华宝兴业现金宝货币市场基金
2009 年年度报告

2009 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：二〇一〇年三月二十九日

§1 重要提示及目录

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 2010 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....1
§2 基金简介.....4
2.1 基金基本情况.....4
2.2 基金产品说明.....4
2.3 基金管理人和基金托管人.....4
2.4 信息披露方式.....4
2.5 其他相关资料.....5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....5
3.1 主要会计数据和财务指标.....5
3.2 基金净值表现.....6
§4 管理人报告.....10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11
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.....11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....13
§5 托管人报告.....13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....13
5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....14
§6 审计报告.....14
6.1 管理层对财务报表的责任.....14
6.2 注册会计师的责任.....14
6.3 审计意见.....15
§7 年度财务报表.....15
7.1 资产负债表.....15
7.2 利润表.....16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....17
7.4 报表附注.....18
§8 投资组合报告.....37
8.1 期末基金资产组合情况.....37
8.2 债券回购融资情况.....37
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明.....37
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....37
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....38
8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....38
8.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....39
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....39
8.8 投资组合报告附注.....39
§9 基金份额持有人信息.....40

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 40
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 40
§10 开放式基金份额变动 40
§11 重大事件揭示 41
11.1 基金份额持有人大会决议 41
11.2 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 41
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 41
11.4 基金投资策略的改变 41
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 41
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况 41
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 41
§12 影响投资者决策的其他重要信息 45
§13 备查文件目录 45

§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	
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	9,957,313,673.30 份	
基金合同存续期	不定期	
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
下属分级级基金的交易代码	240006	240007
报告期末下属分级基金的份额总额	642,822,622.62 份	9,314,491,050.68 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	尹东
	联系电话	021-38505888	010—67595003
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010—66275853
注册地址		上海浦东世纪大道88号金茂大厦48F	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海浦东世纪大道88号金茂大厦48F	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码		200121	100033
法定代表人		郑安国	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金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。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限责任公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道88号金茂大厦48层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2009 年		2008 年		2007 年	
	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 A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B
本期已实现收益	7,046,231.94	25,153,725.10	16,432,767.16	36,527,094.71	7,172,094.49	10,499,792.60
本期利润	7,046,231.94	25,153,725.10	16,432,767.16	36,527,094.71	7,172,094.49	10,499,792.60
本期净值收益率	1.1660%	1.4096%	3.1333%	3.3805%	3.1651%	3.4128%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末		2008 年末		2007 年末	
	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 A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B
期末基金资产净值	642,822,622.62	9,314,491,050.68	1,268,240,386.33	9,968,866,586.28	521,149,317.59	8,324,125,218.66
期末基	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

金份额净值						
3.1.3 累计期末指标	**2009 年末**		**2008 年末**		**2007 年末**	
	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A	华宝兴业现金宝货币 B	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B
累计净值收益率	11.2115%	12.4886%	9.9297%	10.925%	6.59%	7.2978%

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。

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

1. 华宝兴业现金宝货币 A：

阶段	份额净值收益率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	0.2610%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	-0.0793%	0.0006%
过去六个月	0.5047%	0.0010%	0.6805%	0.0000%	-0.1758%	0.0010%
过去一年	1.1660%	0.0047%	1.3500%	0.0000%	-0.1840%	0.0047%
过去三年	7.6381%	0.0063%	6.8927%	0.0028%	0.7454%	0.0035%
自基金成立起至今	11.2115%	0.0053%	10.1336%	0.0023%	1.0779%	0.0030%

注：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. 华宝兴业现金宝货币 B：

阶段	份额净值收益率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	0.3212%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	-0.0191%	0.0006%
过去六个月	0.6262%	0.0010%	0.6805%	0.0000%	-0.0543%	0.0010%
过去一年	1.4096%	0.0047%	1.3500%	0.0000%	0.0596%	0.0047%
过去三年	8.4156%	0.0063%	6.8927%	0.0028%	1.5229%	0.0035%
自基金成立起至今	12.4886%	0.0053%	10.1336%	0.0023%	2.3550%	0.0030%

注：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）。

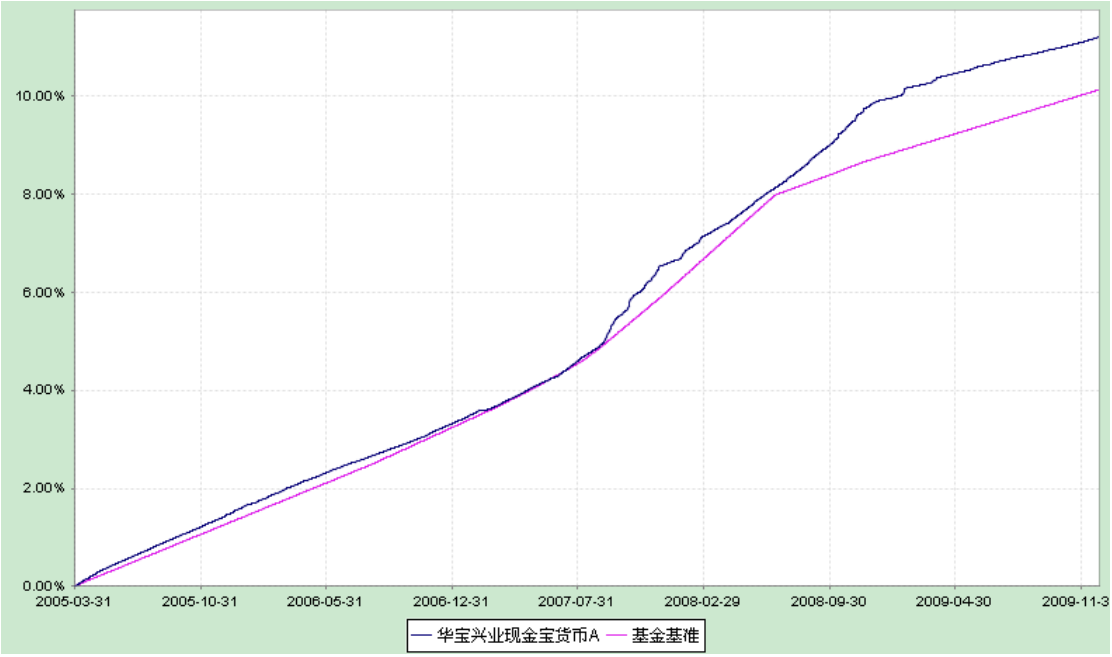
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝兴业现金宝货币市场基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

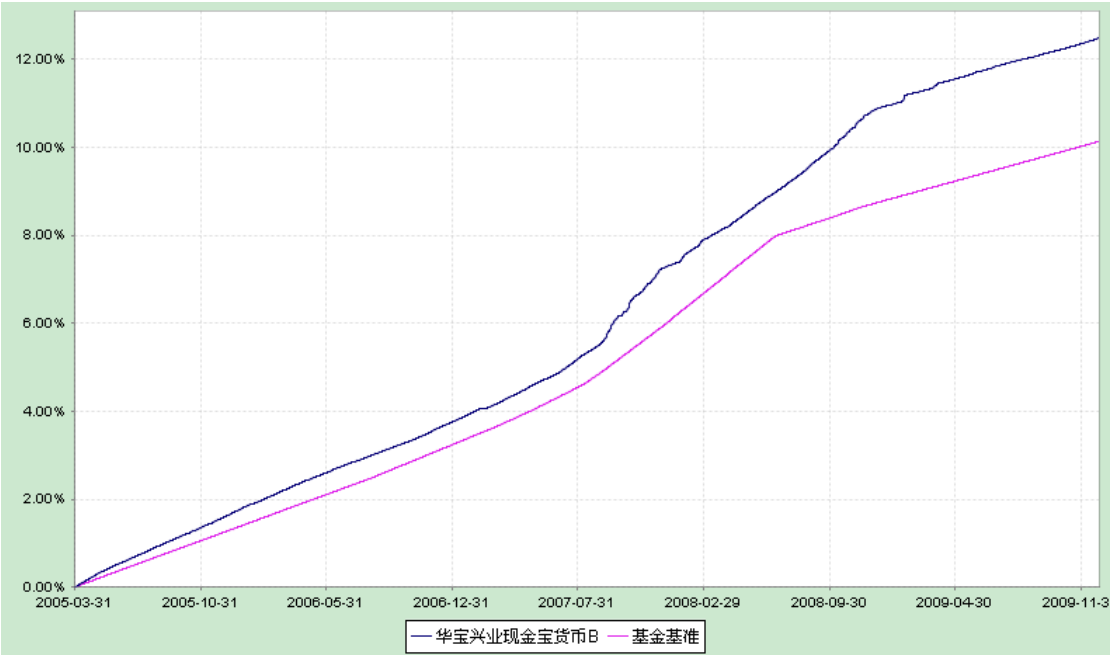
（2005 年 3 月 31 日至 2009 年 12 月 31 日）

1、华宝兴业现金宝货币 A



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 2005 年 4 月 7 日，本基金已根据基金合同规定完成建仓。

2、华宝兴业现金宝货币 B



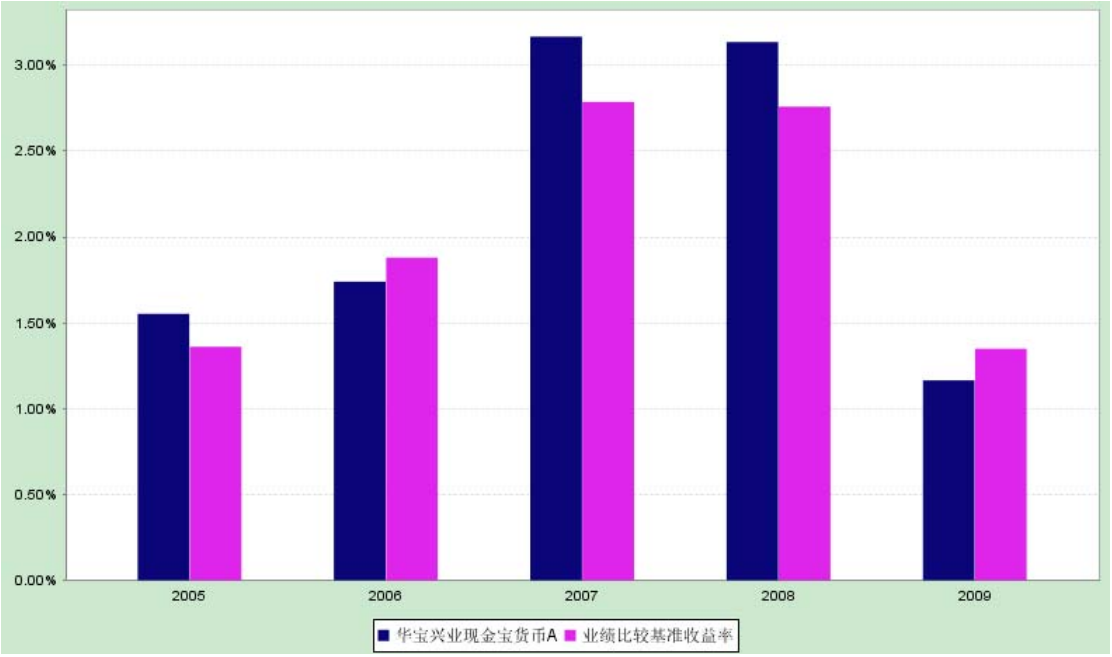
注：按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至 2005 年 4 月 7 日，本基金已根据基金合同规定完成建仓。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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市场基金

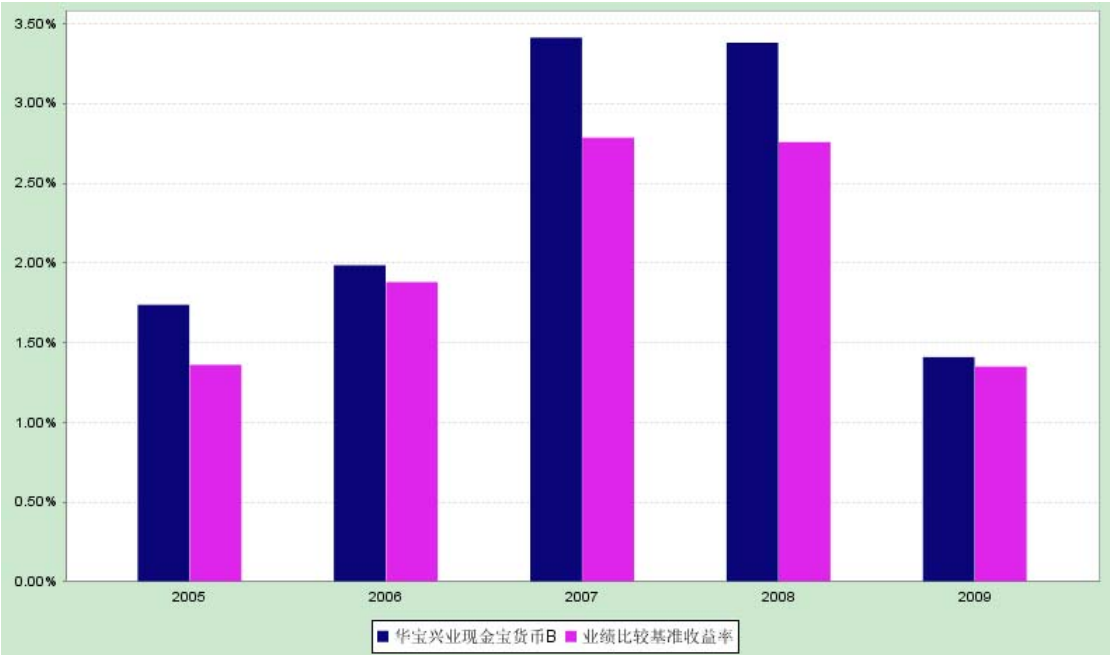
合同生效以来净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1、华宝兴业现金宝货币 A



注：本基金成立于 2005 年 3 月 31 日，2005 年度数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算，特此说明。

2、华宝兴业现金宝货币 B



注：本基金成立于 2005 年 3 月 31 日，2005 年度数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算，特此说明。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、华宝兴业现金宝货币 A

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2009	7,053,215.69	-	-6,983.75	7,046,231.94	-
2008	16,510,753.07	-	-77,985.91	16,432,767.16	-
2007	7,090,348.76	-	81,745.73	7,172,094.49	-
合计	30,654,317.52	-	-3,223.93	30,651,093.59	-

2、华宝兴业现金宝货币 B

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2009	25,070,515.65	-	83,209.45	25,153,725.10	-
2008	38,157,741.59	-	-1,630,646.88	36,527,094.71	-
2007	8,681,182.97	-	1,818,609.63	10,499,792.60	-

合计	71,909,440.21	-	271,172.20	72,180,612.41	-

§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（2009 年 12 月 31 日），所管理的开放式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、增强收益基金以及中证 100 基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 61,954,458,087.07 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
曾丽琼	本基金基金经理兼任增强收益基金基金经理	2007-02-28	-	8 年	本科。曾在杭州市商业银行总行资金营运部从事流动性管理及债券交易，2004 年 9 月加入本公司，任宝康债券基金、本基金经理助理，2007 年 2 月任现金宝基金基金经理，2009 年 2 月兼任增强收益基金基金经理。
刘兴旺	本基金基金经理助理	2008-08-06	-	5 年	硕士。曾在申银万国任固定收益部研究员。2008 年 5 月加入华宝兴业基金管理有限公司，2008 年 8 月至今任现金宝基金基金经理助理。

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，现金宝证券投资基金在短期内出现过正回购比例超过 20%的情况。发生此类情况后，该基金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，基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制，确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内，基金管理人严格实施公平交易制度；加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析；分析结果没有发现交易价差异常。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

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

回顾 2009 年，债券市场处于一个复杂的国内外经济环境中，一方面是全球经济衰退严重，国内宏观经济在中央出台的一揽子经济刺激计划的推动下，率先复苏；另一方面，为引导经济平稳、安全、有效运行，监管部门出台了一系列风险管理措施，债市交易主体的投资有所限制。货币政策方面，由“适度宽松”转向“动态微调”，公开市场整体为净投放，发行品种增加，利率总体上升。随着宏观经济复苏日渐明朗，加上市场对通胀预期的不断增强，债券市场全年呈现震荡下跌态势，中债综合指数（净价）全年下跌 4.03 点，跌幅 3.83%，中债国债收益率曲线全年平均上行 63BP。

从结构上看，2009 年债券市场还发生了深刻的变化，信用类债券的爆炸式发展成为当年一大亮点，信用类产品的发展不仅体现在存量的绝对增长，在信用级别方面，也有了进一步的细分，多样化、不同级别的发行主体为债券市场投资人提供了丰富的投资品种。

2009 年，现金宝基金管理人针对本基金作为现金管理工具的特点，在日常基金运作中，坚持“在流动性管理中创造价值”理念，力求跟随市场步伐，作出前瞻判断，突破货币市场基金“买入并持有到期”的基本投资策略，比如在 2009 年 1 季度末，短端收益最低时果断降低了债券投资比例；而在“十一”节前判断公开市场操作将持续维稳情况下，迅速加大了

1 年期品种的投资比例，此番操作的结果是本基金的流动性与安全性放在了收益的前边，在收益率曲线震荡走高的行情下，基金组合偏离度基本保持正值，但组合静态收益作出了一定让度，业绩欠佳，落后于比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2009 年现金宝 A 年化均值 1.1660%，现金宝 B 年化均值 1.4096%，业绩比较基准为 1.3500%。

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 2010 年，宏观经济乐观预期下也存在诸多不确定性，外围经济见底反弹，出口形势好于预期，但出口能否延续去年年底的态势、能否给经济增长带来持续较大正贡献还需进一步观察；另一方面，政府投资在逐渐淡出，宏观调控目标将着重于调结构、扩内需等方面。我们判断货币政策将较前期收紧，因货币供应增速较快是未来通胀压力的重要基础性因素，在较高的货币乘数条件下，如果基础货币依然保持较快的扩张，则未来货币环境无疑将成为通胀发展的温床。年初央行已启动了准备金调控工具，同时对商业银行信贷发放量进行了窗口指导。作为债券市场的投资主体，调控的提前使得商业银行的资产配置步伐出现变化，债券市场存在结构性投资机会。

未来现金宝货币市场基金管理人将密切跟踪相关政策动向，关注各项经济指标变化，在做好流动性、安全性管理下适度提高组合收益，保障持有人利益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，

根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据业务情况调整和细化了市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）全面开展内部审计工作。2009 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计，并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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中，各部门参与如下：

（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）金融工程部：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，为估值提供相关模型。

（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）必要时基金经理参与制定估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

4.8 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按基金份额面值 1.00 元分配后转入持有人权益，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。本基金在本年度累计分配收益 32,199,957.04 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 31,806,853.79 元，计入应付利润科目 393,103.25 元。

§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，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额，A 级为 7,046,231.94 元，B 级为 25,153,725.10 元。

5.3 托管人对本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 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20333 号

华宝兴业现金宝货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华宝兴业现金宝货币市场基金的财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是华宝兴业现金宝货币市场基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2) 选择和运用恰当的会计政策；

(3) 作出合理的会计估计。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评

估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了华宝兴业现金宝货币市场基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限责任公司　　注册会计师 马颖旎 张鸿

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2010-03-24

§7 年度财务报表

7.1 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：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	3,209,271,889.15	1,324,719,338.50
结算备付金		10,134,761.90	6,585,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	487,885,852.71	3,097,160,583.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		487,885,852.71	3,097,160,583.70
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	6,245,254,930.88	6,206,400,000.00
应收证券清算款		-	596,157,920.00
应收利息	7.4.7.5	5,368,084.68	7,079,227.73
应收股利		-	-

应收申购款		728,069.20	1,232,330.09
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		9,958,643,588.52	11,239,334,400.02
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2009年12月31日**	**上年度末 2008年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		509,637.22	1,160,973.33
应付托管费		154,435.49	351,810.06
应付销售服务费		83,165.08	206,409.87
应付交易费用	7.4.7.6	29,974.18	31,756.60
应交税费		95,100.00	95,100.00
应付利息		-	-
应付利润		393,103.25	316,877.55
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	64,500.00	64,500.00
负债合计		1,329,915.22	2,227,427.41
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.8	9,957,313,673.30	11,237,106,972.61
未分配利润	7.4.7.9	-	-
所有者权益合计		9,957,313,673.30	11,237,106,972.61
负债和所有者权益总计		9,958,643,588.52	11,239,334,400.02

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 9,957,313,673.30 份。其中现金宝 A 为 642,822,622.62 份，现金宝 B 为 9,314,491,050.68 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业现金宝货币市场基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	**附注号**	**本期** 2009年1月1日至2009年12月31日	**上年度可比期间** 2008年1月1日至2008年12月31日
一、收入		**44,688,612.65**	**63,779,503.09**
1.利息收入		37,958,259.66	56,113,288.08
其中：存款利息收入	7.4.7.10	5,982,951.92	1,537,631.62

债券利息收入		22,381,304.42	47,550,791.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,594,003.32	7,024,865.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,730,352.99	7,666,215.01
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	6,730,352.99	7,666,215.01
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
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		**12,488,655.61**	**10,819,641.22**
1．管理人报酬		7,714,226.20	5,943,202.56
2．托管费		2,337,644.19	1,800,970.40
3．销售服务费		1,643,194.85	1,461,976.08
4．交易费用	7.4.7.14	-	-
5．利息支出		449,060.29	1,288,395.80
其中：卖出回购金融资产支出		449,060.29	1,288,395.80
6．其他费用	7.4.7.15	344,530.08	325,096.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**32,199,957.04**	**52,959,861.87**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		32,199,957.04	52,959,861.87

7.3 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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31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）	11,237,106,972.61	-	11,237,106,972.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,199,957.04	32,199,957.04
三、本期基金份额交易产生的基金净	-1,279,793,299.31	-	-1,279,793,299.31

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	13,894,465,267.33	-	13,894,465,267.33
2. 基金赎回款	-15,174,258,566.64	-	-15,174,258,566.64
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）	-	-32,199,957.04	-32,199,957.04
五、期末所有者权益（基金净值）	9,957,313,673.30	-	9,957,313,673.30
项目	**上年度可比期间** 2008年1月1日至2008年12月31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）	8,845,274,536.25	-	8,845,274,536.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,959,861.87	52,959,861.87
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）	2,391,832,436.36	-	2,391,832,436.36
其中：1. 基金申购款	28,908,286,947.76	-	28,908,286,947.76
2. 基金赎回款	-26,516,454,511.40	-	-26,516,454,511.40
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）	-	-52,959,861.87	-52,959,861.87
五、期末所有者权益（基金净值）	11,237,106,972.61	-	11,237,106,972.61

报告附注为财务报表的组成部分

本报告附注从 7.1 至 7.4 的财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：裴长江，主管会计工作负责人：黄小薏，会计机构负责人：向辉

7.4 报表附注

7.4.1 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《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；一年以内的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内的债券；期限在一年以内的债券回购；期限在一年以内的中央银行票据以及中国证监会、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)。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2010 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则－基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允

价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变

化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

不适用。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权

益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。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按基金份额面值 1.00 元分配后于次日转入持有人权益，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。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴

20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
活期存款	409,271,889.15	24,719,338.50
定期存款	2,800,000,000.00	1,300,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	2,600,000,000.00	1,300,000,000.00
存款期限 1-3 个月	200,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计	3,209,271,889.15	1,324,719,338.50

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	487,885,852.71	488,362,000.00	476,147.29	0.0048
	合计	487,885,852.71	488,362,000.00	476,147.29	0.0048
项目		上年度末 2008 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	3,097,160,583.70	3,111,886,000.00	14,725,416.30	0.1310
	合计	3,097,160,583.70	3,111,886,000.00	14,725,416.30	0.1310

注：1、偏离金额＝影子定价－摊余成本；

2、偏离度＝偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	–	–

银行间买入返售证券	6,245,254,930.88	2,264,150,754.23
合计	6,245,254,930.88	2,264,150,754.23
项目	上年度末 2008年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,206,400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,206,400,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额
1	0981074	09华联CP01	2010-01-04	101.37	500000	50,685,000.00	-
2	0981227	09首钢CP01	2010-01-04	100.53	2000000	201,060,000.00	-
3	0981250	09中电投CP01	2010-01-04	100.23	1000000	100,230,000.00	-
4	0981253	09船重CP01	2010-01-04	100.21	1000000	100,210,000.00	-
5	0981168	09津钢管CP02	2010-01-05	100.97	800000	80,776,000.00	-
6	0981170	09郑煤CP01	2010-01-05	101.08	500000	50,540,000.00	-
7	0981175	09湘华凌CP01	2010-01-05	100.85	500000	50,425,000.00	-
8	0981178	09平高CP01	2010-01-05	100.93	500000	50,465,000.00	-
9	0981180	09外高桥CP01	2010-01-05	100.83	200000	20,166,000.00	-
10	0981188	09广州港CP01	2010-01-05	100.47	300000	30,141,000.00	-
11	0981202	09重汽CP01	2010-01-05	100.37	200000	20,074,000.00	-
12	0981223	09华电股CP01	2010-01-05	100.40	500000	50,200,000.00	-
13	0981063	09百联CP01	2010-01-05	101.34	500000	50,670,000.00	-
14	0981228	09振华CP01	2010-01-05	100.49	1000000	100,490,000.00	-
15	0981198	09神火CP01	2010-01-05	100.78	500000	50,390,000.00	-
16	0981201	09农六师CP02	2010-01-05	100.69	600000	60,414,000.00	-
17	0981241	09永煤CP03	2010-01-05	100.47	700000	70,329,000.00	-
18	0981253	09船重CP01	2010-01-05	100.21	800000	80,168,000.00	-
19	0981145	09华侨城CP01	2010-01-06	101.04	1000000	101,040,000.00	-
20	0981177	09阳煤CP01	2010-01-06	100.62	1100000	110,682,000.00	-

21	0981222	09沪城建CP01	2010-01-06	100.52	500000	50,260,000.00	-
22	0981235	09成渝CP01	2010-01-06	100.51	1000000	100,510,000.00	-
23	0981021	09北建工CP01	2010-01-07	104.60	500000	52,300,000.00	-
24	0981013	09贵航CP01	2010-01-07	104.36	500000	52,180,000.00	-
25	0981158	09昆钢CP01	2010-01-07	101.23	500000	50,615,000.00	-
26	0981093	09营口港CP01	2010-01-07	101.96	500000	50,980,000.00	-
27	0981172	09铁二股CP02	2010-01-07	101.00	700000	70,700,000.00	-
28	0981082	09悦达CP01	2010-01-07	101.25	300000	30,375,000.00	-
29	0981203	09铁十四CP01	2010-01-11	100.71	300000	30,213,000.00	-
30	0981170	09郑煤CP01	2010-01-11	101.08	900000	90,972,000.00	-
31	0981160	09二滩CP02	2010-01-11	101.11	300000	30,333,000.00	-
32	0981244	09集通CP02	2010-01-11	100.28	200000	20,056,000.00	-
33	0981152	09厦钨CP02	2010-01-11	101.27	300000	30,381,000.00	-
34	0981177	09阳煤CP01	2010-01-11	100.62	300000	30,186,000.00	-
35	0981156	09一拖CP02	2010-01-12	101.24	200000	20,248,000.00	-
36	0981162	09安琪CP01	2010-01-12	101.20	500000	50,600,000.00	-
37	0981166	09沙钢CP01	2010-01-12	101.39	800000	81,112,000.00	-
合计			-	-	22500000	2,271,176,000.00	-
项目	上年度末 2008年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额
合计			-	-	-	-	-

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应收活期存款利息	104,414.77	134,295.28
应收定期存款利息	830,278.64	48,750.00
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,901.92	3,193.78
应收债券利息	2,386,852.10	6,403,481.79
应收买入返售证券利息	2,013,573.55	429,427.69

应收申购款利息	29,063.70	60,079.19
其他	-	-
合计	5,368,084.68	7,079,227.73

7.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	29,974.18	31,756.60
合计	29,974.18	31,756.60

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
债券账户维护费	-	-
预提费用	64,500.00	64,500.00
合计	64,500.00	64,500.00

7.4.7.8 实收基金

华宝兴业现金宝货币 A

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,268,240,386.33	1,268,240,386.33
本期申购	3,366,228,690.48	3,366,228,690.48
本期赎回（以“-”号填列）	-3,991,646,454.19	-3,991,646,454.19
本期末	642,822,622.62	642,822,622.62

华宝兴业现金宝货币 B

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	9,968,866,586.28	9,968,866,586.28
本期申购	10,528,236,576.85	10,528,236,576.85
本期赎回（以“-”号填列）	-11,182,612,112.45	-11,182,612,112.45
本期末	9,314,491,050.68	9,314,491,050.68

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

华宝兴业现金宝货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	7,046,231.94	-	7,046,231.94
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-7,046,231.94	-	-7,046,231.94
本期末	-	-	-

华宝兴业现金宝货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	25,153,725.10	-	25,153,725.10
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-25,153,725.10	-	-25,153,725.10
本期末	-	-	-

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
活期存款利息收入	930,763.60	1,138,756.51
定期存款利息收入	4,346,084.19	48,750.00
其他存款利息收入	357,916.68	-
结算备付金利息收入	295,129.21	83,773.95
其他	53,058.24	266,351.16
合计	5,982,951.92	1,537,631.62

7.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期以及上年度均无买卖股票差价收入。

7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
卖出债券成交总额	3,500,379,781.02	7,108,043,858.56
减：卖出债券成本总额	3,488,919,568.97	7,088,411,310.50
减：应收利息总额	4,729,859.06	11,966,333.05
债券投资收益	6,730,352.99	7,666,215.01

7.4.7.13 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度均无衍生工具收益。

7.4.7.14 交易费用

本基金本报告期及上年度均无交易费用。

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	240,000.00	193,270.70
银行费用	26,530.08	53,825.68
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	344,530.08	325,096.38

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期内无或有事项的说明。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日后的收益分配事项如下：

	宣告日	分配收益所属期间
2010年度		
－第1号收益支付公告	2010/01/16	2009/12/15-2010/01/14
－第2号收益支付公告	2010/02/24	2010/01/15-2010/02/21
－第3号收益支付公告	2010/03/16	2010/02/22-2010/03/14

7.4.9 关联方关系

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、基金代销机构

华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
法国兴业资产管理有限公司(Société Générale Asset Management SA)	基金管理人的股东
上海宝钢集团公司(“宝钢集团”)	基金管理人的最终控制方
华宝证券经纪有限责任公司(“华宝证券”)	受基金管理人的控股股东控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度均未通过关联交易单位进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,714,226.20	5,943,202.56
其中：支付销售机构的客户维护费	267,706.37	252,424.90

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,337,644.19	1,800,970.40

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 X 0.1% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2009年1月1日至2009年12月31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	合计
中国建设银行	708,099.61	7,502.31	715,601.92
华宝兴业	325,640.53	130,450.03	456,090.56
华宝证券	144.42	-	144.42
合计	1,033,884.56	137,952.34	1,171,836.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	合计
中国建设银行	793,385.17	36,321.01	829,706.18
华宝兴业	312,735.88	60,898.53	373,634.41
合计	1,106,121.05	97,219.54	1,203,340.59

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。

7.4.10.3 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 2009年1月1日至2009年12月31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	20,051,425.41	-	400,387,205.48	411,834.25	6,714,271,600.00	379,298.53
上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	238,905,363.74	-	-	-	6,664,500,000.00	659,351.78

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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A	华宝兴业现金宝货币B
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	518,190.00	-	452,587.51	-
期间认购总份额	-	-	-	-
期间申购/买入总份额	6,069.61	-	65,602.49	-
期间因拆分增加的份额	-	-	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	524,259.61	-	518,190.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	-	0.00%	-

注：1、期间申购/买入总份额均为红利再投份额。

2、基金管理人运用固有资金投资本基金采用市场公开的费率。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	华宝兴业现金宝货币A 本期末 2009年12月31日		华宝兴业现金宝货币A 上年度末 2008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
华宝信托	-	-	-	-
宝钢集团	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-

关联方名称	华宝兴业现金宝货币B 本期末 2009年12月31日		华宝兴业现金宝货币B 上年度末 2008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
华宝信托	659,950,000.00	6.63%	1,175,592,000.00	10.46%
宝钢集团	300,476,803.15	3.02%	300,000,000.00	2.67%
华宝证券	50,000,000.00	0.50%	50,000,000.00	0.44%

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。

7.4.10.5 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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 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	409,271,889.15	1,223,263.60	1,324,719,338.50	1,187,506.51

7.4.10.6 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均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.11 利润分配情况

1、华宝兴业现金宝货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
7,053,215.69	-	-6,983.75	7,046,231.94	-

2、华宝兴业现金宝货币B

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
25,070,515.65	-	83,209.45	25,153,725.10	-

7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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新发/增发而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的证券。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 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，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括督察长、内部控制委员会、副总经理、内控审计风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。内控审计风险管理部在副总经理指导下对公司内

部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为内部内控审计风险管理部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以副总经理领导的内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对内控审计风险管理部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行和具有基金托管资格的银行中信银行股份有限公司，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按<中国人民银行信用评级管理指导意见>设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年末

	2009 年 12 月 31 日	2008 年 12 月 31 日
A-1	250,301,575.01	160,425,065.33
A-1 以下	-	-
未评级	207,739,422.27	2,876,902,416.20
合计	458,040,997.28	3,037,327,481.53

注：未评级债券均为央行票据和政策性金融债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年末 2008 年 12 月 31 日
AAA	29,844,855.43	9,783,986.10
AAA 以下	-	-
未评级	-	50,049,116.07
合计	29,844,855.43	59,833,102.17

注：未评级债券均为央行票据和政策性金融债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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 180 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”(附注 7.4.4.5)对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009 年 12 月 31 日	6 个月 以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	3,209,271,889.15	-	-	-	3,209,271,889.15
结算备付金	10,134,761.90	-	-	-	10,134,761.90
交易性金融资产	199,863,646.66	288,022,206.05	-	-	487,885,852.71
买入返售金融资产	6,245,254,930.88	-	-	-	6,245,254,930.88
应收利息	-	-	-	5,368,084.68	5,368,084.68
应收申购款	-	-	-	728,069.20	728,069.20
资产总计	9,664,525,228.59	288,022,206.05	-	6,096,153.88	9,958,643,588.52
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	509,637.22	509,637.22
应付托管费	-	-	-	154,435.49	154,435.49
应付销售服务费	-	-	-	83,165.08	83,165.08
应付交易费用	-	-	-	29,974.18	29,974.18
应交税费	-	-	-	95,100.00	95,100.00
应付利润	-	-	-	393,103.25	393,103.25

其他负债	-	-	-	64,500.00	64,500.00
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	1,329,915.22	1,329,915.22
利率敏感度缺口	9,664,525,228.59	288,022,206.05	-	4,766,238.66	9,957,313,673.30
上年度末 2008 年 12 月 31 日	**6 个月以内**	**6 个月-1 年**	**1-5 年**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	1,324,719,338.50	-	-	-	1,324,719,338.50
结算备付金	6,585,000.00	-	-	-	6,585,000.00
交易性金融资产	1,451,898,893.35	1,645,261,690.35	-	-	3,097,160,583.70
买入返售金融资产	6,206,400,000.00	-	-	-	6,206,400,000.00
应收证券清算款	-	-	-	596,157,920.00	596,157,920.00
应收利息	-	-	-	7,079,227.73	7,079,227.73
应收申购款	-	-	-	1,232,330.09	1,232,330.09
资产总计	8,989,603,231.85	1,645,261,690.35	-	604,469,477.82	11,239,334,400.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,160,973.33	1,160,973.33
应付托管费	-	-	-	351,810.06	351,810.06
应付销售服务费	-	-	-	206,409.87	206,409.87
应付交易费用	-	-	-	31,756.60	31,756.60
应交税费	-	-	-	95,100.00	95,100.00
应付利润	-	-	-	316,877.55	316,877.55
其他负债	-	-	-	64,500.00	64,500.00
负债总计	-	-	-	2,227,427.41	2,227,427.41
利率敏感度缺口	8,989,603,231.85	1,645,261,690.35	-	602,242,050.41	11,237,106,972.61

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 64 万元	增加约 362 万元
	2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 62 万元	减少约 361 万元

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

§8 投资组合报告

8.1 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	487,885,852.71	4.90
	其中：债券	487,885,852.71	4.90
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,245,254,930.88	62.71
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	2,264,150,754.23	22.74
3	银行存款和结算备付金合计	3,219,406,651.05	32.33
4	其他各项资产	6,096,153.88	0.06
	合计	9,958,643,588.52	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.14	
	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	-	-
	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

金额单位：人民币元

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
1	2009-01-20	22.98	本基金于 1 月 19 日发生巨额赎回	1 个工作日后调整

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	14
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	175
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	14

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 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 180 天。

8.3.2 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	93.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.30	-
2	30 天(含)—60 天	2.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	0.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.30	-
4	90 天(含)—180 天	1.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	2.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.95	-

8.4 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	-	-
2	央行票据	177,905,555.21	1.79
3	金融债券	29,833,867.06	0.30
	其中：政策性金融债	29,833,867.06	0.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	250,301,575.01	2.51
6	其他	29,844,855.43	0.30
7	合计	487,885,852.71	4.90
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	59,678,722.49	0.60

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	0981145	09 华侨城 CP01	1,000,000	100,218,826.96	1.01
2	0901040	09 央行票据 40	1,000,000	98,840,433.81	0.99
3	0901042	09 央行票据 42	500,000	49,403,666.07	0.50
4	0981182	09 中普天 CP02	300,000	30,086,340.54	0.30
5	0981169	09 邮科院 CP01	300,000	30,006,836.64	0.30
6	0981208	09 招商局 CP01	300,000	30,001,197.63	0.30
7	050603	05 中行 02 浮	300,000	29,844,855.43	0.30
8	090213	09 国开 13	300,000	29,833,867.06	0.30
9	0901038	09 央行票据 38	300,000	29,661,455.33	0.30
10	0981156	09 一拖 CP02	200,000	20,022,276.03	0.20

8.6“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	4
报告期内偏离度的最高值	0.2608%
报告期内偏离度的最低值	-0.0082%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0803%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明

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。本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.0000 元。

8.8.2 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。

8.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.8.4 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	5,368,084.68
4	应收申购款	728,069.20
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,096,153.88

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	5,563	115,553.23	19,546,799.48	3.04%	623,275,794.84	96.96%
华宝兴业现金宝货币B	103	90,431,951.94	8,935,908,627.43	95.94%	378,582,422.71	4.06%
合计	5,666	90,547,505.17	8,955,455,426.91	89.94%	1,001,858,217.55	10.06%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	华宝兴业现金宝货币 A	14,949.39	0.0023%
	华宝兴业现金宝货币 B	-	-
	合计	14,949.39	0.0023%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝兴业现金宝货币 A	华宝兴业现金宝货币 B
基金合同生效日基金份额总额	1,253,872,199.53	1,060,572,248.00
本报告期期初基金份额总额	1,268,240,386.33	9,968,866,586.28
本报告期基金总申购份额	3,366,228,690.48	10,528,236,576.85
减：本报告期基金总赎回份额	3,991,646,454.19	11,182,612,112.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	642,822,622.62	9,314,491,050.68

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、2009 年 6 月 30 日，经中国证券监督管理委员会核准，华宝兴业基金管理公司聘任任志强先生、HUANG XIAOYI HELEN（黄小薏）女士为公司副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

11.5 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在本报告期的审计报酬为 60,000.00 元人民币。目前该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（2005 年 3 月 31 日）起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
申银万国	1	-	-	-	-	–

注：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。

11.7.2 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		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
申银万国	-	-	42,205,300,000.00	100.00%	-	-

11.8 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。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业现金宝货币市场基金限制大额申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-01-09
2	华宝兴业现金宝货币市场基金春节假期前暂停申购和转入业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-01-17
3	华宝兴业基金公司关于网上直销建设银行卡交易费率调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-01-20
4	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-03-03
5	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金增加深圳发展银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-03-23
6	关于华宝兴业基金管理有限公司增加中国国际金融有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-03-25
7	关于华宝兴业旗下部分基金增加华宝证券经纪有限责任公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-04-02
8	华宝兴业现金宝货币市场基金增加中信银行为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理	2009-04-02

		人网站	
9	关于华宝兴业旗下部分基金增加中国农业银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-04-02
10	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-04-17
11	华宝兴业现金宝货币市场基金五一假期前暂停申购和转入业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-04-28
12	关于华宝兴业基金管理有限公司增加齐鲁证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-04-29
13	关于华宝兴业基金管理有限公司在光大证券开办基金定期定额投资计划业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-05-08
14	华宝兴业现金宝货币市场基金端午假期前暂停申购和转入业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-05-23
15	关于调整华宝兴业现金宝货币市场基金大额申购及转换转入业务限额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-07-10
16	华宝兴业基金管理有限公司关于开通建设银行网上直销定期定额业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-07-14
17	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业现金宝货币市场基金增加代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-08-05
18	华宝兴业基金管理有限公司关于开通民生银行借记卡基金网上交易业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-08-18
19	关于华宝兴业基金管理有限公司旗下基金参与中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理	2009-09-04

		人网站	
20	华宝兴业基金公司关于调整开放式基金业务规则的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-09-12
21	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-09-15
22	华宝兴业现金宝货币市场基金国庆假期前暂停申购和转入业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-09-25
23	华宝兴业基金管理有限公司关于取消现金宝货币市场基金大额申购及转换转入业务限制的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-10-27
24	关于华宝兴业旗下基金在深圳发展银行开通基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-01
25	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金增加广发华福证券有限责任公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-02
26	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务开通情况的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-08
27	关于华宝兴业现金宝货币市场基金调整转换限额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-17
28	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金增加信达证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-22
29	华宝兴业基金管理有限公司关于调整基金网上直销定期定额申购限额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-25
30	华宝兴业现金宝货币市场基金元旦假期前暂停申购和转入业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理	2009-12-26

		人网站	
31	关于华宝兴业基金管理有限公司旗下部分基金增加广东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-29

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2009 年 1 月 16 日，本基金托管人公告中国建设银行聘请胡哲一先生担任中国建设银行副行长；

2、2009 年 5 月 14 日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

3、2009 年 5 月 26 日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

4、2009 年 5 月 26 日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

5、2009 年 8 月 2 日，本基金托管人公告，自 2009 年 7 月 24 日起陈佐夫先生就任中国建设银行执行董事。

6、2009 年 9 月 27 日，本基金托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告。

7、2009 年 10 月 11 日，本基金托管人发布关于控股股东增持中国建设银行股份的公告。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同；

华宝兴业现金宝货币市场基金招募说明书；

华宝兴业现金宝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。

13.2 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。

13.3 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

二〇一〇年三月二十九日