华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7月16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4月1日起至6月30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	501,608,065.33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,捕捉和把握交风险套利机会,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提升的投资机会。 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。
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4月1日 - 2015年6月30日)
1. 本期已实现收益	359,185,529.21
2.本期利润	359,185,529.21
3.期末基金资产净值	50,160,806,533.27

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

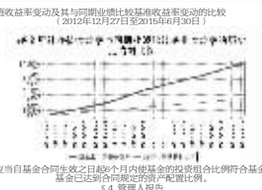
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.8376%	0.0028%	0.3366%	0.0000%	0.5010%	0.0028%

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指数债券型证券投资基金基金经理,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投资基金法》、《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 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

二季度市场流动性呈现前松后紧的格局,6月之前资金面异常宽松,资金利率处于历史低位。6月份随着地方债务置换发行提速、PPP扩容以及金融机构半年度考核等多重因素的叠加作用下,流动性趋紧。报告期内,央行于5月11日和6月28日两度降息,并且于4月20日、6月28日两度降准,货币政策维持宽松基调不变。从公布的经济数据来看,宏观经济略有改善,但动能偏弱,依然在底部徘徊。市场收益率水平普遍下行,其中短端自5月降息以来下行较快,长端则是先下后上,降幅略小。本基金在报告期内,保持债券的整体仓位不变,降低同业存款配比,同时增加逆回购比例,继续保持平均组合剩余期限处于较短位置,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0.8376%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%,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

展望三季度,国内宏观经济景气度将有所改善,但目前来看动力较弱,因此维持经济低位运行的判断不变。货币政策仍然处于放松的周期之中,无论是稳增长还是配合地方债的发行,央行都会给予货币政策配合,并且保持流动性宽松。目前第二批置换债券已经开始发行,而第三批置换债券可能也在酝酿之中,大量供给将使债券市场承压。在IPO节奏未打破前,交易所回购与银行间回购依然存在倒挂。在此背景下,维持债券、逆回购与同业存款的均衡配比,随时把握市场动向。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	16,288,349,904.63	31.78
	其中:债券	16,288,349,904.63	31.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	14,875,574,711.76	29.02
	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	19,644,844,558.97	38.33
4	其他资产	448,600,274.78	0.88
5	合计	51,257,369,450.14	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	1.26
	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	-	-
	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	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	80
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

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(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	48.14	2.13
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	18.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	9.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	9.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.45	2.13

5.4 报告期末投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	90,105,372.91	0.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,086,574,025.08	6.15
	其中:政策性金融债	3,086,574,025.08	6.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	13,111,670,506.64	26.14
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	16,288,349,904.63	32.47
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	130317	13进出17	5,200,000	520,720,209.81	1.04
2	011574003	15陕煤化SCP003	4,500,000	449,853,771.55	0.90
3	041459052	14中冶CP002	3,500,000	352,280,714.48	0.70
4	150403	15农发03	3,500,000	349,027,958.96	0.70
5	150211	15国开11	3,300,000	331,222,004.54	0.66
6	011537006	15中建材SCP006	3,300,000	330,004,790.94	0.66
7	140218	14国开18	3,000,000	300,032,095.97	0.60
8	011574001	15陕煤化SCP001	3,000,000	299,975,341.24	0.60
9	011599184	15武钢SCP001	3,000,000	299,969,455.28	0.60
10	011474005	14陕煤化SCP005	2,700,000	270,830,801.14	0.54

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	0.2011%
报告期内偏离度的最低值	0.0662%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1456%

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	81,133,761.16
3	应收利息	367,466,513.62
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	448,600,274.78

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	345,719,320.29
报告期期间基金总申购份额	463,742,612.32
减:报告期期间基金总赎回份额	307,853,867.28
报告期期末基金份额总额	501,608,065.33

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4月1日	80.00	0.00	-
2	二级市场卖出	2015年4月1日	-746,714.00	-74,679,211.28	-
3	二级市场买入	2015年4月1日	16,602.00	1,660,116.99	-
4	申购	2015年4月2日	300,064.00	30,006,400.00	-
5	分红再投资	2015年4月3日	34.00	0.00	-
6	分红再投资	2015年4月7日	129.00	0.00	-
7	二级市场卖出	2015年4月7日	-848,178.00	-84,818,344.53	-
8	二级市场买入	2015年4月7日	548,000.00	54,798,300.01	-
9	二级市场买入	2015年4月9日	1,187.00	118,700.00	-
10	二级市场买入	2015年4月10日	800,000.00	79,997,000.01	-
11	分红再投资	2015年4月13日	241.00	0.00	-
12	二级市场买入	2015年4月13日	247,200.00	24,711,358.59	-
13	分红再投资	2015年4月14日	123.00	0.00	-
14	二级市场卖出	2015年4月14日	-179,245.00	-17,920,028.46	-
15	分红再投资	2015年4月15日	92.00	0.00	-
16	二级市场卖出	2015年4月15日	-450,000.00	-45,002,150.00	-
17	分红再投资	2015年4月16日	44.00	0.00	-
18	二级市场买入	2015年4月16日	129,300.00	12,929,353.50	-
19	分红再投资	2015年4月17日	80.00	0.00	-
20	二级市场卖出	2015年4月17日	-549,071.00	-54,930,062.85	-
21	申购	2015年4月20日	1,049,287.00	104,928,700.00	-
22	分红再投资	2015年4月21日	142.00	0.00	-
23	二级市场卖出	2015年4月21日	-1,049,367.00	-104,987,769.62	-
24	申购	2015年4月22日	849,764.00	84,976,400.00	-
25	分红再投资	2015年4月23日	239.00	0.00	-
26	申购	2015年4月23日	200,114.00	20,011,400.00	-
27	分红再投资	2015年4月24日	98.00	0.00	-
28	二级市场卖出	2015年4月24日	-1,050,259.00	-105,068,061.88	-
29	申购	2015年4月27日	500,675.00	50,067,500.00	-
30	分红再投资	2015年4月28日	46.00	0.00	-
31	二级市场卖出	2015年4月28日	-500,773.00	-50,083,309.28	-
32	申购	2015年4月28日	500,000.00	50,000,000.00	-
33	分红再投资	2015年4月29日	45.00	0.00	-
34	二级市场卖出	2015年4月29日	-500,046.00	-50,010,400.42	-
35	分红再投资	2015年4月30日	1.00	0.00	-
36	二级市场卖出	2015年5月5日	951,400.00	95,100,809.21	-
37	分红再投资	2015年5月6日	91.00	0.00	-
38	二级市场买入	2015年5月6日	100,000.00	9,996,000.00	-
39	分红再投资	2015年5月7日	92.00	0.00	-
40	二级市场卖出	2015年5月7日	-255,000.00	-25,502,800.01	-
41	赎回	2015年5月7日	-100,000.00	-10,000,971.88	-
42	分红再投资	2015年5月8日	69.00	0.00	-
43	二级市场卖出	2015年5月8日	-696,000.00	-69,685,920.57	-
44	申购	2015年5月8日	255,110.00	25,511,000.00	-
45	分红再投资	2015年5月11日	73.00	0.00	-
46	二级市场卖出	2015年5月11日	-255,208.00	-25,529,118.74	-
47	分红再投资	2015年5月12日	796,869.00	79,686,900.00	-
48	分红再投资	2015年5月12日	98.00	0.00	-
49	二级市场卖出	2015年5月12日	-796,942.00	-79,729,256.28	-
50	申购	2015年5月12日	253,291.00	25,329,100.00	-
51	分红再投资	2015年5月13日	23.00	0.00	-
52	二级市场卖出	2015年5月13日	-253,389.00	-25,349,626.34	-
53	申购	2015年5月13日	797,293.00	79,729,300.00	-
54	分红再投资	2015年5月14日	70.00	0.00	-
55	二级市场卖出	2015年5月14日	-797,316.00	-79,768,295.45	-
56	申购	2015年5月14日	253,496.00	25,349,600.00	-
57	分红再投资	2015年5月15日	21.00	0.00	-
58	申购	2015年5月15日	797,683.00	79,768,300.00	-
59	分红再投资	2015年5月18日	270.00	0.00	-
60	分红再投资	2015年5月19日	83.00	0.00	-
61	二级市场买入	2015年5月19日	2,000,500.00	199,999,405.92	-
62	分红再投资	2015年5月20日	241.00	0.00	-
63	分红再投资	2015年5月21日	234.00	0.00	-
64	分红再投资	2015年5月22日	238.00	0.00	-
65	二级市场卖出	2015年5月22日	-3,054,500.00	-305,580,234.57	-
66	申购	2015年5月25日	3,053,808.00	305,580,800.00	-
67	分红再投资	2015年5月26日	350.00	0.00	-
68	分红再投资	2015年5月27日	218.00	0.00	-
69	分红再投资	2015年5月28日	217.00	0.00	-
70	分红再投资	2015年5月29日	216.00	0.00	-
71	分红再投资	2015年6月1日	681.00	0.00	-
72	分红再投资	2015年6月2日	220.00	0.00	-
73	二级市场买入	2015年6月2日	200,000.00	19,986,200.01	-
74	分红再投资	2015年6月3日	240.00	0.00	-
75	分红再投资	2015年6月4日	250.00	0.00	-
76	二级市场卖出	2015年6月4日	-1,004,807.00	-100,491,348.24	-
77	分红再投资	2015年6月5日	202.00	0.00	-
78	二级市场卖出	2015年6月5日	-2,253,729.00	-225,478,842.26	-
79	申购	2015年6月5日	1,005,052.00	100,505,200.00	-
80	分红再投资	2015年6月8日	246.00	0.00	-
81	二级市场卖出	2015年6月8日	-1,005,200.00	-100,560,639.30	-
82	申购	2015年6月8日	2,254,788.00	225,478,800.00	-
83	分红再投资	2015年6月9日	159.00	0.00	-
84	二级市场卖出	2015年6月9日	-2,107,375.00	-210,781,394.80	-
85	申购	2015年6月9日	1,005,607.00	100,560,700.00	-
86	分红再投资	2015年6月11日	98.00	0.00	-
87	分红再投资	2015年6月11日	74.00	0.00	-
88	分红再投资	2015年6月12日	69.00	0.00	-
89	分红再投资	2015年6月15日	208.00	0.00	-
90	分红再投资	2015年6月16日	74.00	0.00	-
91	分红再投资	2015年6月17日	70.00	0.00	-
92	二级市场卖出	2015年6月17日	-1,054,002.00	-105,410,936.50	-
93	分红再投资	2015年6月18日	7.00	0.00	-
94	申购	2015年6月18日	3,161,923.00	316,192,300.00	-
95	分红再投资	2015年6月19日	222.00	0.00	-
96	二级市场卖出	2015年6月19日	-562,175.00	-56,233,803.08	-
97	分红再投资	2015年6月23日	764.00	0.00	-
98	二级市场卖出	2015年6月23日	-607,412.00	-60,748,364.49	-
99	申购	2015年6月23日	262,076.00	26,207,600.00	-
100	分红再投资	2015年6月24日	256.00	0.00	-
101	二级市场卖出	2015年6月24日	-2,355,475.00	-235,646,863.83	-
102	申购	2015年6月24日	908,046.00	90,804,600.00	-
103	分红再投资	2015年6月25日	68.00	0.00	-
104	二级市场卖出	2015年6月25日	-908,302.00	-90,864,251.47	-
105	申购	2015年6月25日	2,356,468.00	235,646,800.00	-
106	分红再投资	2015年6月26日	180.00	0.00	-
107	二级市场卖出	2015年6月26日	-2,356,536.00	-235,749,941.07	-
108	申购	2015年6月26日	908,643.00	90,864,300.00	-
109	分红再投资	2015年6月29日	213.00	0.00	-
110	二级市场卖出	2015年6月29日	-908,823.00	-90,898,258.58	-
111	申购	2015年6月29日	2,357,499.00	235,749,900.00	-
112	分红再投资	2015年6月30日	195.00	0.00	-
113	申购	2015年6月30日	908,989.00	90,898,900.00	-
合计			2,536,784.00	251,841,134.44	

注:交易日期为确认日期,交易金额为确认金额。

§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;

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同;

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金招募说明书;

华宝兴业现金添益交易型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7月18日

华宝兴业现金宝货币市场基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7月16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4月1日起至6月30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	5,699,818,542.88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	391,554,942.72份	354,936,188.01份	4,953,327,412.15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4月1日 - 2015年6月30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	2,418,839.07	1,231,381.02	20,191,443.10
2.本期利润	2,418,839.07	1,231,381.02	20,191,443.10
3.期末基金资产净值	391,554,942.72	354,936,188.01	4,953,327,412.15

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	0.8821%	0.0049%	0.3366%	0.0000%	0.5455%	0.0049%

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	0.9423%	0.0049%	0.3366%	0.0000%	0.6057%	0.0049%

注:基金收益分配是按日结转份额。

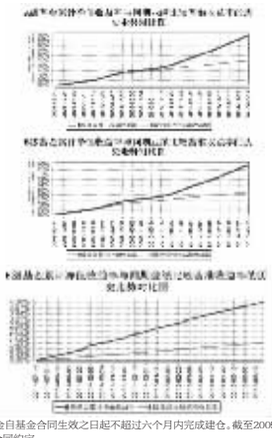
华宝兴业现金宝货币E

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	0.9423%	0.0049%	0.3366%	0.0000%	0.6057%	0.0049%

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6月30日)



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指数债券型证券投资基金基金经理助理的职务。2013年8月起任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理。2015年5月起任华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理。2015年5月起任华宝兴业先进成长股票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、《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 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 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

二季度市场流动性呈现前松后紧的格局,6月之前资金面异常宽松,资金利率处于历史低位。6月份随着地方债务置换发行提速、IPO扩容以及金融机构半年度考核等多重因素的叠加作用下,流动性趋紧。报告期内,央行于5月11日和6月28日两度降息,并且于4月20日、6月28日两度降准,货币政策维持宽松基调不变。从公布的经济数据来看,宏观经济略有改善,但动能偏弱,依然在底部徘徊。市场收益率水平普遍下行,其中短端自5月降息以来下行较快,长端则是先下后上,降幅略小。本基金在报告期内,降低了债券的整体仓位,同业存款配比也有所下降,逆回购比例增加,继续保持平均组合剩余期限处于较短位置,整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

现金