

(上接B051版)

全国免费业务咨询电话:95511-8
开放式基金业务咨询电话:0755-82400862
公司网址: <http://www.pingan.com>
(23)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期北座)
法定代表人:王东明
电话:010-60838888
传真:010-60833739
联系人:胡波
客户服务热线:95548
公司网址: www.csc.com.cn
(24)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层、29层
法定代表人:潘军
联系人:胡博
电话:021-63258888
传真:021-63267279
客户服务热线:95503
公司网站: www.dfwm.com.cn
(25)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人:沈强
客户服务电话:95548
公司网址: www.bigsun.com.cn
(26)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16楼至26楼
法定代表人:何如
联系人:肖彬
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客户服务热线:95536
国信证券网站: www.guosen.com.cn
(27)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层
法定代表人:杨宝林
基金业务联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户咨询电话:95548
公司网址: www.citicsd.com
(28)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人:陈宇
邮政编码:20120
客服电话:400-820-9808,021-38929908
总部传真电话:021-68777222
传真:021-68778222
公司网站: <http://www.cbhskn.com>
(29)中银国际证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
咨询电话:400628888或各地营业网点咨询电话
网址: www.bocichina.com
传真:021-50372474
(30)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙呼和浩特和浩特市新城区新华东街111号邮编10010
办公地址:内蒙呼和浩特和浩特市新城区新华东街111号邮编10010
法定代表人:庞介民
联系人:王旭华
联系电话:0471-4972343
公司网站: www.chtsec.com
(31)长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:董广华
联系人:陈琳
电话:0755-83516094
传真:0755-83516677
客户服务电话: 0755-36860000,400 6666 888
公司网址: www.cgws.com
(32)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:王春峰
联系人:蔡亚
电话:022-28451991
传真:022-28451958
客户服务电话: 4006515988
网址: <http://www.bhjq.com>
(33)中原证券股份有限公司
住所:郑州郑东新区CBD东3号3号招商局广场A座18-21层
法定代表人:吕长岩
联系人:陈琳
电话:0755-82025342
传真:0755-82025342
联系人:刘斌
客服电话:400 6008 9552
网址: www.ccina.com
(34)中国国际金融有限公司
住所:北京市建国门外大街1号国贸大厦2层27及28层
法定代表人:丁学东
基金业务联系人:罗春蓉、陈曦、唐婧
联系电话:010-65051166
传真:010-65080665
(35)民生证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人:余斌
联系人:张明
联系电话:010-85127622
联系传真:010-85127917
网址: www.msq.com
客户服务电话:4006198888
(36)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:臧阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
网址: www.qlq.com.cn
(37)华鑫证券有限责任公司
地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:姜鑫海
客服电话:96326(福建省外请加0591)
公司网址: www.hfzq.com
(38)信达证券股份有限公司
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
联系人:董倩
联系电话:010-63081000
客服电话:400-800-8899
公司网址: www.cindasc.com
(39)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:张雪北
电话:0451-85863696
传真:0451-82282711
客户服务热线:400-666-2288
网址: www.jhjq.com
(40)国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常承
客户服务电话:400-818-8118
网址: www.guodu.com
(41)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:杨树财
电话:0431-85096517
传真:0431-85096765
客服电话:4006000866
网址: www.nesc.cn
(42)德邦证券股份有限公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南纬大楼
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼
邮政编码:200122
注册资本:16.92亿元人民币
法定代表人:姚文平
联系人:陈磊
联系电话:862168761616-8507
传真:862168767881
(43)安泰证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财富中心B11楼
法定代表人:李工
电话:0551-66161666
传真:0551-66161600
网址: www.hazq.com
客户服务电话: 96518(安徽),400-80-96518(全国)
(44)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:蒋卫华
联系人:许馨雅
电话:021-53519888
传真:021-53519888
网址: www.96328.com
客户服务电话:4008919198,021-962518
(45)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18楼
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:宋来旺
电话:021-20333333
传真:021-50098252
客服电话:95531,400-8888-588
网址: www.longone.com.cn
(46)中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
法定代表人:王宜四
联系人:戴静
联系电话:0791-86768681

客服电话:400-8866-567
公司网址: www.avicsec.com
(47)西南证券股份有限公司
住所:重庆市江北区桥北苑二号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维
客户服务电话:4008-096-096
传真:023-63786212
联系人:崔强
(48)山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市市府西街60号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:山西省太原市市府西街60号山西国际贸易中心东塔楼
联系人:郭海
联系电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客户服务电话:400-666-1618,95573
公司网址: www.iv18.com
(49)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海浦东新区泰康路32号C栋2楼
法定代表人:汪海波
电话:021-38690777
公司网址: www.noah-fund.com
客户服务电话:400-821-5399
(50)深圳开元基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区园岭路国旅控股置地大厦8楼
法定代表人:杨鹏
电 话:010-58325395
传 真:010-58325282
客户服务电话:400-166-1188
网址: <http://xj8j.com>
(51)和讯信息科技有限公司
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王禹
电话:021-20835788
传真:021-20835879
客户服务电话:400-920-0022
公司网址: licaike.hexun.com
(52)深圳市新华德普投资咨询有限公司
注册地址:深圳市罗湖区园岭路国旅控股置地大厦8楼
法定代表人:杨鹏
电 话:010-58325395
传 真:010-58325282
客户服务电话:400-166-1188
网址: <http://xj8j.com>
(53)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:曹峰
电话:0755-33227951
传 真:0755-33227951
公司网址: www.zlfund.cn www.jimw.com
客服电话:4006-788-887
(54)杭州数米基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
电 话:021-60897840
传 真:0571-26697013
客服电话:4000-766-123
公司网址: <http://www.fund123.cn/>
(55)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座2楼
法定代表人:其实
电话:021-54509988
传真:021-64883908
公司网址: www.1234567.com
客户服务电话:400-1818-188
(56)上海好买基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东新区东川路360号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
电话:021-58870111
传真:021-68909011
客服热线:400-700-9665
好买基金交易网: www.ehowbuy.com
(57)浙江百花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法定代表人:凌顺平
电话:0571-88911818
传真:0571-88910240
网址: www.5ifund.com
(58)宜信普信投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号4号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区
联系人:齐程
销售网站: www.yixinfund.com
客服电话:400-6099-200
(59)中经北证(北京)证券资产管理有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号院5号楼1层
法人代表名称:徐福慧
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号院1号楼1层
电话:010-68998820
传真:010-88815550
网站: www.bzfunds.com
(二)客服:4008-773-772登记机构:华宝兴业基金管理有限公司(同上)
(三)律师事务所和经办律师
名称:通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
联系电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:刘颖琦/陈颖/彭明、孙晋
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
执行事务合伙人:杨绍信
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:张振波
经办注册会计师:汪捷、张振波
五、基金合同
基金名称:华宝兴业活期通货币市场基金
基金类型:契约型开放式基金
六、基金的投资
(一)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。
(二)投资范围
本基金的投资范围包括:
1、现金;
2、通知存款;
3、短期融资券;
4、剩余期限在397天以内(含397天)的债券;
5、1年内(含1年)的银行定期存款、大额存单;
6、期限在1年内(含1年)的债券回购;
7、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;
8、期限在1年内(含1年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);
9、剩余期限在397天以内(含397天)中期票据;
10、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。
未来若法律法规或监管机构允许其他基金投资品种的,本基金可参与存单单的投资,不开召开基金份额持有人大会,具体投资比例按照届时有效的法律法规和监管机构的有关规定执行。
(三)投资策略
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
(四)投资管理
本基金通过短期金融工具积极稳健投资,在保持本金安全与资产充分流动性的基础上,追求稳定的现金收益。主要投资策略如下:
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,结合本基金现金流的分析,确定投资组合平均剩余期限,把握买卖时机,如果预期未来利率将上升,则可适当增加投资组合平均剩余期限的办法规避利率风险,相反,如果预期未来利率下降,则延长投资组合平均剩余期限,赚取利率下降带来的超额回报。本基金的平均剩余期限控制在120天以内。
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。其中有三种方式可以选择:子弹策略是将偿还期限高度集中于收益率变动上的一点,哑铃策略是将偿还期限集中于曲线的两端,而重点投资于期限较短的债券和期限较长的债券,弱化中期限的债券;而梯形策略是将收益率曲线的凸起部分均匀分布时,集中投资于这几个凸起部分所在年度的债券。
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。本基金将根据各种品种(国债、金融债、央行票据、债券回购、短期融资券、现金等)的市场规模、交易活跃程度、相对收益、信用评级、平均期限等因素来确定类属配置各资产的配置比例,再通过评估各类资产的流动性和收益性利率,确定不同期限类别资产的具体配置比例。
4、套利策略
由于市场环境差异、交易所市场参与者差异,以及资金供求失衡导致的短期利率异常差异,使得债券市场存在套利机会。无风险套利主要包括银行间市场、交易所市场的跨市场套利(同一交易市场中不同品种的跨品种套利,和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
基金管理人将密切注意短期资金需求激增的机会,通过逆回购的方式出售其他以分享短期资金拆借利率提升的投资品种。
6、现金流管理策略
本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。投资运作中本基金将采用均衡分散、滚动投资、优化期限配置等方法,加强流动性管理。本基金将密切关注基金的结构和情况,适时调整基金流动性和日伪效应等因素,对投资组合的现金比例进行中期调整。同时,也会通过调整回购操作和债券品种的期限结构来保持流动性,并有效分散基金现金流,保持本基金的高流动性。
(四)投资管理
1、基金管理人研究通过内部独立研究,研究人员根据市场公开披露的信息和专业机构提供的研究报告,对市场利率的预期变动进行分析,跟踪、监测市场上各类金融投资工具的收益率变动,并据此提出投资建议。
2、投资决策委员会的指导,本基金定期小组会对国内外宏观经济、货币政策、资本市场发展趋势等因素的分析判断,按照基金合同约定,提出下一阶段本基金资产配置比例。
3、投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和对外市场的判断决定本基金的投资策略,审核并批准基金经理小组提交的资产配置方案或重大投资决定。
4、基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议,参与本基金投资研究和部和其他研究机构的研究报告,选择具体投资标的,构建投资组合并负责其日常管理。
5、设置集中交易室,基金经理将投资指令下达给集中交易室,交易员需在复核投资指令合法合规的前提下,将指令发送给交易员执行,保证决策和执行环节的分离。

票。

6、监察稽核部及风险管理部对基金投资过程进行日常监督。
7、基金经理小组跟踪货币市场的发展变化,结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况,以及组合风险和流动性的评估情况,对投资组合进行动态调整。基金管理人确保基金持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资组合进行调整。
(五)业绩比较基准
人民币活期存款利率(税后)。
活期存款是具备最高流动性的存款,本基金期望通过科学严谨的管理,使本基金达到类似活期存款的流动性以及更高的收益,因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。
如果今后法律法规发生变化,或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
(六)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。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
(七)投资组合平均剩余期限计算方法
1、计算公式
本基金按下列公式计算平均剩余期限:
Σ(投资于金融工具产生的资产×剩余期限-Σ投资于金融工具产生的负债×剩余期限+Σ债券正回购×剩余期限)/(投资于金融工具产生的资产-投资于金融工具产生的负债+债券正回购)
其中:投资于金融工具产生的资产包括现金资产(含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金),一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券,期限在一年以内(含一年)的逆回购,期限在一年以内(含一年)的资产支持证券、买断式回购产生的待回购金融资产、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。
投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的正回购、买断式回购产生的待返售债券。
(八)投资组合平均剩余期限的确定方法
1、货币资产和负债剩余期限的确定方法
(1)银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为0天;证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的实际交易日天数计算;买断式回购履约金的剩余期限以计算日至协议到期的实际剩余天数计算。
(2)一年以内(含一年)银行定期存款,大额存单的剩余期限以计算日至协议到期的实际剩余天数计算。
(3)组合中债券的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数,以下情况除外:
①允许投资的浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。
(4)回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限以计算日至回购协议到期的实际剩余天数计算。
(5)中央银行票据、资产支持证券、中期票据的剩余期限以计算日至中央银行票据、资产支持证券、中期票据到期的实际剩余天数计算。
(6)买断式回购产生的待返售债券的剩余期限以该金融工具的剩余期限。
(7)新发行回购产生的待返售债券的剩余期限以计算日至回购协议到期的实际剩余天数计算。
(8)法律法规、中国证监会另有规定的,从其规定。
(九)投资限制
1、组合限制
基金的投资组合将遵循以下限制:
(1)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;
(2)本基金与本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(3)存款银行仅限于有证券投资基金托管资格、证券投资基金销售业务资格以及合格境外机构投资者托管资格的商业银行,本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的30%,拟投资时提前支取且不得有利息损失的银行存款,可不受此限制;
(4)本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;
(5)在全国银行间同业拆借市场中债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;
(6)投资于同一公司发行的短期企业债券和短期融资券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(7)除发生巨额赎回情形外,本基金债券正回购的融资余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%;
(8)本基金持有的剩余期限不超过397天且剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%。本基金不得投资于以定期存款利率为基础的浮动利率债券;
(9)买断式回购融入债券的剩余期限不得超过397天;
(10)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(11)本基金应投资于信用级别评级为AAA以上(含AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降,不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
(12)本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准:
A、国内信用评级机构评定的A-1级或相当于A-1级的短期信用级别;
B、根据有关规定予以豁免评级的短融中,其发行人最近3年的信用评级和跟踪评级应符合下列条件之一:
A)国内信用评级机构评定的AA级或相当于AA级的长期信用级别;
B)国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。同一发行人持有具有国内信用评级和国际信用评级的,以国内信用评级为准。本基金持有的短期融资券信用评级不得下降,不再符合信用评级标准的,基金管理人应在评级报告发布之日起20个交易日以内予以全部减持;
(13)法律法规或中国证监会规定的其它比例限制。
法律法规或监管部门变更或取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。
因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,除第(7)、(11)、(12)项另有约定外,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。对于第(7)项,基金管理人应当在5个交易日内进行调整。
基金管理人应当自基金合同生效之日起3个工作日内将基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
2、本基金不得投资于以下金融工具:
(1)股票、权证;
(2)可转换债券;
(3)剩余期限超过397天的债券;
(4)信用等级在AA级以下的企业债券;
(五)以定期存款利率为基础的浮动利率债券;
(6)非在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券;
(7)中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。
法律法规或监管部门取消上述限制,基金管理人履行适当程序后,本基金可不受上述限制。
3、禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人投资;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
法律、行政法规及监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,本基金投资不再受相关限制。
(六)基金管理人代表基金行使证券权利的处理原则及方法
1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使证券权利,保护基金份额持有人的利益;
2、有利于基金财产的安全与增值;
3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的人牟取任何不正当利益。
(十)经基金管理人公告有关规则及事项,本基金可以依据法律法规的规定参与融资融券。
(十一)基金的投资组合报告
本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日,本报告中列财务数据未经审计。
1.报告期末基金资产组合情况

| 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 | 10,002,460.62 | 13.46 |
| 其中:政策性金融债 | 10,002,460.62 | 13.46 | |
| 4 | 企业债券 | -- | -- |
| 5 | 企业短期融资券 | 23,048,791.91 | 31.02 |
| 6 | 中期票据 | -- | -- |
| 7 | 其他 | -- | -- |
| 8 | 合计 | 33,051,252.53 | 44.48 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -- | -- |

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 | 140212 | 14国债12 | 100,000 | 10,002,460.62 | 13.46 |
| 2 | 041455016 | 14鲁新12 | 50,000 | 5,017,263.66 | 6.75 |
| 3 | 041469024 | 14广农CP02 | 50,000 | 5,016,390.98 | 6.75 |
| 4 | 041456014 | 14中债富CP02 | 50,000 | 5,009,280.69 | 6.74 |
| 5 | 041477001 | 14蓝标金CP001 | 50,000 | 5,000,085.24 | 6.73 |
| 6 | 011474004 | 14原华化SCP004 | 30,000 | 3,005,771.23 | 4.05 |

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 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1910% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0738% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1310% |

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。
(八)投资报告报后注
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进行摊销,每日计提收益。
(九)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。
(十)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特别说明。
(十一)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 | 1,376,921.55 |
| 4 | 应收申购款 | -- |
| 5 | 其他应收款 | 15,742.00 |
| 6 | 待摊费用 | -- |
| 7 | 其他 | -- |
| 8 | 合计 | 1,392,663.55 |

七、基金业绩
本基金截止日为2015年3月31日,基金过往业绩不代表未来表现,本报告中所列数据未经审计。

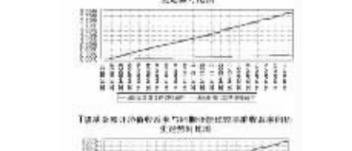
1.净值增长率与同期比较基准收益率比较

| 阶段 | 华宝兴业活期通货币A | | | | | |
|-----------------------|---------------|---------------|-------------------|---------|---------|--|
| | 净值收益率 标准差② | 净值收益率 标准差③ | 业绩比较基准收益率 标准差④ | ①-③ | ②-④ | |
| 2014/05/23-2014/12/31 | 2.0803% | 0.0083% | 0.2138% | 0.0000% | 1.8665% | |
| 2015/01/1-2015/03/31 | 0.8832% | 0.0114% | 0.0863% | 0.0000% | 0.7969% | |
| 2014/05/23-2015/03/31 | 2.9819% | 0.0092% | 0.3001% | 0.0000% | 2.6818% | |

注:基金收益分配是按日结转的。
华宝兴业活期通货币A

| 阶段 | 华宝兴业活期通货币A | | | | | |
|-----------------------|---------------|---------------|-------------------|---------|---------|--|
| | 净值收益率 标准差② | 净值收益率 标准差③ | 业绩比较基准收益率 标准差④ | ①-③ | ②-④ | |
| 2014/05/23-2014/12/31 | 2.2321% | 0.0083% | 0.2158% | 0.0000% | 2.0163% | |
| 2015/01/1-2015/03/31 | 0.9434% | 0.0114% | 0.0863% | 0.0000% | 0.8571% | |
| 2014/05/23-2015/03/31 | 3.1966% | 0.0092% | 0.3021% | 0.0000% | 2.8945% | |

注:基金收益分配是按日结转的。
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



注:1.本基金从原华宝兴业中短债50指数债券型证券投资基金转型而来,本基金合同生效于2014年5月21日,截止报告日本基金合同生效满一年。
2.按照基金合同的约定,自基金成立日后的6个月内达到规定的投资组合,截至2014年11月21日,本基金已达到合同约定的资产配置比例。

八、基金份额的申购和赎回
(一)申购和赎回场所
本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的方式办理基金基金份额的申购与赎回。
(二)申购和赎回的开放日及时间
投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。
基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或时间办理基金份额的申购或赎回或转换申请,投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,视为下一开放日的申购、赎回或转换申请。
(三)申购与赎回的原则
1、“确定价”原则,即申购、赎回价格以每份基金份额净值为1.00元的基准进行计算;
2、“金额申购”原则,即申购以金额申购,赎回以份额赎回;
3、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间内撤销;
4、基金份额持有人赎回时,除指定赎回外,基金管理人按“先进先出”的原则,对该持有人账户内该销售机构托管的基金份额进行处理,即登记确认日期在先的基金份额优先赎回,登记确认日期在后的基金份额后赎回。
5、基金管理人有权决定本基金的规模上限,但最迟应在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
6、基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(四)申购与赎回的费率
1.申购和赎回的申请方式
投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。
2.申购和赎回申请的确认
基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对交易的有效性进行确认,在T+2日(含)之前,投资人可在T+2日内(包括当日)向销售网点柜台或向销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。
3.申购和赎回的款项支付
投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购或赎回基金份额机构确认基金份额时,申购或赎回成功。
基金份额持有人递交赎回申请,赎回成功,基金份额登记机构确认赎回时,赎回成功。
投资人赎回申请成功后,基金管理人将在在法律法规规定的期限内支付赎回款项。正常情况下,投资人赎回(T日)申请成功后,基金管理人将指示基金托管人按有关规定将赎回款项于T+1日从基金托管账户划出,经销售机构划往基金份额持有人指定的银行账户。如遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响了业务流程,则赎回款项划付时间相应顺延。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。
(五)申购和赎回的数额限制
1.通过代销网点和直销网申申购本基金单笔最低金额为100元人民币,基金代销机构另有规定的,以基金代销机构的規定为准。通过直销柜台首次申购的最低金额为102元人民币,追加申购最低金额为100元人民币。代销网点的投资人转入直销柜台进行交易要受直销机构最低金额的限制。
投资人可多次申购,对单个投资人累计持有份额不设上限限制。
2.投资人分配的基金收益结转为基金份额时,不受最低申购金额的限制。
3.投资人可将其全部或部分基金份额赎回,单笔赎回份额不得少于100份,基金持有未赎回份额不足100份(含100份)的基金份额赎回时,基金管理人可将其全部基金份额一并赎回。
基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,赎回成功。
基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,赎回成功。
(六)申购和赎回的基金费用及其用途
投资人赎回申请成功后,基金管理人将在在法律法规规定的期限内支付赎回款项。正常情况下,投资人赎回(T日)