华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

2014 第二季度报告

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2014年7月18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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月15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	华宝添益
基金主代码	511990
交易代码	511990
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月27日
报告期末基金份额总额	202,068,148.68份
投资目标	保持本金的安全性和基金财产的流动性，追求高于比较基准的稳定收益。
投资策略	1.久期策略：基于对宏观经济环境的深入研究，预期未来市场利率的变化趋势，结合基金未来现金流的分析，确定投资组合平均剩余期限，把握买卖时机。2.收益率曲线策略：收益率曲线策略是根据收益曲线的非平行移动调整资产组合，将预期到的变动资本化。3.类属配置策略：类属配置策略主要实现两个目标：一是通过类属配置满足基金流动性需求，二是通过类属配置获得投资收益。4.套利策略：基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会，进行跨市场、跨品种操作，以期获得安全的超额收益。5.逆回购策略：基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致的短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。6.现金流管理策略：投资运作中本基金将采用均衡分布、滚动投资、优化期限配置等方法，加强流动性管理。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注：本基金份额净值为100元。

§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	273,909,137.70
2.本期利润	273,909,137.70
3.期末基金资产净值	20,206,814,868.15

注：1、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。由于货币市场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。

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

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	0.9708%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.6342%	0.0009%

注：基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

（2012年12月27日至2014年6月30日）

注：根据基金合同的约定，基金管理人应当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基金合同的有关约定。截至2013年6月27日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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		
陈昕	本基金基金经理、华宝兴业现金宝货币基金经理	2012年12月27日	－	10年	经济学学士。2003年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在清算登记部、交易部、固定收益部从事固定收益产品相关的估值、交易、投资工作，2010年7月起任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理，2011年11月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理，2012年6月至2014年2月兼任华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金经理，2012年12月起兼任华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《货币市场基金管理暂行规定》、《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，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

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与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的5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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

二季度，债券市场整体表现为牛市普涨行情，收益率曲线稳步下行，呈现出扁平化特征。央行货币政策继续维持稳健的整体基调，但期间多次使用创新微调手段进行放松，在控制总量的基础上，通过定向降低存款准备金率以及再贷款，盘活存量、优化结构，提升资金配置的针对性、有效性，确保货币政策向实体经济的传导渠道更加顺畅。在此背景下，投资者流动性预期明显改善，现券投资价值显现，市场交投活跃、走势稳健。

受新股发行分流影响，6月中下旬交易所资金面快速趋紧，对场内货币市场基金造成了明显冲击，本基金也不例外。本基金在报告期内，根据货币市场的趋势性变化，进行了资产结构调整，重点增持了中高等级信用债，并适当拉长平均组合剩余期限，整体运行平稳，经受住了市场波动的考验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值收益率为0.9708%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%，业绩比较基准为同期7天通知存款利率（税后）。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度，微刺激的政策效果将逐步显现，宏观经济企稳回升的概率很大，通胀无忧将继续处于温和水平。债券市场在经历上半年的明显上涨之后，多数品种已经稍显疲态，在新的推动因素出现前，可能将以盘整震荡行情为主。相较而言，持有票息或将是获取收益的主要途径，而资本利得的捕捉难度较大。货币市场有望继续维持宽松态势，在资金价格稳定的背景下，收益率曲线短端的波动幅度将收敛。货币基金收益率存在下行压力，但仍处在历史高位具有投资价值。本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则，关注市场出现的新变化，避免事件性冲击，努力把握市场机会，为投资者谋取稳定回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	6,205,611,454.97	29.49
	其中：债券	6,205,611,454.97	29.49
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	707,490,301.24	3.36
	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	13,977,539,307.46	66.43
4	其他资产	150,536,119.32	0.72
5	合计	21,041,177,182.99	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	2.33	
	其中：买断式回购融资	0.00	
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	816,959,391.52	4.04
	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	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

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120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	14.20	4.04
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
2	30天（含）－60天	27.28	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
3	60天（含）－90天	15.90	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
4	90天（含）－180天	25.75	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
5	180天（含）－397天（含）	20.25	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
	合计	103.38	4.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	2,222,642,851.89	11.00
	其中：政策性金融债	2,222,642,851.89	11.00
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	3,982,968,603.08	19.71
6	中期票据	－	－
7	其他	－	－
8	合计	6,205,611,454.97	30.71
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	－	－

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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	041453047	14武钢CP001	4,200,000	420,060,757.94	2.08
2	130243	13国开43	3,800,000	380,249,695.19	1.88
3	140316	14进出16	2,800,000	277,650,140.73	1.37
4	110257	11国开57	2,700,000	269,947,402.34	1.34
5	140429	14农发29	2,500,000	250,255,284.78	1.24
6	140430	14农发30	2,500,000	250,160,128.56	1.24
7	011486003	14光明SCP003	2,000,000	199,951,247.52	0.99
8	041455019	14苏广播CP001	1,500,000	150,009,830.20	0.74
9	011490001	14苏交通SCP001	1,500,000	150,000,369.31	0.74
10	041459013	14海淀国资CP001	1,400,000	140,333,853.48	0.69

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	－
报告期内偏离度的最高值	0.0951%
报告期内偏离度的最低值	0.0132%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0463%

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

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

5.8.2

本报告期内，本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	150,535,692.72
4	应收申购款	－
5	其他应收款	426.60
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	150,536,119.32

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	244,495,198.01
报告期期间基金总申购份额	162,799,338.97
减：报告期期间基金总赎回份额	205,226,388.30
报告期期末基金份额总额	202,068,148.68

注：本基金基金合同生效于2012年12月27日。本基金的份额折算日为基金合同生效当日。折算后基金份额净值为100元。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	分红再投资	2014年4月1日	108.00	－	0.00%
2	二级市场卖出	2014年4月1日	-1,010,945.00	-101,109,866.19	0.00%
3	申购	2014年4月1日	1,011,090.00	101,109,000.00	0.00%
4	分红再投资	2014年4月3日	123.00	－	0.00%
5	二级市场卖出	2014年4月3日	-512,961.00	-51,305,156.95	0.00%
6	分红再投资	2014年4月4日	57.00	－	0.00%
7	二级市场卖出	2014年4月4日	-498,390.00	-49,860,430.77	0.00%
8	申购	2014年4月8日	1,011,840.00	101,184,000.00	0.00%
9	分红再投资	2014年4月10日	110.00	－	0.00%
10	二级市场卖出	2014年4月10日	-2,812,377.00	-281,261,872.39	0.00%
11	二级市场买入	2014年4月10日	2,572,352.00	257,257,374.67	0.00%
12	申购	2014年4月10日	240,040.00	24,004,000.00	0.00%
13	分红再投资	2014年4月11日	82.00	－	0.00%
14	二级市场卖出	2014年4月11日	-475,993.00	-47,611,475.82	0.00%
15	申购	2014年4月11日	413,100.00	41,310,000.00	0.00%
16	分红再投资	2014年4月14日	172.00	－	0.00%
17	分红再投资	2014年4月15日	103.00	－	0.00%
18	分红再投资	2014年4月16日	103.00	－	0.00%
19	分红再投资	2014年4月17日	101.00	－	0.00%
20	二级市场卖出	2014年4月17日	-633,000.00	-63,302,465.00	0.00%
21	二级市场买入	2014年4月17日	263,000.00	26,300,363.00	0.00%
22	分红再投资	2014年4月18日	61.00	－	0.00%
23	二级市场卖出	2014年4月18日	-1,177,171.00	-117,737,728.94	0.00%
24	二级市场买入	2014年4月18日	597,481.00	59,757,800.29	0.00%
25	二级市场买入	2014年4月21日	1,012,900.00	101,292,431.21	0.00%
26	分红再投资	2014年4月22日	104.00	－	0.00%
27	二级市场卖出	2014年4月22日	-275,961.00	-27,596,588.96	0.00%
28	二级市场买入	2014年4月22日	63,000.00	6,300,063.00	0.00%
29	分红再投资	2014年4月23日	83.00	－	0.00%
30	二级市场卖出	2014年4月23日	-1,013,104.00	-101,310,400.00	0.00%
31	二级市场买入	2014年4月23日	1,226,100.00	122,610,767.75	0.00%
32	分红再投资	2014年4月24日	106.00	－	0.00%
33	分红再投资	2014年4月25日	106.00	－	0.00%
34	分红再投资	2014年4月28日	324.00	－	0.00%
35	二级市场卖出	2014年4月28日	-1.00	-99.99	0.00%
36	分红再投资	2014年4月29日	126.00	－	0.00%
37	二级市场卖出	2014年4月29日	-163,394.00	-16,337,079.84	0.00%
38	二级市场买入	2014年4月29日	100,400.00	10,038,795.20	0.00%
39	分红再投资	2014年4月30日	103.00	－	0.00%
40	二级市场卖出	2014年4月30日	-750,850.00	-75,116,234.50	0.00%
41	分红再投资	2014年5月5日	111.00	－	0.00%
42	二级市场卖出	2014年5月5日	-200,103.00	-20,012,101.03	0.00%
43	申购	2014年5月6日	1,014,490.00	101,449,000.00	0.00%
44	分红再投资	2014年5月8日	111.00	－	0.00%
45	二级市场卖出	2014年5月8日	-1,014,601.00	-101,474,904.42	0.00%
46	申购	2014年5月8日	982,290.00	98,229,000.00	0.00%
47	分红再投资	2014年5月12日	316.00	－	0.00%
48	二级市场卖出	2014年5月12日	-700,000.00	-70,008,600.00	0.00%
49	二级市场买入	2014年5月12日	200,000.00	20,002,200.00	0.00%
50	申购	2014年5月12日	532,520.00	53,252,000.00	0.00%
51	分红再投资	2014年5月13日	50.00	－	0.00%
52	分红再投资	2014年5月14日	104.00	－	0.00%
53	分红再投资	2014年5月15日	103.00	－	0.00%
54	二级市场卖出	2014年5月15日	-100,000.00	-10,001,300.00	0.00%
55	申购	2014年5月15日	100,010.00	10,001,000.00	0.00%
56	分红再投资	2014年5月16日	93.00	－	0.00%
57	分红再投资	2014年5月19日	307.00	－	0.00%
58	二级市场卖出	2014年5月19日	-200,000.00	-20,000,800.00	0.00%
59	分红再投资	2014年5月20日	82.00	－	0.00%
60	二级市场卖出	2014年5月20日	-583,801.00	-58,381,369.30	0.00%
61	二级市场买入	2014年5月20日	100,000.00	9,999,900.02	0.00%
62	分红再投资	2014年5月21日	32.00	－	0.00%
63	二级市场卖出	2014年5月21日	-1,422,369.00	-142,235,130.20	0.00%
64	二级市场买入	2014年5月21日	1,590,184.00	159,016,277.98	0.00%
65	分红再投资	2014年5月22日	50.00	－	0.00%
66	二级市场卖出	2014年5月22日	-883,431.00	-88,344,450.47	0.00%
67	二级市场买入	2014年5月22日	783,399.00	78,338,912.18	0.00%
68	分红再投资	2014年5月23日	40.00	－	0.00%
69	分红再投资	2014年5月26日	118.00	－	0.00%
70	二级市场买入	2014年5月26日	409,800.00	40,976,208.60	0.00%
71	分红再投资	2014年5月27日	81.00	－	0.00%
72	二级市场买入	2014年5月27日	206,500.00	20,648,967.51	0.00%
73	分红再投资	2014年5月28日	110.00	－	0.00%
74	分红再投资	2014年5月29日	103.00	－	0.00%
75	分红再投资	2014年5月30日	102.00	－	0.00%
76	二级市场卖出	2014年5月30日	-716,802.00	-71,686,572.02	0.00%
77	分红再投资	2014年6月3日	121.00	－	0.00%
78	二级市场买入	2014年6月3日	717,000.00	71,691,470.82	0.00%
79	申购	2014年6月3日	1.00	100.00	0.00%
80	赎回	2014年6月3日	-1.00	-100.00	0.00%
81	分红再投资	2014年6月4日	106.00	－	0.00%
82	分红再投资	2014年6月5日	102.00	－	0.00%
83	分红再投资	2014年6月6日	125.00	－	0.00%
84	分红再投资	2014年6月9日	305.00	－	0.00%
85	二级市场卖出	2014年6月9日	-100,000.00	-10,000,300.00	0.00%
86	分红再投资	2014年6月10日	90.00	－	0.00%
87	二级市场卖出	2014年6月10日	-460,000.00	-45,999,120.00	0.00%
88	二级市场买入	2014年6月10日	100,100.00	10,009,599.60	0.00%
89	分红再投资	2014年6月11日	55.00	－	0.00%
90	二级市场买入	2014年6月11日	101,653.00	10,164,548.41	0.00%
91	分红再投资	2014年6月12日	65.00	－	0.00%
92	二级市场买入	2014年6月12日	358,400.00	35,838,210.32	0.00%
93	分红再投资	2014年6月13日	104.00	－	0.00%
94	分红再投资	2014年6月16日	305.00	－	0.00%
95	分红再投资	2014年6月17日	106.00	－	0.00%
96	赎回	2014年6月17日	-1,018,633.00	-101,863,300.00	0.00%
97	二级市场买入	2014年6月19日	113,800.00	11,376,524.94	0.00%
98	分红再投资	2014年6月20日	11.00	－	0.00%
99	二级市场买入	2014年6月20日	100.00	10,000.10	0.00%
100	分红再投资	2014年6月23日	35.00	－	0.00%
101	二级市场买入	2014年6月23日	300,000.00	29,990,500.01	0.00%
102	分红再投资	2014年6月24日	42.00	－	0.00%
103	二级市场买入	2014年6月24日	205,600.00	20,555,333.52	0.00%
104	分红再投资	2014年6月25日	64.00	－	0.00%
105	二级市场卖出	2014年6月25日	-619,694.00	-61,973,597.60	0.00%
106	申购	2014年6月26日	1,019,696.00	101,969,600.00	0.00%
107	分红再投资	2014年6月30日	325.00	－	0.00%
合计			9,110.00	152,904.74	

注：交易日期为申请日期。交易金额为确认金额（不含交易费用），交易份额为确认份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同；
华宝兴业现金添益交易型货币市场基金招募说明书；
华宝兴业现金添益交易型货币市场基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

8.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年7月18日

华宝兴业现金宝货币市场基金

2014 第二季度报告

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2014年7月18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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月15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	华宝兴业现金宝货币	
基金主代码	240006	
交易代码	240006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年3月31日	
报告期末基金份额总额	5,844,936,539.60份	
投资目标	保持本金的安全性与流动性，追求高于比较基准的收益率。	
投资策略	以对宏观经济及利率走势的判断为基础，在满足组合平均久期、收益性以及信用等级的前提下利用现代金融分析方法和工具，优化组合配置效果，实现组合增值。	
业绩比较基准	同期7天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
下属两级基金的交易代码	240006	240007
报告期末下属两级基金的份额总额	489,118,227.07份	5,355,818,312.53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）	
	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
1.本期已实现收益	5,847,680.08	92,888,962.45
2.本期利润	5,847,680.08	92,888,962.45
3.期末基金资产净值	489,118,227.07	5,355,818,312.53

注：1、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。由于货币市场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。

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

华宝兴业现金宝货币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	1.0190%	0.0038%	0.3366%	0.0000%	0.6824%	0.0038%

注：基金收益分配是按日结转份额。

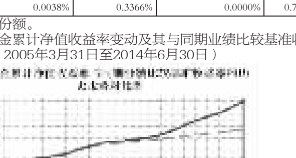
华宝兴业现金宝货币B

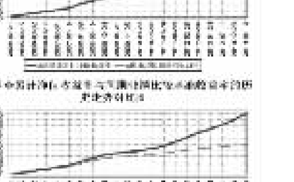
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.0797%	0.0038%	0.3366%	0.0000%	0.7431%	0.0038%

注：基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

（2005年3月31日至2014年6月30日）





注：按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至2005年4月7日，本基金已根据基金合同规定完成建仓，资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
陈昕	本基金基金经理、华宝添益基金经理	2011年11月15日	－	10年	经济学学士。2003年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在清算登记部、交易部、固定收益部从事固定收益产品相关的估值、交易、投资工作，2010年7月起任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理，2011年11月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理，2012年6月至2014年2月兼任华宝兴业中证短融50债券基金基金经理，2012年12月起兼任华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《货币市场基金管理暂行规定》、《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，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

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与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的5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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

二季度，债券市场整体表现为牛市普涨行情，收益率曲线稳步下行，呈现出扁平化特征。央行货币政策继续维持稳健的整体基调，但期间多次使用创新微调手段进行放松，在控制总量的基础上，通过定向降低存款准备金率以及再贷款，盘活存量、优化结构，提升资金配置的针对性、有效性，确保货币政策向实体经济的传导渠道更加顺畅。在此背景下，投资者流动性预期明显改善，现券投资价值显现，市场交投活跃、走势稳健。

本基金在报告期内，根据货币市场的趋势性变化，进行了资产结构调整，重点增持了中高等级信用债，并适当拉长平均组合剩余期限，整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

现金宝A：本基金报告期内净值收益率为1.0190%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%，业绩比较基准为同期7天通知存款利率（税后）。

现金宝B：本基金报告期内净值收益率为1.0797%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%，业绩比较基准为同期7天通知存款利率（税后）。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度，微刺激的政策效果将逐步显现，宏观经济企稳回升的概率很大，通胀将继续处于温和水平。债券市场在经历上半年的明显上涨之后，多数品种已经稍显疲态，在新的推动因素出现前，可能将以盘整震荡行情为主。相较而言，持有票息或将是获取收益的主要途径，而资本利得的捕捉难度较大。货币市场有望继续维持宽松态势，在资金价格稳定的背景下，收益率曲线短端的波动幅度将收敛。货币基金收益率存在下行压力，但仍处在历史高位具有投资价值。本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则，努力把握市场机会，为投资者谋取稳定回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	2,669,034,974.44	38.97
	其中：债券	2,669,034,974.44	38.97
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	190,900,686.35	2.79
	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	3,927,265,795.51	57.34
4	其他资产	62,219,443.61	0.91
5	合计	6,849,420,899.91	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	2.24	
	其中：买断式回购融资	0.00	
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	949,197,513.20	16.24
	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	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

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投资组合平均剩余期限未超过180 天。

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	20.60	17.07
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
2	30天（含）－60天	33.50	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
3	60天（含）－90天	24.44	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.52	－
4	90天（含）－180天	6.26	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
5	180天（含）－397天（含）	31.32	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
	合计	116.12	17.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	1,119,060,422.70	19.15
	其中：政策性金融债	1,119,060,422.70	19.15
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	1,549,974,551.74	26.52
6	中期票据	－	－
7	其他	－	－
8	合计	2,669,034,974.44	45.66
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,444,339.36	0.52

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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	130236	13国开36	3,200,000	320,085,785.94	5.48
2	041453047	14武钢CP001	2,000,000	200,005,636.73	3.42
3	011490002	14苏交通SCP002	2,000,000	200,002,927.20	3.42
4	140410	14农发10	1,700,000	170,176,431.04	2.91
5	140316	14进出16	1,500,000	148,722,340.07	2.54
6	140430	14农发30	1,200,000	120,113,542.96	2.06
7	011417004	14华电SCP004	1,200,000	119,953,160.21	2.05
8	140204	14国开04	1,000,000	100,097,477.49	1.71
9	011490001	14苏交通SCP001	1,000,000	100,000,123.24	1.71
10	041461018	14沪电力CP001	1,000,000	100,000,117.03	1.71

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	－
报告期内偏离度的最高值	0.1485%
报告期内偏离度的最低值	0.0377%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0779%

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

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

5.8.2

本报告期内，本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	57,986,990.82
4	应收申购款	4,212,388.66
5	其他应收款	20,064.13
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	62,219,443.61

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
报告期期初基金份额总额	631,754,623.22	6,599,761,554.29
报告期期间基金总申购份额	573,877,275.99	10,801,810,273.89
减：报告期期间基金总赎回份额	716,513,672.14	12,045,753,515.65
报告期期末基金份额总额	489,118,227.07	5,355,818,312.53

注：总申购份额含份额级别调整、转换入份额和红利再投；总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2014年4月15日	-28,000,000.00	-28,000,000.00	0.00%
2	申购	2014年5月16日	110,000,000.00	110,000,000.00	0.00%
3	申购	2014年5月19日	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
4	申购	2014年6月9日	45,000,000.00	45,000,000.00	0.00%
5	赎回	2014年6月17日	-50,000,000.00	-50,000,000.00	0.00%
6	赎回	2014年6月18日	-50,000,000.00	-50,000,000.00	0.00%
合计			67,000,000.00	67,000,000.00	

注：交易日期为申请日期。交易金额为确认金额（不含交易费用），交易份额为确认份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2014年7月8日发布《关于华宝兴业现金宝货币市场基金增加E类基金份额并相应修改基金合同的公告》，华宝兴业现金宝货币市场基金将于2014年7月14日起增加E类基金份额。增加E类基金份额后，本基金将分设A类、B类和E类三类基金份额。敬请投资者注意。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同；
华宝兴业现金宝货币市场基金招募说明书；
华宝兴业现金宝货币市场基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年7月18日

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2014年7月18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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月15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	华宝兴业先进成长股票
基金主代码	240009
交易代码	240009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月7日
报告期末基金份额总额	1,100,328,786.22份
投资目标	分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长，在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额回报。
投资策略	本基金将使用定量与定性相结合的方法，选择具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业进行投资，重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业，同时也兼顾有先进企业的传统行业。
业绩比较基准	新上证综指收益率。
风险收益特征	本基金是一只积极型的股票投资基金，属于证券投资基金中的较高风险品种。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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	79,753,525.42
2.本期利润	109,714,844.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.1026
4.期末基金资产净值	1,997,959,445.56
5.期末基金份额净值	1.8158

注：1、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。

2、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。

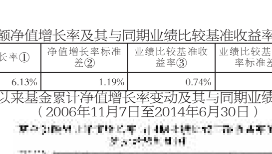
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	6.13%	1.19%	0.74%	0.77%	5.39%	0.42%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

（2006年11月7日至2014年6月30日）



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2007年5月7日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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		
朱亮	本基金基金经理、华宝兴业新兴产业基金基金经理、华宝兴业创新股票基金经理	2012年6月1日	－	8年	硕士。曾在倍多科技（中国）有限公司任产品总监，国金证券股份有限公司任研究员。2008年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任研究部高级分析师，国内投资部基金经理助理，2012年6月至今任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理。2013年7月起兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理，2014年5月起兼任华宝兴业创新优选股票型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，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

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与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的5%。 本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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

2014年二季度，市场整体表现为上涨，但以创业板和中小板为代表的成长股表现要明显好于以上证指数和沪深300为代表的大盘蓝筹股。在此期间，上证综指和沪深300指数分别上涨0.32%和0.61%；深成指、中小板指数和创业板指数分别上涨2.48%、4%和5.58%。分行业来看，国防军工、通信、计算机的行业指数涨幅超过10%；交通运输、纺织服装和商业贸易等行业指数表现较差，跌幅超过3%。成长股内部也出现很大分化，前几年的大牛股如歌尔、大华、富瑞等继续下跌，而以智慧城市、医疗服务、电动车等代表的新成长股相对强势，股价屡创新高。我们认为，这其中细分行业景气度的变化是股价表现的内因，而整个市场存量资金的博弈，放大了细分板块间的股价表现。

报告期间，我们总体仓位波动不大，维持在较高的水平，并增持了一些业绩超预期的高成长性个股。同时，我们也减持了一些业绩不达预期的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为6.13%，同期业绩比较基准收益率为0.74%，基金表现领先于基准5.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度以来，伴随着房地产投资增速的不断下滑，政府又开始从信贷和投资方面开始一些微刺激动作，以期对冲房地产投资增速下滑对经济的负面影响。展望三季度，我们预计经济有可能在政策的再次干预下出现企稳，这将有利于市场短期企稳。但是，从目前来看，中国经济仍然处在增速下滑的通道，A股，尤其是与宏观经济息息相关的大盘蓝筹股仍难以有较好的表现，而成长股也需要时间来消化其较高的估值。但从更长远一点来看，我们仍然对未来几年的股市表现有很大信心，主要是我们处在以电动车、页岩气、智能手机等代表的席卷全球的技术创新、以移动互联网代表的商业模式创新，以及中国深化改革带来的制度创新的三曲共奏中，这必将对股市有着长期积极的影响。

我们仍坚持以成长股为核心配置的策略，紧密跟踪各行业景气度变化，精选优秀的公司，坚定长期持有，分享这些公司中长期业绩快速增长带来的丰厚回报。感谢基金持有人一直以来对我们的支持，我们将继续勤勉尽责，努力为持有人创造好的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,576,282,755.07	78.05
	其中：股票	1,576,282,755.07	78.05
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	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	92,550,366.28	4.58
	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	259,385,865.05	12.84
7	其他资产	91,482,684.33	4.53
8	合计	2,019,701,670.73	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	－	－
B	采矿业	50,410,207.22	2.52
C	制造业	571,407,307.20	28.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,316,300.64	0.57
E	建筑业	－	－
F	批发和零售业	45,892,202.95	2.30
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	380,343,877.01	19.04
J	金融业	－	－
K	房地产业	22,049,464.50	1.10
L	租赁和商务服务业	225,025,203.80	11.26
M	科学研究和技术服务业	18,238,990.72	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	196,461,819.24	9.83
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	13,035,662.90	0.65
R	文化、体育和娱乐业	42,101,718.89	2.11
S	综合	－	－
	合计	1,576,282,755.07	78.89

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300070	碧水源	5,433,719	158,936,280.75	7.95
2	002400	省广股份	3,700,000	90,946,000.00	4.55
3	300090	盛运股份	5,719,023	90,074,612.25	4.51
4	002707	众信旅游	900,000	81,000,000.00	4.05
5	300212	易华录	2,450,000	76,734,000.00	3.84
6	002065	东华软件	3,664,748	73,734,729.76	3.69
7	300054	鼎龙股份	5,551,723	67,175,848.30	3.36
8	300026	红日药业	1,929,789	56,542,817.70	2.83
9	300058	蓝色光标	1,999,970	53,079,203.80	2.66
10	300157	恒泰艾普	3,609,783	46,710,592.02	2.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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投资。

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

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

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

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	548,111.76
2	应收证券清算款	90,578,198.78
3	应收股利	－
4	应收利息	83,584.24
5	应收申购款	272,789.55
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	91,482,684.33

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002707	众信旅游	81,000,000.00	4.05	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,090,717,726.06
报告期期间基金总申购份额	75,378,384.60
减：报告期期间基金总赎回份额	65,767,324.44
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	－
报告期期末基金份额总额	1,100,328,786.22

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	565,568.07
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	565,568.07
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.05

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同；
华宝兴业先进成长股票型证券投资基金招募说明书；
华宝兴业先进成长股票型证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

8.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年7月18日