

Disclosure

华宝兴业现金宝货币市场基金 2008年半年度报告摘要

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: 2008年8月26日

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2008年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。...

本报告期起始日期为2008年1月1日,截止日期为2008年6月30日。本报告中有关财务资料未经审计。...

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。...

第一章 基金简介

1.基金运作方式

华宝兴业现金宝货币市场基金为契约型开放式基金,存续期间为永久存续。基金管理人、托管人及基金合同生效日期...

华宝兴业现金宝货币市场基金管理人: 华宝兴业基金管理有限公司, 托管人: 中国建设银行股份有限公司, 2006年3月31日基金合同生效。...

3.基金简称、交易代码及基金份额 本基金根据投资人在销售机构保留的基金份额,对投资人持有的基金份额按照不同的费率计提销售与服务费。...

本基金的简称、交易代码,本报告期末(截止2008年6月30日)基金份额总额列表如下: 基金简称 交易代码 期末基金份额总额(份)...

4.基金投资目标、投资策略、业绩比较基准及风险收益特征 投资目标: 保持本基金的安全性及流动性,追求高于比较基准的收益率。...

5.基金管理人有关情况 名称: 华宝兴业基金管理有限公司 信息披露负责人: 刘月华...

6.基金托管人有关情况 名称: 中国建设银行股份有限公司(简称“中国建设银行”) 信息披露负责人: 尹东...

7.基金信息披露媒体及其他 本基金登载半年度报告正文的互联网网址: www.fund.com 本基金会定期准备备地包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。...

第二章 基金主要财务指标、基金净值表现

1.主要会计数据和财务指标

Table with 4 columns: Item, Classification, Reporting Period, Value. Includes data for revenue, expenses, net profit, etc.

2.净值增长率与同期比较基准收益率比较

Table with 6 columns: Stage, Fund Grade, Net Growth Rate, Benchmark, etc. Includes line graphs for comparison.

3.基金累计净值增长率与比较基准收益率走势对比



按照基金合同的约定,自基金合同生效日的6个月内达到规定的资产组合,截至2008年4月7日,本基金达到合同规定的资产配置比例。...

第三章 基金管理人报告

基金管理人于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(2008年6月30日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略增长基金、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、行业精选基金和海外中国成长基金(OHII)。...

1.基金经理简介

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, Start Date, End Date. Lists fund managers and their terms.

2.基金遵规守信情况说明

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、债市场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平均申购期限超过180天的情况。发生此类情况后,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。...

3.基金经理报告 二季度宏观经济增速继续放缓,但下降幅度低于市场预期,通胀水平依然处于高位,食品价格开始出现回落趋势,2季度末物价出现明显下降。出口情况好于年初的预期,出口增速和顺差规模下降幅度较小,对贸易顺差出现了一定反弹。...

上半年第一季度人民币升值速度较快,数据显示有超过5000亿的热钱流入国内,同时公开市场操作到期资金多,加上A股市场不断震荡下行的行情,使得大量资金回流银行体系,整体银行体系资金较为宽松,充裕的流动性以及加息预期的弱化引发了债市在1-4月出现一波小牛市行情,进入4月下旬至6月底,因加息预期重起以及央行密集上调存款准备金率,大幅回笼流动性,债市市场进入调整阶段。...

展望下半年,在全球经济失衡、外需放缓的背景下,自然灾害、初级产品价格上涨使得国内经济面临偏紧的形势。物价方面,短期物价有缓和迹象,但中期趋势仍不容乐观。考虑本轮通胀既有国内经济过热的内因,也有国际油价、原材料上涨的大背景。...

4.基金公平交易情况说明 (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。...

(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 (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。...

第四章 托管人报告

中国建设银行股份有限公司(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托管协议》,托管华宝兴业现金宝货币市场基金(以下简称现金宝基金)。...

本报告期内,基金管理人严格执行公平交易制度,包括股票风格库的划分、异常交易行为监控自动化、异常交易制度的制定、交易价差分析及自动化等。...

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本基金投资风格相似的投资组合。 (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。...

第五章 财务会计报告

1.比较资产负债表 金额单位:人民币元 项目 截至2008年6月30日 截至2007年12月31日 资产 银行存款 109,781,018.30 84,390,958.13...

2.比较基金利润表 金额单位:人民币元 项目 截至2008年1月1日至2008年6月30日止期间 截至2007年1月1日至2007年6月30日止期间...

3.比较基金所有者权益(净值)变动表 金额单位:人民币元 项目 截至2008年1月1日至2008年6月30日止期间 截至2007年1月1日至2007年6月30日止期间...

金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, Actual Fund, Undistributed Profit, Total. Shows financial data for the period.

4.会计报表附注 (1)本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。...

自2007年7月1日起,本基金执行新会计准则及中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,修改后的基金合同及中国证监会发布的关于基金行业业务操作的有关规定。...

(2)报告期内,本基金无重大会计差错。 (3)报告期内重大关联方关系及关联交易 a.关联方关系

Table with 2 columns: Related Party Name, Relationship with the Fund. Lists related parties like management and托管人.

下述关联交易均在正常业务范围按一般商业条款订立。 b.关联方交易

a.管理人报酬 支付基金管理人华宝兴业基金管理有限公司的管理人报酬按前一日本基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。...

b.托管费 支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日本基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。...

c.基金销售服务费 本基金在半年度需支付托管费711,266.15元(2007年同期:245,503.23元)。...

d.关联方为保管的银行存款余额及由此产生的利息收入 本基金人的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率或协议利率计息。...

e.与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易(含回购) 本基金在本会计期间与去年同期与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下: 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Related Party Name, 2008年1月1日至2008年6月30日止期间, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2008年6月30日, 2007年6月30日.

(4)报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产 本基金本报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产。 a.与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易(含回购) 本基金在本会计期间与去年同期与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下: 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Related Party Name, 2008年1月1日至2008年6月30日止期间, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2008年6月30日, 2007年6月30日.

(5)报告期末流通受限不能自由转让的基金资产 本基金本报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产。 b.与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易(含回购) 本基金在本会计期间与去年同期与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下: 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Related Party Name, 2008年1月1日至2008年6月30日止期间, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2008年6月30日, 2007年6月30日.

(6)报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产 本基金本报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产。 c.与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易(含回购) 本基金在本会计期间与去年同期与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下: 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Related Party Name, 2008年1月1日至2008年6月30日止期间, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2008年6月30日, 2007年6月30日.

(7)报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产 本基金本报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产。 d.与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易(含回购) 本基金在本会计期间与去年同期与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下: 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Related Party Name, 2008年1月1日至2008年6月30日止期间, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2008年6月30日, 2007年6月30日.

(8)报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产 本基金本报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产。 e.与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易(含回购) 本基金在本会计期间与去年同期与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下: 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Related Party Name, 2008年1月1日至2008年6月30日止期间, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2008年6月30日, 2007年6月30日.

(9)报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产 本基金本报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产。 f.与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易(含回购) 本基金在本会计期间与去年同期与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下: 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Related Party Name, 2008年1月1日至2008年6月30日止期间, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2008年6月30日, 2007年6月30日.

(10)报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产 本基金本报告期末未流通受限不能自由转让的基金资产。 g.与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易(含回购) 本基金在本会计期间与去年同期与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下: 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Related Party Name, 2008年1月1日至2008年6月30日止期间, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2008年6月30日, 2007年6月30日.

(1) 按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: No., Bond Type, Fair Value, Proportion. Lists bond portfolio details.

(2) 基金投资前十名债券明细

Table with 5 columns: No., Bond Code, Bond Name, Fair Value, Proportion. Lists top 10 bond investments.

上表中,“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。 5.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: Item, Deviation. Shows deviation between shadow pricing and amortized cost.

6.投资组合报告附注 (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。...

(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。...

(3) 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无涉及投资决策程序需特别说明。...

(4) 本基金报告期末其他资产构成如下: 序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 0.00...

Table with 3 columns: No., Name, Amount. Lists other assets.

(5) 基金管理人于2008年3月3日通过代销机构申购本基金50,000元,申购费率为0%。基金管理人按照有关规定于2008年2月28日进行了公开披露。 第七节 基金份额持有人户数、持有人结构

1.期末持有人户数及持有人结构列表如下: 类别 基金份额持有人户数(户) 持有人结构 机构投资者 个人投资者...

Table with 4 columns: Category, Number of Shareholders, Institutional Investor, Individual Investor. Shows shareholder structure.

2.期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况: 项目 期末持有本开放式基金的总量(份) 占本基金基金份额比例...

Table with 3 columns: Item, Amount, Proportion. Shows staff investment in funds.

第八节 基金份额变动情况 1.基金合同生效日基金总份额 单位:份 基金 基金合同生效日基金总份额 现金宝A 1,263,872,199.53...

Table with 2 columns: Fund Name, Total Shares at Contract Effective Date. Shows fund total shares.

2.本基金在报告期内基金份额的变动情况列表如下: 单位:份 报告期末基金份额总额 现金宝A 521,149,317.59...

Table with 3 columns: Report End Total, Cash宝A, Cash宝B. Shows fund share changes.

注:总申购份额含各级别调整和转入份额;总赎回份额含各级别调整和转出份额。 第九章 重大事件揭示

1.报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。 2.报告期内基金管理人未发生重大人事变动。 3.2008年6月13日,中国证券监督管理委员会核准基金托管人中国建设银行投资托管服务部副总理纪伟的高级管理人员任职资格。...

4.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。 5.本基金的投资策略在报告期内未发生变更。 6.本基金本报告期收益分配事项: 本基金自基金合同生效日起,每日将基金净收益分配给基金份额持有人,并于每月15日以前以1.00元结转为相应的基金份额,成立不满1个月时不结转。...

7.基金管理人已于2008年1月16日、2月16日、3月18日、4月16日、5月16日和6月17日分别在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此收益分配事项公告。 8.本基金管理人、托管人及其高级管理人员未出现受监管部门稽查或处罚的情形。 9.本基金未租用交易所席位。 10.2008年5月6日,因工作变动,赵林先生辞去基金托管人中国建设银行董事、副行长的职务。2008年5月19日,中国建设银行第二届董事会第十次会议决议聘任朱小黄先生为该行副行长。 11.2008年5月27日,基金托管人中国建设银行发布关于美国银行公司行使认购期权的通知,美国银行公司将根据与中央汇金投资有限公司于2005年6月17日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权。 12.2008年6月12日,基金托管人中国建设银行股东大会选举李树斌女士为该行执行董事并经中国银行业监督管理委员会核准同意任职,于2008年7月21日起任职。 13.根据基金管理人与中国国际证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》,中国国际证券于2008年4月11日起代理销售基金管理人所管理的宝康系列基金(宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金)、多策略增长基金、先进成长基金、动力组合基金、收益增长基金和本基金。 基金管理人已于2008年4月11日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。 14.根据基金管理人、恒泰证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》,恒泰证券自2008年4月14日起代理销售基金管理人所管理的宝康系列基金(宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金)、多策略增长基金、先进成长基金、动力组合基金、收益增长基金、行业精选基金和海外中国成长基金。 基金管理人已于2008年4月11日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。 15.基金管理人通过电话系统进行升级、更新,并在对新办公电话及传真予以公告后于2008年6月10日正式启用,原总公司总机自该日起停止使用。 基金管理人已于2008年6月2日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。 16.根据基金管理人、交通银行股份有限公司签署的《证券投资基金销售代理协议》,交通银行自2008年6月26日起代理销售基金管理人所管理的宝康系列基金(宝康消费品基金、宝康灵活配置基金和宝康债券基金)、多策略增长基金、先进成长基金、收益增长基金、本基金、先进成长基金、行业精选基金和海外中国成长基金。 基金管理人已于2008年6月24日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。 华宝兴业基金管理有限公司 2008年8月26日