

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

[2015]第三季度报告

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

报告送达日期:2015年10月27日

§ 重要提示

基金管理人的董事会及监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对本基金合同约定，于2015年10月23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信经营、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。投资者欲了解基金的投资决策情况，请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9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	611990
交易代码	611990
契约型开放式	
报告期末基金份额总额	2,173,146,626.02份
投资目标	保持基金的本金和基金财产的流动性，追求高于比较基准的稳定收益。
1.久期策略	基于对宏观经济环境的深入研究，预期未来市场利率将呈现震荡走势，本基金将采取合理的资产配置策略，以确保基金的流动性需求并力求获得稳定的收益。
2.收益曲线定价	收益曲线策略是根据收益曲线的非平行运动调整组合，寻找市场的流动资金。
3.套利策略	通过识别并利用货币基金的稳定性与流动性的差异，通过申购赎回机制，捕捉并利用已知的机构、进行市场的品种操作，以获得稳定的收益。
4.逆回购策略	基金管理人将密切关注关于回购的新闻等信息，因回购的期限和资金的需求量，适时地卖出持有的回购券，增加资金的流动性。
5.风险资产配置	根据资产配置比例，适时地买入风险资产，如股票、债券、基金等。
6.现金管理策略	在货币市场中集中地均匀分布，滚动投资，优化配置，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，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1.00元。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	870,809,612.14
2.本期利润	870,809,612.14
3.期末基金余额	2,173,146,626.02

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,本期无实现收益和本期利润的金额相等。

2.所列基金财务指标不包括持有人认购或交易基金的交易费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2基金净值表现

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1.00元。

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7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	870,809,612.14
2.本期利润	870,809,612.14
3.期末基金余额	2,173,146,626.02

注:本基金份额净值为1.00元。

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

过去三个月 0.5680% 0.0000% 0.3043% 0.0000% 0.2477% 0.0000%

注:基金收益分配按日结转份额。

3.2.2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9月30日)



注:根据基金合同的约定,基金管理人应当在基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合符合基金合同的有关约定。截至2013年6月27日,本基金已达合同规定的资产配置比例。

5.4 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间	证券从业年限	说明
陈群	本基金基金经理、华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理	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,先后在华宝兴业基金管理有限公司、华宝基金管理有限公司从事货币基金产品相关的销售、交易、客户服务工作。2010年7月任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2011年1月任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2012年1月至今任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2013年1月至今任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2014年1月至今任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2015年1月至今任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2015年6月至今任华宝兴业基金管理有限公司基金经理。

注:1.任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2.证券从业年限从取得基金业从业资格之日起计算。

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,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、《证券投资基金运作管理办法》、《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,履行诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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,基金管理人严格执行投资决策委员会会议决议、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、公平交易机制、研究报告管理制度、投资决策授权制度、公平交易制度、绩效评估制度等各项制度,严格执行《证券投资内部控制制度》,确保各投资组合在投资决策、交易执行、业绩评估等环节得到公平对待,基金经理在授权范围内进行投资决策,基金经理在授权范围内进行公平交易。

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%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内整体投资策略和运作分析

三季度整体货币市场一季度有显著的长期限资金利率均有上升,主要源于央行在8月11日宣布完善人民币中间价报价机制,人民币贬值预期大幅升值,人民币兑美元中间价在一周之内累计升值4.4%,即期汇率累计升值约2.8%,汇率贬值的预期导致资金流向境内,通过人民币升值预期的驱动,导致资金利率上升,而资金利率的上升又进一步加剧人民币贬值预期,形成恶性循环。

从资金面来看,央行公开市场操作量有所增加,但资金利率波动幅度有所减小,资金利率中枢有所降低,但仍未具备明显的持续性。

从资金供给方面看,央行公开市场操作量有所增加,但资金利率波动幅度有所减小,资金利率中枢有所降低,但仍未具备明显的持续性。

从资金需求方面看,央行公开市场操作量有所增加,但资金利率波动幅度有所减小,资金利率中枢有所降低,但仍未具备明显的持续性。

从资金供需方面看,央行公开市场操作量有所增加,但资金利率波动幅度有所减小,资金利率中枢有所降低,但仍未具备明显的持续性。

从资金供需方面看,央行公开市场操作量有所增加,但资金利率波动幅度有所减小,资金利率中枢有所降低,