

华宝兴业现金宝货币市场基金 2015 年半年度报告（摘要）

2015 年 6 月 30 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

送出日期：2015 年 8 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。本半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 2015 年 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业现金宝货币市场基金		
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		
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	5,699,818,542.88 份		
基金合同存续期	不定期		
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

2.2 基金产品说明

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。

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
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	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
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,574,442.34	3,908,690.24	45,627,769.23
本期利润	5,574,442.34	3,908,690.24	45,627,769.23
本期净值收益率	1.9825%	2.1038%	2.1039%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)		
期末基金资产净值	391,554,942.72	354,936,188.01	4,953,327,412.15
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)		
累计净值收益率	35.4775%	38.8531%	4.2681%

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

华宝兴业现金宝货币 A

阶段	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—④
----	------	------	-------	-----	-----

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去一个月	0.2632%	0.0061%	0.1110%	0.0000%	0.1522%	0.0061%
过去三个月	0.8821%	0.0049%	0.3366%	0.0000%	0.5455%	0.0049%
过去六个月	1.9825%	0.0066%	0.6695%	0.0000%	1.3130%	0.0066%
过去一年	4.1813%	0.0088%	1.3500%	0.0000%	2.8313%	0.0088%
过去三年	12.8364%	0.0058%	4.0487%	0.0000%	8.7877%	0.0058%
自基金合同生效日起至 今	35.4775%	0.0057%	17.7267%	0.0019%	17.7508%	0.0038%

华宝兴业现金宝货币 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
过去一个月	0.2827%	0.0061%	0.1110%	0.0000%	0.1717%	0.0061%
过去三个月	0.9423%	0.0049%	0.3366%	0.0000%	0.6057%	0.0049%
过去六个月	2.1038%	0.0066%	0.6695%	0.0000%	1.4343%	0.0066%
过去一年	4.4314%	0.0088%	1.3500%	0.0000%	3.0814%	0.0088%
过去三年	13.6519%	0.0058%	4.0487%	0.0000%	9.6032%	0.0058%
自基金合同生效日起至 今	38.8531%	0.0057%	17.7267%	0.0019%	21.1264%	0.0038%

华宝兴业现金宝货币 E

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
过去一个月	0.2827%	0.0061%	0.1110%	0.0000%	0.1717%	0.0061%
过去三个月	0.9423%	0.0049%	0.3366%	0.0000%	0.6057%	0.0049%
过去六个月	2.1039%	0.0066%	0.6695%	0.0000%	1.4344%	0.0066%
自基金合同生效日起至 今	4.2681%	0.0090%	1.3019%	0.0000%	2.9662%	0.0090%

注：1、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）。

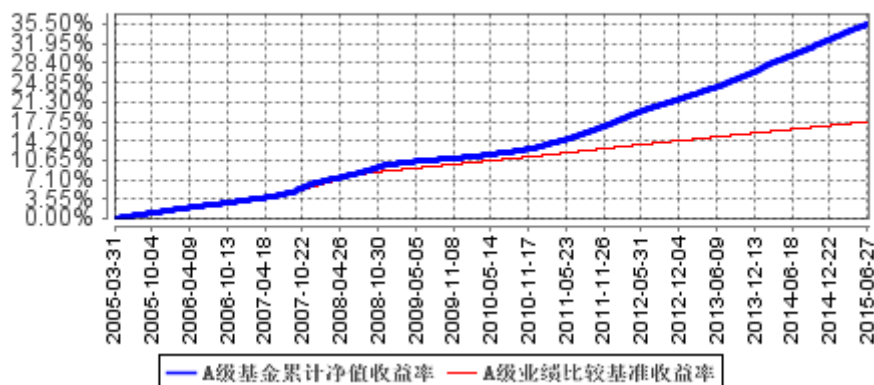
2、本基金业绩比较基准为：同期 7 天通知存款利率（税后）。

3、华宝兴业现金宝 E 成立于 2014 年 7 月 14 日，其自基金合同生效日起至今的数据的计算起始日期为 2014 年 7 月 14 日。

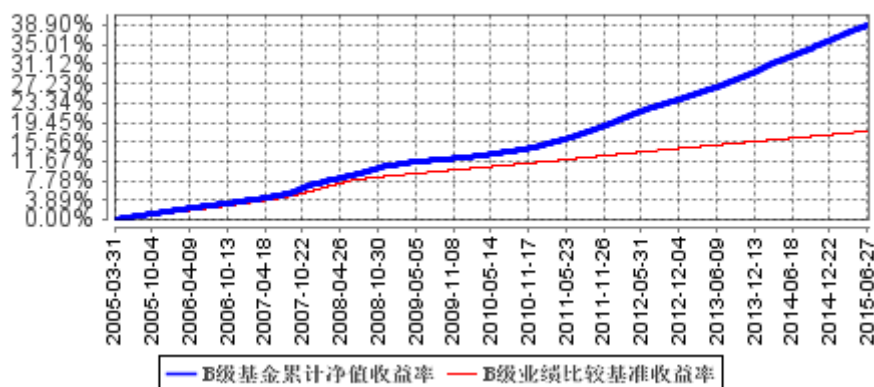
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

（2005 年 3 月 31 日至 2015 年 6 月 30 日）

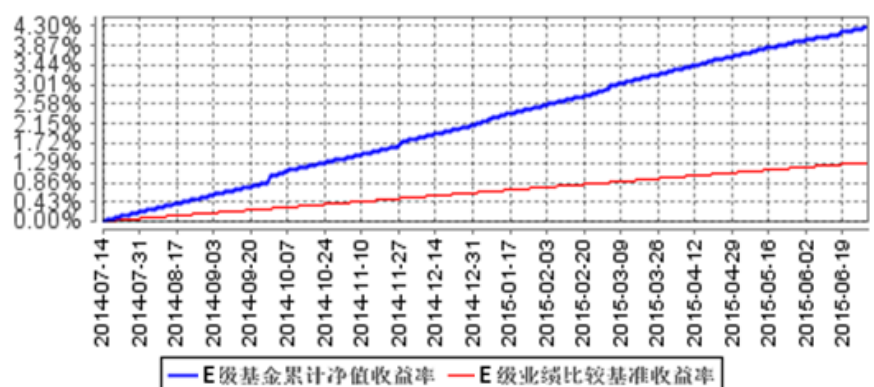
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B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



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。

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 6 月 30 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、成熟市场动量优选基金、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、华宝兴业活期通货币市场基金、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、华宝兴业国策导向基金、华宝兴业新价值基金、华宝兴业新机遇基金、华宝兴业医疗分级基金、华宝兴业中证 1000 分级基金和华宝兴业万物互联基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 110,943,781,389.61 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	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。
林昊	本基金基金经理助理、华宝添益基金经理助理	2014 年 6 月 16 日	-	9 年	本科。2006 年 5 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任渠道经理、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。

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 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，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业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年市场流动性整体较大，资金利率处于历史低位。报告期内，央行分别于 3 月 1 日、5 月 11 日和 6 月 28 日三度降息。调整后，一年期存款利率累计由 2.75% 下调至 2.0%。同时又于 2 月 4 日、4 月 20 日、6 月 28 日三度宣布下调金融机构存款准备金率，为市场注入流动性，也为地方债务置换的平稳过渡提供政策支持。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，货币政策与财政政策的接连调整表明政策托底的意愿较强。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，债券和同业存款的整体仓位略有下降，逆回购比例有所提升，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

现金宝 A：本基金报告期内净值收益率为 1.9825%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，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 2.1038%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，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 2.1039%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，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

展望下半年，国内宏观经济景气度将有所改善，但目前来看动力较弱，因此经济将维持低位运行的判断不变。虽然美国加息预期以及国内 CPI 有所上行将对未来货币政策的方向产生一定影响，但从现有情况来看，考虑到地方债置换持续产生的供给压力，因此基于稳增长以及配合地

方债的发行，央行都会给予货币政策支持，并且维持流动性处于相对宽松水平。7 月初 IPO 暂停以来，大量资金将货币基金作为短期流动性管理工具，基金规模整体增加较快。本基金将密切跟踪市场动向，谨防 IPO 重启后可能带来的流动性冲击，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 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 & 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。每月集中宣告收益分配并将当月收益结转到基金份额持有人基金账户。现金宝 A 级基金在本报告期累计分配收益 5,574,442.34 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 5,581,786.39 元，计入应付利润科目-7,344.05 元。现金宝 B 级基金在本报告期累计分配收益 3,908,690.24 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 3,951,028.93 元，计入应付利润科目-42,338.69 元。现金宝 E 级基金在本报告期累计分配收益 45,627,769.23 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 45,615,532.38 元，计入应付利润科目 12,236.85 元。

4.8 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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为：A 级：5,574,442.34 元；B 级：3,908,690.24 元；E 级：45,627,769.23 元。

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业现金宝货币市场基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		1,973,105,670.85	2,009,022,752.74
结算备付金		1,045,000.00	40,000.00

存出保证金		-	-
交易性金融资产		1,310,926,672.84	2,112,803,489.10
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,310,926,672.84	2,112,803,489.10
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		2,277,379,756.06	86,720,330.08
应收证券清算款		-	-
应收利息		39,985,081.47	66,530,205.12
应收股利		-	-
应收申购款		324,733,777.79	2,605,705.08
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		5,927,175,959.01	4,277,722,482.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30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		225,399,687.30	11,519,862.72
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		764,275.61	1,073,245.39
应付托管费		231,598.66	325,225.82
应付销售服务费		73,801.14	141,668.28
应付交易费用		35,258.22	43,145.06
应交税费		-	-
应付利息		7,414.34	1,542.41
应付利润		493,397.10	530,842.99
递延所得税负债		-	-
其他负债		351,983.76	479,000.00
负债合计		227,357,416.13	14,114,532.67
所有者权益：			
实收基金		5,699,818,542.88	4,263,607,949.45
未分配利润		-	-
所有者权益合计		5,699,818,542.88	4,263,607,949.45
负债和所有者权益总计		5,927,175,959.01	4,277,722,482.12

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额

5,699,818,542.88 份，其中 A 类基金份额 391,554,942.72 份，B 类基金份额 354,936,188.01 份，

E 类基金份额 4,953,327,412.15 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业现金宝货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		63,660,870.18	193,910,981.66
1.利息收入		58,505,425.25	189,717,726.82
其中：存款利息收入		27,707,545.20	115,137,306.50
债券利息收入		25,102,241.73	44,239,699.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,695,638.32	30,340,721.20
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,155,444.93	4,193,254.84
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		5,155,444.93	4,193,254.84
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）		-	-
减：二、费用		8,549,968.37	19,881,719.60
1. 管理人报酬		4,396,767.89	12,562,009.36
2. 托管费		1,332,353.92	3,806,669.53
3. 销售服务费		470,903.80	1,214,232.79
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		2,124,450.18	2,090,727.15
其中：卖出回购金融资产支出		2,124,450.18	2,090,727.15
6. 其他费用		225,492.58	208,080.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		55,110,901.81	174,029,262.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		55,110,901.81	174,029,262.06

”号填列)			
-------	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业现金宝货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	4,263,607,949.45	-	4,263,607,949.45
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	55,110,901.81	55,110,901.81
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)	1,436,210,593.43	-	1,436,210,593.43
其中：1. 基金申购款	12,319,849,724.83	-	12,319,849,724.83
2. 基金赎回款	-10,883,639,131.40	-	-10,883,639,131.40
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)	-	-55,110,901.81	-55,110,901.81
五、期末所有者权益 (基金净值)	5,699,818,542.88	-	5,699,818,542.88
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 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)	4,011,156,894.35	-	4,011,156,894.35
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	174,029,262.06	174,029,262.06
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)	1,833,779,645.25	-	1,833,779,645.25

其中：1. 基金申购款	24, 106, 746, 417. 67	-	24, 106, 746, 417. 67
2. 基金赎回款	-22, 272, 966, 772. 42	-	-22, 272, 966, 772. 42
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）	-	-174, 029, 262. 06	-174, 029, 262. 06
五、期末所有者权益（基金净值）	5, 844, 936, 539. 60	-	5, 844, 936, 539. 60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>黄小薏</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业现金宝货币市场基金(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”)证监基金字[2005]23号《关于同意华宝兴业现金宝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《华宝兴业现金宝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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,313,988,355.58元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第33号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》于2005年3月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,314,444,447.53份基金份额,其中认购资金利息折合456,091.95份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司(以下简称“华宝兴业”),基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》和《华宝兴业现金宝货币市场基金更新的招募说明书》的规定,本基金根据投资者单个基金账户保留的基金份额的不同,分成A类、B类和E类三类基金份额。三级基金份额单独设置基金代码,按照不同的费率计提销售服务费并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据本基金管理人华宝兴业于2014年7月8日发布《关于华宝兴业现金宝货币市场基金增加E类基金份额并相应修改基金合同的公告》,投资者于2014年7月14日前在华宝兴业直销中心保留的A类和B类基金份额已在该日自动转为E类基金份额,已在华宝兴业直销中心签约的A类和B类基金份额的定期定额投资计划已转为E类基金份额的定期定额投资计划。当投资者在

销售机构保留的 A 类基金份额达到 500 万份时，本基金注册登记机构自动将其在该销售机构保留的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额，并将其未结转份额结转成 B 类基金份额；当投资者在销售机构保留的 B 类基金份额低于 500 万份时，本基金注册登记机构自动将其在该销售机构保留的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额，并将其未结转份额结转成 A 类基金份额。基金的升降级不收取费用。现金宝 A、B 类基金份额只能通过代销机构申购；现金宝 E 类基金份额仅通过基金管理人华宝兴业直销中心（包括直销柜台、直销 e 网金、公司淘宝店）及基金管理人指定的电子交易平台办理申购。现金宝 A(代码：240006)类申购起点 500 元起，追加持有 500 元起，销售服务费年费率 0.25%；现金宝 B(代码：240007)类申购起点 500 元起，追加持有 500 元起，销售服务费年费率 0.01%；现金宝 E(代码：000678)类申购起点 0.01 元起，追加持有 0.01 元起，销售服务费年费率 0.01%。

根据《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》和最新公布的《华宝兴业现金宝货币市场基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为现金；一年以内的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内的债券；期限在一年以内的债券回购；期限在一年以内的中央银行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 7 天通知存款利率(税后)。

6.4.2 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》、《华宝兴业现金宝货币市场基金 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 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[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易各关联方

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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)	基金管理人的股东

Management S.A.)	
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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,396,767.89	12,562,009.36
其中：支付销售机构的客户维护费	123,020.91	257,390.04

注：支付基金管理人华宝兴业的基金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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,332,353.92	3,806,669.53

注：支付基金托管人中国建设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。

6.4.8.2.3 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 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	合计
中国建设银行	198,100.75	2,571.26	0.00	200,672.01
华宝兴业	3.31	0.00	109,911.88	109,915.19
华宝证券	2,560.98	1,759.71	0.00	4,320.69
合计	200,665.04	4,330.97	109,911.88	314,907.89
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 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 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	合计
	中国建设银行	376,550.53	6,522.45	-
华宝兴业	258,843.59	314,303.76	-	-
华宝证券	1,901.05	0.00	-	-
合计	637,295.17	320,826.21	-	-

注：1、支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华宝兴业，再由华宝兴业计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额持有人、B 类基金份额持有人、E 类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率分别为 0.25%、0.01%和 0.01%。其计算公式为：

日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

2、华宝兴业现金宝 E 成立于 2014 年 7 月 14 日。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息收 入	交易金额	利息支出
中国建设银行	31,098,852.74	-	-	-	883,800,000.00	189,197.90
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息收 入	交易金额	利息支出
中国建设银行	30,886,515.62	25,493,314.73	-	-	1,926,920,000.00	261,948.74

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2015 年 1 月 1 日至 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
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
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	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	386,719,483.18	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	268,000,000.00	-
期末持有的基金份额	-	118,719,483.18	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.22%	-

注：1、华宝兴业现金宝 E 成立于 2014 年 7 月 14 日。

2、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

3、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。

。

6.4.8.4.2 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

华宝兴业现金宝货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华宝信托	0.00	0.00%	18,549,064.90	3.79%

华宝兴业现金宝货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
华宝信托	0.00	0.00%	50,345,810.07	0.94%

华宝兴业现金宝货币 E

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
华宝信托	56,495,527.84	0.99%	0.00	0.00%

注：除基金管理人之外的其它关联方投资本基金的费率按照本基金招募说明书的规定进行。

6.4.8.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,105,670.85	24,841.34	83,265,795.51	19,562.57

注：上述银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内与上年度可比期间无参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 225,399,687.30 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
090205	09 国开 05	2015 年 7 月 1 日	100.24	300,000	30,072,000.00
140444	14 农发 44	2015 年 7 月 1 日	100.35	500,000	50,175,000.00
150202	15 国开 02	2015 年 7 月 1 日	100.54	500,000	50,270,000.00
100304	10 进出 04	2015 年 7 月 1 日	100.05	500,000	50,025,000.00
140223	14 国开 23	2015 年 7 月 1 日	100.40	300,000	30,120,000.00
150211	15 国开 11	2015 年 7 月 1 日	100.35	200,000	20,070,000.00
合计				2,300,000	230,732,000.00

6.4.9.3.2 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，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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次的余额为 1,310,926,672.84 元，无属于第一或第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第二层次 2,112,803,489.10 元，无属于第一或第三层次的余额)。于 2015 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负债均属于第一层次(2014 年 12 月 31 日：同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 31 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 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	1,310,926,672.84	22.12
	其中：债券	1,310,926,672.84	22.12
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,277,379,756.06	38.42
	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	1,974,150,670.85	33.31
4	其他各项资产	364,718,859.26	6.15
5	合计	5,927,175,959.01	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	4.76	
	其中：买断式回购融资	-	
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	225,399,687.30	3.95
	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
3	2015 年 6 月 24 日	26.21	巨额赎回	两个工作日
4	2015 年 6 月 25 日	20.10	巨额赎回	两个工作日

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	34
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	34

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。

7.3.2 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	71.73	3.95
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	8.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	9.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	2.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	5.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		97.59	3.95

7.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	490,932,723.69	8.61
	其中：政策性金融债	490,932,723.69	8.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	819,993,949.15	14.39
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,310,926,672.84	23.00
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 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

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	140218	14 国开 18	1,900,000	190,085,822.29	3.33
2	140444	14 农发 44	1,000,000	100,182,153.23	1.76
3	041462028	14 南山集	1,000,000	100,088,494.75	1.76

		CP002			
4	011499041	14 徐工 SCP002	900,000	89,997,981.37	1.58
5	011522004	15 神华 SCP004	800,000	79,995,395.81	1.40
6	150202	15 国开 02	500,000	50,275,536.45	0.88
7	041453093	14 北部湾 CP003	500,000	50,001,716.40	0.88
8	041461051	14 悦达 CP002	500,000	50,000,030.10	0.88
9	041457003	14 厦国贸 CP001	500,000	49,999,022.19	0.88
10	100304	10 进出 04	500,000	49,995,880.62	0.88

7.6 “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	43
报告期内偏离度的最高值	0.3366%
报告期内偏离度的最低值	0.0873%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2143%

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1

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。

7.8.2

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。

7.8.3

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。

7.8.4 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	39,985,081.47
4	应收申购款	324,733,777.79
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	364,718,859.26

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
华宝兴业现金宝货币 A	6,304	62,112.14	8,212,334.87	2.10%	383,342,607.85	97.90%
华宝兴业现金宝货币 B	17	20,878,599.29	45,593,638.76	12.85%	309,342,549.25	87.15%
华宝兴业现金宝货币 E	12,131	408,319.79	4,695,022,199.24	94.79%	258,305,189.41	5.21%
合计	18,452	21,349,031.23	4,748,828,196.37	83.32%	950,990,346.51	16.68%

8.2 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	华宝兴业现金宝货币 A	0.00	0.0000%
	华宝兴业现金宝货币 B	0.00	0.0000%
	华宝兴业现金宝货币 E	12,247,381.53	0.2473%
	合计	12,247,381.53	0.2149%

8.3 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	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	华宝兴业现金宝货币 A	0
	华宝兴业现金宝货币 B	0
	华宝兴业现金宝货币 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝兴业现金宝货币 A	0
	华宝兴业现金宝货币 B	0
	华宝兴业现金宝货币 E	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	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
基金合同生效日（2005 年 3 月 31 日）基金份额总额	1,253,872,199.53	1,060,572,248.00	-
本报告期期初基金份额总额	331,093,730.67	585,788,659.38	3,346,725,559.40
本报告期基金总申购份额	1,075,270,459.41	1,259,888,369.41	9,984,690,896.01
减：本报告期基金总赎回份额	1,014,809,247.36	1,490,740,840.78	8,378,089,043.26
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期末基金份额总额	391,554,942.72	354,936,188.01	4,953,327,412.15

注：1. 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。

2. 华宝兴业现金宝 E 成立于 2014 年 7 月 14 日。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内基金管理人受稽查或处罚的情况

因公司原基金经理牟旭东被追究“利用非公开信息交易”刑事责任，上海证监局于 2014 年 11 月对公司进行了专项检查。公司于 2015 年 1 月 23 日收到了上海证监局下发的《沪证监决【2015】18 号-关于华宝兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。公司已经完成了相关问题的整改，并已向上海证监局上报了专项报告。

2、报告期内，本基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：（1）选择标准：资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2. 本期交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	755,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

华宝兴业基金管理有限公司
2015 年 8 月 28 日