华富强化回报债券型证券投资基金

【2011】第二季度报告

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2011年7月20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2011年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2011年4月1日至2011年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富强化回报债券(场内简称:华富强债)
基金主代码	164105
交易代码	164105
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后,转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2010年9月8日
报告期末基金份额总额	1,999,206,694.42份
投资目标	在控制风险的基础上,力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素,研判各类固定收益类资产以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、要约收购类股票等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险,以确定各类金融资产的配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-172,604.67
2.本期利润	-12,169,074.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0061
4.期末基金资产净值	1,983,835,267.82
5.期末基金份额净值	0.992

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。

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增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-0.60%	0.18%	0.90%	0.11%	-1.50%	0.07%

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

注:根据《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%。本基金还可以参与新股申购、股票增发和要约收购类股票投资,并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。本基金投资于非固定收益类证券的比例不超过基金资产的20%。在封闭期结束后,本基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为2010年9月8日到2011年3月8日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定。

§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		
曾刚	华富强化回报债券基金基金经理、华富收益增强债券基金基金经理、公司固定收益部总监	2010年9月8日	-	十一年	中国科技大学学士、清华大学MBA,先后在红塔证券自营业务总部、汉唐证券债券业务总部、华宝兴业基金研究部负责宏观经济和债券的研究;2005年7月任上海电气财务公司资产管理部经理助理,负责固定收益投资。
张钫	华富强化回报债券基金基金经理	2011年4月26日	-	九年	上海社会科学院金融学硕士,历任上海远东资信评估有限公司研究员、房地产评级部经理、集团与证券评级部副经理,新华财经有限公司资信评级部高级经理,2009年5月加入华富基金管理有限公司,任债券研究员、华富强化回报债券基金基金助理。

注:曾刚的任职日期为该基金成立之日,张钫的任职日期指公司作出决定之日,证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《证券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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规,对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人在报告期内严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》以及本公司公平交易制度的相关规定,在日常交易中公平对待所管理的不同投资组合。

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

按照华富强化回报和华富收益增强的基金合同,华富强化回报和华富收益增强都属于债券型基金,2011年2季度,华富强化回报和华富收益增强A、华富收益增强B的净值增长率分别为-0.60%与-2.32%、-2.42%。华富强化回报和华富收益增强的差异不大。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为发生。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度,通胀创出新高,经济呈现疲态,市场对经济和政策的预期产生分歧。纯债方面,资金面紧张推动各期限收益率快速上行,政策性金融债收益率创年内新高,信用品种在季末受到部分机构去杠杆化的影响。股市在估值和业绩担忧下下跌,其中中小板和创业板跌幅较大,可转债随股市波动整体下行。

二季度,本基金继续配置信用债,适当增加组合久期,但在杠杆使用上仍有所保留。大盘转债遭遇部分损失,但考虑到风险可控,仍保留了较高仓位。二季度本基金继续回避新股申购,分批次减持存量股票。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2010年9月8日正式成立。截止2011年6月30日,本基金份额净值为0.992元,累计份额净值为0.992元。报告期,本基金本季度净值增长率为-0.60%,同期业绩比较基准收益率为0.90%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,通胀有望见顶,但回落幅度有待继续观察。国内经济增长可能继续在低位徘徊,外围经济则面临较多的不确定性,美国经济复苏缓慢,欧债危机继续扩大。

基于对政策部分放松的预期,权益市场可能有波段性机会,但空间有限。转债中性偏积极,需关注供给增加的短期压力。利率品种方面,随着资金面的改善,通胀回落,中长期金融债的配置价值会逐渐显现。信用品种方面,偏负面因素多一些,供给压力较大,地方融资平台再融资风险和区域偿债"短板"存在,信用利差有上行的压力,但同时高等级信用债仍可找到合适的配置机会。三季度,本基金将继续着力于优化组合的信用和流动性结构。

本基金将在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,稳健地做好配置策略,积极而不激进,均衡投资,以三年封闭期的综合收益率较高为重要目标,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

§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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	167,061,624.67	6.24
	其中:股票	167,061,624.67	6.24
2	固定收益投资	2,319,787,785.92	86.67
	其中:债券	2,319,787,785.92	86.67
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	101,900,352.85	3.81
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	49,564,423.79	1.85
6	其他资产	38,233,859.02	1.43
7	合计	2,676,548,046.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,827,682.40	0.34
B	采掘业	21,440,000.00	1.08
C	制造业	105,773,442.27	5.33
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	8,885,000.00	0.45
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	14,147,000.00	0.71
C7	机械、设备、仪表	82,741,442.27	4.17
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,323,500.00	0.27
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	22,932,000.00	1.16
G	信息技术业	2,346,000.00	0.12
H	批发和零售贸易	2,419,000.00	0.12
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	167,061,624.67	8.42

5.3 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股票投资明细

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	002531	天顺风能	2,050,000	39,011,500.00	1.97
2	300161	华中数控	900,000	26,253,000.00	1.32
3	601006	大秦铁路	2,800,000	22,932,000.00	1.16
4	300157	恒泰艾普	670,000	21,440,000.00	1.08
5	002540	亚太科技	700,000	14,147,000.00	0.71
6	300165	天瑞仪器	514,000	12,634,120.00	0.64
7	002521	齐峰股份	500,000	8,885,000.00	0.45
8	601118	海南橡胶	554,195	6,827,682.40	0.34
9	600642	申能股份	1,050,000	5,323,500.00	0.27
10	601890	亚星锚链	225,615	3,260,136.75	0.16

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	49,750,000.00	2.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,631,206,910.00	82.22
5	企业短期融资券	160,011,000.00	8.07
6	中期票据	-	-
7	可转债	478,819,875.92	24.14
8	其他	-	-
9	合计	2,319,787,785.92	116.93

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

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	113002	工行转债	1,660,790	196,753,791.30	9.92
2	113001	中行转债	1,573,960	166,178,696.80	8.38
3	110015	石化转债	975,350	105,191,497.50	5.30
4	122819	11常城建	711,100	71,181,110.00	3.59
5	1180046	11莱芜开投债	700,000	70,588,000.00	3.56

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

注: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

注: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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	1,420,642.82
3	应收股利	882,000.00
4	应收利息	35,681,216.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,233,859.02

5.8.4 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	113002	工行转债	196,753,791.30	9.92
2	113001	中行转债	166,178,696.80	8.38
3	110078	澄星转债	7,500,219.30	0.38

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300161	华中数控	26,253,000.00	1.32	筹划重大资产重组事项停牌

5.8.6 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,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	-
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	-
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	-

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本封闭式基金

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、华富强化回报债券型证券投资基金基金合同

2、华富强化回报债券型证券投资基金托管协议

3、华富强化回报债券型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富强化回报债券型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。

华富中证100指数证券投资基金

【2011】第二季度报告

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2011年7月20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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中证100指数
基金主代码	410008
交易代码	410008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月30日
报告期末基金份额总额	198,205,969.04份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%和年跟踪误差不超过4%,以实现对中证100指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,本基金的标的指数为中证100指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略,即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下,其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,866,095.09
2.本期利润	-5,847,750.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0292
4.期末基金资产净值	164,111,486.05
5.期末基金份额净值	0.8280

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。

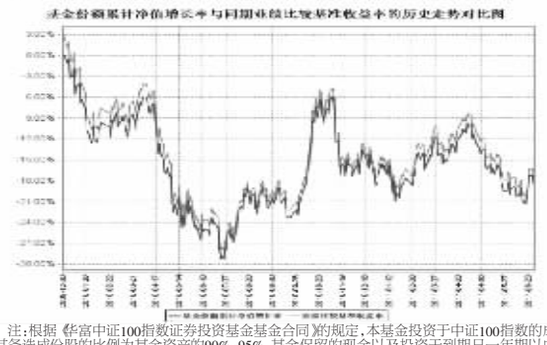
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-3.77%	1.02%	-4.41%	1.02%	0.64%	0.00%

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



注:根据《华富中证100指数证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资于中证100指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的90%~95%,基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2009年12月30日到2010年6月30日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富中证100指数证券投资基金基金合同》的规定。

§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		
郭晨	华富中证100指数基金基金经理	2010年12月27日	-	四年	四川大学管理学硕士。历任平安资产管理公司运营管理部绩效分析师,东吴基金管理有限公司研究部、产品策略部金融工程研究员。2009年11月加入华富基金管理有限公司,任投资部华富中证100指数基金基金经理助理。

注:郭晨的任职日期为公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规,对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人在报告期内严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》以及本公司公平交易制度的相关规定,在日常交易中公平对待所管理的不同投资组合。

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

本基金管理人在报告期内严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》以及本公司公平交易制度的相关规定,在日常交易中公平对待所管理的不同投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为发生。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本季度市场呈现震荡下行的走势,季度初期指数见顶之后,市场便进入了一段持续的单边下跌之中,直到本季度最后几个交易日市场开始反弹,整个季度市场处于普跌之中,中证100指数下跌了4.69%。

国内通胀高居不下导致央行不断对流动性进行紧缩,上半年加息和调整存款准备金率一直贯穿始终,市场资金面比较紧张,随着货币紧缩政策的持续,市场开始担心实体经济受到影响,经济下滑导致企业盈利下降。此外,政府对房地产的打压、欧债危机、美国经济复苏过程曲折、日本地震等问题也对市场产生了较大影响。上半年市场整体疲弱,成长股弱于价值型股票,小盘股弱于大盘蓝筹股。中小板和创业板指数跌幅较大,中小盘股票前两年积累了较大的泡沫,IPO发行市盈率过高,二级市场炒作也较为充分,中小盘概念股票与大盘蓝筹股估值差异大大。今年这个泡沫逐渐被刺破,一些公司的业绩不达预期,同时监管层加速中小盘股票的IPO审批,在筹码大幅增加的情况下,中小盘股也失去了溢价能力,今年以来,一二级市场的中小盘股票的估值均大幅下降,回归价值,这是国内A股市场进一步成熟的表现,作为机构投资者,我们很高兴看到这一点。

作为被动型指数基金,华富中证100指数基金本季度严格恪守本基金的投资理念和投资目标,实现了对基准的有效跟踪。报告期内基金运作良好,跟踪偏离度和跟踪误差均符合基金合同的要求。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2009年12月30日正式成立。截止2011年6月30日,本基金份额净值为0.8280元,累计份额净值为0.8280元。报告期,本基金份额净值增长率为-3.77%,同期业绩比较基准收益率为-4.41%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为国内市场机会大于风险,目前国内通胀已经逐步见顶,经济下滑的证据不明显,国外欧债、美债危机可能还会出现负面消息,因此我们判断,政府的调控行动逐步进入尾声,未来进一步紧缩流动性的可能不大。对房地产的政策打压进一步加码的可能性也较小,保障房、水利建设等领域的投资有望对经济产生正面影响。另外由于上半年市场出现了相当幅度的下跌,估值处于历史底部,我们判断未来市场仍然是结构性行情,大盘蓝筹股下跌空间有限,可能出现估值修复的脉冲行情,中小盘股票将出现分化,估值合理、质地优秀的公司有望同时受益于估值提升和业绩成长,而基本面有瑕疵的中小盘股票将逐步被市场淘汰。

本基金是完全复制的指数基金,为投资者提供有效跟踪市场的投资工具,通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争实现对业绩基准的有效跟踪。我们将恪守基金合同的规定,保持对基准的紧密跟踪,使投资者分享中国经济长期快速增长的成果。

§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	权益投资	153,719,101.71	93.32
	其中:股票	153,719,101.71	93.32
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	10,232,426.35	6.21
6	其他资产	765,758.02	0.46
7	合计	164,717,286.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按证券行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	394,240.00	0.24
B	采掘业	20,779,647.71	12.66
C	制造业	41,032,376.92	25.00
C0	食品、饮料	8,919,291.52	5.43
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,121,466.70	1.29
C5	电子	137,515.00	0.08
C6	金属、非金属	8,935,921.40	5.45
C7	机械、设备、仪表	19,425,293.68	11.84
C8	医药、生物制品	1,492,888.62	0.91
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,105,781.52	1.89
E	建筑业	4,668,185.51	2.84
F	交通运输、仓储业	6,367,503.84	3.88
G	信息技术业	3,650,205.09	2.22
H	批发和零售贸易	2,329,267.92	1.42
I	金融、保险业	63,573,851.58	38.74
J	房地产业	6,332,944.12	3.86
K	社会服务业	949,991.00	0.58
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	535,106.50	0.33
	合计	153,719,101.71	93.67

注:本基金本报告期指数投资部分含拟于2011年7月1日调入中证100指数的备选成分股,具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

5.2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

注:本基金本报告期未持有积极投资部分股票。

5.3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股票投资明细

5.3.1报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600036	招商银行	692,056	9,010,569.12	5.49
2	601318	中国平安	145,226	7,010,059.02	4.27
3	600016	民生银行	1,192,631	6,833,775.63	4.16
4	600000	浦发银行	593,775	5,842,746.00	3.56
5	601166	兴业银行	397,775	5,362,007.00	3.27
6	600030	中信证券	366,136	4,789,058.88	2.92
7	601088	中国神华	142,904	4,307,126.56	2.62
8	601398	工商银行	890,151	3,970,073.46	2.42
9	000002	万 科A	420,023	3,549,194.35	2.16
10	600519	贵州茅台	16,436	3,494,786.68	2.13

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-

注:本基金本报告期未持有债券。

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

注:本基金本报告期未持有债券。

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

注:本基金本报告期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

注: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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

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	364,598.85
4	应收利息	4,295.20
5	应收申购款	146,863.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	765,758.02

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在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。

5.8.5.2报告期末积极投资前十名股票中存在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部分股票。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	220,424,712.25
本报告期期间基金总申购份额	5,566,769.81
减:本报告期期间基金总赎回份额	27,785,513.02
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	198,205,969.04

§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。

华富收益增强债券型证券投资基金

【2011】第二季度报告

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2011年7月20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2011年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2011年4月1日至2011年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富收益增强债券
基金主代码	410004
交易代码	410004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月28日
报告期末基金份额总额	2,538,194,878.36份
投资目标	本基金主要投资于固定收益类产品,在维持资产较高流动性、严格控制投资风险、获得债券稳定收益的基础上,积极利用各种稳健的金融工具和投资渠道,力争基金资产的持续增值。
投资策略	本基金以系统化研究为基础,通过对固定收益类资产的主动配置获得稳定的债券总收益,并通过新股申购、转债投资等品种的主动投资提升基金资产的增值效率。投资策略主要包括纯固定收益、新股申购、转债投资等。
业绩比较基准	中信标普全债指数
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,预期其长期平均风险和收益高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属两级基金简称	华富收益增强债券A / 华富收益增强债券B
下属两级交易代码	410004 / 410005
下属两级基金报告期末份额总额	1,619,359,083.90份 / 918,835,794.46份

§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(2011年4月1日-2011年6月30日)	
	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
1.本期已实现收益	11,834,304.58	5,577,535.98
2.本期利润	-47,991,107.41	-28,750,373.05
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0270	-0.0282
4.期末基金资产净值	1,851,010,584.73	1,045,728,944.25
5.期末基金份额净值	1.1431	1.1381

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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基