华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

2015 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:2016年3月28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2016年3月23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为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2015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	
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	
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	130,640,484,680.53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	
下属分级基金的基金简称:	华宝添益	华宝添益B
下属分级基金的场内简称:	华宝添益	-
下属分级基金的交易代码:	511990	001893
报告期末下属分级基金的份额总额	127,439,390,084.80份	3,201,094,595.73份

注:本基金场内基金份额(A类基金份额)简称为“华宝添益”,基金份额净值为100.00元;场外基金份额(B类基金份额)简称为“华宝添益B”,基金份额净值为1.00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,把握证券时机。 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,进行货币市场、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抬升的投资机会。 6.民企债管理策略: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@fstund.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.fstund.com
基金年度报告备置地点	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	2015年			2014年			2013年		
		华宝添益	华宝添益B	华宝添益		华宝添益B	华宝添益		华宝添益B
本期已实现收益	2,537,847,817.87		1,451,608.63	851,560,816.66		-	122,067,709.50		-
本期利润	2,537,847,817.87		1,451,608.63	851,560,816.66		-	122,067,709.50		-
本期净值收益率	3.1508%		0.2921%	4.2821%		-	3.7382%		-
3.1.2 期末数据和指标	2015年末			2014年末			2013年末		
期末基金资产净值	127,439,390,084.80		3,201,094,595.73	20,579,552,220.19		-	5,535,418,516.79		-
期末基金份额净值	100		1.0000	100		-	100		-
3.1.3 累计期末指标	2015年末			2014年末			2013年末		
累计净值收益率	11.6446%		0.2921%	8.2343%		-	3.7899%		-

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

华宝添益

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	0.6126%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.2723%	0.0004%
过去六个月	1.2041%	0.0007%	0.6805%	0.0000%	0.5236%	0.0007%
过去一年	3.1508%	0.0029%	1.3500%	0.0000%	1.8008%	0.0029%
过去三年	11.5889%	0.0029%	4.0500%	0.0000%	7.5389%	0.0029%
自基金合同生效日起至今	11.6446%	0.0029%	4.0684%	0.0000%	7.5762%	0.0029%

华宝添益B

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	0.2921%	0.0026%	0.1923%	0.0000%	0.0998%	0.0026%
自基金合同生效日起至今	0.2921%	0.0026%	0.1923%	0.0000%	0.0998%	0.0026%

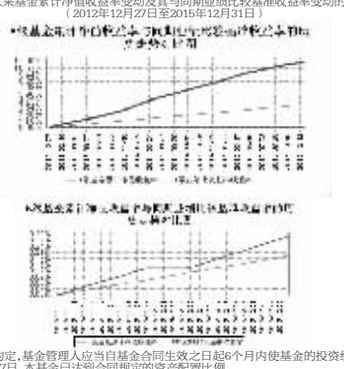
注:1.本基金业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

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)。

3.2015年11月9日起,华宝兴业现金添益基金新增场外基金份额(B类基金份额,简称“华宝添益B”),11月10日起有资金进入申购,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数据的计算起始日期为2015年11月10日。

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

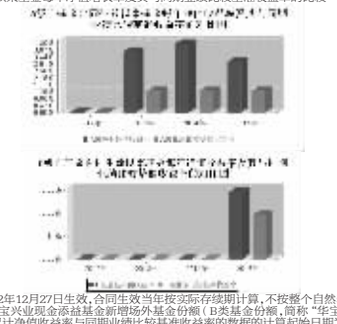
(2012年12月27日至2015年12月31日)



注:1.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。

2.2015年11月9日起,华宝兴业现金添益基金新增场外基金份额(B类基金份额,简称“华宝添益B”),11月10日起有资金进入申购,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2015年11月10日。

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



注:1.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。

2.2015年11月9日起,华宝兴业现金添益基金新增场外基金份额(B类基金份额,简称“华宝添益B”),11月10日起有资金进入申购,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数据的计算起始日期为2015年11月10日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

华宝添益					
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
2015	2,531,299,960.41	-	6,547,857.46	2,537,847,817.87	
2014	850,064,936.34	-	1,495,880.32	851,560,816.66	
2013	121,364,916.84	-	702,792.66	122,067,709.50	
合计	3,502,729,813.59	-	8,746,530.44	3,511,476,344.03	

单位:人民币元

华宝添益B					
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
2015	1,223,311.00	-	228,297.63	1,451,608.63	
合计	1,223,311.00	-	228,297.63	1,451,608.63	

§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(2015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、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、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业1000分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业中国互联网和华宝兴业转型升级基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计182,703,481,955.16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	固定收益部副总经理、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结算、交易、投资工作。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-2014年2月兼任华宝兴业中证短融60指数债券型证券投资基金基金经理,2012年12月起兼任华宝兴业添益交易型货币市场基金基金经理。2015年3月起任固定收益副总经理。
林昊	本基金基金经理助理、华宝兴业现金宝货币基金经理助理	2015年6月16日	-	9年	本科。2006年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任集道经理、市场支持经理、行政经理、交易员、高级交易员等职务。2014年6月任华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理助理。
高文庆	本基金基金经理助理、华宝兴业现金宝货币基金经理助理	2015年8月27日	-	5年	硕士。2010年5月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任助理风险分析师、产品开发助理、助理产品经理、信用分析师等职务。2015年8月任华宝兴业现金宝货币市场基金、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 管理人对投资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 管理人对投资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投资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,所有投资组合的投资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实现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

2015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涉及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,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 管理人对报告期内基金的投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年货币市场整体呈现前紧后松的格局,二季度后收益率下行显著。在经济下行寻底的过程中,货币政策从一季度末开始持续发力,年内累计实现5次降息、4次降准。一季度,债券收益率经历了短暂的V型走势,主要是由于资金价格未有效回落,且市场对于财政部地方债务置换债券供给增加的不确定性有所担忧,导致了收益率短暂上行。3月31日央行降息后,资金价格回落,二季度流动性转为主要受每月IPO影响,呈现有规律的波动。7月股灾以后,IPO暂停,金融市场整体风险偏好下行,固定收益类资产受到追捧,货币基金规模也得以迅速发展,短中长各期限的债券收益率再下台阶。8.11汇改后,人民币出现阶段性贬值,受外汇占款减少、基础货币投放收缩的影响,市场流动性受到挤压,但央行及时开展公开市场逆回购操作并使用SLO等新型货币工具,缓解了紧张局面。随着股市企稳,11月IPO再度重启且频率加快,但对于资金面的影响已逐渐趋弱,银行间7日回购加权平均利率维持在2.4%的低位,债券收益率也继续下行。

本基金在报告期内,结合宏观经济与货币市场的变化,在资产配置上以同业存款为主,债券等其他品种为辅。同时,在信用债配置上注意规避低评级和产能过剩行业相关债券,组合平均剩余期限维持在较短水平,整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

场内份额:华宝添益:本基金报告期内净值收益率为3.1508%,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)。

场外份额:华宝添益B:本基金报告期内净值收益率为0.2921%,同期业绩比较基准收益率为0.1923%,业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)。

注:2015年11月9日起,华宝兴业现金添益基金新增场外基金份额(B类基金份额,简称“华宝添益B”),11月10日起有资金进入申购,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数据的计算起始日期为2015年11月10日。

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2016年,宏观经济寻底的过程仍在继续,供给侧改革的持续推进将有利于提高全社会生产率,为经济企稳打下坚实基础。货币政策也将保持宽松的环境,央行近期公布了将提高公开市场操作频率,并下调了最近一次MLF操作6个月和1年的利率,这预示着,未来央行将更多地通过公开市场操作7天逆回购以及MLF等工具来管理流动性,并引导市场利率,构建从短期到中期的利率走廊。IPO改革后,对于资金冻结的压力有所缓解,但是新的一年里,转债发行有加速的趋势,对流动性会带来短期的扰动。同时,国债、地方债以及专项金融债的供给在2016年也会明显增加,加之地方财政支出能力提升对经济产生推动作用,债券利率下行空间有限。此外,从去年330房产新政以来,包括贷款、税收等各项优惠政策纷纷落地,房地产去库存进入白热化阶段,一线城市房价上涨快速,使得居民大类资产配置的方向有所变化,股市和债市的资金将受到一定影响。从全球环境来看,美联储自去年12月开启近十年来的首次加息后,全球资本回流美国的速度正在加快,尽管美国的宏观经济数据目前似乎无法充分验证并支持再一次加息,但仍需谨慎对待美元进入加息周期对全球其他货币的影响。

综上所述,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,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,为投资者谋取稳定回报。

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。2015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,不断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A类份额在本年度累计分配收益2,537,847,817.87元,其中以红利再投资方式结转入实收基金2,531,299,960.41元,计入应付利润科目6,547,857.46元。B类份额在本年度累计分配收益1,451,608.63元,其中以红利再投资方式结转入实收基金1,223,311.00元,计入应付利润科目228,297.63元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金A份额实施利润分配的金额为2537847817.87元;B份额实施利润分配的金额为1451608.63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:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		87,348,496,286.85	9,922,760,916.40
结算备付金		1,520,133,557.14	6,713,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产		23,397,038,170.95	8,614,778,301.51
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		23,397,038,170.95	8,614,778,301.51
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		18,624,112,683.13	1,819,165,968.75
应收证券清算款		-	-
应收利息		960,416,844.70	230,362,422.76
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		4,554.54	-
资产总计		131,850,202,097.31	20,593,780,609.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		1,118,700,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		40,942,872.88	5,721,650.71
应付托管费		10,528,167.35	1,471,281.56
应付销售服务费		29,244,909.27	4,086,893.33
应付交易费用		753,528.88	84,780.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		9,190,938.40	2,414,783.31
递延所得税负债		-	-
其他负债		357,000.00	449,000.00
负债合计		1,209,717,416.78	14,228,389.23
所有者权益:			
实收基金		130,640,484,680.53	20,579,552,220.19
未分配利润		-	-
所有者权益合计		130,640,484,680.53	20,579,552,220.19
负债和所有者权益总计		131,850,202,097.31	20,593,780,609.42

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额总额4,475,488,496.58份,其中A类基金份额的份额总额为1,274,393,900.85份,份额净值100.00元;B类基金份额的份额总额为3,201,094,595.73份,份额净值1.00元。

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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一.收入		3,225,910,569.36	1,012,979,022.50
1.利息收入		3,216,692,902.70	1,004,942,216.04
其中:存款利息收入		2,163,826,107.82	628,199,336.07
债券利息收入		640,549,986.83	249,451,018.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		412,316,808.05	127,291,861.04
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		9,179,711.87	8,033,056.46
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		9,179,711.87	8,033,056.46
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
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)		37,954.79	3,750.00
减:二.费用		686,611,142.86	161,418,206.84
1. 管理人报酬		344,167,753.93	74,179,430.99
2. 托管费		88,500,279.73	19,074,710.81
3. 销售服务费		245,834,110.01	52,985,307.95
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		7,386,938.82	14,654,644.48
其中:卖出回购金融资产支出		7,386,938.82	14,654,644.48
6. 其他费用		722,060.37	524,111.61
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,539,299,426.50	851,560,816.66
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		2,539,299,426.50	851,560,816.66

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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	20,579,552,220.19	-	20,579,552,220.19
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,539,299,426.50	2,539,299,426.50
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)	110,060,932,460.34	-	110,060,932,460.34
其中:1.基金申购款	262,971,194,071.41	-	262,971,194,071.41
2.基金赎回款	-152,910,261,611.07	-	-152,910,261,611.07
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)	-	-2,539,299,426.50	-2,539,299,426.50
五.期末所有者权益(基金净值)	130,640,484,680.53	-	130,640,484,680.53

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	5,535,418,516.79	-	5,535,418,516.79
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	851,560,816.66	851,560,816.66
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)	15,044,133,703.40	-	15,044,133,703.40
其中:1.基金申购款	82,858,008,136.34	-	82,858,008,136.34
2.基金赎回款	-67,813,874,432.94	-	-67,813,874,432.94
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)	-	-851,560,816.66	-851,560,816.66
五.期末所有者权益(基金净值)	20,579,552,220.19	-	20,579,552,220.19

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:

黄小蕙 向晖 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,存续期限不定,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验资并出具了编号为普华永道中天验字(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。

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。

经中国证监会备案,本基金于2015年11月9日起增设本基金的场外基金份额(以下简称“B类基金份额”)。本基金的原场内基金份额为A类基金份额,A类基金份额仅在上交所申购、赎回和上市交易,B类基金份额(不上市交易),仅在场外进行申购和赎回。A类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币100.00元,B类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币1.00元。A类基金份额由中国证券登记结算有限责任公司进行登记;B类基金份额由华宝兴业基金管理有限公司进行登记。

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利率(税后)。

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2016年3月24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日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协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2015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2015年12月31日的财务状况以及2015年度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

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

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