

4) 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

①以公允价值计量的金融工具

②公允价值计量使用的工具

③公允价值计量时公允价值具有重大意义的最低级别的输入值,公允价值层次可分为:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上(未调整的情况)可观察到的;第二层次:相同资产或负债在活跃市场以外的资产或负债的输入值;第三层次:相同资产或负债的输入值(非活跃市场报价的)可观察到的;第三层次中的市场报价以外的资产或负债的输入值

④公允价值以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值,不可观察输入值。

⑤以公允价值计量的金融工具,其公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,322,424,503.71 元,无属于第一或第二层次的余额 2011 年 12 月 31 日;第二层次 1,556,866,189.71 元,无属于第一或第三层次余额 2011 年 12 月 31 日。

⑥公允价值所属层级的重大变动

iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

98 投资组合报告			
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	1,322,224,503.71	40.98
	其中:债券	1,322,224,503.71	40.98
	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	1,851,317,855.54	57.38
4	其他各项资产	52,705,848.18	1.63
5	合计	3,226,248,207.43	100.00

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	1.61	
	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	191,099,502.75	6.30
	其中：卖式回购/融资融券		
注：报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例=报告期每个交易日债券融资余额占资产净值的简单平均值。			
3	报告期内公司总资产超过基金资产净值的20%的比例		
8.3	报告期内公司总资产超过基金资产净值的20%的比例		
8.3.1	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	140	
	报告期内投资组合平均剩余期限最高值	159	
	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超过180天情况说明		
	在本报告期内本基金的投资组合平均剩余期限未超过180天。		
8.3.2	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	0.72	6.30

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.32	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

3	60天(含)—90天	20.81	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.32	-
4	90天(含)—180天	58.06	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	23.42	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	105.33	6.30
8.4 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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	381,028,312.72	12.56
	其中：政策性金融债	381,028,312.72	12.56
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券		941,196,190.00	31.04	
6	中期票据		100,000,000.00		
7	其他				
8	合计		1,322,224,503.71	43.60	
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债务		131,095,826.86	4.32	
8.5 受限资产或保本/非保本资产管理计划/信托计划/未排名的资产管理/信托投资/资管					
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	120228	国开28	2,500,000	249,932,485.86	8.24
2	090407	09在07	1,000,000	109,679,385.87	3.32

3	041261027	12云铜股 CP001	900,000	90,074,888.24	2.97
---	-----------	----------------	---------	---------------	------

4	041260026	12东阳光 CP001	600,000	60,173,260.40	1.98
5	041253026	12东阳光 CP001	600,000	60,111,169.68	1.98
6	041254036	12蒙东 CP002	500,000	50,067,461.58	1.65
7	041262027	12云铜 CP001	500,000	50,040,003.08	1.65
8	041269033	12碧水源 CP001	500,000	50,027,059.93	1.65

9	041251005	12百联集 CP001	400,000	40,273,509.70	1.33
		12王些			

10	4125162023	CP002	400,000	40,054,643.54	1.32
8.7 定义“公允价值”和“公允价值”确定的基金资产净值的项目					
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)~0.5%间的次数				偏离情况	
报告期内偏离度的最高值				43	
报告期内偏离度的最低值				0.1449%	
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值				-0.0406%	
8.8 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				0.1442%	
和基金管理人未持有资产支持证券					
8.8 投资组合报告附注					

8.8.2 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公允价值20%的情况。

8.8.4 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额	单位:人民币元
1	存出保证金	-	
2	应收证券清算款	20,618,403.84	
3	应收利息	30,763,558.87	
4	应收申购款	1,323,885.47	
5	其他应收款	-	
6	待摊费用	-	
7	其他	-	
8	合计	52,705,848.18	

			持有人结构
--	--	--	-------

类别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏 兴业 聚宝 聚宝 正A	6,901	130,790.87	32,729,418.25	3.63%	869,858,401.36	96.37%
华夏 兴业 聚宝 聚宝 正B	102	20,881,427.88	1,583,001,289.95	74.32%	546,904,353.37	25.68%
合计	7,003	433,027.77	1,615,708,708.20	53.28%	1,416,762,754.73	46.72%

9.2 期末基金管理人从从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人固有资金	华宝兴业现金宝货币A	10,521,725.70	1.1657%

基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝兴业现金宝货币B	0.00	0.0000%
	合计	10,521.72570	0.3470%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间：100万份以上；
2、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间：0至10万份；
附：数量区间为0.0至10万份 含>10万份至50万份 含>50万份至100万份 含>100万份以上。
\$10 开放式基金金额变动

	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
基金合同生效日(2005年3月31日)基金份额总额	1,253,872,199.53	1,060,572,248.00

本报告期期初基金份额总额	617,704,111.34	4,054,172,889.16
本报告期基金总申购份额	7,502,290,877.56	16,943,017,357.82
减：本报告期基金总赎回份额	7,217,407,169.29	18,867,284,603.66

本报告期基金拆分变动总额		
本报告期末基金份额总额	902,587,819.61	2,129,905,643.32
注：总份额指报告期内拆伙、份额赎回和转入份额；总赎回指报告期内份额赎回、转出份额。		
§11 重大风险提示		
<p>11.1 基金份额持有人大会决议</p> <p>本基金基金份额持有人大会决议事项如下：</p> <p>11.2 基金份额持有人大会决议事项对基金财产和基金份额持有人的重大不利影响</p> <p>2022年11月15日，经基金份额持有人大会决议，聘任杨希君为华国鑫源设计投资管理（香港）有限公司董事兼首席运营官，其任职资格已经中国证监会核准注册，符合《基金法》、《基金运作办法》、《基金销售管理办法》和《基金管理人信息披露管理办法》的有关规定，其任职资格已报中国证监会核准注册，符合《2021-1036号》。</p> <p>11.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼</p> <p>报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。</p> <p>11.4 基金投资策略的重大变化</p> <p>本基金的投资策略在报告期内未发生变更。</p>		

基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况；
本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚的情况。

11.7	基金利用证券公司交易单元的具体情况					
11.7.1	基金利用证券公司交易单元进行股票投资及基金支付情况					金额单位：人民币元
券商名称	基金单元数量	股票交易 成交金额	占股票总额 成交总额的比例	应付该券商的佣金	占佣金总额 佣金的比例	备注
光大证券	1	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	

注：1.基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：1)选择标准：实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示经营稳健；经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为受到中国证监会和中国证券业协会处罚；有中国证监会核准的全国证券经纪业务资格；具有较强的证券研究能力；积极完善服务网络，能够及时、准确、全面地向基金管理人提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；当地市场的辐射能力。

2.本基金交易单元无发生变化。

3.确定各选交易单元：a)确定；

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况		金额单位：人民币元	
	债券交易	债券回购交易	权证交易
		上中期债	

券商名称	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例	成交金额	占当期权证 成交总额 的比例
光大证券	--	--	--	--	--	--
中信建投	--	--	--	--	--	--
118、本期绝对值超过0.5%的情况						
基本本报告期内不存在偏度绝对值超过0.5%的情况						
62、报告期内公司买卖股票的其他重要信息						
1、2012年1月16日，授予人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞职的公告，自2012年1月16日起：王洪军先生就任董事长。因此，公司于2012年1月16日起变更了董事。						
2、2012年11月15日，根据工作需要，中国建设银行投资托管部更名为投资托管业务部。						
华宝兴业基金管理有限公司						2013年3月27
