华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第一季度 报告

2014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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	华宝兴业上证180价值ETF联接
基金主代码	240016
交易代码	240016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月23日
报告期末基金份额总额	255,655,089.94份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF以达到投资目标。当本基金申购赎回和买卖目标ETF,或基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,本管理人会在10个交易日内对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×上证180价值指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	本基金为ETF联接基金,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金,紧密跟踪标的指数,属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相匹的产品。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华宝兴业上证180价值ETF
基金主代码	510030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年4月23日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年5月28日
基金管理人名称	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化
投资策略	本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下,本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况(如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代(何行业股票优先考虑),以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。
业绩比较基准	上证180价值指数
风险收益特征	本基金为股票基金,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金,紧密跟踪标的指数,属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相匹的产品。

§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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-4,065,199.15
2.本期利润	-11,258,858.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0430
4.期末基金资产净值	206,912,910.85
5.期末基金份额净值	0.809

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。

3.2.1 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	-4.94%	1.10%	-4.82%	1.10%	-0.12%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

(2010年4月23日至2014年3月31日)

注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的3个月内达到规定的资产组合,截至2010年7月底,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		
徐林明	本基金基金经理、华宝兴业上证180价值ETF基金经理、量化投资部总经理	2010年4月23日	-	12年	复旦大学经济学硕士,FRM,曾在兴业证券、凯龙财经(上海)有限公司、中银证券从事金融工程研究工作。2005年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理。2009年9月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理,2010年2月起任量化投资部总经理,2010年4月起兼任华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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、《华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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

回顾2014年一季度,宏观经济开局不佳,经济数据低于预期,房地产市场风险和信用违约风险开始显现,人民币汇率创近10年来最大的单季贬值,宏观经济正经历转型的阵痛,3月旬稳增长措施的出台阶段性企稳市场预期。一季度理财市场的最大赢家为货币市场基金,反映利率市场化进程的加快和投资者现金为王的选择。在主题投资的脉冲行情下股票市场整体呈现弱势特征,板块表现分化严重,主板市场跌幅收窄,创业板冲高回落。在本报告期中,沪深300和上证180价值指数分别下跌7.89%和5.10%,中小板指数下跌7.73%,而创业板指数上涨1.79%。

本报告期本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.809元,本报告期基金份额净值增长率为-4.94%,同期业绩比较基准收益率为-4.82%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度的绝对值为0.05%,年化跟踪误差为1.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年二季度,稳增长措施将对冲经济下行的风险,但市场将迎来信托兑付小高峰,再加上IPO再启后的资金分流,股市仍面临比较复杂的环境。处于转型和改革的宏观背景下,在刚性兑付逐渐被打破的风险开始市场化的投资背景下,资本市场承受较大的融资压力,或许也将承担更多投资功能。今年以来蓝筹股群体的超预期分红方案提升其低估值的实际吸引力,国企改革和优先股等正改善蓝筹股的基本面预期,而注册制的推进预计将对A股市场结构供求关系和估值体系产生深远影响。对于估值处于历史底部区域的蓝筹股,或许应该以相对积极的态度对待。

作为指数基金的管理人,我们将继续严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,积极应对成分股调整和基金申购赎回,严格控制基金相对目标指数的跟踪误差,实现对上证180价值指数的有效跟踪。

§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	基金投资	192,123,085.71	92.10
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,786,976.78	5.17
8	其他资产	5,685,515.55	2.73
9	合计	208,595,578.04	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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	上证180价值ETF	指数型	交易型开放式	华宝兴业基金管理有限公司	192,123,085.71	92.85

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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。

5.12.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	87,535.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,492.38
5	应收申购款	5,595,488.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,685,515.55

5.12.4 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。

5.12.5 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

报告期初基金份额总额	273,844,508.67
报告期间基金总申购份额	34,075,410.39
减:报告期间基金总赎回份额	52,264,829.12
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	255,655,089.94

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,419,398.81
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,419,398.81
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.34

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同;

华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书;

华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议;

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。

8.2 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。

8.3 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
2014年4月22日

华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014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:2014年4月22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2014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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014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	11,849,627.11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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	100,629.32
2.本期利润	172,465.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0121
4.期末基金资产净值	12,410,830.86
5.期末基金份额净值	1.047

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。

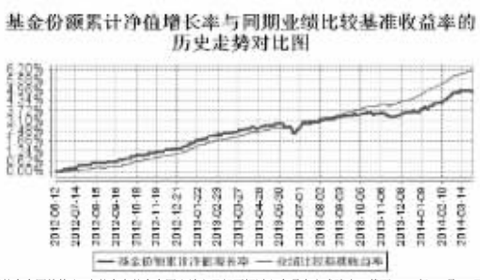
3.2 基金净值表现

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	1.06%	0.06%	1.56%	0.02%	-0.50%	0.04%

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2014年3月31日)



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	2012年6月12日	2014年2月19日	10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月起兼任华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。
王瑞海	固定收益部总经理、本基金基金经理、华宝兴业增强收益债券基金经理	2014年2月19日	-	19年	硕士。曾在深圳中大投资管理公司、海南证券北京营业部、太平人寿保险有限公司、太平资产管理有限公司从事投资管理、股票自营和固定收益投资研究工作。2012年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,任固定收益部总经理。2013年4月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理,2014年2月兼任华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金经理。

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、《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。

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

2014年1季度,中国货币市场和债券市场总体情况较为稳定。度过传统资金紧张的春节之后,资金面进入较为宽松阶段。伴随资金宽松,债券市场有一轮较为可观的上涨,但上涨并不持续,信用利差拉大,体现了市场对后期资金面和经济形势的谨慎态度。在回业监管日趋严格的环境下,银行同业业务呈逐步放缓,而货币基金为代表的同业存款供应方迎大幅缩加,导致货币基金重点配置的同业存款利率在春节后大幅下滑,是货币基金收益率在春节后显著下降的主要原因。本基金在一季度适当增加了银行存款的配置,进行了债券仓位结构优化,重点加大了短期金融债的配置比例,由于本基金在春节后规模快速增长,配置的资产收益率较低,本基金一季度后半期收益率有所下降。

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1.3172%,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

今年一季度已经公布的宏观数据显示国内经济增长势头进一步趋弱,工业增加值、固定资产投资、消费和出口数据均显著下滑。企业、政府杠杆高企,金融资产过度膨胀,传统的刺激经济增长的措施目前遇到较大阻碍,信用风险受到前所未有的关注,这使得资金更难流入实体经济,而仅在金融系统运转,体现为目前货币市场宽松但企业融资非常困难的局面。央行在3月份加大了人民币汇率的双向波动幅度,用贬值打击了流入中国套利的热钱,但在国内经济进一步趋弱,而美国QE退出的背景下,也加大了资金流出中国的风险。二季度传统上资金面将比一季度趋紧,外汇占款减少,财政存款上缴,央行目前的公开市场操作也是态度谨慎,因此我们对二季度的货币市场,以及受资金面影响较大的短融,保持较大的谨慎。

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。更加注重做好流动性管理,防范可能出现的半年末资金紧张情况导致的基金流动性风险。

§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	15,091,500.00	88.29
	其中:债券	15,091,500.00	88.29
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,690,682.95	9.89
7	其他资产	311,789.49	1.82
8	合计	17,093,972.44	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	15,091,500.00	121.60
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	15,091,500.00	121.60

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	011309007	13国电集SCP007	150,000	15,091,500.00	121.60

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金不投资股票。

5.10.3 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	251,993.12
5	应收申购款	1,492.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	58,303.84
8	其他	-
9	合计	311,789.49

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	16,091,250.25
报告期期间基金总申购份额	178,663.11
减:报告期期间基金总赎回份额	4,420,286.25
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	11,849,627.11

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.本基金资产规模低于5000万,对于基金跟踪标的指数等投资运作管理带来一定影响,敬请投资者注意风险。

2.经与本基金基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,本基金管理人拟对本基金实施转型并正在以通讯方式召开基金份额持有人大会。本次转型涉及基金名称变更、基金类型变更、基金投资变更、基金份额分类、基金的费率及费率结构变更、基金的收益与分配变更、基金存续条件变更以及依据最新法律法规对现《基金合同》相关内容的修订等内容,转型后基金名称将由"华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金"变更为"华宝兴业活期通货币市场基金",《华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金合同》则变更为《华宝兴业活期通货币市场基金基金合同》。具体内容请参考本基金管理人于2014年3月24日发布的《华宝兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,基金份额持有人大会表决票收取时间自2014年4月14日起至2014年4月25日17:00止。请持有人关注本基金管理人的后续公告并根据自身的风险承受能力及时做出相应的投资决策。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 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。

9.3 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
2014年4月22日

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

2014 第一季度 报告

2014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:2014年4月22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2014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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014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	244,495,198.01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积极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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	192,070,520.85
2.本期利润	192,070,520.85
3.期末基金资产净值	24,449,519,801.48

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

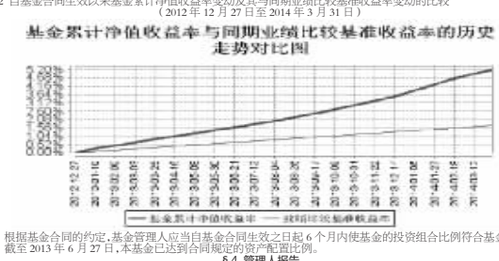
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.3172%	0.0026%	0.3329%	0.0000%	0.9843%	0.0026%

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2014年3月31日)



注: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。

§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	2012年12月27日	-	10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