华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

2013 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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年3月31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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2013年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业现金添益交易型货币市场基金
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
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
报告期末基金份额总额	55,354,185.17份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-01-28

注:本基金份额净值为100元。

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。 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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588 ,021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告报告备置地点	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年12月27日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	122,067,709.50	898,931.56
本期利润	122,067,709.50	898,931.56
本期净值收益率	3.7382%	0.0499%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末基金资产净值	5,535,418,516.79	1,803,310,821.23
期末基金份额净值	100.0000	100.0000
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末
累计净值收益率	3.7899%	0.0499%

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

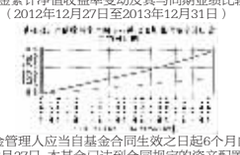
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1621%	0.0017%	0.3403%	0.0000%	0.8218%	0.0017%
过去六个月	2.0843%	0.0023%	0.6805%	0.0000%	1.4038%	0.0023%
过去一年	3.7382%	0.0026%	1.3500%	0.0000%	2.3882%	0.0026%
自基金合同生效日起至今	3.7899%	0.0026%	1.3684%	0.0000%	2.4215%	0.0026%

注:1、本基金业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

2、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)。

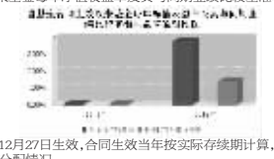
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2012年12月27日至2013年12月31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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2012年12月27日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2013	121,364,916.84	-	702,792.66	122,067,709.50	
2012	682,821.23	-	216,110.33	898,931.56	
合计	122,047,738.07	-	918,902.99	122,966,641.06	

§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(2013年12月31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、华宝短融50基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金和华宝兴业服务优选基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计42,053,592,319.43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		
陈昕	本基金基金经理、华宝兴业现金宝货币基金经理、华宝兴业中证短融50债券基金基金经理	2012年12月27日	-	9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月起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。
谈云飞	本基金基金经理助理、华宝兴业现金宝货币基金经理助理、华宝兴业中证短融50债券基金基金经理助理	2013年4月8日	-	8年	金融学硕士,CFA,2005年1月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任机构理财部研究员、机构投资部投资经理,固定收益部分析师,2013年4月起任华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业中证短融50债券型证券投资基金和华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理助理。

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。

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,现金添益交易型货币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%、存放在具有托管资格的同一商业银行存款占净值比超过30%、存放在不具有托管资格的同一商业银行存款占净值比超过5%、组合平均剩余期限超过120天的情况。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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面,公司使用统一的投资研究管理系统,并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时,该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面,投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立,并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面,所有投资组合的投指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易,交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序,由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令,公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时,公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制,主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督,公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督,主要监督的事项包括以下内容。

1)每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行1日、3日、5日同向交易价差分析。

3)对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点,同一投资组合短期内对同一债券的反向交易,债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异,回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4)对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2013年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法,确保了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。公司内部制定的公平交易制度涵盖的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

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,分析了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;并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(1日、3日、5日)同向交易的样本,对其进行95%置信区间下的假设检验分析,同时结合各组合的成交金额,并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析结果未发现异常情况。

4.3.3 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 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

2013年,中国货币市场和债券市场经历较大波动。6月底的钱荒,是中国货币基金诞生以来最大的挑战,此后货币市场在三季度有短暂的缓和,但进入四季度之后,回购利率逐步抬升,居高不下,利率债和信用债收益率均大幅走高、金融债收益率创历史新高。本轮债券的下跌,跟经济基本面和通胀关系并不大,更重要的原因是在利率市场化大背景下,银行等债市主要配置机构的负债成本居高不下,导致在资产配置上抛弃低收益的债券品种。在业绩压力下,银行还在增加高收益的同业资产配置,降低债券配置。而这导致的另一个结果是银行同业存款利率水平居高不下,同业存款是货币基金的重要配置资产,这有利于货币基金收益率的提升。本基金在2季度起主动降低了利率债和信用债的仓位,降低债券久期,用较高仓位配置于同业存款,获得了较高收益,并且在同业存款期限安排上充分考虑基金的流动性。

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3.7382%,同期业绩比较基准收益率为1.3500%,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

当前国内经济运行稳中偏弱,经济增长数据尚处于政府容忍范围之内,但趋势不容乐观。金融资产膨胀、企业和政府杠杆高企,资产泡沫化,蕴含了较大的金融风险,也阻止了央行通过放松货币信贷来提升经济的传统路径。中央经济工作会议指出,继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策,保持货币信贷及社会融资规模合理增长,要着力防控债务风险,要把控制和化解地方政府性债务风险作为经济工作的重要任务。央行的货币政策已经比较明确,将通过偏紧的资金面迫使金融体系主动降低杠杆,促进实体经济调结构。美国QE退出已经明确,国内经济弱化可能导致资金外流,可以预见未来较长时间资金面情况不乐观,这不利于长期限金融资产的表现。短端利率高企虽然有利于货币基金的短久期资产配置,但资金紧张的局面给货币基金的流动性管理也带来前所未有的考验。

本基金目前仍将致力于做好流动性管理,防范可能出现的结构性资金紧张情况,控制好组合的剩余期限,在此基础上,抓住关键时点做好资产配置。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自2003年3月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

(一)规范员工行为操守,加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式,明确员工的行为准则,防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训,努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

(二)完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性,不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监,每个人都必须清楚自己的权力和职责,承担相应责任。另一方面,伴随市场变革和产品创新,公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中,公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验,在符合公司基本制度的前提下,根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程,涉及其它部门或领域的,由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则,并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

(三)有重点地全面开展内部审计稽核工作。2013年,监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计,加强了防控内幕交易等行为的稽核力度;并与相关部门进行沟通,形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环,不断提高工作质量。

在今后的工作中,本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念,完善内控制度,提高工作水平,努力防范和控制各种风险,保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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100元固定份额净值申购赎回,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转入所有者权益。华宝添益基金在本年度累计分配收益 122,067,709.50元,其中以红利再投资方式结转入实收基金 121,364,916.84 元,计入应付利润科目 702,792.66 元。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为122,067,709.50元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		3,240,676,176.35	1,802,626,437.00
结算备付金		255,526,000.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		869,239,837.44	-
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		869,239,837.44	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		1,400,882,730.83	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		28,773,811.56	1,036,432.48
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		5,795,098,556.18	1,803,662,869.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		-	-
应付证券清算款		256,000,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,243,699.33	68,954.02
应付托管费		319,808.37	17,731.03
应付销售服务费		888,356.66	49,252.87
应付交易费用		20,272.04	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		918,902.99	216,110.33
递延所得税负债		-	-
其他负债		289,000.00	-
负债合计		259,680,039.39	352,048.25
所有者权益:			
实收基金		5,535,418,516.79	1,803,310,821.23
未分配利润		-	-
所有者权益合计		5,535,418,516.79	1,803,310,821.23
负债和所有者权益总计		5,795,098,556.18	1,803,662,869.48

注:

1. 报告截止日2013年12月31日,基金份额净值100元,基金份额总额55,354,185.17份。于2012年12月31日,基金份额净值100元,基金份额总额18,033,108.21份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年12月27日(基金合同生效日) 至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年12月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入		148,678,949.27	1,036,432.48
1.利息收入		146,959,474.96	1,036,432.48
其中:存款利息收入		106,700,567.04	1,036,432.48
债券利息收入		32,618,305.96	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,640,601.96	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,719,474.31	-
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,719,474.31	-
资产支持证券投资收益		-	-
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		26,611,239.77	137,500.92
1.管理人报酬		11,762,053.62	68,954.02
2.托管费		3,024,528.06	17,731.03
3.销售服务费		8,401,467.01	49,252.87
4.交易费用		-	-
5.利息支出		2,987,722.47	-
其中:卖出回购金融资产支出		2,987,722.47	-
6.其他费用		435,468.61	1,563.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		122,067,709.50	898,931.56
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		122,067,709.50	898,931.56

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31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)	1,803,310,821.23	-	1,803,310,821.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	122,067,709.50	122,067,709.50
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)	3,732,107,695.56	-	3,732,107,695.56
其中:1.基金申购款	16,314,889,916.84	-	16,314,889,916.84
2.基金赎回款	-12,582,782,221.28	-	-12,582,782,221.28
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)	-	-122,067,709.50	-122,067,709.50
五、期末所有者权益(基金净值)	5,535,418,516.79	-	5,535,418,516.79

项目	上年度可比期间 2012年12月27日(基金合同生效日)至2012年12月31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)	1,802,628,000.00	-	1,802,628,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	898,931.56	898,931.56
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)	682,821.23	-	682,821.23
其中:1.基金申购款	682,821.23	-	682,821.23
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-898,931.56	-898,931.56
五、期末所有者权益(基金净值)	1,803,310,821.23	-	1,803,310,821.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

黄小慧 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]1651号《关于核准华宝兴业现金添益交易型货币市场基金募集的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,802,628,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第546号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》于2012年12月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为18,026,280.00份基金份额。本基金有效认购资金在募集期间产生的利息在银行结息日计入基金资产。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业现金添益交易型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现金;通知存款;短期融资券;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;期限在1年以内(含1年)的债券回购;剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;期限在1年以内(含1年)的中央银行票据;剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据以及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。

经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证基字[2013]17号审核同意,本基金18,026,280.00份基金份额于2013年1月28日在上交所挂牌交易。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于2014年3月27日批准报出。

7.4.2 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》、《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度和2012年12月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间 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2013年12月31日和2012年12月31日的财务状况以及2013年度和2012年12月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年12月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,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;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致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,基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为100.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有申购当日的分红权益,而赎回的基金份额享有赎回当日的分红权益。买入的基金份额自享有买入当日的分红权益,而卖出的基金不享有卖出当日的分红权益。本基金以份额面值100.00元固定份额净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配结转至投资人基金账户。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.