华宝兴业活期通货币市场基金

【2015】半年度报告摘要

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
送出日期:2015年8月28日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2015年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2015年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业活期通货币市场基金	
基金简称	华宝兴业活期通货币	
基金主代码	000643	
交易代码	000643	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年5月21日	
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	
报告期末基金份额总额	68,732,829.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T
下属分级基金的交易代码:	000643	240021
报告期末下属分级基金的份额总额	59,520,896.69份	9,211,932.95份

2.2 基金产品说明

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。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。 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 基金管理人将密切关注基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素,对投资组合的现金比例进行结构化管理。同时,也会通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金流,保持本基金的充分流动性。
业绩比较基准	人民币活期存款利率(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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	王永民
	联系电话	021-38505888	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588,021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	834,220.55	691,140.78
本期利润	834,220.55	691,140.78
本期净值收益率	1.8733%	1.9954%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末基金资产净值	59,520,896.69	9,211,932.95
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)	
累计净值收益率	3.9926%	4.2720%

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。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。

3、本基金收益分配按日结转份额。

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

华宝兴业活期通货币A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3315%	0.0257%	0.0288%	0.0000%	0.3027%	0.0257%
过去三个月	0.9815%	0.0196%	0.0873%	0.0000%	0.8942%	0.0196%
过去六个月	1.8733%	0.0160%	0.1736%	0.0000%	1.6997%	0.0160%
过去一年	3.6510%	0.0130%	0.3500%	0.0000%	3.3010%	0.0130%
自基金合同生效日起至今	3.9926%	0.0124%	0.3874%	0.0000%	3.6052%	0.0124%

华宝兴业活期通货币T

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3516%	0.0258%	0.0288%	0.0000%	0.3228%	0.0258%
过去三个月	1.0421%	0.0197%	0.0873%	0.0000%	0.9548%	0.0197%
过去六个月	1.9954%	0.0160%	0.1736%	0.0000%	1.8218%	0.0160%
过去一年	3.8995%	0.0130%	0.3500%	0.0000%	3.5495%	0.0130%
自基金合同生效日起至今	4.2720%	0.0123%	0.3893%	0.0000%	3.8827%	0.0123%

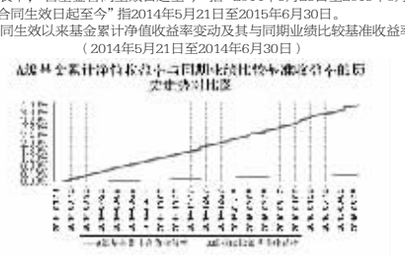
注:1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

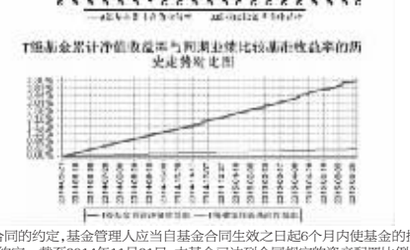
2、本基金业绩比较基准为:同期7天通知存款利率(税后)。

3、A类份额的表中,“自基金合同生效日起至今”指“2014年5月23日至2015年6月30日”;T类份额的表中,“自基金合同生效日起至今”指2014年5月21日至2015年6月30日。

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

(2014年5月21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2014年11月21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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2015年6月30 日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证100基金、上证180价值ETF、上证180价值ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证180成长ETF、上证180成长ETF联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业活期通货币市场基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向基金、华宝兴业新价值基金、华宝兴业新机遇基金、华宝兴业医疗分级基金、华宝兴业中证1000分级基金和华宝兴业万物互联基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计110,943,781,389.61元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王瑞海	固定收益部总经理、本基金基金经理、华宝兴业可转债债券基金经理	2014年2月19日	-	20年	硕士。曾在深圳中大投资管理公司、海南证券、北京营业部、太平人寿保险有限公司、太平资产管理有限公司从事投资管理,股票自营和固定收益投资研究工作。2012年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,任固定收益部总经理。2013年4月至2014年10月兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理,2014年2月至2014年5月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,2014年5月兼任华宝兴业活期通货币市场基金基金经理。2014年5月兼任华宝兴业可转债债券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、《华宝兴业活期通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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化,活期通货币市场基金在短期内出现过持有的现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于5%、存放具有基金托管资格的同一商业银行存款占基金资产净值比超过30%以及投资于同一公司发行的短期企业债券和短期融资券占基金资产净值比超过10%的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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,我司服务优选基金与事件驱动基金于6月11日对股票——尚荣医疗(002551)发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的5%。 发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同,且事件驱动基金处于建仓期进行买入,服务优选为实现收益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定, 同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度,不涉及利益输送行为。本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,央行多次降准、降息,虽然有其他方面因素的考虑,但应对资金外逃也是目的之一。从外贸数据来看,上半年一直是顺差,但外汇占款却是在减少。因此,央行强调中性货币政策是有道理的。

上半年基金自身的规模波动也较大,每当为应对投资者赎回而卖出债券时,都产生释放利润的效应,吸引了投资人大规模的申购。随后,由于规模被稀释,基金收益率降低,赎回又大规模袭来,因此规模波动很大。

为保持收益的平稳,进入第二季度后期,本基金逐渐减少了债券的投资,将存款和逆回购做为了主要的投资方向,并将组合的整体期限缩短,目的是在六月份收益率较高时,增加可投资的额度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

活期通A:本基金报告期内净值收益率为1.8733%,同期业绩比较基准收益率为0.1736%,业绩比较基准为人民币活期存款利率(税后)。

活期通T:本基金报告期内净值收益率为1.9954%,同期业绩比较基准收益率为0.1736%,业绩比较基准为人民币活期存款利率(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

六月份开始的股灾,对短期的资金市场造成很大的影响,避险资金逐渐聚集在短期资金的投资上,等待新的投资方向的出现。

对影响未来的利率走向,货币政策与财政政策的协调问题意义最为重要。从目前看,货币政策继续宽松的空间不大,而财政政策加码是必然的选择。长期债券的发行将会加大,资金利率特别是长端利率上行的可能性增加。

美元加息的时间逐渐临近,各类分析都认为资金外流对包括中国在内的新兴市场冲击不小。同时,国内资本市场维稳无疑也需要资金支持,如果资本市场动荡加剧,后果将更加严重。

综上所述,资金供给与需求将逐渐失去平衡,短端资金利率向上是大概率事件。本基金将继续以存款作为主要的投资方向,并根据市场情况适当进行逆回购投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中,公司内部参与估值流程的各方职责分工如下:

(一)、基金会计:根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算,并对基金投资品种进行估值。

(二)、量化投资部:对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下,根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法(比如:指数收益法)进行估值,并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

(三)、估值委员会:定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时,评价现有估值政策和程序的适用性。

(四)、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见, 但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式,每日计算当日收益并以红利再投资形式每日全额分配收益,每日分配的收益于分配次日按份额面值1.00元转入所有者权益。活期通A级基金在本年度累计分配收益834,220.55元, 其中以红利再投资方式结转入实收基金833,727.59元, 计入应付利润科目492.96元。活期通T级基金在本年度累计分配收益691,140.78元,其中以红利再投资方式结转入实收基金695,577.69元,计入应付利润科目-4,436.91元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对华宝兴业活期通货币市场基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核, 未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华宝兴业活期通货币市场基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		52,551,414.52	56,711,606.82
结算备付金		254,380.00	27,500.00
存出保证金		-	1,204.57
交易性金融资产		-	30,094,400.49
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	30,094,400.49
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		10,000,001.20	13,400,000.00
应收证券清算款		5,003,068.50	-
应收利息		113,572.41	1,127,632.12
应收股利		-	-
应收申购款		1,005,667.68	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		68,928,104.31	101,362,344.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	9,999,865.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,009.08	29,676.77
应付托管费		6,063.34	8,992.95
应付销售服务费		13,148.96	11,199.22
应付交易费用		1,070.75	2,456.79
应交税费		-	-
应付利息		-	1,666.34
应付利润		4,037.88	7,981.83
递延所得税负债		-	-
其他负债		150,944.66	319,000.00
负债合计		195,274.67	10,380,838.90
所有者权益:			
实收基金		68,732,829.64	90,981,505.10
未分配利润		-	-
所有者权益合计		68,732,829.64	90,981,505.10
负债和所有者权益总计		68,928,104.31	101,362,344.00

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额68,732,829.64份,其中A类基金份额59,520,896.69份,T类基金份额9,211,932.95份。

6.2 利润表

会计主体:华宝兴业活期通货币市场基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至2014年6月30日
一、收入		1,903,652.58	262,838.31
1.利息收入		1,706,100.50	262,857.54
其中:存款利息收入		1,062,631.48	228,799.15
债券利息收入		464,924.79	4,888.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		178,544.23	29,170.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		197,552.08	-19.23
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		197,552.08	-19.23
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
减:二、费用		378,291.25	62,090.95
1. 管理人报酬		141,025.28	19,162.08
2. 托管费		42,734.83	5,806.67
3. 销售服务费		66,688.18	12,125.65
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		30,642.64	-
其中:卖出回购金融资产支出		30,642.64	-
6. 其他费用		97,200.32	24,996.55
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,525,361.33	200,747.36
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,525,361.33	200,747.36

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业活期通货币市场基金

本报告期:2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	90,981,505.10	-	90,981,505.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,525,361.33	1,525,361.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-22,248,675.46	-	-22,248,675.46
其中:1.基金申购款	407,744,616.09	-	407,744,616.09
2.基金赎回款	-429,993,291.55	-	-429,993,291.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,525,361.33	-1,525,361.33
五、期末所有者权益(基金净值)	68,732,829.64	-	68,732,829.64
项目	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	10,223,123.18	-	10,223,123.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	200,747.36	200,747.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	96,031,461.23	-	96,031,461.23
其中:1.基金申购款	98,459,456.91	-	98,459,456.91
2.基金赎回款	-2,427,995.68	-	-2,427,995.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-200,747.36	-200,747.36
五、期末所有者权益(基金净值)	106,254,584.41	-	106,254,584.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____黄小薏_____ _____向辉_____ _____张幸骏_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业活期通货币市场基金(以下简称“本基金”)由华宝兴业中证短融50 指数债券型证券投资基金(以下简称“短融50基金”)转型而成。《关于华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金转型有关事项的议案》经短融50基金基金份额持有人大会决议通过,中国证券监督管理委员会于2014年5月13日下发《关于华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金份额持有人大会决议备案的回函》(证券基金机构监管部部函[2014]204号),短融50基金基金份额持有人大会决议生效。依据该基金份额持有人大会决议及本基金管理人于2014年3月24日发布的《华宝兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告 中附件四:《华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金转型方案说明书》的相关规定,本基金管理人已于2014年5月15日发布了《关于华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金份额折算的公告》, 并于2014年5月20日对原短融50基金进行了基金份额折算与变更登记,折算后短融50基金份额变更为华宝兴业活期通货币市场基金的T类基金份额。经与基金托管人中国银行股份有限公司确认, 短融50基金折算前基金份额净值为1.048元,基金份额总额为 9,751,688.62份,折算后基金份额净值为 1.000 元,基金份额总额为 10 ,223,123.18 份。

同时,根据《华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定,经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,基金管理人已将《华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金合同》、《华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金托管协议》修订为《华宝兴业活期通货币市场基金基金合同》、《华宝兴业活期通货币市场基金托管协议》, 并已报中国证监会备案。

《华宝兴业活期通货币市场基金基金合同》、《华宝兴业活期通货币市场基金托管协议》自原短融50基金折算日次日,即2014年5月21日起生效,原《华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金合同》、《华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。

根据《华宝兴业活期通货币市场基金基金合同》和《华宝兴业活期通货币市场基金招募说明书》的规定,本基金根据投资人持有基金份额的时间,分别设置A 类、T类两类基金份额,每类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用。本基金A 类基金份额开放申购和赎回业务。本基金A 类基金份额自申购确认之日起,该笔基金份额在该基金账户的持有时间达到90日时,该账户持有的该笔基金份额由A类基金份额自动升级为T类基金份额,T类基金份额不能直接申购。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业活期通货币市场基金基金合同》的有关规定,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年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;6、期限在1年以内(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年以内(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基金投资同业存单的,本基金可参与同业存单的投资,不需召开基金份额持有人大会,具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。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。

本基金的业绩比较基准为人民币活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则 - 基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业活期通货币市场基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况以及2015上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司(“宝钢集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝钢集团控制的公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	141,025.28	19,162.08
其中:支付销售机构的客户维护费	43,466.99	1,580.34

注:支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数.

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	42,734.83	5,806.67

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T	合计
华宝证券	1.04		1.04
中国银行	6,424.23	184.42	6,608.65
华宝兴业	7,017.28	1,328.16	8,345.44
合计	13,442.55	1,512.58	14,955.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T	合计
华宝兴业	12,009.67	64.54	12,074.21
中国银行	2.26	23.34	25.60
合计	12,011.93	87.88	12,099.81

注:1、支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给华宝兴业,再由华宝兴业计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额持有人和T类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率分别为0.25%和0.01%。其计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率 / 当年天数。6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T
期初持有的基金份额	0.00	50,604,241.22
期间申购/买入总份额	-	398,818.60
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	51,003,059.82
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

项目	上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	50,158,006.32	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	50,158,006.32	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.04%	0.00%

注:1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年5月21日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	7,651,414.52	25,592.15	7,884,616.22	3,057.03

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其