

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金 2016 年第 3 季度报告

2016 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：2016 年 10 月 25 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 2016 年 10 月 21 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 2016 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	13,284,775,666.23 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	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	
下属分级基金的基金简称	华宝添益	华宝添益 B
下属分级基金的场内简称	华宝添益	-
下属分级基金的交易代码	511990	001893
报告期末下属分级基金的份额总额	1,007,934,107.12 份	12,276,841,559.11 份

注：本基金场内基金份额（A类基金份额）简称为“华宝添益”，基金份额净值为100.00元；场外基金份额（B类基金份额）简称为“华宝添益B”，基金份额净值为1.00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（2016年7月1日—2016年9月30日）	
	华宝添益	华宝添益 B
1. 本期已实现收益	623,486,730.07	47,667,847.23
2. 本期利润	623,486,730.07	47,667,847.23
3. 期末基金资产净值	100,793,410,711.89	12,276,841,559.11

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

华宝添益

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	0.5941%	0.0005%	0.3393%	0.0000%	0.2548%	0.0005%

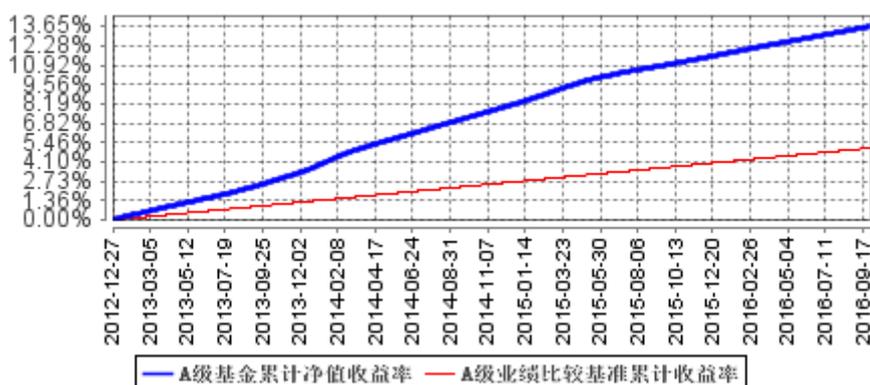
华宝添益 B

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	0.6453%	0.0006%	0.3393%	0.0000%	0.3060%	0.0006%

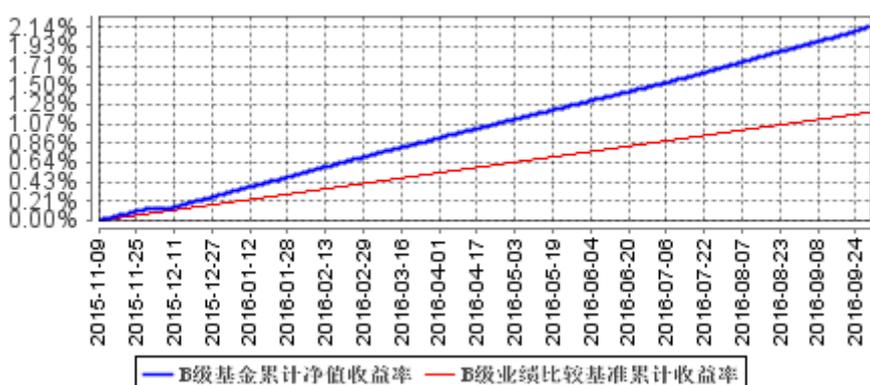
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2012 年 12 月 27 日至 2016 年 9 月 30 日)

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 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。
 2. 2015 年 11 月 9 日起，华宝兴业现金添益基金新增场外基金份额（B 类基金份额，简称“华宝添益 B”），11 月 10 日起有资金进入申购，上图中其累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的数据的计算起始日期为 2015 年 11 月 10 日。

§ 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	固定收益部总经理、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	-	12 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,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-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。2015 年 3 月起任固定收益部副总经理。2016 年 5 月起任固定收益部总经理。

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合规守信情况的说明

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、《货币市场基金监督管理办法》、《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金合同》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 报告期内基金投资策略和运作分析

在 7 月公布的经济金融数据超预期跳水后,8 月以来经济则呈现短期企稳的态势,工业增速创 5 个月新高至 6.3%,出口降幅连续 3 个月收窄,汽车销售火爆带动消费增速小幅回升,而基建地产双双回升也拉动投资低位反弹。三季度央行公开市场重启 14 天和 28 天逆回购,锁短放长的操作使得隔夜为代表的短端资金成本抬升了近 10BP 以上,货币利率中枢和波动性均较二季度有所上升。在央行 14 天逆回购重启、经济数据反弹、信贷金融数据回升、大量非标和协议存款到期导致高收益资产稀缺等多因素影响下,三季度债市维持震荡,但收益率调整幅度有限,收益率曲线平坦化。

本基金在报告期内管理规模保持稳定,资产配置上仍以同业存款为主,同时在 9 月保持了一定比例的滚动回购操作,以应对季末时点性的冲击,整体运行平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

场内份额:华宝添益:本基金报告期内净值收益率为 0.5941%,同期业绩比较基准收益率为 0.3393%,业绩比较基准为同期 7 天通知存款利率(税后)。

场外份额:华宝添益 B:本基金报告期内净值收益率为 0.6453%,同期业绩比较基准收益率为 0.3393%,业绩比较基准为同期 7 天通知存款利率(税后)。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	14,370,044,803.83	12.70
	其中：债券	14,370,044,803.83	12.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	13,026,707,860.13	11.51
	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	85,096,274,155.85	75.21
4	其他资产	646,758,071.31	0.57
5	合计	113,139,784,891.12	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	0.32	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	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	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	95

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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 120 天。

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	20.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	18.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	24.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	16.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	19.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.49	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 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	1,118,777,183.68	0.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,874,588,208.80	4.31
	其中：政策性金融债	4,874,588,208.80	4.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,099,522,048.63	2.74
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,277,157,362.72	4.67
8	其他	-	-
9	合计	14,370,044,803.83	12.71
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 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	111691212	16 南京银行 CD015	15,000,000	1,481,367,671.36	1.31
2	060228	06 国开 28	14,500,000	1,449,627,395.49	1.28
3	140201	14 国开 01	9,100,000	918,786,363.56	0.81
4	111616038	16 上海银行 CD038	9,000,000	888,979,401.63	0.79
5	111611361	16 平安 CD361	9,000,000	876,761,496.31	0.78
6	111607044	16 招行 CD044	8,000,000	790,750,205.06	0.70
7	111621011	16 渤海银行 CD011	6,500,000	641,741,916.29	0.57
8	111611183	16 平安 CD183	6,000,000	597,556,672.07	0.53
9	011699155	16 大连港 SCP001	5,000,000	499,978,204.43	0.44
10	130244	13 国开 44	3,600,000	360,573,392.94	0.32

5.7 “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	0.0301%
报告期内偏离度的最低值	0.0117%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0240%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

华宝添益货币基金截至 2016 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的 16 南京银行 CD015(111691212) 发行主体南京银行股份有限公司于 2016 年 3 月 21 日收到江苏证监局《关于对南京银行股份有限公司采取责令改正措施的决定》。因公司个别支行基金宣传推介材料存在违规情形，未出具年度监察稽核报告，有 2 项关于基金销售的管理制度未向江苏证监局报备，基金销售业务规范执行不到位等问题，采取出具责令改正的行政监管措施，同时责令进行改正。

华宝添益货币基金截至 2016 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的 16 招行 CD044 (111607044) 发行主体招商银行股份有限公司于 2016 年 1 月 6 日收到吉林证监局《关于对招商银行股份有限公司长春分行采取责令改正措施的决定》。因公司未及在网站更新基金销售人员资格情况，部分从事基金销售业务的人员未取得基金销售业务资格，销售过程中出现不符合法规的行为等问题，采取出具责令改正的行政监管措施，同时责令进行改正。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证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。

5.9.3 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	应收利息	646,758,071.31
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	646,758,071.31

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝添益	华宝添益 B
报告期期初基金份额总额	1,113,812,263.91	4,726,741,353.71
报告期期间基金总申购份额	58,284,954.17	20,523,490,353.84
报告期期间基金总赎回份额	164,163,110.96	12,973,390,148.44
报告期期末基金份额总额	1,007,934,107.12	12,276,841,559.11

注：1、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。

折算后本基金场内份额（A 类基金份额）的份额净值为 100.00 元。

2、自 2015 年 11 月 9 日起增设华宝兴业现金添益交易型货币市场基金的场外基金份额（B 类基金份额），场外份额（B 类基金份额）的份额净值为 1.00 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	分红再投资	2016 年 7 月 1 日	215.00	0.00	-
2	分红再投资	2016 年 7 月 4 日	651.00	0.00	-
3	分红再投资	2016 年 7 月 5 日	216.00	0.00	-
4	分红再投资	2016 年 7 月 6 日	215.00	0.00	-
5	分红再投资	2016 年 7 月 7 日	215.00	0.00	-
6	分红再投资	2016 年 7 月 8 日	216.00	0.00	-
7	分红再投资	2016 年 7 月 11 日	648.00	0.00	-
8	分红再投资	2016 年 7 月 12 日	244.00	0.00	-
9	分红再投资	2016 年 7 月 13 日	215.00	0.00	-
10	分红再投资	2016 年 7 月 14 日	214.00	0.00	-
11	分红再投资	2016 年 7 月 15 日	215.00	0.00	-
12	分红再投资	2016 年 7 月 18 日	660.00	0.00	-

13	分红再投资	2016 年 7 月 19 日	235.00	0.00	-
14	分红再投资	2016 年 7 月 20 日	211.00	0.00	-
15	分红再投资	2016 年 7 月 21 日	215.00	0.00	-
16	分红再投资	2016 年 7 月 22 日	226.00	0.00	-
17	分红再投资	2016 年 7 月 25 日	645.00	0.00	-
18	分红再投资	2016 年 7 月 26 日	213.00	0.00	-
19	分红再投资	2016 年 7 月 27 日	213.00	0.00	-
20	分红再投资	2016 年 7 月 28 日	214.00	0.00	-
21	分红再投资	2016 年 7 月 29 日	214.00	0.00	-
22	分红再投资	2016 年 8 月 1 日	727.00	0.00	-
23	分红再投资	2016 年 8 月 2 日	223.00	0.00	-
24	分红再投资	2016 年 8 月 3 日	214.00	0.00	-
25	分红再投资	2016 年 8 月 4 日	212.00	0.00	-
26	分红再投资	2016 年 8 月 5 日	212.00	0.00	-
27	分红再投资	2016 年 8 月 8 日	625.00	0.00	-
28	分红再投资	2016 年 8 月 9 日	258.00	0.00	-
29	分红再投资	2016 年 8 月 10 日	205.00	0.00	-
30	分红再投资	2016 年 8 月 11 日	206.00	0.00	-
31	分红再投资	2016 年 8 月 12 日	205.00	0.00	-
32	分红再投资	2016 年 8 月 15 日	611.00	0.00	-
33	分红再投资	2016 年 8 月 16 日	210.00	0.00	-
34	分红再投资	2016 年 8 月 17 日	215.00	0.00	-

35	分红再投资	2016 年 8 月 18 日	217.00	0.00	-
36	分红再投资	2016 年 8 月 19 日	269.00	0.00	-
37	分红再投资	2016 年 8 月 22 日	608.00	0.00	-
38	分红再投资	2016 年 8 月 23 日	211.00	0.00	-
39	分红再投资	2016 年 8 月 24 日	205.00	0.00	-
40	分红再投资	2016 年 8 月 25 日	207.00	0.00	-
41	分红再投资	2016 年 8 月 26 日	207.00	0.00	-
42	分红再投资	2016 年 8 月 29 日	626.00	0.00	-
43	分红再投资	2016 年 8 月 30 日	237.00	0.00	-
44	分红再投资	2016 年 8 月 31 日	209.00	0.00	-
45	分红再投资	2016 年 9 月 1 日	206.00	0.00	-
46	分红再投资	2016 年 9 月 2 日	208.00	0.00	-
47	分红再投资	2016 年 9 月 5 日	618.00	0.00	-
48	分红再投资	2016 年 9 月 6 日	206.00	0.00	-
49	分红再投资	2016 年 9 月 7 日	205.00	0.00	-
50	分红再投资	2016 年 9 月 8 日	202.00	0.00	-
51	分红再投资	2016 年 9 月 9 日	224.00	0.00	-
52	分红再投资	2016 年 9 月 12 日	601.00	0.00	-
53	分红再投资	2016 年 9 月 13 日	202.00	0.00	-
54	分红再投资	2016 年 9 月 14 日	204.00	0.00	-
55	分红再投资	2016 年 9 月 19 日	1,096.00	0.00	-
56	分红再投资	2016 年 9 月 20 日	207.00	0.00	-

57	分红再投资	2016年9月21日	209.00	0.00	-
58	分红再投资	2016年9月22日	235.00	0.00	-
59	分红再投资	2016年9月23日	254.00	0.00	-
60	分红再投资	2016年9月26日	641.00	0.00	-
61	分红再投资	2016年9月27日	283.00	0.00	-
62	分红再投资	2016年9月28日	216.00	0.00	-
63	分红再投资	2016年9月29日	237.00	0.00	-
64	分红再投资	2016年9月30日	220.00	0.00	-
65	强制调减	2016年9月30日	-3,370,349.00	-	-
66	强制调减	2016年9月30日	-24,000.00	-2,401,656.00	-
67	强制调减	2016年9月30日	-33,500.00	-3,352,311.50	-
68	强制调减	2016年9月30日	-2,800.00	-280,193.20	-
69	强制调减	2016年9月30日	-100.00	-10,007.40	-
70	强制调减	2016年9月30日	-300.00	-30,022.20	-
71	强制调减	2016年9月30日	-500.00	-50,034.00	-
72	强制调减	2016年9月30日	-500.00	-50,034.00	-
73	强制调减	2016年9月30日	-1,900.00	-190,129.20	-
74	强制调减	2016年9月30日	-3,600.00	-360,244.80	-
75	强制调减	2016年9月30日	-1,100.00	-110,074.80	-
76	强制调减	2016年9月30日	-8,000.00	-800,544.00	-
77	强制调减	2016年9月30日	-12,400.00	-1,240,843.20	-
78	强制调减	2016年9月30日	-42,700.00	-4,272,903.60	-

79	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-900.00	-90,061.20	-
80	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-17,900.00	-1,791,217.20	-
81	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,000.00	-100,068.00	-
82	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-2,200.00	-220,149.60	-
83	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-900.00	-90,061.20	-
84	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-11,675.00	-1,168,293.90	-
85	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-200.00	-20,014.80	-
86	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,600.00	-160,118.40	-
87	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
88	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-26,308.00	-2,632,588.94	-
89	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300.00	-30,020.40	-
90	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-12,400.00	-1,240,843.20	-
91	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
92	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,006.90	-
93	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,680.00	-
94	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-3,800.00	-380,258.40	-
95	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500.00	-50,037.00	-
96	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,006.80	-
97	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,680.00	-
98	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-5,200.00	-520,353.60	-
99	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-12,400.00	-1,240,843.20	-
100	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-3,000.00	-300,204.00	-

101	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,300.00	-830,564.40	-
102	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
103	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-5,896.00	-590,036.30	-
104	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500.00	-50,037.00	-
105	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-400.00	-40,029.60	-
106	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-3,425.00	-342,732.90	-
107	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-9,500.00	-950,646.00	-
108	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,000.00	-100,068.00	-
109	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,300.00	-830,564.40	-
110	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-200.00	-20,014.80	-
111	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-108,192.00	-10,826,557.06	-
112	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,400.00	-140,095.20	-
113	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,680.00	-
114	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,300.00	-830,564.40	-
115	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,000.00	-100,068.00	-
116	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300.00	-30,022.20	-
117	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-12,100.00	-1,210,822.80	-
118	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-2,000.00	-200,136.00	-
119	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-9,800.00	-980,666.40	-
120	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-7,200.00	-720,489.60	-
121	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,047.60	-
122	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-5,000.00	-500,340.00	-

123	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-15,000.00	-1,501,020.00	-
124	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
125	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
126	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-30,608.00	-3,063,003.78	-
127	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-4,600.00	-460,331.20	-
128	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,300.00	-830,597.60	-
129	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,400.00	-140,100.80	-
130	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-900.00	-90,064.80	-
131	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-7,500.00	-750,540.00	-
132	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-5,000.00	-500,360.00	-
133	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-4,900.00	-490,352.80	-
134	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.20	-
135	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,100.00	-110,079.20	-
136	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-3,100.00	-310,223.20	-
137	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,600.00	-160,115.20	-
138	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-600.00	-60,043.20	-
139	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300.00	-30,021.60	-
140	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-600.00	-60,043.20	-
141	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-900.00	-90,064.80	-
142	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,720.00	-
143	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-7,900.00	-790,568.80	-
144	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,050.40	-

145	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,389.00	-839,512.40	-
146	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-48,800.00	-4,883,562.40	-
147	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.30	-
148	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-7,500.00	-750,547.50	-
149	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-5,000.00	-500,365.00	-
150	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-17,600.00	-1,761,284.80	-
151	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-400.00	-40,029.20	-
152	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300,000.00	-30,021,900.00	-
153	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-24,000.00	-2,401,656.00	-
154	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.30	-
155	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-5,000.00	-500,365.00	-
156	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,500.00	-150,109.50	-
157	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-30,300.00	-3,032,211.90	-
158	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-47,400.00	-4,743,460.20	-
159	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300.00	-30,021.90	-
160	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-7,800.00	-780,569.40	-
161	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-19,811.00	-1,982,546.20	-
162	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-600.00	-60,044.40	-
163	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
164	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-145,900.00	-14,599,629.40	-
165	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-5,000.00	-500,330.00	-
166	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-6,300.00	-630,415.80	-

167	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-400.00	-40,029.60	-
168	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,051.80	-
169	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
170	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.20	-
171	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-900.00	-90,064.80	-
172	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-3,000.00	-300,216.00	-
173	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-6,800.00	-680,489.60	-
174	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300.00	-30,021.60	-
175	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,700.00	-170,122.40	-
176	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,300.00	-830,597.60	-
177	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
178	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-400.00	-40,028.80	-
179	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,050.40	-
180	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-50,000.00	-5,003,600.00	-
181	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,200.00	-820,590.40	-
182	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,200.00	-120,079.20	-
183	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-17,600.00	-1,761,267.20	-
184	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-69,539.00	-6,958,906.81	-
185	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
186	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
187	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
188	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300.00	-30,019.80	-

189	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500.00	-50,033.00	-
190	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-19,900.00	-1,991,313.40	-
191	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-2,000.00	-200,132.00	-
192	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,006.60	-
193	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-400.00	-40,029.60	-
194	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-200,000.00	-20,014,600.00	-
195	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
196	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
197	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500.00	-50,037.00	-
198	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500.00	-50,033.00	-
199	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-2,000.00	-200,132.00	-
200	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
201	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300.00	-30,022.20	-
202	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
203	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500.00	-50,037.00	-
204	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
205	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-600.00	-60,044.40	-
206	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500.00	-50,037.00	-
207	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
208	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-400.00	-40,029.60	-
209	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
210	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-

211	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-9,000.00	-900,666.00	-
212	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
213	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
214	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-9,000.00	-900,666.00	-
215	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,046.20	-
216	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,300.00	-130,085.80	-
217	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
218	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,051.80	-
219	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-2,000.00	-200,132.00	-
220	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,660.00	-
221	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-200.00	-20,013.20	-
222	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-2,100.00	-210,138.60	-
223	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,007.40	-
224	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
225	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
226	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,000.00	-100,074.00	-
227	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,051.80	-
228	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500,000.00	-50,033,500.00	-
229	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,051.80	-
230	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-200.00	-20,014.80	-
231	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,000.00	-100,074.00	-
232	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,051.80	-

233	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-10,000.00	-1,000,740.00	-
234	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-12,276.00	-1,228,496.15	-
235	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-9,700.00	-970,708.10	-
236	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,051.10	-
237	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-149,550.00	-14,965,767.60	-
238	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-3,000.00	-300,216.00	-
239	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,600.00	-860,619.20	-
240	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-11,500.00	-1,150,793.50	-
241	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,300.00	-830,572.70	-
242	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-11,000.00	-1,100,792.00	-
243	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,006.80	-
244	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,050.40	-
245	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,006.90	-
246	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-698.00	-69,847.46	-
247	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,500.00	-150,102.00	-
248	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-20,200.00	-2,021,373.60	-
249	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-400.00	-40,027.20	-
250	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,100.00	-110,074.80	-
251	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,048.30	-
252	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-24,000.00	-2,401,656.00	-
253	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-27,500.00	-2,751,870.00	-
254	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-57,100.00	-5,713,882.80	-

255	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-6,100.00	-610,414.80	-
256	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,500.00	-150,102.00	-
257	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-5,000.00	-500,340.00	-
258	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-600.00	-60,040.80	-
259	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,200.00	-820,557.60	-
260	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-700.00	-70,047.60	-
261	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,400.00	-140,095.20	-
262	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-900.00	-90,061.20	-
263	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,000.00	-100,068.00	-
264	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-13,000.00	-1,300,884.00	-
265	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,000.00	-100,068.00	-
266	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-24,000.00	-2,401,728.00	-
267	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-3,000.00	-300,207.00	-
268	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,000.00	-100,069.00	-
269	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300.00	-30,021.60	-
270	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500,000.00	-50,037,000.00	-
271	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,006.90	-
272	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-50,000.00	-5,003,600.00	-
273	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-54,600.00	-5,463,767.40	-
274	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,006.80	-
275	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,902.00	-190,329.34	-
276	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-23,892.00	-2,390,920.22	-

277	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-300.00	-30,020.70	-
278	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-29,488.00	-2,950,982.11	-
279	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-100.00	-10,006.90	-
280	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-8,300.00	-830,572.70	-
281	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500.00	-50,034.50	-
282	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-1,800.00	-180,124.20	-
283	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-800.00	-80,055.20	-
284	强制调减	2016 年 9 月 30 日	-500.00	-50,034.50	-
285	强制调增	2016 年 9 月 30 日	3,370,349.00	0.00	-
合计			-3,350,446.00	-337,273,125.77	

注：交易日期为确认日期，交易金额为确认金额。

§ 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。

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项

种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2016 年 10 月 25 日