华宝兴业现金宝货币市场基金

2012 年度 报告摘要

2012年12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
送出日期:2013年3月27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2013年3月20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有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2012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	3,032,493,462.93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
下属分级基金的交易代码;	240006	240007
报告期末下属分级基金的份额总额	902,587,819.61份	2,129,905,643.32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	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	sxxpl@fsfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588,021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郑安国	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.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	2012年		2011年		2010年	
	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	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	38,207,349.56	115,538,155.19	12,901,523.78	73,457,257.37	3,310,622.86	28,081,905.01
本期利润	38,207,349.56	115,538,155.19	12,901,523.78	73,457,257.37	3,310,622.86	28,081,905.01
本期净值收益率	4.0945%	4.3444%	3.8032%	4.0521%	1.6533%	1.9003%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末		2011年末		2010年末	
期末基金资产净值	902,587,819.61	2,129,905,643.32	617,704,111.34	4,054,172,889.16	230,914,152.02	5,567,338,696.68
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2012年末		2011年末		2010年末	
累计净值收益率	22.1570%	24.4526%	17.3520%	19.2709%	13.0523%	14.6262%

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

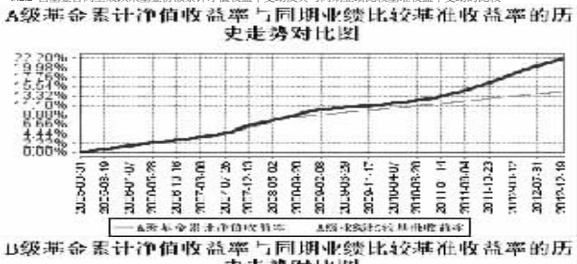
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8842%	0.0036%	0.3393%	0.0000%	0.5449%	0.0036%
过去六个月	1.7421%	0.0035%	0.6792%	0.0000%	1.0629%	0.0035%
过去一年	4.0945%	0.0037%	1.4139%	0.0002%	2.6806%	0.0035%
过去三年	9.8421%	0.0043%	4.2236%	0.0002%	5.6185%	0.0041%
过去五年	14.6046%	0.0052%	8.3312%	0.0021%	6.2734%	0.0031%
自基金合同生效起至今	22.1570%	0.0051%	14.3572%	0.0021%	7.7998%	0.0030%

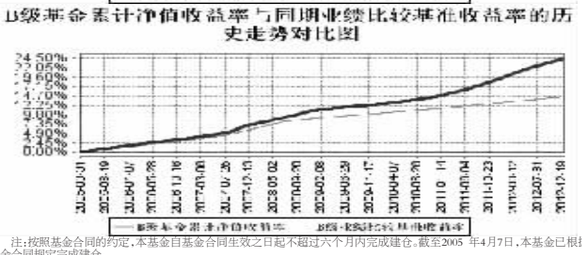
华宝兴业现金宝货币B

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
过去三个月	0.9452%	0.0036%	0.3393%	0.0000%	0.6059%	0.0036%
过去六个月	1.8650%	0.0035%	0.6792%	0.0000%	1.1858%	0.0035%
过去一年	4.3444%	0.0037%	1.4139%	0.0002%	2.9305%	0.0035%
过去三年	10.6357%	0.0043%	4.2236%	0.0002%	6.4121%	0.0041%
过去五年	15.9880%	0.0052%	8.3312%	0.0021%	7.6568%	0.0031%
自基金合同生效起至今	24.4526%	0.0051%	14.3572%	0.0021%	10.0954%	0.0030%

注: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)。

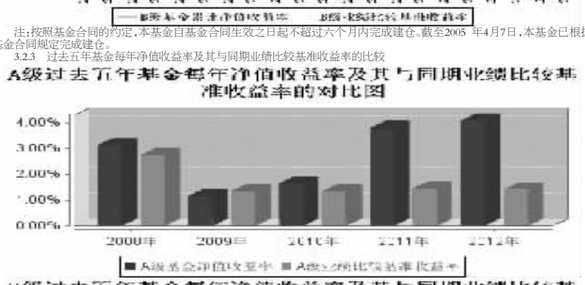
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

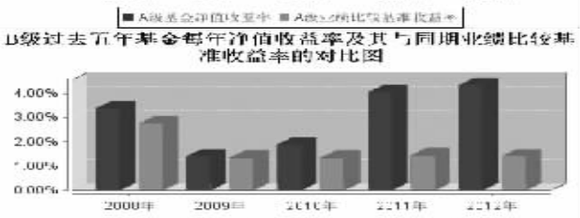




注:按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至2005 年4月7日,本基金已根据基金合同规定完成建仓。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

华宝兴业现金宝货币A					
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
2012	38,230,535.90	-	-23,186.34	38,207,349.56	
2011	12,780,170.21	-	121,353.57	12,901,523.78	
2010	3,304,226.10	-	6,396.76	3,310,622.86	
合计	54,314,932.21	-	104,563.99	54,419,496.20	
华宝兴业现金宝货币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
2012	116,259,063.15	-	-720,907.96	115,538,155.19	
2011	73,131,487.76	-	325,769.61	73,457,257.37	
2010	27,747,255.57	-	334,649.44	28,081,905.01	
合计	217,137,806.48	-	-60,488.91	217,077,317.57	

§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(2012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、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、华宝短融50基金、华宝兴业资源优选基金和华宝添益基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计37,660,892,995.57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,华宝兴业中证短融50债券基金基金经理、华宝添益基金基金经理	2011年11月15日	-	8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月起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。

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。

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经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日间向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖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。对上述监督内容在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

2012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;并采集了连续同个季度期间内、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,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%。

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

2012年债券市场整体表现良好,通胀水平回落,宏观经济运行底部回稳,以及货币政策适度放松构成了几大支撑市场走强的积极因素。具体分品种来看,在收益导向驱动下,信用债表现明显优于利率债,市场投资偏好相当集中。当然此间也并非一片坦途,在经历了上半年的强劲上涨之后,三季度市场曾出现连续调整,之后伴随着价值修复部分到位,四季度市场重新企稳收益率呈现小幅波动状态。

货币市场全年的波动区间较去年明显收敛,波动频率也有所降低,央行对于流动性管理措施有效,从前期的直接降准,到下半年逐步增加逆回购的操作规模、期限进行替代,调控更为精细平滑,市场波动被有效熨平,同时市场预期趋于稳定。

报告期内,本基金考虑到央行货币政策出现逐步放松,市场流动性水平稳中趋缓,判断货币市场收益率中枢水平将逐步出现下移,因此多数时间将组合平均剩余期限保持在较长水平,同时对大类资产配置进行了结构调整,从绝对收益水平以及信用利差的角度考虑,在收益率的较高位置重点增持了中低等级短期融资券。报告期内基金整体运作平稳,取得了良好的投资回报。

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4.0945%,同期业绩比较基准收益率为1.4139%,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4.3444%,同期业绩比较基准收益率为1.4139%,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

目前来看,2013年的前期,宏观经济运行和通胀仍将较为平稳,货币政策整体基调也无明显转向。影响债券市场的几大主要因素未见改变,市场在缺乏催化剂的情况下,难以孕育出显著的趋势性行情,将以持有收益为主。在追求绝对回报的同时,本年具体操作中对于信用债投资要做好风险预防和控制,密切跟踪各行业和经营主体的景气状况,避免偶发的个体信用事件对于资产组合产生明显影响。

本基金将继续对宏观经济、货币政策做好跟踪预判,并据此构建资产组合、调整投资策略,力争为投资者获取持久稳定的回报。

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。

(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。公司根据业务情况调整和细化了市场、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。2012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,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级基金在本年度累计分配收益 38,207,349.56 元,其中以红利再投资方式结转入实收基金 38,230,535.90元,计入应付利润科目 -23,186.34 元。现金宝B级基金在本年度累计分配收益 115,538,155.19元,其中以红利再投资方式结转入实收基金 116,259,063.15元,计入应付利润科目 -720,907.96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:A级为38,207,349.56元,B级为115,538,155.19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:华宝兴业现金宝货币市场基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:			
银行存款		1,851,317,855.54	1,701,643,846.48
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		1,322,224,503.71	1,155,866,189.71
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,322,224,503.71	1,155,866,189.71
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	1,797,805,056.70
应收证券清算款		20,618,403.84	-
应收利息		30,763,558.87	19,446,150.64
应收股利		-	-
应收申购款		1,323,885.47	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,226,248,207.43	4,674,761,243.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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		191,099,502.75	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,113,972.56	864,146.05
应付托管费		337,567.48	261,862.41
应付销售服务费		256,590.61	141,646.80
应付交易费用		30,352.09	31,215.14
应交税费		95,100.00	95,100.00
应付利息		75,480.68	-
应付利润		437,178.33	1,181,272.63
递延所得税负债		-	-
其他负债		309,000.00	309,000.00
负债合计		193,754,744.50	2,884,243.03
所有者权益:			
实收基金		3,032,493,462.93	4,671,877,000.50
未分配利润		-	-
所有者权益合计		3,032,493,462.93	4,671,877,000.50
负债和所有者权益总计		3,226,248,207.43	4,674,761,243.53

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.00元,基金份额总额3,032,493,462.93份,其中A类基金份额902,587,819.61份,B类基金份额2,129,905,643.32份。

7.2 利润表

会计主体:华宝兴业现金宝货币市场基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		174,824,579.46	97,836,640.65
1.利息收入		161,033,272.04	94,795,500.80
其中:存款利息收入		87,255,274.35	29,393,205.41
债券利息收入		57,458,428.47	37,813,823.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,319,569.22	27,588,472.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		13,791,307.42	3,041,139.85
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		13,791,307.42	3,041,139.85
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)		-	-
减:二、费用		21,079,074.71	11,477,859.50
1. 管理人报酬		12,572,633.53	7,214,348.44
2. 托管费		3,809,888.93	2,186,166.27
3. 销售服务费		2,812,832.61	1,035,046.64
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		1,496,804.99	685,344.88
其中:卖出回购金融资产支出		1,496,804.99	685,344.88
6. 其他费用		386,914.65	356,953.27
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		153,745,504.75	86,358,781.15
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		153,745,504.75	86,358,781.15

7.3 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:2012年1月1日 至 2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	4,671,877,000.50	-	4,671,877,000.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	153,745,504.75	153,745,504.75
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)	-1,639,383,537.57	-	-1,639,383,537.57
其中:1.基金申购款	24,445,308,235.38	-	24,445,308,235.38
2.基金赎回款	-26,084,691,772.95	-	-26,084,691,772.95
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)	-	-153,745,504.75	-153,745,504.75
五、期末所有者权益(基金净值)	3,032,493,462.93	-	3,032,493,462.93
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	5,798,252,848.70	-	5,798,252,848.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	86,358,781.15	86,358,781.15
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)	-1,126,375,848.20	-	-1,126,375,848.20
其中:1.基金申购款	15,050,676,663.10	-	15,050,676,663.10
2.基金赎回款	-16,177,052,511.30	-	-16,177,052,511.30
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)	-	-86,358,781.15	-86,358,781.15
五、期末所有者权益(基金净值)	4,671,877,000.50	-	4,671,877,000.50

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:

董长江、黄小蕾、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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31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191,099,502.75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	2013年1月4日	100.32	300,000	30,096,000.00
120228	12国开28	2013年1月4日	99.77	2,500,000	249,425,000.00
合计				2,800,000	279,521,000.00

7.4.9.3.2 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,因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 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)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2012年12月31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级的余额为1,322,224,503.71元,无属于第一或第三层级的余额(2011年12月31日:第二层级1,155,866,189.71元,无属于第一或第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,322,224,503.71	40.98
	其中:债券	1,322,224,503.71	40.98
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	1,851,317,855.54	57.38
4	其他各项资产	52,705,848.18	1.63
5	合计	3,226,248,207.43	100.00

8.2 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	1.61
	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	191,099,502.75 / 6.30
	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

本报告期内债券正回购的资金余额未有超过基金资产净值的20%的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	140
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	159
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

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。

8.3.2