华宝兴业现金宝货币市场基金 2009年半年度报告摘要

2009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
报告送出日期:二〇〇九年八月二十八日

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2009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2009年1月1日起至2009年6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝兴业现金宝货币	
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	1,606,391,013.67份	
下属两级基金的基金简称	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
下属两级基金的交易代码	240006	240007
报告期末下属两级基金的份额总额	454,446,996.89份	1,151,944,016.78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	尹东
	联系电话	021-38505888	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	yindong.zh@ccb.cn
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	本基金半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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2009年1月1日-2009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
本期已实现收益	5,394,444.81	19,510,265.64
本期利润	5,394,444.81	19,510,265.64
本期净值收益率	0.6580%	0.7785%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)	
期末基金资产净值	454,446,996.89	1,151,944,016.78
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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

1. 华宝兴业现金宝货币A:

阶段	份额净值收益率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
过去一个月	0.0929%	0.0036%	0.1110%	0.0000%	-0.0181%	0.0036%
过去三个月	0.2509%	0.0021%	0.3366%	0.0000%	-0.0857%	0.0021%
过去六个月	0.6580%	0.0066%	0.6695%	0.0000%	-0.0115%	0.0066%
过去一年	2.3362%	0.0072%	1.4713%	0.0004%	0.8649%	0.0068%
过去三年	7.9980%	0.0061%	7.1994%	0.0026%	0.7986%	0.0035%
自基金合同生效起至今	10.6530%	0.0055%	9.4531%	0.0023%	1.1999%	0.0032%

2. 华宝兴业现金宝货币B:

阶段	份额净值收益率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
过去一个月	0.1129%	0.0036%	0.1110%	0.0000%	0.0019%	0.0036%
过去三个月	0.3113%	0.0021%	0.3366%	0.0000%	-0.0253%	0.0021%
过去六个月	0.7785%	0.0066%	0.6695%	0.0000%	0.1090%	0.0066%
过去一年	2.5819%	0.0072%	1.4713%	0.0004%	1.1106%	0.0068%
过去三年	8.7788%	0.0061%	7.1994%	0.0026%	1.5794%	0.0035%
自基金合同生效起至今	11.7886%	0.0055%	9.4531%	0.0023%	2.3355%	0.0032%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

华宝兴业现金宝货币市场基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005年3月31日至2009年6月30日)

1.华宝兴业现金宝货币A

2.华宝兴业现金宝货币B

注: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。

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(2009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、大盘精选基金和增强收益基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计48,400,241,713.33元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
曾丽琼	本基金基金经理兼任增强收益基金基金经理	2007-2-28	-	8年	本科。曾在杭州市商业银行总行资金营运部从事流动性管理及债券交易,2004年9月加入本公司,任宝康债券基金、本基金经理助理,2007年2月任现金宝基金基金经理,2009年2月兼任增强收益基金基金经理。
刘兴旺	本基金基金经理助理	2008-8-6	-	5年	硕士。曾在申银万国任固定收益部研究员。2008年5月加入本公司,2008年8月起任本基金基金经理助理。

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办法》、《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,现金宝证券投资基金在短期内出现过正回购比例超过20%的情况。发生此类情况后,该基金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,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度;加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金没有发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

上半年债市整体呈震荡盘整走势,收益率曲线震荡走高。1月中旬开始债市出现深幅调整,导致市场调整的原因是去年12月份信贷大幅反弹,此前预期的商业银行惜贷现象并没有出现,信贷投放量远超市场预期;2月份春节长假后,信贷反弹再次成为市场调整的诱因,公募基金成为杀跌主力;进入二季度,受新增贷款回落以及发电量、工业增加值同比增速放缓影响,市场对宏观经济回暖预期有所降温,加之商业银行配置压力较大,中长期国债、金融债收益率率先回落,并带动收益率曲线中短端下移,收益率曲线走出09年以来幅度最大的一波下移行情;但反弹并没有延续多久就被通胀预期打断,5月份大宗商品价格快速上涨,6月份发改委两度上调成品油价格,市场对通胀预期再度升温,加之IPO重启使得市场开始担忧资金面压力,自5月底开始收益率曲线再度进入上行通道,目前调整走势仍在延续。

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,我们认为资金面在IPO冲击下会阶段性承压,而宏观基本面仍将延续今年以来的向好趋势,受一级市场扩容以及商业银行配置压力下降影响,我们认为收益率曲线仍将震荡走高,短端面临的压力大于中长端,收益率曲线整体会略显平坦化;从中央国债登记公司公布的债券托管数据来看,公募基金对债市的影响将进一步边缘化,商业银行对债市的主导作用会继续加强,市场交易机会仍然存在,但获取的难度日益增大,前期一、二市场倒挂现象将很难再现。

我们维持前期看法,即认为CPI已经于上半年触底,但受去年基数较高因素影响,三季度总体仍将维持低位波动,进入四季度后,随着翘尾因素的减弱以及大宗商品价格上涨传导的影响,CPI有望进入正值区域;我们认为在目前产能过剩的背景下,短期通胀压力对债市冲击相对有限,但全球实行数量宽松货币政策对中长期通胀的影响必须保持警惕。

我们维持前期看法,即认为货币政策进一步放松的可能性甚微,短期货币政策将延续适度宽松,但基于以下原因,我们认为货币政策提前微调的可能性正逐步增大:(1)上半年信贷增量过大且持续时间较长;(2)M1增速快速反弹且维持高位;(3)外汇占款上升且渐成趋势;(4)货币政策从调整到发挥效用有时滞。

上半年对货币基金而言操作较为困难:前五个月货币市场利率维持低位,短端收益率极度平坦化,扣除运作成本后收益严重倒挂;6月份后受IPO重启影响,货币市场利率逐步走高;现金宝管理人采取积极的投资策略,适时降低债券仓位和组合剩余期限,增加定期存款配置以面对再投资收益过低的窘境,取得了良好收益。考虑到公开市场利率仍处螺旋上升阶段,我们认为一年期以内的利率产品仍有10-30bp调整空间,目前位置短期利率产品仍缺乏吸引力。因此我们将维持组合的高流动性和短久期,确保组合的安全性。

未来现金宝货币市场基金管理人将密切跟踪相关政策动向,关注各项经济指标变化,重点做好流动性管理;考虑到IPO对货币市场冲击明显,管理人将根据IPO时期货币市场运行特点提高组合收益,严防流动性风险,最大程度保障持有人的利益。

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中,各部门参与如下:

(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)金融工程部: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,为估值提供相关模型。

(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)必要时基金经理参与制定估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

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按基金份额面值1.00元分配后转入持有人权益,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。本基金在本年度累计分配收益24,904,710.45元,其中以红利再投资方式结计入实收基金24,858,871.63元,计入应付利润科目45,838.82元。

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,本基金实施利润分配的金额为24,904,710.45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:2009年6月30日

单位:人民币元

资产		本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产:			
银行存款		400,698,321.14	1,324,719,338.50
结算备付金		9,126,666.67	6,585,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产		928,428,835.26	3,097,160,583.70
其中:股票投资		-	-
债券投资		928,428,835.26	3,097,160,583.70
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		250,000,000.00	6,206,400,000.00
应收证券清算款		75,018,100.00	596,157,920.00
应收利息		3,580,809.52	7,079,227.73
应收股利		-	-
应收申购款		7,615,650.63	1,232,330.09
递延所得税资产		-	-
其他资产		120,985.26	-
资产总计		1,674,589,368.48	11,239,334,400.02
负债和所有者权益		本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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		67,199,846.40	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		525,801.71	1,160,973.33
应付托管费		159,333.84	351,810.06
应付销售服务费		128,398.35	206,409.87
应付交易费用		7,695.60	31,756.60
应交税费		95,100.00	95,100.00
应付利息		2,160.39	-
应付利润		45,838.82	316,877.55
递延所得税负债		-	-
其他负债		34,179.70	64,500.00
负债合计		68,198,354.81	2,227,427.41
所有者权益:			
实收基金		1,606,391,013.67	11,237,106,972.61
未分配利润		-	-
所有者权益合计		1,606,391,013.67	11,237,106,972.61
负债和所有者权益总计		1,674,589,368.48	11,239,334,400.02

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值1.00元,基金份额总额1,606,391,013.67份。其中现金宝A为454,446,996.89份,现金宝B为1,151,944,016.78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:2009年1月1日-2009年6月30日

单位:人民币元

项目		本期 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
一、收入		34,248,031.76	22,011,941.26
1.利息收入		27,807,023.03	21,722,835.39
其中:存款利息收入		4,123,626.01	983,350.11
债券利息收入		18,083,784.53	16,502,863.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,599,612.49	4,236,621.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		6,441,008.73	289,105.87
其中:股票投资收益		-	-
债券投资收益		6,441,008.73	289,105.87
资产支持证券投资收益		-	-
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)		-	-
二、费用(以"-"号填列)		-9,343,321.31	-4,326,184.99
1.管理人报酬		-5,843,888.83	-2,347,178.20
2.托管费		-1,770,875.38	-711,266.15
3.销售服务费		-1,197,248.19	-530,138.05
4.交易费用		-	-
5.利息支出		-360,484.94	-566,009.77
其中:卖出回购金融资产支出		-360,484.94	-566,009.77
6.其他费用		-170,823.97	-171,592.82
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		24,904,710.45	17,685,756.27
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		24,904,710.45	17,685,756.27

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:2009年1月1日-2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009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)	11,237,106,972.61	-	11,237,106,972.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,904,710.45	24,904,710.45
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)	-9,630,715,958.94	-	-9,630,715,958.94
其中:1.基金申购款	3,211,340,337.83	-	3,211,340,337.83
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-12,842,056,296.77	-	-12,842,056,296.77
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)	-	-24,904,710.45	-24,904,710.45
五、期末所有者权益(基金净值)	1,606,391,013.67	-	1,606,391,013.67
项目	上年度可比期间 2008年1月1日-2008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)	8,845,274,536.25	-	8,845,274,536.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,685,756.27	17,685,756.27
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)	-7,824,609,099.22	-	-7,824,609,099.22
其中:1.基金申购款	7,539,381,044.08	-	7,539,381,044.08
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-15,363,990,143.30	-	-15,363,990,143.30
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)	-	-17,685,756.27	-17,685,756.27
五、期末所有者权益(基金净值)	1,020,665,437.03	-	1,020,665,437.03

6.4 报表附注

6.4.1 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、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
华宝信托投资有限责任公司("华宝信托")	基金管理人的股东
上海宝钢集团公司("宝钢集团")	受基金管理人的股东控制的公司
华宝证券经纪有限责任公司("华宝证券")	受基金管理人的股东控制的公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
当期应支付的管理费	5,843,888.83	2,347,178.20
其中:当期已支付	5,318,087.12	2,083,732.87
期末未支付	525,801.71	263,445.33

注:支付基金管理人华宝兴业的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×0.33%/当年天数。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日
当期应支付的托管费	1,770,875.38	711,266.15
其中:当期已支付	1,611,541.54	631,434.20
期末未支付	159,333.84	79,831.95

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×0.1%/当年天数。

6.4.3.2.3 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 2009年1月1日-2009年6月30日			
	当期应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	A类基金合计	B类基金合计
华宝兴业	258,299.05	42,129.15	198,583.46	101,844.74
中国建设银行	469,588.43	52,732.92	516,140.31	6,181.04
合计	727,887.48	94,862.07	714,723.77	108,025.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日-2008年6月30日			
	当期应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	A类基金合计	B类基金合计
华宝兴业	135,619.61	31,708.03	136,585.85	30,741.79
中国建设银行	233,842.17	57,466.24	280,321.05	10,987.36
合计	369,461.78	89,174.27	416,906.90	41,729.15

注: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基金管理有限公司,再由华宝兴业基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额持有人和B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%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。

6.4.3.3 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 2009年1月1日-2009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	-	-	-	-	6,327,561,600.00	350,197.56
上年度可比期间 2008年1月1日-2008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	-	-	-	-	1,271,190,000.00	87,188.15

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 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 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日-2008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A	华宝兴业现金宝货币B
期初持有的基金份额	518,190.00	-	452,587.51	-
期间认购/总份额	-	-	-	-
期间申购/买入总份额	3,540.12	-	56,869.57	-
期间因拆分增加的份额	-	-	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	521,730.12	-	509,457.08	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.03%	-	0.05%	-

注: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。

6.4.3.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	华宝兴业现金宝货币A 本期末 2009年6月30日		华宝兴业现金宝货币A 上年度末 2008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
宝钢集团	178,889.24	0.01%	-	-
华宝信托	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-
关联方名称	华宝兴业现金宝货币B 本期末 2009年6月30日		华宝兴业现金宝货币B 上年度末 2008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
宝钢集团	-	-	300,000,000.00	2.67%
华宝信托	-	-	1,175,592,000.00	10.46%
华宝证券	-	-	50,000,000.00	0.44%

注:其他关联方投资其适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.3.5 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 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日-2008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	698,321.14	624,333.47	109,781,018.30	799,505.27

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按约定利率计息。

6.4.3.6 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过往可比期间无参与关联方承销证券的情况。

6.4.4 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2009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67,199,846.40元,是以如下债券作为质押:

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
0801098	08央行票据98	2009-7-1	99.70	700,000	69,790,000.00
合计		-	-	700,000	69,790,000.00

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券

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	928,428,835.26	55.44
	其中:债券	928,428,835.26	55.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	250,000,000.00	14.93
	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	409,824,987.81	24.47
4	其他资产	86,335,545.41	5.16
5	合计	1,674,589,368.48	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	融资余额	占基金资产净值比例(%)
1	9,645,697,348.90	1.69
	其中:买断式回购融资	-
2	67,199,846.40	4.18
	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的比例(%)	原因	调整期
1	2009-1-20	22.98	本基金于1月19日发生巨额赎回	1个工作日后调整完毕

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?????????	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	122
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

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	36.41	4.18
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	26.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	19.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.61	-
4	90天(含)—180天	3.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	18.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.55	4.18

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	728,101,116.30	45.33
3	金融债券	100,330,076.75	6.25
-	其中:政策性金融债	100,330,076.75	6.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,198,011.17	5.61
6	其他	9,799,631.04	0.61
7	合计	928,428,835.26	57.80
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,799,631.04	0.61

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	0801104	08央行票据104	2,500,000	249,408,744.22	15.53
2	0801098	08央行票据98	2,300,000	229,300,956.87	14.27
3	0801092	08央行票据92	2,000,000	199,603,551.57	12.43
4	070416	07农发16	500,000	50,357,607.46	3.13
5	020208	02国开08	500,000	49,972,469.29	3.11
6	0801108	08央行票据108	500,000	49,787,863.64	3.10
7	0981106	09中牧CP01	400,000	40,050,661.32	2.49
8	0981033	09中节能CP01	300,000	30,092,572.39	1.87
9	0981054	09中普天CP01	200,000	20,054,777.46	1.25
10	050603	05中行02浮	100,000	9,799,631.04	0.61

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	4
报告期内偏离度的最高值	0.2608%
报告期内偏离度的最低值	0.0577%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1396%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 基金计价方法说明

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。本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.0000元。

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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.8.4 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额