华宝兴业现金宝货币市场基金
2017年半年度报告（摘要）

2017年6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

送出日期：2017年8月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业现金宝货币市场基金		
基金简称	华宝兴业现金宝货币		
基金主代码	240006		
交易代码	240006		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2005 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		
报告期末基金份额总额	2,665,321,320.37 份		
下属分级基金的基金简称：	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 E
下属分级基金的交易代码：	240006	240007	000678
报告期末下属分级基金的份额总额	185,957,805.19 份	114,574,769.16 份	2,364,788,746.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	保持本金的安全性与流动性，追求高于比较基准的收益率。
投资策略	以对宏观经济及利率走势的判断为基础，在满足组合平均久期、收益性以及信用等级的前提下利用现代金融分析方法和工具，优化组合配置效果，实现组合增值。
业绩比较基准	同期 7 天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 ）	报告期（2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日）	报告期（ 2017 年 1 月 1 日 -2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,538,496.21	6,801,492.40	70,435,607.37
本期利润	3,538,496.21	6,801,492.40	70,435,607.37
本期净值收益率	1.8182%	1.9394%	1.9394%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（ 2017 年 6 月 30 日 ）		
期末基金资产净值	185,957,805.19	114,574,769.16	2,364,788,746.02
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（ 2017 年 6 月 30 日 ）		
累计净值收益率	43.1411%	47.4141%	10.6970%

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。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。

3、本基金收益分配按日结转份额。

4、华宝兴业现金宝 E 成立于 2014 年 7 月 14 日，其本期净值收益率和累计净值收益率的数据的计算起始日期为 2014 年 7 月 14 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

华宝兴业现金宝货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3222%	0.0016%	0.1110%	0.0000%	0.2112%	0.0016%

过去三个月	0.9281%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.5915%	0.0010%
过去六个月	1.8182%	0.0014%	0.6695%	0.0000%	1.1487%	0.0014%
过去一年	3.0685%	0.0023%	1.3481%	0.0000%	1.7204%	0.0023%
过去三年	10.0746%	0.0057%	4.0500%	0.0000%	6.0246%	0.0057%
自基金合同生效日起至今	43.1411%	0.0053%	20.4267%	0.0018%	22.7144%	0.0035%

华宝兴业现金宝货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3419%	0.0016%	0.1110%	0.0000%	0.2309%	0.0016%
过去三个月	0.9886%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.6520%	0.0010%
过去六个月	1.9394%	0.0014%	0.6695%	0.0000%	1.2699%	0.0014%
过去一年	3.3158%	0.0023%	1.3481%	0.0000%	1.9677%	0.0023%
过去三年	10.8702%	0.0057%	4.0500%	0.0000%	6.8202%	0.0057%
自基金合同生效日起至今	47.4141%	0.0053%	20.4267%	0.0018%	26.9874%	0.0035%

华宝兴业现金宝货币 E

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3420%	0.0016%	0.1110%	0.0000%	0.2310%	0.0016%
过去三个月	0.9887%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.6521%	0.0010%
过去六个月	1.9394%	0.0014%	0.6695%	0.0000%	1.2699%	0.0014%
过去一年	3.3157%	0.0023%	1.3481%	0.0000%	1.9676%	0.0023%
自基金合同生效日起至今	10.6970%	0.0057%	4.0019%	0.0000%	6.6951%	0.0057%

注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

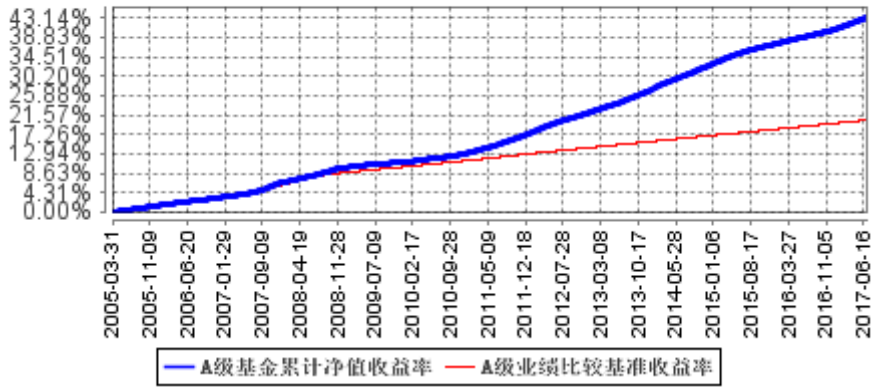
2、本基金业绩比较基准为：同期 7 天通知存款利率（税后）。

3、华宝兴业现金宝 E 成立于 2014 年 7 月 14 日，其自基金合同生效日起至今的数据的计算起始日期为 2014 年 7 月 14 日。

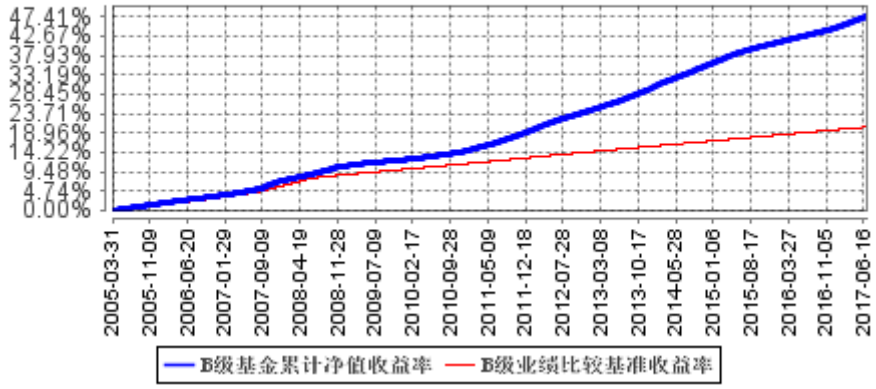
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2005 年 3 月 31 日至 2017 年 6 月 30 日)

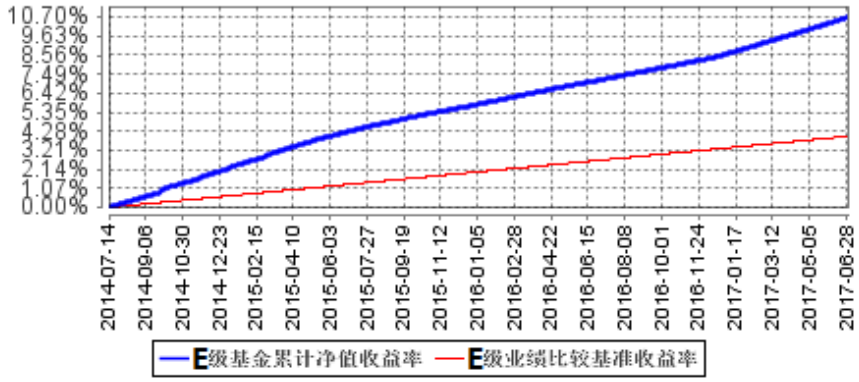
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



E 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、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 2005 年 4 月 7 日，本基金已根据基金合同规定完成建仓。

2、华宝兴业现金宝 E 成立于 2014 年 7 月 14 日，本报告中其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的数据的计算起始日期为 2014 年 7 月 14 日。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2017 年 6 月 30 日），所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、中国互联网基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业 1000 分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业转型升级基金、核心优势基金、美国消费基金、宝鑫纯债基金、香港中小盘基金、中证全指证券公司 ETF、中证军工 ETF、新活力基金、沪深 300 指数增强基金、未来产业主导基金、新起点基金、红利基金、新动力基金、新飞跃基金、新回报基金、新优选基金、香港大盘基金、智慧产业基金、第三产业基金及新优享基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 122,557,514,320.78 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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、华宝添益基金经理	2011 年 11 月 15 日	-	13 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 月至 2014 年 2 月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。2015 年 3 月起任固定收益部副总经理。2016 年 5 月任固定收益部总经理。
高文庆	本基金基金经理、华宝新起点混合基金经理、华宝添益基金经理助理	2017 年 3 月 17 日	-	7 年	硕士。2010 年 5 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任助理风险分析师、助理产品经理、信用分析师、高级信用分析师、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起任华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
林昊	本基金基金经理 助理、华宝添益基金经理 助理、华宝新机遇 混合、华宝新活力 混合、华宝新价值混合基金经理	2014 年 6 月 16 日	2017 年 4 月 26 日	11 年	本科。2006 年 5 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起担任华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝兴业新活力灵活配置混合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、《货币市场基金监督管理办法》、《华宝兴业现金宝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。

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，现金宝货币市场基金在短期内出现过现金、国债、中央银行票据、政策性金融债以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值低于 10%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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年国内经济走势基本平稳，GDP 同比增长 6.9%，比上年同期提高了 0.2 个百分点。外需带动下的净出口出现好转，消费保持平稳，投资总体增速放缓，通胀维持低位。2017 年上半年，市场流动性整体处于紧平衡状态，央行货币政策延续去年四季度以来的“稳健中性”，投放相对审慎，上半年央行通过货币政策工具合计净投放 122 亿元，其中通过公开市场操作合计净回笼 7550 亿元，通过 MLF 净投放 7672 亿元，央行今年的操作体现出缩短放长的特征。在操作利率

方面，央行分别在春节前后以及美联储 3 月加息后两次上调公开市场逆回购和 MLF 等货币市场工具操作利率。利率超预期上调叠加央行实质从紧的的货币政策，使得市场资金价格中枢明显上行，其中银行间 7 天回购利率中枢由 1 季度的 3.09%上行至 2 季度的 3.35%，3 个月 SHIBOR 报价也自年初开始一路上行超过 120BP 至 4.5%左右水平。债市方面，受到货币政策收紧及监管政策风暴双重因素压制，债券收益率呈现震荡上行。截至 2017 年 6 月 30 日，1 年期和 10 年期国债收益率较年初分别上行 71BP、46BP，短端上升幅度明显大于长端，收益率曲线平坦化。

本基金在报告期内，以同业存款为主要投资标的，债券、同业存单等其他品种为辅，整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

现金宝 A：本基金报告期内净值收益率为 1.8182%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，业绩比较基准为同期 7 天通知存款利率（税后）。

现金宝 B：本基金报告期内净值收益率为 1.9394%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，业绩比较基准为同期 7 天通知存款利率（税后）。

现金宝 E：本基金报告期内净值收益率为 1.9394%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，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

展望下半年，宏观经济经济增速可能因房地产投资、企业去库存周期呈现下行态势而承受一定压力，不过外贸回暖以及积极财政带动基建投资或能够部分对冲房地产投资、制造业投资动力的减弱。短期来看，债市交易情绪的主要因素仍为资金面和对未来监管政策变化的预期，而去杠杆和保增长的博弈在下半年也显得更为关键。在此背景下，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，维持资产结构的均衡配比，随时把握市场动向，为投资者谋取稳定回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中，公司内部参与估值流程的各方职责分工如下：

（一）、基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

（二）、量化投资部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

（三）、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并以红利再投资形式每日全额分配收益，每日分配的收益于分配次日按份额面值 1.00 元转入所有者权益。每月集中宣告收益分配并将当月收益结转到基金份额持有人基金账户。现金宝 A 级基金在本年度累计分配收益 3,538,496.21 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 3,540,479.56 元，计入应付利润科目-35,012.36 元。现金宝 B 级基金在本年度累计分配收益 6,801,492.40 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 6,835,660.10 元，计入应付利润科目-22,326.83 元。现金宝 E 级基金在本年度累计分配收益 70,435,607.37 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 70,876,742.29 元，计入应付利润科目-460,793.64 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为：A 级：3,538,496.21 元；B 级：6,801,492.40 元；E 级：70,435,607.37 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业现金宝货币市场基金

报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		2,091,913,006.99	2,445,172,772.48
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		824,381,844.82	1,443,799,148.39
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		824,381,844.82	1,443,799,148.39
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	662,522,873.79
应收证券清算款		-	-
应收利息		16,376,575.46	27,381,990.22
应收股利		-	-
应收申购款		11,087,763.41	25,932,488.15
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,943,759,190.68	4,604,809,273.03
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 6 月 30 日**	**上年度末 2016 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		275,909,542.04	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,066,858.12	1,336,817.90
应付托管费		323,290.36	405,096.32
应付销售服务费		70,578.70	74,105.12
应付交易费用		31,060.87	38,818.63

应交税费		-	-
应付利息		20,804.08	-
应付利润		518,132.83	995,418.80
递延所得税负债		-	-
其他负债		497,603.31	509,000.00
负债合计		278,437,870.31	3,359,256.77
所有者权益：			
实收基金		2,665,321,320.37	4,601,450,016.26
未分配利润		-	-
所有者权益合计		2,665,321,320.37	4,601,450,016.26
负债和所有者权益总计		2,943,759,190.68	4,604,809,273.03

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 2,665,321,320.37 份，其中 A 类基金份额 185,957,805.19 份，B 类基金份额 114,574,769.16 份，E 类基金份额 2,364,788,746.02 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		92,534,969.57	117,859,080.74
1.利息收入		92,044,508.05	118,931,661.63
其中：存款利息收入		69,437,849.06	72,283,902.54
债券利息收入		15,521,336.91	32,217,765.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,085,322.08	14,429,993.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		490,461.52	-1,072,580.89
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		490,461.52	-1,072,580.89
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列）			
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、费用		11,759,373.59	18,087,055.16
1．管理人报酬		6,942,842.36	12,690,063.45
2．托管费		2,103,891.65	3,845,473.86
3．销售服务费		443,984.25	612,765.77
4．交易费用		-	-
5．利息支出		2,031,989.52	709,358.12
其中：卖出回购金融资产支出		2,031,989.52	709,358.12
6．其他费用		236,665.81	229,393.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		80,775,595.98	99,772,025.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		80,775,595.98	99,772,025.58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,601,450,016.26	-	4,601,450,016.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	80,775,595.98	80,775,595.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,936,128,695.89	-	-1,936,128,695.89
其中：1.基金申购款	13,049,141,074.18	-	13,049,141,074.18
2.基金赎回款	-14,985,269,770.07	-	-14,985,269,770.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-80,775,595.98	-80,775,595.98

五、期末所有者权益（基金净值）	2,665,321,320.37	-	2,665,321,320.37
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,561,755,774.97	-	7,561,755,774.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	99,772,025.58	99,772,025.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,146,726,905.43	-	-1,146,726,905.43
其中：1.基金申购款	11,807,793,792.13	-	11,807,793,792.13
2.基金赎回款	-12,954,520,697.56	-	-12,954,520,697.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-99,772,025.58	-99,772,025.58
五、期末所有者权益（基金净值）	6,415,028,869.54	-	6,415,028,869.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小薏	向辉	张幸骏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业现金宝货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]23 号《关于同意华宝兴业现金宝货币市场基金募集的批复》核准，由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募

集不包括认购资金利息共募集人民币 2,313,988,355.58 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 33 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》于 2005 年 3 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,314,444,447.53 份基金份额，其中认购资金利息折合 456,091.95 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》和《华宝兴业现金宝货币市场基金更新的招募说明书》的规定，本基金根据投资者单个基金账户保留的基金份额的不同，分成 A 类、B 类和 E 类三类基金份额。三级基金份额单独设置基金代码，按照不同的费率计提销售服务费并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据本基金管理人华宝兴业于 2014 年 7 月 8 日发布《关于华宝兴业现金宝货币市场基金增加 E 类基金份额并相应修改基金合同的公告》，投资者于 2014 年 7 月 14 日前在华宝兴业直销中心保留的 A 类和 B 类基金份额已在该日自动转为 E 类基金份额，已在华宝兴业直销中心签约的 A 类和 B 类基金份额的定期定额投资计划已转为 E 类基金份额的定期定额投资计划。当投资者在销售机构保留的 A 类基金份额达到 500 万份时，本基金注册登记机构自动将其在该销售机构保留的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额，并将其未结转份额结转成 B 类基金份额；当投资者在销售机构保留的 B 类基金份额低于 500 万份时，本基金注册登记机构自动将其在该销售机构保留的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额，并将其未结转份额结转成 A 类基金份额。基金的升降级不收取费用。现金宝 A、B 类基金份额只能通过代销机构申购；现金宝 E 类基金份额仅通过基金管理人华宝兴业直销中心(包括直销柜台、直销 e 网金、公司淘宝店)及基金管理人指定的电子交易平台办理申购。现金宝 A(代码：240006)类申购起点 500 元起，追加持有 500 元起，销售服务费年费率 0.25%；现金宝 B(代码：240007)类申购起点 500 万元起，追加持有 500 元起，销售服务费年费率 0.01%；现金宝 E(代码：000678)类申购起点 0.01 元起，追加持有 0.01 元起，销售服务费年费率 0.01%。

根据《货币市场基金管理暂行规定》、《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》和最新公布的《华宝兴业现金宝货币市场基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购、中央银行票据，经中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为同期 7 天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《 华宝兴业现金宝货币市场基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转

让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税。

2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

根据中国证监会于 2017 年 7 月 21 日发布的《关于核准华宝兴业基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可（2017）1321 号），中国证监会已核准“领先资产管理有限公司”将持有的我公司 49%的股权转让给 Warburg Pincus Asset Management,L.P.。我公司及相关股东目前正在办理后续的工商变更登记等相关事宜，敬请投资者知悉。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司 (Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司(“宝钢财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,942,842.36	12,690,063.45
其中：支付销售机构的客户维护费	109,328.18	81,426.85

注：支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	2,103,891.65	3,845,473.86

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 E	合计
中国建设银行	101,447.64	1,375.19	0.00	102,822.83
华宝兴业	0.31	-0.01	181,825.67	181,825.97
华宝证券	4,293.76	3,085.97	0.00	7,379.73
合计	105,741.71	4,461.15	181,825.67	292,028.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 E	合计
中国建设银行	137,639.19	788.73	-	138,427.92
华宝兴业	-	-	332,715.83	332,715.83
华宝证券	3,144.16	37,162.61	-	40,306.77
合计	140,783.35	37,951.34	332,715.83	511,450.52

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华宝兴业，再由华宝兴业计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额持有人和 B 类基金份额持有人约定的年基金销售服务费率分别为 0.25%和 0.01%。其计算公式为：日基金销售服务费＝前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
银行间市场	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

交易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	1,222,510,000.00	234,257.46
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	51,484,499.18	-	-	-	725,500,000.00	39,497.00

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 E
基金合同生效日（ 2005 年 3 月 31 日 ）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	559,242.89
期间申购/买入总份额	-	-	10,858.05
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	570,100.94
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	0.0200%

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 E
基金合同生效日（ 2005 年 3 月 31 日 ）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-

期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

注： 1、华宝兴业现金宝 E 成立于 2014 年 7 月 14 日。

2、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

3、基金管理人投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

华宝兴业现金宝货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华宝证券有限责任公司	1,238,339.89	0.6700%	1,693,126.08	0.9300%
华宝投资有限公司	1,188,153.97	0.6400%	-	-

华宝兴业现金宝货币 E

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华宝投资有限公司	591,291,682.41	25.0000%	836,859,842.50	20.1200%

注：除基金管理人之外的其它关联方投资本基金采用市场公开的费率。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	913,006.99	7,121.09	660,637.70	3,935.54

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内与上年度可比期间无参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（ 2017 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 824,381,844.82 元，无属于第一或第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次 1,443,799,148.39 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管

理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	824,381,844.82	28.00
	其中：债券	824,381,844.82	28.00
	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	2,091,913,006.99	71.06
4	其他各项资产	27,464,338.87	0.93
5	合计	2,943,759,190.68	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	3.22	
	其中：买断式回购融资	-	
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	275,909,542.04	10.35
	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

本报告期内债券正回购的资金余额未有超过基金资产净值的 20%的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	82
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

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。

7.3.2 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	5.64	10.35
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	27.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	60.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	14.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	1.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		109.42	10.35

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	228,964,065.99	8.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,924,554.75	1.50

	其中：政策性金融债	39,924,554.75	1.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,974,329.67	0.37
6	中期票据	-	-
7	同业存单	545,518,894.41	20.47
8	其他	-	-
9	合计	824,381,844.82	30.93
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111709250	17 浦发银行 CD250	2,000,000	197,885,812.86	7.42
2	111720124	17 广发银行 CD124	1,500,000	149,499,631.49	5.61
3	179922	17 贴现国债 22	800,000	79,697,170.63	2.99
4	179924	17 贴现国债 24	500,000	49,772,616.32	1.87
5	111611361	16 平安 CD361	500,000	49,702,889.43	1.86
6	111707141	17 招商银行 CD141	500,000	49,490,458.46	1.86
7	111710297	17 兴业银行 CD297	500,000	49,471,552.25	1.86
8	111709119	17 浦发银行 CD119	500,000	49,468,549.92	1.86
9	170204	17 国开 04	300,000	29,912,361.61	1.12
10	179927	17 贴现国债 27	300,000	29,790,408.56	1.12

7.6 “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	0.0315%

报告期内偏离度的最低值	-0.0061%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0082%

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1

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。

7.8.2

现金宝货币基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的 16 平安 CD361（111611361)发行主体平安银行股份有限公司于 2016 年 12 月 2 日收到中国银行间市场交易商协会的通报批评和整改通知。因其作为主承销商，对青岛海湾集团有限公司未能按照相关自律规则的规定及时披露公司重大资产无偿划转相关事项，未能及时召开持有人会议，给予平安银行通报批评处分，责令平安银行立即纠正违规行为,并针对本次事件中暴露出的问题进行整改。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，认为上述处分不会对证券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。

7.8.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	16,376,575.46
4	应收申购款	11,087,763.41
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	27,464,338.87

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华宝兴业现金宝货币 A	123,861	1,501.34	10,973,581.29	5.90%	174,984,223.90	94.10%
华宝兴业现金宝货币 B	5	22,914,953.83	104,443,928.39	91.16%	10,130,840.77	8.84%
华宝兴业现金宝货币 E	27,531	85,895.49	2,055,710,220.15	86.93%	309,078,525.87	13.07%
合计	151,397	17,604.85	2,171,127,729.83	81.84%	494,193,590.54	18.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝兴业现金宝货币 A	50,839.27	0.0273%
	华宝兴业现金宝货币 B	-	-
	华宝兴业现金宝货币 E	43,834,226.41	1.8536%
	合计	43,885,065.68	1.6465%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝兴业现金宝货币 A	0
	华宝兴业现金宝货币 B	0
	华宝兴业现金宝货币 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝兴业现金宝货币 A	0
	华宝兴业现金宝货币 B	0
	华宝兴业现金宝货币 E	0-10
	合计	0-10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 E
基金合同生效日（2005 年 3 月 31 日）基金份额总额	1,253,872,199.53	1,060,572,248.00	-
本报告期期初基金份额总额	181,548,642.74	260,534,635.86	4,159,366,737.66
本报告期基金总申购份额	271,547,101.89	565,053,107.19	12,212,540,865.10
减:本报告期基金总赎回份额	267,137,939.44	711,012,973.89	14,007,118,856.74
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	185,957,805.19	114,574,769.16	2,364,788,746.02

注：1.总申购份额含份额级别调整、转换入份额和红利再投；总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

2.华宝兴业现金宝 E 成立于 2014 年 7 月 14 日。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2017 年 6 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，副总经理任志强因个人原因，自 2017 年 5 月 31 日起不再担任副总经理的职务。

2017 年 8 月 11 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，董事长郑安国先生因个人原因，自 2017 年 8 月 9 日起不再担任董事长的职务，由孔祥清先生接任公司董事长职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

注：1.基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2.本期交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170223~20170227	506,675,857.85	580,000,000.00	1,091,754,314.16	1,188,153.97	0.04
	2	20170629~20170630	330,183,984.62	525,895,448.39	270,150,000.00	591,291,682.41	22.18
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

华宝兴业基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日