（上接B367版）

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

6.2 转型后：华宝兴业活期通货币市场基金

6.2.1.1 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：2014年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日
资 产：		
银行存款		97,884,616.22
结算备付金		370,000.00
存出保证金		0.00
交易性金融资产		5,806,435.25
其中：股票投资		0.00
基金投资		0.00
债券投资		5,806,435.25
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		8,600,000.00
应收证券清算款		0.00
应收利息		406,210.58
应收股利		0.00
应收申购款		3,800.00
递延所得税资产		0.00
其他资产		-
资产总计		113,071,062.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30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		6,543,483.13
应付赎回款		-
应付管理人报酬		15,976.93
应付托管费		4,841.49
应付销售服务费		10,383.26
应付交易费用		973.66
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		11,597.02
递延所得税负债		-
其他负债		229,222.15
负债合计		6,816,477.64
所有者权益：		
实收基金		106,254,584.41
未分配利润		-
所有者权益合计		106,254,584.41
负债和所有者权益总计		113,071,062.05

注：1、报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.00元，基金份额总额 106,254,584.41 份，其中A类基金份额98,277,115.27份，T类基金份额7,977,469.14份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2014年5月21日(转型日，即新基金合同生效日)至2014年6月30日。

6.2.2利润表

会计主体：华宝兴业活期通货币市场基金

本报告期：2014年5月21日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年5月21日至2014年6月30日
一、收入		262,838.31
1.利息收入		262,857.54
其中：存款利息收入		228,799.15
债券利息收入		4,888.01
资产支持证券利息收入		0.00
买入返售金融资产收入		29,170.38
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-19.23
其中：股票投资收益		0.00
基金投资收益		0.00
债券投资收益		-19.23
资产支持证券投资收益		0.00
贵金属投资收益		0.00
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)		0.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		0.00
5.其他收入(损失以"-"号填列)		0.00
减：二、费用		62,090.95
1.管理人报酬		19,162.08
2.托管费		5,806.67
3.销售服务费		12,125.65
4.交易费用		0.00
5.利息支出		0.00
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		24,996.55
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		200,747.36
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		200,747.36

6.2.3 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：2014年5月21日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月21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	0.00	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	0.00	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	0.00	106,254,584.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4 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

6.2.4 报表附注

6.2.5 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）。

6.2.4.2 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。

6.2.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014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2014年6月30日的财务状况以及2014年5月21日（转型日） 至2014年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.2.4.4重要会计政策和会计估计

6.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.2.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.2.4.4.3 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。

6.2.4.4.4 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。

6.2.4.4.5 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，如估值日无交易日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。

6.2.4.4.6 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。

6.2.4.4.7 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1.00元。

6.2.4.4.8 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。

6.2.4.4.9 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。

6.2.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每一类别的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。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。

6.2.4.4.11 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。

6.2.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.2.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.2.4.6 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。

6.4.2.7关联方关系

6.2.4.7.1 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。

6.2.4.7.2 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。

6.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的交易。

6.2.4.8.2 关联方报酬

6.2.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月21日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,162.08
其中：支付销售机构的客户维护费	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.

6.2.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月21日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	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。

6.2.4.8.2.3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 2014年5月21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	2.62	23.34	25.96
合计	12,012.29	87.88	12,100.17

6.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.8.4.1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 2014年5月21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
基金合同生效日(2014年5月21日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
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	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	51.04%	-

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。

6.2.4.8.4.2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

本报告期末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.2.4.8.5 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 2014年5月21日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	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。

6.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.2.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.2.4.9 期末（ 2014年6月30日 ）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.2.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

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。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具以公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：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)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014年6月30日，本基金持有的以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级的余额为5,806,435.25元，无属于第一或第三层级的余额。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

无。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1转型前：华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金

（报告期：2014年1月1日至2014年5月20日（转型前的最后一日））

7.1.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
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	-	-
	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	10,391,615.33	99.51
7	其他各项资产	50,727.27	0.49
8	合计	10,442,342.60	100.00

注：上表为本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）的基金资产组合情况。

7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）未持有股票投资。

7.1.3 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

本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）未持有股票投资。

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期（2014年1月1日至5月20日）无股票投资。

7.1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期（2014年1月1日至5月20日）无股票投资。

7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期（2014年1月1日至5月20日）无股票投资。

7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）未持有债券投资。

7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）未持有债券投资。

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）未持有资产支持证券投资。

7.1.8 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贵金属投资明细

本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）未持有贵金属投资。

7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）未持有权证投资。

7.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.10.1本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.1.10.2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。

7.1.10.3本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.1.11 投资组合报告附注

7.1.11.1

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。

7.1.11.2

本基金不投资股票。

7.1.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,024.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	47,702.84
8	其他	-
9	合计	50,727.27

注：上表为本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）的其他各项资产构成。

7.1.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）未持有处于转股期的可转换债券。

7.1.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金在转型前的最后一日（2014年5月20日）未持有股票投资。

7.2 转型后：华宝兴业活期通货币市场基金

（报告期：2014年5月21日（转型日）至2014年6月30日）

7.2.1 期末基金资产组合情况

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	5,806,435.25	5.14
	其中：债券	5,806,435.25	5.14
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	8,600,000.00	7.61
	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	98,254,616.22	86.90
4	其他各项资产	410,010.58	0.36
5	合计	113,071,062.05	100.00

7.2.2 债券回购融资情况

本报告期内本基金未发生债券回购融资.

7.2.3 基金投资组合平均剩余期限

7.2.3.1 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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同规定"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。

7.2.3.2 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	65.65	6.16
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	9.41	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	30.97	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.03	6.16

7.2.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,806,435.25	5.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	5,806,435.25	5.46
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.2.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	019322	13国债22	29,000	2,909,283.14	2.74
2	019314	13国债14	28,970	2,897,152.11	2.73

7.2.6 "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	0.0059%
报告期内偏离度的最低值	-0.0024%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0010%

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

7.2.8 投资组合报告附注

7.2.8.8

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。

7.2.8.9

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。

7.2.8.10

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。

7.2.8.11 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	406,210.58
4	应收申购款	3,800.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	410,010.58

§8 基金份额持有人信息

8.1 转型前：华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金

（8.1.1至8.1.3的"期末"指转型前的最后一日（2014年5月20日））

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		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
374	26,074.03	-	-	9,751,688.62	100.00%

8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.2 转型后：华宝兴业活期通货币市场基金

（8.2.1至8.2.3的"期末"指报告期末2014年6月30日）

8.2.4 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			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
华宝兴业活期通货币A	48	2,047,439.90	98,158,006.62	99.88%	119,108.65	0.12%
华宝兴业活期通货币T	333	23,956.36	0.00	0.00%	7,977,469.14	100.00%
合计	381	278,883.42	98,158,006.62	92.38%	8,096,577.79	7.62%

8.2.5 期末基金管理人的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
基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝兴业活期通货币A	1,504.49	0.0015%
	华宝兴业活期通货币T	-	-
	合计	1,504.49	0.0014%

8.2.6 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝兴业活期通货币A	0
	华宝兴业活期通货币T	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝兴业活期通货币A	0
	华宝兴业活期通货币T	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

9.1转型前：华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金

（报告期：2014年1月1日至5月20日）

单位：份

基金合同生效日（2012年6月12日）基金份额总额	1,823,227,424.79
本报告期期初基金份额总额	16,091,250.25
报告期期间基金总申购份额	19,691,220.40
减:报告期期间基金总赎回份额	26,030,782.03
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,751,688.62

注 ：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

9.2转型后：华宝兴业活期通货币市场基金

（报告期：2014年5月21日至6月30日）

单位：份

	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T
基金合同生效日(2014年5月21日)基金份额总额	-	10,223,123.18
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	98,428,616.77	30,840.14
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	151,501.50	2,276,494.18
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	98,277,115.27	7,977,469.14

注：总申购份额含红利再投。

§10 重大事件揭示

10.1基金份额持有