华宝兴业现金宝货币市场基金

【2015】第一季度报告

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
报告送出日期:2015年4月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2015年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业现金宝货币		
基金主代码	240006		
交易代码	240006		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2005年3月31日		
报告期末基金份额总额	1,919,385,892.38份		
投资目标	保持本金的安全性与流动性,追求高于比较基准的收益率。		
投资策略	以对宏观经济及利率走势的判断为基础,在满足组合平均久期、收益性以及信用等级的前提下利用现代金融分析方法和工具,优化组合配置效果,实现组合增值。		
业绩比较基准	同期7天通知存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B	华宝兴业现金宝货币E
下属分级基金的交易代码	240006	240007	000678
报告期末下属分级基金的份额总额	270,157,407.62份	43,989,956.07份	1,605,238,528.69份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)		
	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B	华宝兴业现金宝货币E
1. 本期已实现收益	3,155,603.27	2,677,309.22	25,436,326.13
2.本期利润	3,155,603.27	2,677,309.22	25,436,326.13
3.期末基金资产净值	270,157,407.62	43,989,956.07	1,605,238,528.69

注:1、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。

2.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

华宝兴业现金宝货币A

阶段	净值收益率①	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	1.0907%	0.0078%	0.3329%	0.0000%	0.7578%	0.0078%

注:基金收益分配是按日结转份额。

华宝兴业现金宝货币B

阶段	净值收益率①	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	1.1506%	0.0078%	0.3329%	0.0000%	0.8177%	0.0078%

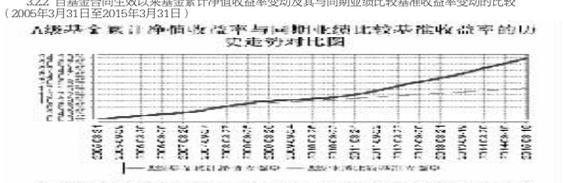
注:基金收益分配是按日结转份额。

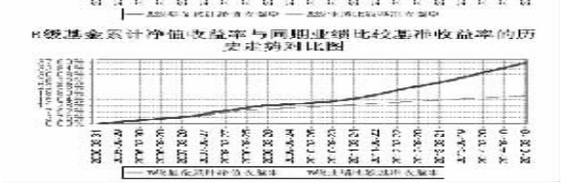
华宝兴业现金宝货币E

阶段	净值收益率①	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	1.1507%	0.0078%	0.3329%	0.0000%	0.8178%	0.0078%

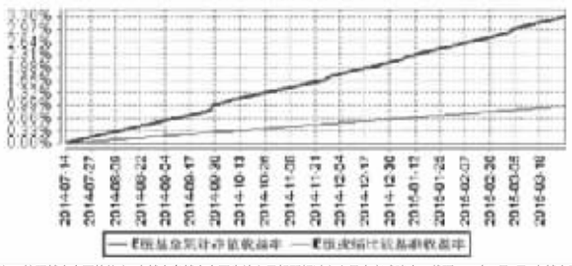
注:基金收益分配是按日结转份额。

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(2005年3月31日至2015年3月31日)





E级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1.按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至2005年4月7日,本基金已根据基金合同规定完成建仓,资产配置比例符合基金合同约定。

2. 华宝兴业现金宝E成立于2014年7月14日,本报告中其累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图的数据的计算起始日期为2014年7月14日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、华宝添益基金经理	2011年11月15日	-	11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月至2014年2月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。

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《证券从业从人员资格管理办法》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》、《华宝兴业现金宝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,现金宝货币市场基金在短期内出现过持有未到期融资占基金资产净值比超过20%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 公平交易专项说明

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,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 投资组合报告附注

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度市场流动性整体平稳,央行于2月4日宣布下调存款准备金率0.5%,并同时对小微企业贷款占比达标的城商行、非县域农商行额外降准0.5%,对中国农发银行额外降准4%,释放流动性约6400亿元。春节后,央行又紧接着宣布降息,于3月1日起下调金融机构存贷款基准利率0.25%。货币政策接连调整,表明国内宏观经济依旧在底部徘徊,政策托底的意愿较强,实体融资成本下降亦需靠政策加码推进。市场收益率水平波动较大,受降息影响收益率一度探至低位,后期由于投资者担心供给增加收益率出现快速反弹,整体呈现先下后上走势,市场情绪由强转弱。本基金在报告期内,延续了四季度的资产配置思路,维持中高等级信用债配比,并适当缩短平均组合的剩余期限,整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

现金宝A:本基金报告期内净值收益率为1.0907%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%,业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)。

现金宝B:本基金报告期内净值收益率为1.1506%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%,业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)。

现金宝E:本基金报告期内净值收益率为1.1507%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%,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

展望二季度,国内宏观经济短期内仍将维持在低位运行,政策暖风频吹为经济托底提供坚实基础,亚投行的成立、"一带一路"的深入、房贷新政的推出都对经济给加呵护,货币政策方面,总体维持相对宽松的判断,不排除二季度继续降准、降息的可能性。二季度随着利率产品供给的增加,收益率较难出现趋势性下行的机会。股市火爆对资金的吸引,使得商业银行存款流失的压力在进一步加强,同业存款需求将维持在较高水平。在此背景下,维持同业存款较高占比是比较明智的选择。本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则,兼顾组合的安全性和流动性,平衡配置各类资产,为投资者谋取稳定回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	960,555,439.81	45.88
	其中:债券	960,555,439.81	45.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	75,500,313.25	3.61
	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	1,009,992,611.99	48.24
4	其他资产	47,802,589.04	2.28
5	合计	2,093,850,954.09	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	6.19
	其中:买断式回购融资	0.00
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	172,999,513.50 / 9.01
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2015年3月11日	21.16	巨额赎回	两个工作日
2	2015年3月12日	20.38	巨额赎回	两个工作日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	73
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180 天。

5.3.2 报告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(%)	各期负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	28.21	9.01
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	20.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	17.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.58	-
4	90天(含)-180天	39.62	-
	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		106.60	9.01

5.4 报告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(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	220,127,968.62	11.47
	其中:政策性金融债	220,127,968.62	11.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	740,427,471.19	38.58
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	960,555,439.81	50.04
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,274,570.97	1.58

5.5 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	140430	14农发30	1,200,000	120,005,996.18	6.25
2	041462028	14南山集CP002	1,000,000	100,470,106.56	5.23
3	011499031	14阳泉SCP002	1,000,000	100,008,682.90	5.21
4	011499041	14徐工SCP002	900,000	89,986,564.55	4.69
5	140444	14农发44	500,000	50,020,730.78	2.61
6	041453093	14北部湾CP003	500,000	50,003,836.30	2.61
7	041461051	14悦达CP002	500,000	50,000,067.76	2.61
8	041457003	14厦国资CP001	500,000	49,993,820.74	2.60
9	011499004	14新兴际华SCP001	500,000	49,993,264.21	2.60
10	041469046	14张江CP001	500,000	49,986,682.60	2.60

5.6 "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	0.2386%
报告期内偏离度的最低值	0.0873%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1710%

5.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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法进行摊销,每日计提收益。

5.8.2

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基金资产净值20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 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	29,052,091.59
4	应收申购款	18,750,497.45
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	47,802,589.04

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B	华宝兴业现金宝货币E
报告期期初基金份额总额	331,093,730.67	585,788,659.38	3,346,725,559.40
报告期期间基金总申购份额	397,094,925.30	566,654,459.91	2,131,936,546.15
减:报告期期间基金总赎回份额	458,031,248.35	1,108,453,163.22	3,873,423,576.86
报告期期末基金份额总额	270,157,407.62	43,989,956.07	1,605,238,528.69

注:总申购份额含份额级别调整、转换入份额和红利再投;总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同;

华宝兴业现金宝货币市场基金招募说明书;

华宝兴业现金宝货币市场基金托管协议;

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;

基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

8.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2015年4月21日

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

【2015】第一季度报告

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
报告送出日期:2015年4月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2015年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝添益
场内简称	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
报告期末基金份额总额	345,719,320.29份
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水平行移动调整资产组合,将短期到的变动资本化,配置获得投资收益。 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.新利策略:基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下,适当参与市场的新利,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价格带来的收益。 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。
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

注:本基金份额净值为100元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1. 本期已实现收益	262,673,821.38
2.本期利润	262,673,821.38
3.期末基金资产净值	34,571,932,029.34

注:1.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。

2.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。

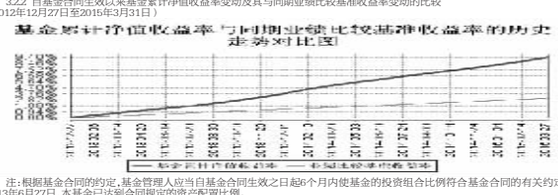
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值收益率①	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	1.0770%	0.0025%	0.3329%	0.0000%	0.7441%	0.0025%

注:基金收益分配是按日结转份额。

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2015年3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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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市场基金经理	2012年12月27日	-	11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月至2014年2月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。

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《证券从业从人员资格管理办法》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。

4.3 公平交易专项说明

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,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度市场流动性整体平稳,央行于2月4日宣布下调存款准备金率0.5%,并同时对小微企业贷款占比达标的城商行、非县域农商行额外降准0.5%,对中国农发银行额外降准4%,释放流动性约6400亿元。春节后,央行又紧接着宣布降息,于3月1日起下调金融机构存贷款基准利率0.25%。货币政策接连调整,表明国内宏观经济依旧在底部徘徊,政策托底的意愿较强,实体融资成本下降亦需靠政策加码推进。市场收益率水平波动较大,受降息影响收益率一度探至低位,后期由于投资者担心供给增加收益率出现快速反弹,整体呈现先下后上走势,市场情绪由强转弱。本基金在报告期内,延续了四季度的资产配置思路,维持中高等级信用债配比,并适当缩短平均组合的剩余期限,整体运行平稳。

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1.0770%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%,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

展望二季度,国内宏观经济短期内仍将维持在低位运行,政策暖风频吹为经济托底提供坚实基础,亚投行的成立、"一带一路"的深入、房贷新政的推出都对经济给加呵护,货币政策方面,总体维持相对宽松的判断,不排除二季度继续降准、降息的可能性。二季度随着利率产品供给的增加,收益率较难出现趋势性下行的机会。股市火爆对资金的吸引,使得商业银行存款流失的压力在进一步加强,同业存款需求将维持在较高水平。在此背景下,维持同业存款较高占比是比较明智的选择。本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则,兼顾组合的安全性和流动性,平衡配置各类资产,为投资者谋取稳定回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	10,227,254,855.15	29.50
	其中:债券	10,227,254,855.15	29.50
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,617,694,746.52	16.21
	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	18,506,691,248.56	53.39
4	其他资产	313,702,439.33	0.90
5	合计	34,665,343,289.56	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	1.29
	其中:买断式回购融资	0.00
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 / 71,779,844.11	0.21
	其中:买断式回购融资 / -	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	73
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"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。

5.3.2 报告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(%)	各期负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	36.31	0.21
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	17.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	23.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	11.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	10.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.36	0.21

5.4 报告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(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	2,492,898,715.96	7.21
	其中:政策性金融债	2,492,898,715.96	7.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	7,734,356,139.19	22.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	10,227,254,855.15	29.58
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 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	041453047	14武钢CP001	6,600,000	660,996,299.27	1.91
2	140327	14进出27	3,500,000	350,045,472.56	1.01
3	011574001	15陕煤化SCP001	3,000,000	299,957,466.65	0.87
4	140230	14国开30	2,700,000	269,052,337.66	0.78
5	140213	14国开13	2,600,000	259,728,158.85	0.75
6	011599101	15华地铁SCP001	2,500,000	249,841,109.99	0.72
7	140430	14农发30	2,200,000	220,009,709.86	0.64
8	140377	14进出77	2,200,000	218,570,264.77	0.63
9	011574002	15陕煤化SCP002	2,100,000	210,073,033.05	0.61
10	140437	14农发37	2,000,000	199,995,780.23	0.58

5.6 "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	0.1977%
报告期内偏离度的最低值	0.0626%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1242%

5.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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法进行摊销,每日计提收益。

5.8.2

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基金资产净值20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 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	436.73
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	313,702,439.33

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	205,795,522.20
报告期期间基金总申购份额	279,193,212.12
减:报告期期间基金总赎回份额	139,269,414.03
报告期期末基金份额总额	345,719,320.29

注:本基金基金合同生效于2012年12月27日,本基金的份额折算日为基金合同生效当日。折算后基金份额净值为100元。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	分红再投资	2015年1月5日	609.00	0.00	-
2	分红再投资	2015年1月6日	122.00	0.00	-
3	二级市场卖出	2015年1月7日	-1,039,014.00	-103,899,281.89	-
4	分红再投资	2015年1月7日	112.00	0.00	-
5	二级市场买入	2015年1月8日	8,743.00	874,265.03	-
6	分红再投资	2015年1月9日	1.00	0.00	-
7	二级市场买入	2015年1月12日	569,387.00	56,917,233.95	-
8	二级市场卖出	2015年1月12日	-338,856.00	-33,878,997.78	-
9	分红再投资	2015年1月12日	3.00	0.00	-
10	二级市场买入	2015年1月13日	100,000.00	9,996,000.00	-
11	二级市场卖出	2015年1月13日	-339,390.00	-33,935,064.88	-
12	分红再投资	2015年1月13日	26.00	0.00	-
13	申购	2015年1月14日	539,502.00	53,950,200.00	-
14	申购	2015年1月15日	500,079.00	50,007,900.00	-
15	二级市场卖出	2015年1月16日	-539,528.00	-53,964,669.62	-
16	分红再投资	2015年1月16日	60.00	0.00	-
17	申购	2015年1月16日	510,077.00	51,007,700.00	-
18	二级市场卖出	2015年1月19日	-500,139.00	-50,018,901.25	-
19	分红再投资	2015年1月19日	174.00	0.00	-
20	申购	2015年1月19日	429,747.00	42,974,700.00	-
21	二级市场卖出	2015年1月20日	-510,251.00	-51,031,633.31	-
22	分红再投资	2015年1月20日	80.00	0.00	-
23	二级市场卖出	2015年1