华宝兴业活期通货币市场基金

2014 第三季度 报告

2014年9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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业活期通货币	
基金主代码	000643	
交易代码	000643	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年5月21日	
报告期末基金份额总额	56,720,800.66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。本基金的平均剩余期限控制在120天以内。 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 基金管理人将密切关注基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素,对投资组合的现金比例进行结构化管理。同时,也会通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金流,保持本基金的充分流动性。	
业绩比较基准	人民币活期存款利率(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。本基金的预期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	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T
下属两级基金的交易代码	000643	240021
报告期末下属两级基金的份额总额	50,770,131.64份	5,950,669.02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(2014年7月1日-2014年9月30日)	
	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T
1. 本期已实现收益	510,499.58	72,708.62
2.本期利润	510,499.58	72,708.62
3.期末基金资产净值	50,770,131.64	5,950,669.02

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

华宝兴业活期通货币A

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	0.8503%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.7621%	0.0008%

注:基金收益分配是按日结转份额。

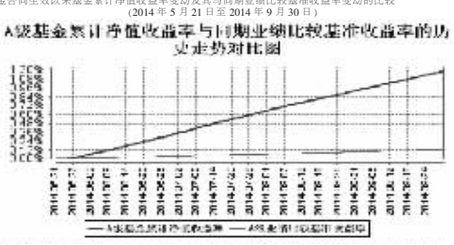
华宝兴业活期通货币T

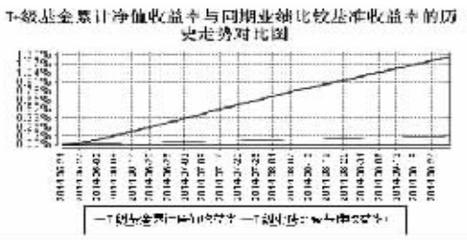
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9112%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.8230%	0.0008%

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

(2014年5月21日至2014年9月30日)





注:1.本基金从原华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金转型而来,本基金合同生效于2014年5月21日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2.按照基金合同的规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六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		
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,华宝兴业可转债债券基金经理	2014年5月21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月至2014年5月任华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金(该基金自2014年5月21日转型为华宝兴业活期通货币市场基金)基金经理。2014年5月兼任华宝兴业活期通货币市场基金基金经理。2014年5月兼任华宝兴业可转债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.证券从业之义遵从行业协会《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、《华宝兴业活期通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,本基金没有发现异常交易行为。

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

三季度,是新契约生效以来第一个完整的投资季度,整体货币政策宽松,流动性除月末和新股发行时有些紧张外,大部分时间以宽为主,央行有意通过公开市场操作引导短期利率下行,银行间市场和交易所市场的短期利率分化日益严重。货币基金重点配置的同业存款利率一直在走低,这是货币基金收益率下降的主要原因。本基金目前仍然主要以银行存款配置为主,回购和现金配置较少。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

活期通A:本基金报告期内净值收益率为0.8503%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%,业绩比较基准为人民币活期存款利率(税后)。

活期通T:本基金报告期内净值收益率为0.9112%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%,业绩比较基准为人民币活期存款利率(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

四中全会召开在即,沪港通、地方债发行、房贷政策放松等等逐渐进入落实阶段,同往年一样,十月中下旬市场将进入政策敏感期,各项宏观政策的具体实施细则,会对市场的预期产生较大的影响。

市场的流动性处于较宽松阶段,估计在四中全会前后较长一段时间不会有大的变化,降低实体经济融资成本仍将是市场的主基调。在严控信用的前提下,把握好各个时段的流动性特征,掌握好政策性金融债和短期融资券的配置比例,控制好组合的剩余期限,在此基础上,抓住关键时点做好资产配置,努力提高收益率。

§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	15,053,705.21	26.40
	其中:债券	15,053,705.21	26.40
	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	41,027,806.48	71.94
4	其他资产	949,895.67	1.67
5	合计	57,031,407.36	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	0.85	
	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	-	-
	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	82
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	58

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同规定"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(%)
1	30天以内	19.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	35.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	26.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	17.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.87	-

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	摊余成本(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	10,014,095.35	17.66
	其中:政策性金融债	10,014,095.35	17.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	5,039,609.86	8.88
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	15,053,705.21	26.54
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140212	14国开12	100,000	10,014,095.35	17.66
2	041365013	13需山水务CP001	50,000	5,039,609.86	8.88

5.6 "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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0455%
报告期内偏离度的最低值	-0.0376%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0170%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

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。

5.8.3

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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,065.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	948,829.87
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	949,895.67

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝兴业活期通货币A	华宝兴业活期通货币T
报告期期初基金份额总额	98,277,115.27	7,977,469.14
报告期期间基金总申购份额	54,231,200.38	50,565,508.93
减:报告期期间基金总赎回份额	101,738,184.01	52,592,309.05
报告期期末基金份额总额	50,770,131.64	5,950,669.02

注:总申购份额含红利再投。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014年8月26日	50,000,000.00	50,000,000.00	-
2	赎回	2014年8月26日	-50,314,201.03	-50,437,330.19	-
合计			-314,201.03	-437,330.19	

注:1.交易日期为申请日期,交易金额为确认金额(不含交易费用),交易份额为确认份额。

2.上表中,申请申购的为活期通基金A类份额,持有满90天后将自动转为活期通T类份额。

§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;

华宝兴业活期通货币市场基金基金合同;

华宝兴业活期通货币市场基金招募说明书;

华宝兴业活期通货币市场基金托管协议;

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办公场所及基金托管人住所备投资者查阅。

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10月24日

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 第三季度 报告

2014年9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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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10月22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7月1日起至9月30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	201,946,081.55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,或基金日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近的产品。
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,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、流动性等因素挑选股票的指数中其他成份股或备选成份股进行替代(同行业股票优先考虑),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近的产品。

§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7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	3,414,446.20
2.本期利润	24,584,018.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0909
4.期末基金资产净值	185,763,645.84
5.期末基金份额净值	0.920

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。

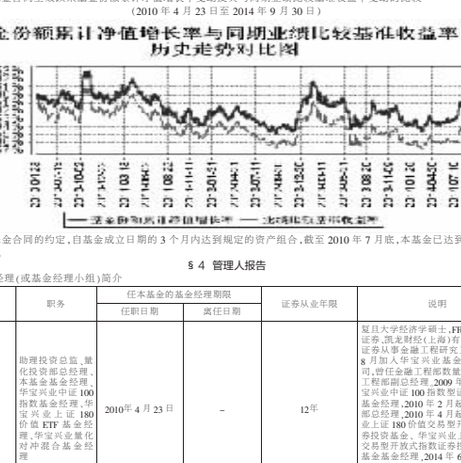
3.2 基金净值表现

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	10.84%	0.88%	8.35%	0.89%	2.49%	-0.01%

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9月30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	助理投资总监,量化投资部总经理,本基金基金经理,华宝兴业中证100指数基金经理,华宝兴业上证180价值ETF基金经理,华宝兴业量化对冲混合基金经理	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,中原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。2014年6月任助理投资总监。2014年9月兼任华宝兴业量化对冲策略混合型发起式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.证券从业合义遵从行业协会《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、《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。

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,上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接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%以及持有的ETF市值占基金资产净值比低于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,本基金没有发现异常交易行为。

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年三季度国内经济形势较为平淡,PMI、发用电量、工业增加值等数据均欠佳,且房地产销售"金九银十"旺季不旺的迹象较为明显,政策稳增长倾斜的趋势较为明显,放松房地产的限购、限贷政策,多措并举缓解企业融资成本高的问题等,定向降准、贷存比口径调整等微调政策保证流动性整体偏松,证券市场在对改革的预期下走出一波反弹行情。在本报告期中,沪深300和上证180价值指数分别上涨13.20%和8.78%,而中小板和创业板指数上涨分别为16.90%和9.69%。

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0.920元,本报告期基金份额净值增长率为10.84%,同期业绩比较基准收益率为8.35%,本报告期内本基金的日均跟踪偏离度的绝对值为0.076%,年化跟踪误差为2.03%。

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年四季度,稳增长措施将继续对冲经济下行的风险,新股发行和传统年底资金紧张期,预计流动性不及三季度。随着十八届四中全会的召开,政策红利将会进一步释放,以及沪港通的实施将提高估值处于历史底部区域的蓝筹股的吸引力,应该以相对积极的态度对待蓝筹股的投资机会。

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	3,725,689.60	1.97
	其中:股票	3,725,689.60	1.97
2	基金投资	172,287,014.69	91.18
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	11,574,462.89	6.13
8	其他资产	1,365,269.98	0.72
9	合计	188,952,437.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	291,041.00	0.16
C	制造业	566,330.00	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	226,499.00	0.12
E	建筑业	175,429.00	0.09
F	批发和零售业	5,264.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	109,507.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,478.00	0.03
J	金融业	2,135,249.60	1.15
K	房地产业	165,892.00	0.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,725,689.60	2.01

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	8,700	359,658.00	0.19
2	600036	招商银行	27,700	287,803.00	0.15
3	600016	民生银行	45,360	283,046.40	0.15
4	600000	浦发银行	24,300	236,925.00	0.13
5	601166	兴业银行	19,200	196,224.00	0.11
6	601328	交通银行	39,300	168,597.00	0.09
7	600839	四川长虹	27,300	118,209.00	0.06
8	601288	农业银行	43,400	108,066.00	0.06
9	600900	长江电力	13,300	105,070.00	0.06
10	601601	中国太保	5,400	104,814.00	0.06

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	交易型开放式	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	172,287,014.69	92.75

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

2013年10月14日中国平安公告其控股子公司平安证券有限责任公司近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》([2013]48号),中国证券监督管理委员会决定责令平安证券改正及给予警告,没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐业务许可3个月。

2013年11月13日招商银行股份有限公司收到交易商协会自律处分。处罚原因是林州重机集团股份有限公司作为债务融资工具发行人,在债务融资工具存续期间,因诚信事项涉及重大事项信息披露延迟及持有人会议延迟召开等情形,主承销商招商银行,中信银行在后续管理工作中未充分尽职履责,根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予主承销商中信银行、招商银行诫勉谈话处分,并处责令改正。

本基金是目标ETF的联接基金,为开放式指数基金,股票部分采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在上证180价值指数中的基准权重构建指数化投资组合,基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

本报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,719.58
2	应收证券清算款	1,245,832.87
3	应收股利	-
4	应收利息	2,217.44
5	应收申购款	70,500.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,365,269.98

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600839	四川长虹	118,209.00	0.06	临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	265,296,547.82
报告期期间基金总申购份额	76,661,778.90
减:报告期期间基金总赎回份额	140,012,245.17
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	201,946,081.55

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份额比例(%)	1.69

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内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办公场所及基金托管人住所备投资者查阅。

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10月24日

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

2014 第三季度 报告

2014年9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:2014年10月24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、