华宝兴业现金添益交易型货币市场基金

2014 第四季度 报告

2014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
报告送出日期:2015年1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2015年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝添益
场内简称	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	205,795,522.20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(2014年10月1日 - 2014年12月31日)
1. 本期已实现收益	204,755,811.33
2.本期利润	204,755,811.33
3.期末基金资产净值	20,579,552,220.19

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

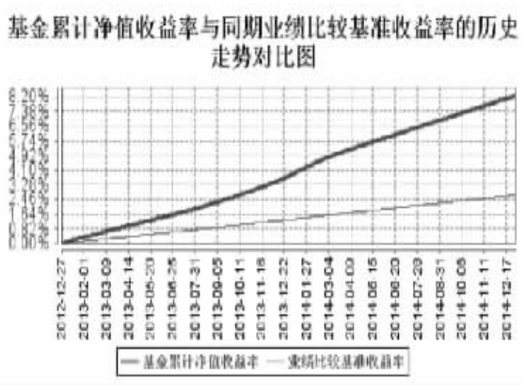
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.9559%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.6156%	0.0011%

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12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

四季度,国内宏观经济依旧维持在底部运行。货币市场呈现前松后紧的格局,总体对央行宽松与大行融出的依赖度较高。在央行减少公开市场操作,前期MLF到期后部分续作,以及IPO发行等因素的叠加影响下,后半季度资金面较为紧张。市场收益率水平亦出现大幅波动,央行降息带来收益率短暂下行后,便出现一波较为快速的反弹。本基金在报告期内,延续了三季度的资产配置思路,维持中高等级信用债配比,并适当拉长平均组合剩余期限,整体运行平稳。

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0.9559%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%,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

展望2015年,中国改革步入深水区、经济发展进入换挡期,经济结构的转型与优化将带给市场新的机遇与挑战。宏观经济短期内仍将维持在低位运行。在新常态下,"滴注式"定向刺激依旧是央行货币政策的主基调,从而促进社会整体融资成本进一步降低。美国等发达经济体的复苏是较为不确定的外部环境,预期不断增强的美国加息将给国内货币政策的施展空间带来影响。下一季度货币市场总体将维持偏紧的格局,金融债与高等级信用债的收益率震荡向下,中低评级产品将受到挤压。在此背景下,持有票息依旧是获取投资收益的主要途径。本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则,兼顾组合的安全性和流动性,平衡配置同业存款和债券投资,为投资者谋取稳定回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警。

§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	8,614,778,301.51	41.83
	其中:债券	8,614,778,301.51	41.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,819,165,968.75	8.83
	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	9,929,473,916.40	48.22
4	其他资产	230,362,422.76	1.12
5	合计	20,593,780,609.42	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	2.85	
	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	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

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(%)
1	30天以内	32.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	6.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	24.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	23.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	12.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		98.95	-

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	2,432,488,748.69	11.82
	其中:政策性金融债	2,432,488,748.69	11.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,182,289,552.82	30.04
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	8,614,778,301.51	41.86
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	041453047	14武邹CP001	4,200,000	420,023,118.35	2.04
2	140429	14农发29	2,800,000	280,152,179.13	1.36
3	140230	14国开30	2,700,000	268,713,795.15	1.31
4	140327	14进出27	2,500,000	250,120,576.62	1.22
5	140213	14国开13	2,500,000	249,371,827.19	1.21
6	140410	14农发10	2,100,000	210,228,663.54	1.02
7	140430	14农发30	2,100,000	210,049,445.61	1.02
8	041456055	14滨建投CP004	2,000,000	199,924,761.12	0.97
9	140207	14国开07	1,800,000	179,979,265.04	0.87
10	041459013	14海淀国资CP001	1,600,000	160,238,237.06	0.78

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	0.2103%
报告期内偏离度的最低值	0.0202%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1517%

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

华宝兴业添益货币市场基金截至2014年12月31日持有前十名证券中(041459013.IB)14海淀国资CP001的发行人因延迟披露2014年一季度财务报表,2014.07.15受到行业自律组织中国银行间交易商协会通报批评。

本基金管理人通过对上述债券进行进一步了解和分析,认为该通报批评不会对该债券的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述债券的投资判断未发生改变。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九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。

5.8.4 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	应收利息	230,362,422.76
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	230,362,422.76

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	155,759,767.85
报告期期间基金总申购份额	237,849,755.22
减:报告期期间基金总赎回份额	187,814,000.87
报告期期末基金份额总额	205,795,522.20

注:本基金基金合同生效于2012年12月27日。本基金的份额折算日为基金合同生效当日。折算后基金份额净值为100元。

§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	二级市场买入	2014年10月17日	221,200.00	22,125,308.80	0.00%
2	二级市场买入	2014年10月20日	600,100.00	60,010,000.00	0.00%
3	二级市场买入	2014年10月21日	1,331,600.00	133,159,600.00	0.00%
4	二级市场买入	2014年10月22日	350,400.00	35,036,280.40	0.00%
5	二级市场买入	2014年10月23日	400,000.00	39,991,393.38	0.00%
6	二级市场买入	2014年10月24日	973,673.00	97,358,753.57	0.00%
7	二级市场买入	2014年10月27日	126,846.00	12,683,331.54	0.00%
8	二级市场买入	2014年11月7日	50,606.00	5,061,308.49	0.00%
9	二级市场买入	2014年11月10日	1,308,300.00	130,830,000.00	0.00%
10	二级市场买入	2014年11月14日	371,400.00	37,142,678.70	0.00%
11	二级市场买入	2014年11月18日	433,000.00	43,299,767.00	0.00%
12	二级市场买入	2014年11月20日	414,100.00	41,399,811.60	0.00%
13	二级市场买入	2014年11月26日	100,000.00	9,994,950.00	0.00%
14	二级市场买入	2014年12月2日	399,900.00	39,989,568.05	0.00%
15	二级市场买入	2014年12月9日	137,100.00	13,709,862.91	0.00%
16	二级市场买入	2014年12月11日	400.00	39,995.60	0.00%
17	二级市场买入	2014年12月24日	858,400.00	85,844,025.97	0.00%
18	二级市场买入	2014年12月25日	379,779.00	37,981,914.90	0.00%
19	二级市场买入	2014年12月26日	275,700.00	27,575,611.20	0.00%
20	二级市场买入	2014年12月30日	123,400.00	12,339,985.80	0.00%
21	二级市场买入	2014年12月31日	443,700.00	44,383,834.70	0.00%
22	二级市场卖出	2014年10月13日	-1,030,516.00	-103,060,244.13	0.00%
23	二级市场卖出	2014年10月15日	-461,199.00	-46,135,391.97	0.00%
24	二级市场卖出	2014年10月17日	-821,200.00	-82,144,814.81	0.00%
25	二级市场卖出	2014年10月20日	-1,031,456.00	-103,156,271.84	0.00%
26	二级市场卖出	2014年10月21日	-715,433.00	-71,545,000.00	0.00%
27	二级市场卖出	2014年10月22日	-634,895.00	-63,485,808.84	0.00%
28	二级市场卖出	2014年10月23日	-731,859.00	-73,172,154.38	0.00%
29	二级市场卖出	2014年10月24日	-329,578.00	-32,956,940.84	0.00%
30	二级市场卖出	2014年10月27日	-445,929.00	-44,594,331.45	0.00%
31	二级市场卖出	2014年10月28日	-325,243.00	-32,529,078.65	0.00%
32	二级市场卖出	2014年10月30日	-264,298.00	-26,434,757.36	0.00%
33	二级市场卖出	2014年11月3日	-100,000.00	-10,001,300.00	0.00%
34	二级市场卖出	2014年11月4日	-668,599.00	-66,866,585.99	0.00%
35	二级市场卖出	2014年11月5日	-100,226.00	-10,023,602.26	0.00%
36	二级市场卖出	2014年11月6日	-300,000.00	-30,003,126.21	0.00%
37	二级市场卖出	2014年11月7日	-632,992.00	-63,307,561.89	0.00%
38	二级市场卖出	2014年11月10日	-1,308,333.00	-130,831,991.67	0.00%
39	二级市场卖出	2014年11月11日	-1,033,496.00	-103,355,625.98	0.00%
40	二级市场卖出	2014年11月13日	-500,111.00	-50,015,199.70	0.00%
41	二级市场卖出	2014年11月14日	-337,661.00	-33,770,908.29	0.00%
42	二级市场卖出	2014年11月17日	-533,800.00	-53,381,067.60	0.00%
43	二级市场卖出	2014年11月20日	-414,100.00	-41,401,703.90	0.00%
44	二级市场卖出	2014年11月26日	-100,000.00	-9,996,800.00	0.00%
45	二级市场卖出	2014年11月27日	-63,422.00	-6,342,200.00	0.00%
46	二级市场卖出	2014年11月28日	-971,520.00	-97,167,559.83	0.00%
47	二级市场卖出	2014年12月2日	-400,000.00	-39,999,200.00	0.00%
48	二级市场卖出	2014年12月3日	-253,100.00	-25,312,277.91	0.00%
49	二级市场卖出	2014年12月4日	-782,341.00	-78,244,600.50	0.00%
50	二级市场卖出	2014年12月8日	-599,000.00	-59,903,494.70	0.00%
51	二级市场卖出	2014年12月9日	-186,019.00	-18,602,134.92	0.00%
52	二级市场卖出	2014年12月11日	-1,036,295.00	-103,633,376.68	0.00%
53	二级市场卖出	2014年12月23日	-608,300.00	-60,829,634.80	0.00%
54	二级市场卖出	2014年12月24日	-1,287,641.00	-128,774,201.05	0.00%
55	二级市场卖出	2014年12月25日	-988,206.00	-98,834,175.28	0.00%
56	二级市场卖出	2014年12月26日	-551,457.00	-55,159,610.84	0.00%
57	二级市场卖出	2014年12月29日	-762,164.00	-76,220,279.96	0.00%
58	二级市场卖出	2014年12月30日	-399,486.00	-39,952,718.26	0.00%
59	二级市场卖出	2014年12月31日	-167,733.00	-16,779,678.52	0.00%
60	分红再投资	2014年10月10日	1.00	0.00	0.00%
61	分红再投资	2014年10月13日	336.00	0.00	0.00%
62	分红再投资	2014年10月15日	105.00	0.00	0.00%
63	分红再投资	2014年10月16日	56.00	0.00	0.00%
64	分红再投资	2014年10月17日	102.00	0.00	0.00%
65	分红再投资	2014年10月20日	128.00	0.00	0.00%
66	分红再投资	2014年10月22日	59.00	0.00	0.00%
67	分红再投资	2014年10月23日	35.00	0.00	0.00%
68	分红再投资	2014年10月27日	196.00	0.00	0.00%
69	分红再投资	2014年10月28日	39.00	0.00	0.00%
70	分红再投资	2014年10月29日	60.00	0.00	0.00%
71	分红再投资	2014年10月30日	102.00	0.00	0.00%
72	分红再投资	2014年10月31日	74.00	0.00	0.00%
73	分红再投资	2014年11月3日	225.00	0.00	0.00%
74	分红再投资	2014年11月4日	66.00	0.00	0.00%
75	分红再投资	2014年11月5日	10.00	0.00	0.00%
76	分红再投资	2014年11月6日	92.00	0.00	0.00%
77	分红再投资	2014年11月7日	61.00	0.00	0.00%
78	分红再投资	2014年11月10日	124.00	0.00	0.00%
79	分红再投资	2014年11月11日	111.00	0.00	0.00%
80	分红再投资	2014年11月13日	61.00	0.00	0.00%
81	分红再投资	2014年11月17日	156.00	0.00	0.00%
82	分红再投资	2014年11月18日	55.00	0.00	0.00%
83	分红再投资	2014年11月19日	99.00	0.00	0.00%
84	分红再投资	2014年11月20日	99.00	0.00	0.00%
85	分红再投资	2014年11月21日	99.00	0.00	0.00%
86	分红再投资	2014年11月24日	297.00	0.00	0.00%
87	分红再投资	2014年11月25日	98.00	0.00	0.00%
88	分红再投资	2014年11月26日	100.00	0.00	0.00%
89	分红再投资	2014年11月27日	102.00	0.00	0.00%
90	分红再投资	2014年11月28日	148.00	0.00	0.00%
91	分红再投资	2014年12月2日	117.00	0.00	0.00%
92	分红再投资	2014年12月3日	102.00	0.00	0.00%
93	分红再投资	2014年12月4日	119.00	0.00	0.00%
94	分红再投资	2014年12月5日	32.00	0.00	0.00%
95	分红再投资	2014年12月8日	303.00	0.00	0.00%
96	分红再投资	2014年12月9日	42.00	0.00	0.00%
97	分红再投资	2014年12月10日	96.00	0.00	0.00%
98	分红再投资	2014年12月11日	119.00	0.00	0.00%
99	分红再投资	2014年12月15日	303.00	0.00	0.00%
100	分红再投资	2014年12月16日	101.00	0.00	0.00%
101	分红再投资	2014年12月17日	99.00	0.00	0.00%
102	分红再投资	2014年12月18日	92.00	0.00	0.00%
103	分红再投资	2014年12月19日	97.00	0.00	0.00%
104	分红再投资	2014年12月22日	294.00	0.00	0.00%
105	分红再投资	2014年12月23日	102.00	0.00	0.00%
106	分红再投资	2014年12月24日	45.00	0.00	0.00%
107	分红再投资	2014年12月25日	66.00	0.00	0.00%
108	分红再投资	2014年12月26日	30.00	0.00	0.00%
109	分红再投资	2014年12月29日	246.00	0.00	0.00%
110	分红再投资	2014年12月30日	31.00	0.00	0.00%
111	分红再投资	2014年12月31日	83.00	0.00	0.00%
112	申购	2014年10月9日	1,030,186.00	103,018,600.00	0.00%
113	申购	2014年10月13日	1,030,602.00	103,060,200.00	0.00%
114	申购	2014年10月15日	461,354.00	46,135,400.00	0.00%
115	申购	2014年10月27日	573,900.00	57,390,000.00	0.00%
116	申购	2014年10月28日	458,497.00	45,849,700.00	0.00%
117	申购	2014年11月3日	100,160.00	10,016,000.00	0.00%
118	申购	2014年11月4日	932,890.00	93,289,000.00	0.00%
119	申购	2014年11月6日	385,466.00	38,546,600.00	0.00%
120	申购	2014年11月7日	597,272.00	59,727,200.00	0.00%
121	申购	2014年11月11日	500,000.00	50,000,000.00	0.00%
122	申购	2014年11月13日	500,000.00	50,000,000.00	0.00%
123	申购	2014年11月14日	500,000.00	50,000,000.00	0.00%
124	申购	2014年11月17日	100,837.00	10,083,700.00	0.00%
125	申购	2014年11月28日	1,035,174.00	103,517,400.00	0.00%
126	申购	2014年12月3日	253,219.00	25,321,900.00	0.00%
127	申购	2014年12月4日	782,446.00	78,244,600.00	0.00%
128	申购	2014年12月8日	599,035.00	59,903,500.00	0.00%
129	申购	2014年12月9日	48,522.00	4,852,200.00	0.00%
130	申购	2014年12月11日	1,036,334.00	103,633,400.00	0.00%
131	申购	2014年12月23日	608,382.00	60,838,200.00	0.00%
132	申购	2014年12月24日	275,691.00	27,569,100.00	0.00%
133	申购	2014年12月25日	762,134.00	76,213,400.00	0.00%
134	申购	2014年12月26日	275,840.00	27,584,000.00	0.00%
135	申购	2014年12月29日	762,202.00	76,220,200.00	0.00%
合计			1,037,954.00	103,046,871.60	

注: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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

§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;

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同;

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金招募说明书;

华宝兴业现金添益交易型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
2015年1月22日

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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
报告送出日期:2015年1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2015年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业收益增长混合
基金主代码	240008
交易代码	240008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月15日
报告期末基金份额总额	613,172,863.53份
投资目标	投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司,以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过公司自行开发的数量化辅助模型,结合宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。股票投资部分采用定量与定性分析相结合,行业配置与定期调整策略;债券投资部分通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理。
业绩比较基准	65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。
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

§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10月1日 - 2014年12月31日)
1.本期已实现收益	256,357,201.13
2.本期利润	-43,727,016.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0611
4.期末基金资产净值	2,576,411,594.65
5.期末基金份额净值	4.2018

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	-1.89%	1.79%	24.76%	1.09%	-26.65%	0.70%

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

(2006年6月15日至2014年12月31日)

注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2006年12月15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		
邵桔阳	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业服务股票基金经理、华宝兴业生态股票基金经理	2010年6月26日	-	8年	硕士,拥有CFA资格。2005年7月至2006年12月任安永会计师事务所审计员,2006年12月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任行业分析师、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理助理、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理助理、国内投资部副总经理的职务,2010年6月至今任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理,2013年6月起兼任华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金经理,2014年6月任助理投资总监,兼任华宝兴业生态中国股票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、《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》