

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
送出日期:2014年8月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、董事会、监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、完整性负连带的法律责任。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。

基金托管人国建建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2014年6月22日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利差分情况、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。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§ 2 简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富强化回报债券
场内简称	华富债
基金代码	164105
交易代码	164105
基金运作方式	契约型，基金合同生效后存续三年内封闭运作，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
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
定期报告期末基金资产总额	528,723,060.83元
基金份额的类别	不定期
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年10月11日

单位:人民币元

报告期截至日: 2014年6月30日

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000099	中信海直	1,364,500.00	0.14
2	000887	中航资本	609,694.93	0.06
3	300363	博腾股份	43,750.00	0.00
4	300370	易事特	37,485.00	0.00
5	300358	楚天科技	28,895.00	0.00
6	300370	安控科技	27,975.00	0.00
7	600309	招商轮船	23,040.00	0.00
8	300380	安硕信息	16,950.00	0.00
9	002723	金莱特	16,895.00	0.00
10	002714	罗平股份	16,000.00	0.00
11	603308	亚通股份	11,500.00	0.00
12	002716	普路通	9,330.00	0.00
13	002028	光洋股份	8,660.00	0.00
14	002705	新宜股份	7,625.00	0.00

注:本表仅列示“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交量)填列,未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额 735,732.36

卖出股票收入(成交)总额 2,362,299.93

注:本表仅列示“买入股票成本(成交)总额”及“卖出股票收入(成交)总额”均按买入成交金额(成交量乘以成交单价)填列,未考虑相关交易费用。

7.4.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

单位:人民币元

序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例 (%)

1 国债 7,180,269 13% 高级债 500,000 51,320,000 9.16

2 行业票据 - -

3 融资券 30,000,000.00 5.35

其中:政策性金融债 30,000,000.00 5.35

4 企业债 655,514,141.95 116.95

其中:可转换债券 - -

6 中期票据 9,847,000.00 1.76

7 财团债 173,546,633.16 30.96

8 其他 - -

9 合计 868,907,825.11 155.02

7.4.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

单位:人民币元

序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例 (%)

1 中国银行 1,364,500.00 0.14

2 行业票据 - -

3 融资券 30,000,000.00 5.35

其中:政策性金融债 30,000,000.00 5.35

4 企业债 655,514,141.95 116.95

其中:可转换债券 - -

6 中期票据 9,847,000.00 1.76

7 财团债 173,546,633.16 30.96

8 其他 - -

9 合计 868,907,825.11 155.02

7.4.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名货币市场基金

单位:人民币元

序号 货币市场基金 公允价值 占基金资产净值比例 (%)

1 中国银行 725,891.41 2,058,901.33

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.06%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年管理费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金管理费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.2 基金托管费

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 2,177,675.54 6,176,704.12

基金管理费按前一天基金资产净值0.06%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金托管费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.3 关联方交易

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 725,891.41 2,058,901.33

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.02%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金托管费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.4 基金管理费

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 725,891.41 2,058,901.33

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.06%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金管理费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.5 基金销售服务费

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金销售服务费 89,603,637.70 40,284,738.63

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.02%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金销售服务费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.6 基金管理费

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 89,603,637.70 40,284,738.63

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.06%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金管理费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.7 基金管理费

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 89,603,637.70 40,284,738.63

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.06%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金管理费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.8 基金管理费

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 89,603,637.70 40,284,738.63

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.06%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金管理费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.9 基金管理费

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 89,603,637.70 40,284,738.63

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.06%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金管理费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.10 基金管理费

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 89,603,637.70 40,284,738.63

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.06%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金管理费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.11 基金管理费

单位:人民币元

序号 项目 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 89,603,637.70 40,284,738.63

注:基金管理费按前一天基金资产净值0.06%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H= E×年托管费率 - 当年天数(H 为每日计提的基金管理费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.12 基金管理费

单位:人民币元