华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞稳健收益债券	
交易代码	460008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月4日	
报告期末基金份额总额	899,228,017.80份	
投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳健增值,力争实现超越业绩比较基准的投资收益	
投资策略	本基金将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上,综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略登主动投资策略,选择合适的时机和品种构建债券组合。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率(税后)+1%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华泰柏瑞稳健收益债券A	华泰柏瑞稳健收益债券C
下属两级基金的交易代码	460008	460108
报告期末下属两级基金的份额总额	774,663,200.40份	124,564,817.40份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年3月31日)	
	华泰柏瑞稳健收益债券A	华泰柏瑞稳健收益债券C
1.本期已实现收益	8,909,890.47	2,475,688.03
2.本期利润	20,849,207.34	6,480,096.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0283	0.0271
4.期末基金资产净值	798,042,840.56	128,076,667.47
5.期末基金份额净值	1.030	1.028

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

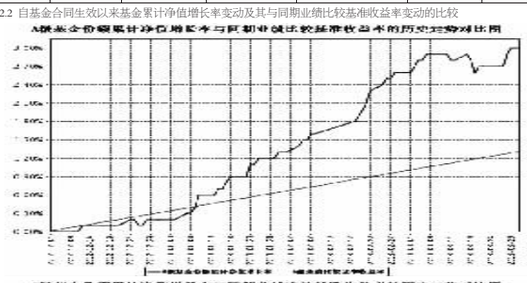
华泰柏瑞稳健收益债券A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	2.79%	0.08%	1.00%	0.02%	1.79%	0.06%

华泰柏瑞稳健收益债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	2.70%	0.08%	1.00%	0.02%	1.70%	0.06%

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



注:1、图示日期为2012年12月4日至2013年3月31日。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(二)投资范围中规定的各项比例,投资于债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈海	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2012年12月3日	-	20年	经济学博士。20年证券投资从业经历。曾任易方达基金管理有限公司月度收益中短期债券投资基金基金经理。2007年11月加入本公司。历任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券基金基金经理、华泰柏瑞货币基金基金经理。2011年9月起任华泰柏瑞信用增利债券基金基金经理。2012年6月起任华泰柏瑞固定收益部副总监。2012年12月起任华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况: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%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

现在看来,过去的一个季度流动性的充沛主要源自外汇占款的远超预期,市场资金的充沛给股市带来活力,也让债券市场的收益率继续下滑。在一季度,债券整体收益率水平在去年基础上继续下降,中低评级信用债继续是市场最活跃的类别,5年期AA中票从年初的5.9%水平下滑了40点左右,而10年期国债只是从较高的3.60%左右回到3.50%一线。在一季度,信用利差水平继续下降,除了流动性因素外,理财类资金对收益的高要求和投资者普遍对中国信用债的信心是主要原因。在银监会关于整顿理财资金的8号文出台以后,市场认为商业银行将对债券市场有更大需求,从而进一步推动了整体债市的上升。

本基金在一季度增加了高票息的城投债等品种,提高了基金的组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A类和B类份额净值分别为1.030元和1.028元,分别上涨2.79%和2.70%,同期本基金的业绩比较基准上涨1%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对二季度债券市场的发展仍然抱有较强的信心。三月份的两会继续强调了可持续发展,稳增长控通胀防风险的宏观政策基调,大大降低了为了保增长强推刺激政策的可能性,保持了债券市场良好的政策环境;而经济的结构性调整使得企业加大投资的整体意愿不强、整体经济保持温和增长的基本面也使债券市场作为投融资工具的大发展能够得到较好的延续。

另一方面,我们也期待债券市场自身的结构性发展,一方面,商业银行对非标理财产品的纠偏可能带来更多的信用债需求;另一方面,经济结构调整中暴露的风险也有望在信用债的等级利差品种选择上得到体现。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,295,327,020.60	98.04
	其中:债券	1,295,327,020.60	98.04
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	4,266,191.43	0.32
6	其他资产	21,567,054.23	1.63
7	合计	1,321,160,266.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	56,716,420.60	6.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,975,000.00	5.40
	其中:政策性金融债	49,975,000.00	5.40
4	企业债券	803,497,600.00	86.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	385,138,000.00	41.59
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,295,327,020.60	139.87

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1280496	12宜城投债	700,000	71,043,000.00	7.67
2	1280289	12锡建发债	500,000	51,310,000.00	5.54
3	1280392	12芜湖新马债	500,000	51,265,000.00	5.54
4	124033	12苏城投	500,000	50,855,000.00	5.49
5	124161	13瑞水泥	500,000	50,850,000.00	5.49

5.6 报告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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

报告期内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的情形,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,952.34
2	应收证券清算款	2,951,956.18
3	应收股利	-
4	应收利息	17,738,711.08
5	应收申购款	861,434.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,567,054.23

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:截至本报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华泰柏瑞稳健收益债券A	华泰柏瑞稳健收益债券C
本报告期期初基金份额总额	858,369,447.47	448,707,354.14
本报告期基金总申购份额	393,956,883.94	113,233,024.32
减:本报告期基金总赎回份额	477,663,131.01	437,375,561.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	774,663,200.40	124,564,817.40

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、本基金的中国证监会批准募集文件

2、本基金的《基金合同》

3、本基金的《招募说明书》

4、本基金的《托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。

客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638

公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2013年4月18日

华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月15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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝短融50
基金主代码	240021
交易代码	240021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月12日
报告期末基金份额总额	83,329,416.01份
投资目标	本基金通过指数化投资,实现对标的指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为以中证短融50指数成份券为基础的被动式指数基金,采用最优复制法,综合考虑跟踪效果、操作风险、投资可行性等因素构建投资组合,并根据基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间债券市场交易特性等情况,对投资组合进行优化调整,以力争对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	95%*中证短融50指数收益率 + 5%*银行活期存款(税后)收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年3月31日)
1.本期已实现收益	922,576.82
2.本期利润	1,407,249.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0106
4.期末基金资产净值	85,383,965.33
5.期末基金份额净值	1.025

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。

2、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。

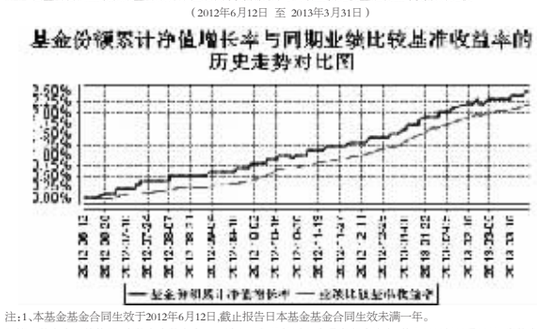
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.99%	0.04%	0.98%	0.02%	0.01%	0.02%

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

(2012年6月12日 至 2013年3月31日)



注:1、本基金基金合同生效于2012年6月12日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、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2012年12月12日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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、华宝兴业现金宝货币基金经理、华宝添益基金经理	2012年6月12日	-	9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。

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、《华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金合同》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,中证短融50指数基金在短期内出现过持有的现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于5%,持有的指数成份券及其备选成份券的投资比例低于基金资产的90%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 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,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度宏观经济依旧在低位运行, 2月份CPI同比受短期食品因素干扰跳升至3.2%但通胀整体态势仍较平稳。1月份外汇占款创出历史新高达6800亿,在此背景下,自2月中旬开始央行公开市场操作出现方向性调整,逆回购暂停正回购则重出江湖,至3月底的连续6周回笼使得市场普遍预期央行货币政策未来将有所收紧。不过由于央行实际净回笼力度相对温和,货币市场除在春节及2月底出现阶段性紧张外,一季度内资金面整体尚可,利率债及信用债收益率均有所下行,信用债表现略优但投资者对其态度趋于谨慎。

报告期内本基金通过既定策略对标的指数进行有效跟踪,整体运行状况良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为0.99%,同期业绩比较基准收益率为0.98%,基金表现领先业绩基准0.01%。

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,二季度宏观经济运行和通胀仍将较为平稳,货币政策出现明显转向的条件尚不成熟。债券市场在缺乏催化剂的情况下,难以出现趋势性行情,仍将以获取持有收益为主。由于经济仍运行在底部区间,企业景气度偏弱,对于信用债投资,要继续做好风险预防和控制,密切跟踪各行业和主体的经营状况,有所取舍,避免偶发的个体信用事件对于资产组合产生明显影响。

下一阶段,本基金将继续按照基金合同的要求,通过既定的指数化投资策略,在做好成份券调整和日常申赎的同时,严格控制跟踪误差,实现对标的指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	80,417,000.00	92.34
	其中:债券	80,417,000.00	92.34
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	5,419,613.68	6.22
6	其他资产	1,250,267.51	1.44
7	合计	87,086,881.19	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,417,000.00	94.18
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	80,417,000.00	94.18

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041261033	12联通CP002	400,000	40,208,000.00	47.09
2	041259058	12国电集CP003	300,000	30,171,000.00	35.34
3	041256022	12武钢CP003	100,000	10,038,000.00	11.76

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

本基金不投资股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,246,884.43
5	应收申购款	3,383.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,250,267.51

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	176,302,778.82
报告期期间基金总申购份额	5,465,673.06
减:报告期期间基金总赎回份额	98,439,035.87
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	83,329,416.01

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金合同;

华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金托管协议;

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;

基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

7.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2013年4月18日

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

2013 第一季度 报告

2013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
报告送出日期:2013年4月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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4月15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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	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
报告期末基金份额总额	54,924,309.02份
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,把握买卖时机。 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,将资期到的变动资本化。 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,进行跨市场、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陡升的投资机会。 6.现金流管理策略: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。
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100元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年3月31日)
1. 本期已实现收益	19,019,561.55
2.本期利润	19,019,561.55
3.期末基金资产净值	5,492,430,901.82

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。

2、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。

3.2 基金净值表现

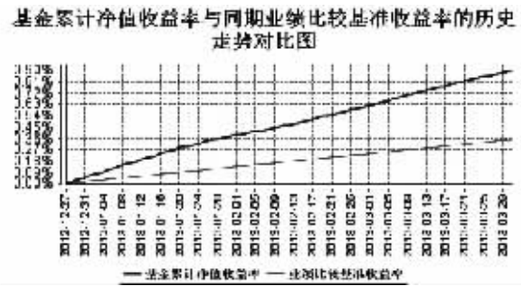
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	①-③	②-④
过去三个月	0.8474%	0.0028%	0.3329%	0.0000%	0.5145%	0.0028%

注:基金收益分配是按日结转份额。

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

(2012年12月27日 至 2013年3月31日)



注:1、本基金基金合同生效于2012年12月27日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、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。截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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、华宝兴业现金宝货币基金经理、华宝兴业中证短融50债券基金基金经理	2012年12月27日	-	9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。

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、《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 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,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度宏观经济依旧在低位运行, 2月份CPI同比受短期食品因素干扰跳升至3.2%但通胀整体态势仍较平稳。1月份外汇占款创出历史新高达6800亿,在此背景下,自2月中旬开始央行公开市场操作出现方向性调整,逆回购暂停正回购则重出江湖,至3月底的连续6周回笼使得市场普遍预期央行货币政策未来将有所收紧。不过由于央行实际净回笼力度相对温和,货币市场除在春节及2月底出现阶段性紧张外,一季度内资金面整体尚可,利率债及信用债收益率均有所下行,信用债表现略优但投资者对其态度趋于谨慎。

基于央行正回购重启、流动性存在逐步收紧的可能,本基金在报告期内将投资组合剩余期限维持在中等水平,并注意利用脉冲走势捕捉高收益资产配置机会,基金整体运作平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值收益率为0.8474%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%,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,二季度宏观经济运行和通胀仍将较为平稳,货币政策出现明显转向的条件尚不成熟。债券市场在缺乏催化剂的情况下,难以出现趋势性行情,仍将以获取持有收益为主。由于经济仍运行在底部区间,企业景气度偏弱,对于信用债投资,要继续做好风险预防和控制,密切跟踪各行业和主体的经营状况,有所取舍,避免偶发的个体信用事件对于资产组合产生明显影响。

下一阶段,本基金将继续对宏观经济、货币政策做好跟踪预判,并据此调整投资组合,力争为投资者获取更好的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,685,054,065.70	28.43
	其中:债券	1,685,054,065.70	28.43
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	367,301,070.95	6.20
	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	3,847,781,843.23	64.92
4	其他资产	27,038,200.37	0.46
5	合计	5,927,175,180.25	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	2.16	
	其中:买断式回购融资	0.00	
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	431,298,522.95	7.85
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告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(%)