,935.24	32.19
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	–	–
	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	66,282,526.92	60.93
4	其他各项资产	7,483,058.33	6.88
5	合计	108,779,520.49	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	4.63
	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	8,998,755.50	9.04
	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。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值情况的说明

本基金合同约定:本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

报告期内投资组合平均剩余期限情况的说明

本基金合同约定:本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过141天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	14.35	9.04
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	15.08	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	30.15	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	10.05	–
4	90天(含)—180天	22.11	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天(含)	20.12	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
6	合计	101.81	9.04

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	20,002,528.70	20.10
	其中:政策性金融债	20,002,528.70	20.10
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	15,011,406.54	15.09
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	35,013,935.24	35.19
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,995,606.90	10.05

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	100,000	10,006,921.80	10.06
2	100236	10国开36	100,000	9,995,606.90	10.05
3	041458027	14苏广电CP001	50,000	5,013,032.17	5.04
4	011415005	14中铝业SCP005	50,000	5,000,042.70	5.03
5	011499021	14徐工SCP001	50,000	4,998,331.67	5.02
6	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–

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	0.17%
报告期内偏离度的最低值	0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.12%

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

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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	763,958.83
4	应收申购款	6,719,099.50
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	7,483,058.33

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	华夏理财21天债券A	华夏理财21天债券B
本报告期期初基金份额总额	138,142,704.30	–
本报告期基金总申购份额	30,583,979.41	7,902,223.85
减:本报告期基金总赎回份额	69,230,808.43	7,902,223.85
本报告期期末基金份额总额	99,495,875.28	–

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级基金份额间升降级的基金份额。

§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的交易明细

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 报告期内按露的主要事项

2014年7月19日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

2014年8月21日发布华夏基金管理有限公司公告。

2014年8月28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宜林银行股份有限公司为代销机构的公告。

2014年9月6日发布华夏基金管理有限公司公告。

2014年9月13日发布华夏基金管理有限公司公告。

2014年9月24日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告。

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、境内首只RQFII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3季度,华夏基金持续保持较为稳健的投资风格并继续以客户需求为导向,努力提高客户资金管理的便利性:(1)适期通客户端V2.0版本上线,为客户打造财富管理和生活管理的移动金融服务平台;(2)网上交易平台上线中国银行卡的开户及交易功能,提高客户使用的便利性;(3)与银联通合作"全民付金融超市"项目,在银联通的服务支持下,向客户提供基金直销交易功能以及信息服务。

§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《华夏理财21天债券型证券投资基金合同》;

9.1.3《华夏理财21天债券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
二〇一四年十月二十四日

华夏永福养老理财混合型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏永福养老理财混合	
基金主代码	000121	
交易代码	000121	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年8月13日	
报告期末基金份额总额	189,506,064.35份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,追求稳定的绝对回报。	
投资策略	本基金主要通过采取资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略等投资策略以实现投资目标。	
业绩比较基准	一年定期存款税后利率+2%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于债券基金、货币市场基金。	
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	

§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7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	8,388,752.88
2.本期利润	14,001,711.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0753
4.期末基金资产净值	213,379,641.28
5.期末基金份额净值	1.126

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

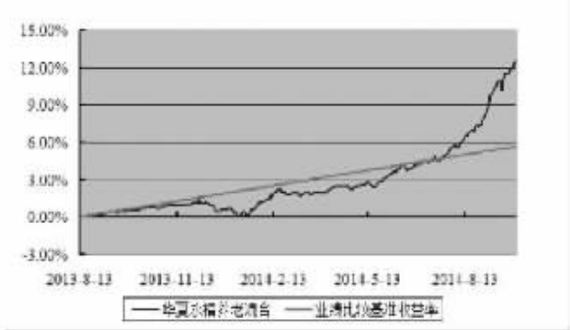
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.96%	0.22%	1.26%	0.00%	6.70%	0.22%

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

华夏永福养老理财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

(2013年8月13日至2014年9月30日)



注:根据华夏永福养老理财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。

§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		
邓湘伟	本基金的基金经理	2013-08-13	–	11年	香港科技大学经济学硕士。曾任海通证券研究员,中银基金研究员、基金经理助理等。2007年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任策略分析师、固定收益部投资经理等。

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》、《公开募集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、研究活动的防内幕交易指导意见》,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

3季度,国际方面,美国经济持续复苏,失业率继续下降,但通胀水平较温和,欧洲经济相对疲弱,欧央行加码宽松措施;新兴市场资金小幅外流,人国内方面,经济增速重回下滑轨道,尽管政府出台加快基建投资和定向降准等微刺激政策,但房地产市场持续疲弱,基建投资无法对冲私人部门投资下滑的影响,工业增加值等指标进一步下滑。银行和企业风险偏好下降,信贷需求和供给意愿降低,货币信贷数据明显走弱。央行货币政策维持中性偏松,定向降准、常备借贷便利(SLF)和下调公开市场正回购利率等措施稳定了市场对资金面的预期,货币市场利率处于平稳低位。

债市方面,利率债季初在经济企稳和获利回吐的压力下有所调整,信用债则在理财需求的支撑下维持强势。随着经济下滑,7月下旬之后债券明显上涨。

报告期内,本基金保持了一定比例的短期存款配置,重点增持短期融资券,波段操作短期政策性金融债,组合总体流动性较好,期限搭配相对合理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,华夏货币A本报告期份额净值收益率为1.0828%;华夏货币B本报告期份额净值收益率为1.1440%。同期业绩比较基准收益率为0.7562%,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4季度,经济增速仍处于下行通道,短期内回升几率不高。在经济基本面支撑、通胀不高及流动性宽松等多方面因素推动下,债券牛市的行情尚不会完全结束。考虑到利率市场化不断深入,银行负债端成本的上行将不可逆转,3季度债券到期收益率的进一步下降对债市之后涨幅空间形成制约,但整体风险不大。

4季度,受改革深化和增量资金的入场影响,股市同经济背离的走势仍有望维持。十八届四中全会召开有望引领改革类股票走出新一轮行情,"沪港通"落地有望拉近大盘蓝筹股与国际市场的估值差距,但市场上涨后整体机会将有所减少,需要更深入的挖掘。主题性机会仍有望延续,土地改革、核电重启、高铁及互联网医疗等主题值得继续关注。

4季度,本基金将保持现有股票和债券的配置比例,积极把握股市的主题转换机会。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将继续秉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	27,697,234.66	11.98
	其中:股票	27,697,234.66	11.98
2	固定收益投资	155,416,924.06	67.20
	其中:债券	155,416,924.06	67.20
	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	16,000,000.00	6.92
	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	25,577,621.71	11.06
7	其他各项资产	6,590,231.18	2.85
8	合计	231,282,011.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	12,413,312.61	5.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,445,977.12	5.83
E	建筑业	950,000.00	0.45
F	批发和零售业	954,800.00	0.45
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	734,455.59	0.34
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	198,689.34	0.09
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	27,697,234.66	12.98

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	600674	川投能源	700,787	12,445,977.12	5.83
2	000887	中鼎股份	320,666	4,345,024.30	2.04
3	002009	天奇股份	139,901	2,351,735.81	1.10
4	000625	长安汽车	160,000	2,192,000.00	1.03
5	002366	丹甫股份	35,000	1,128,750.00	0.53
6	002556	辉隆股份	70,000	954,800.00	0.45
7	600502	安徽水利	100,000	950,000.00	0.45
8	600765	中航重机	30,000	783,000.00	0.37
9	300205	天喻信息	40,000	772,400.00	0.36
10	600037	歌华有线	49,929	734,455.59	0.34

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	31,261,000.00	14.65
	其中:政策性金融债	31,261,000.00	14.65
4	企业债券	40,526,011.60	18.99
5	企业短期融资券	60,552,000.00	28.38
6	中期票据	9,971,000.00	4.67
7	可转债	13,106,912.46	6.14
8	其他	–	–
9	合计	155,416,924.06	72.84

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	140203	14国开03	200,000	21,252,000.00	9.96
2	112190	11亚迪02	110,000	11,165,000.00	5.23
3	041460001	14渝江北嘴CP001	100,000	10,137,000.00	4.75
4	041454002	14川交投CP001	100,000	10,136,000.00	4.75
5	041460022	14川铁投CP001	100,000	10,126,000.00	4.75

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 报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末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	15,837.59
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,210,822.26
5	应收申购款	3,363,571.33
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,590,231.18

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	113003	重工转债	8,005,140.00	3.75
2	110018	国电转债	2,354,400.00	1.10
3	128003	华天转债	1,777,827.56	0.83
4	110020	南山转债	562,550.00	0.26

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

项目	华夏永福养老理财混合
本报告期期初基金份额总额	248,060,967.82
本报告期基金总申购份额	111,652,351.62
减:本报告期基金总赎回份额	170,207,255.09
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	189,506,064.35

§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的交易明细

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 报告期内按露的主要事项

2014年7月19日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购中国电力投资集团公司2014年度第五期超短期融资券的公告。

2014年7月18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年第七期短期融资券的公告。

2014年7月19日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

2014年7月26日发布华夏基金管理有限公司关于调整基金经理的公告。

2014年8月16日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告。

2014年8月20日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告。

2014年8月21日发布华夏基金管理有限公司公告。

2014年8月28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包商银行股份有限公司为代销机构的公告。

2014年9月4日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告。

2014年9月5日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告。

2014年9月6日发布华夏基金管理有限公司公告。

2014年9月6日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告。

2014年9月9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包商银行股份有限公司为代销机构的公告。

2014年9月11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深圳市新兰德证券投资咨询