

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.8 本基金本报告期末未持有权证。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本基金前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.9.3 基金资产净值

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,802.99
5	应收申购款	161,425.44
6	其他应收款	12,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	427,228.43

5.9.4 报告期末持有的处于转股期可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.5.6 报告期末指数投资前十名股票和流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.5.7 报告期末积极投资前十名股票和流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.5.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于计算中四舍五入的原因，本报告合计可能与实际值之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

	单位：份
本报告期初基金份额总额	245,289,886.42
本报告期间基金总申购份额	29,209,553.58
减：本报告期间基金总赎回份额	44,074,727.75
本报告期间基金拆分变动份额	
本报告期末基金份额总额	220,424,712.25

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、 华富中证100指数证券投资基金基金合同

2、 华富中证100指数证券投资基金基金托管协议

3、 华富中证100指数证券投资基金招募说明书

4、 报告期内华富中证100指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	400,240,000.00	11.10
2	央行票据	300,430,000.00	8.33
3	金融债券	341,051,000.00	9.46
	其中:政策性金融债	341,051,000.00	9.46
4	企业债券	1,070,109,125.41	29.67
5	企业短期融资券	80,022,000.00	2.22
6	可转换债	856,397,143.80	23.75
7	其他		

8	合计	3,048,449,269.21	84.53		
8.5	按投资标的公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	4,730,000	506,393,800.00	14.04
2	113002	工行转债	2,400,000	287,424,000.00	7.97
3	010112	21国债02	2,000,000	200,160,000.00	5.55
4	010110	21国债00	2,000,000	200,080,000.00	5.55
5	0881053	08央票53	1,000,000	100,230,000.00	2.78
5.6	报告期内买入的公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细				
5.7	报告期内买入的公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细				
5.8	投资组合报告附注				
5.8.1	报告期内本基金投资的前十名证券中的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况				
5.8.2	本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。				
5.8.3	基金资产净值中公允价值计量				
序号	名称	金额(元)			
1	存出保证金	455,068.45			
2	应收证券清算款	177,744,000.00			
3	应收股利	-			
4	应收利息	47,566,803.53			
5	应收申购款	5,876,462.40			
6	其他应收款	-			
7	待摊费用	-			
8	其他	-			
9	合计	231,642,334.38			
8.4	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细				
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113001	中行转债	506,393,800.00	14.04	
2	110009	双良转债	20,817,547.80	0.58	
3	110078	溢星转债	7,427,622.00	0.21	
4	113002	工行转债	287,424,000.00	7.99	

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002545	东方铁塔	32,903,400.00	0.91	新股锁定
2	601616	广电电气	29,123,531.36	0.81	新股锁定
3	002543	万和电气	27,710,000.00	0.77	新股锁定

5.8.6 投资组合报告期内持有的其他无锁定期股票由于计算中涉及四舍五入的原因,本报告合计数和合计数之和可能存在尾差。

§ 6 开放式基金价格变动

项目	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
本报告期初基金份额总额	2,011,147,214.68	1,260,712,767.52
本报告期间基金总申购份额	551,464,473.51	266,980,641.43
减:本报告期间基金总赎回份额	592,882,219.34	412,119,157.36
本报告期间基金份额变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,969,729,468.85	1,115,574,251.59

§ 7 基金文件目录

1. 华富收益增强债券型证券投资基金基金合同
2. 华富收益增强债券型证券投资基金托管协议
3. 华富收益增强债券型证券投资基金招募说明书
4. 报告期内华富收益增强债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
5. 2. 投资决策
6. 基金管理人、基金托管人
7. 查阅方式

投资者可于基金管理人办公时间随时查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600104	上汽汽车	2,949,835	54,601,445.8	5.56
2	600809	山西汾酒	660,000	40,590,000.00	4.13
3	000581	威孚高科	930,000	35,559,000.00	3.62
4	600688	时代新材	631,770	33,812,330.00	3.44
5	000690	青岛啤酒	1,150,000	32,395,000.00	3.30
6	600231	凌钢股份	2,999,920	31,199,260.00	3.18
7	600581	八一钢铁	2,123,659	30,601,926.19	3.11

9	000061	申银万国	2,150,000	26,982,500.00	2.75
10	000002	万科A	3,006,160	26,123,530.40	2.66

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
 本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
 本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 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	33,588,996.16
3	应收股利	—
4	应收利息	52,986.13
5	应收申购款	8,912,596.99
6	其他应收款	—
7	待摊费用	193,547.88
8	其他	—
9	合计	42,747,925.06

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名持仓明细中存出保证金占基金资产净值比例

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600014	上海汽车	54,601,445.85	5.56	筹划资产重组事宜

5.8.6 投资组合报告附注的其他重要事项
 由于四舍五入原因,本报告涉及金额占资产净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份	
基金合同生效日基金份额总额	1,063,046,976.37
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	89,340,700.90
基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	181,573,968.49
基金合同生效日起至报告期末基金份额变动份额(份额减少以“-”填列)	—
报告期末基金份额总额	970,813,708.78

注:本基金基金合同生效日为2011年7月25日。

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1) 中国证监会核准注册银华股票证券投资基金设立的相关文件;
- 2) 银华银华优选股票型证券投资基金基金合同;
- 3) 银华银华优选股票型证券投资基金基金招募说明书;
- 4) 银华银华优选股票型证券投资基金基金托管协议;
- 5) 基金管理人《基金管理人资格证书》及《企业法人营业执照》;
- 6) 被许可人银华银华优选股票型证券投资基金基金的各项原稿。

7.2 存放地点
 本基金管理人处——上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心19楼

7.3 查阅方式
 投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

7.4 网站查询
 本基金管理人网址:<http://www.bnyf.com>投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人银华证券有限责任公司,咨询电话4007-0017 88 或长话咨询 咸友电子客户, E-mail: service@bnyf.com。

银华银华优选股票型证券投资基金
 二零一一年四月二十二日