

华富收益增强债券型证券投资基金 2010 年半年度报告摘要

2010 年 6 月 30 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

送出日期：2010 年 8 月 26 日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富收益增强债券	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	2,086,813,109.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	华富收益增强债券 A	华富收益增强债券 B
下属分级基金的交易代码：	410004	410005
报告期末下属分级基金的份额总额	1,204,320,010.85 份	882,493,098.39 份

2.2 基金产品说明

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。

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	华富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘
	联系电话	021-68886996
	电子邮箱	manzh@hffund.com
客户服务电话	400-700-8001	010-67595096
传真	021-68887997	010-66275853

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》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华富收益增强债券 A	华富收益增强债券 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)	报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)
本期已实现收益	18,575,358.87	9,265,501.28
本期利润	42,343,044.09	19,040,778.24
加权平均基金份额本期利润	0.0452	0.0344
本期基金份额净值增长率	5.82%	5.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)	

期末可供分配基金份额利润	0.0121	0.0121
期末基金资产净值	1,355,795,463.68	993,266,349.07
期末基金份额净值	1.1258	1.1255

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) 以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润指标的计算方法为采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

华富收益增强债券 A

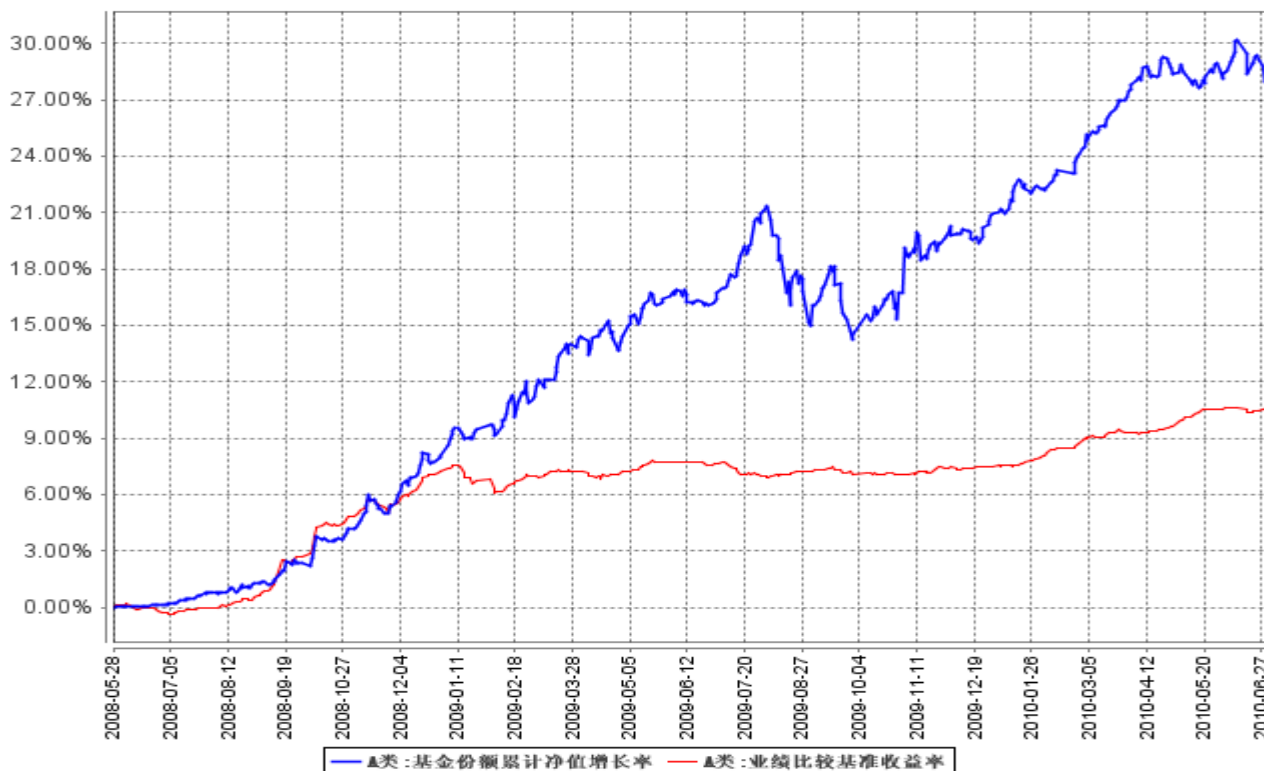
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.43%	0.35%	0.09%	0.05%	-0.52%	0.30%
过去三个月	0.36%	0.26%	1.22%	0.05%	-0.86%	0.21%
过去六个月	5.82%	0.23%	2.95%	0.05%	2.87%	0.18%
过去一年	10.09%	0.36%	2.79%	0.05%	7.30%	0.31%
自基金合同生效日起至今	27.95%	0.29%	10.65%	0.08%	17.30%	0.21%

华富收益增强债券 B

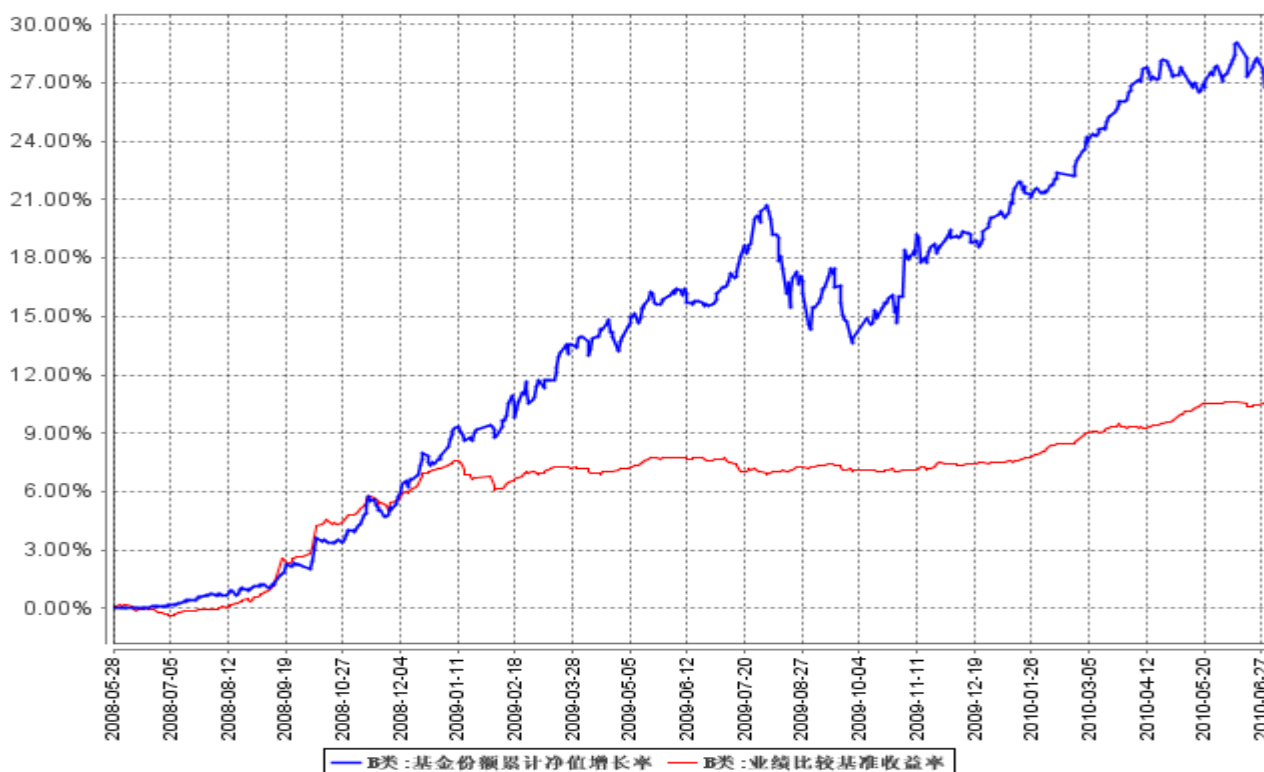
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.48%	0.36%	0.09%	0.05%	-0.57%	0.31%
过去三个月	0.25%	0.26%	1.22%	0.05%	-0.97%	0.21%
过去六个月	5.59%	0.23%	2.95%	0.05%	2.64%	0.18%
过去一年	9.62%	0.36%	2.79%	0.05%	6.83%	0.31%
自基金合同生效日起至今	26.82%	0.29%	10.65%	0.08%	16.17%	0.21%

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

基金份额累计净值增长率与比较基准收益率的历史走势对比图



基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据基金合同的规定，本基金投资债券、货币市场工具等固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的 80%，投资股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金不直接在二级市场买入股票等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购和新股增发，并持有因在一级市

场申购所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票。本基金还可以持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。

§ 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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立，注册资本 1.2 亿元，公司股东为华安证券有限责任公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司。基金管理人于 2005 年 3 月 02 日发起成立并管理其第一只开放式基金——华富竞争力优选混合型证券投资基金。2006 年 6 月 21 日发起成立并管理其第二只开放式基金——华富货币市场基金。2007 年 3 月 19 日发起成立并管理其第三只开放式基金——华富成长趋势股票型证券投资基金。2008 年 5 月 28 日发起成立并管理其第四只开放式基金——华富收益增强债券型证券投资基金。2008 年 12 月 24 日发起成立并管理其第五只开放式基金——华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金。2009 年 7 月 15 日发起成立并管理其第六只开放式基金——华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金。2009 年 12 月 30 日发起成立并管理其第七只开放式基金——华富中证 100 指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾刚	华富收益增强债券基金基金经理、公司固定收益部总监。	2008 年 5 月 28 日	-	十年	中国科技大学学士、清华大学 M B A，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。

注：这里的任职日期指基金成立之日，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合规守信情况的说明

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、

基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金为债券型基金，本基金管理人管理的其他基金的投资风格与本基金的投资风格不相似。

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 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

上半年，GDP 增速冲高回落，工业增加值尽显疲态，消费有所提高但后劲不足，年初以来 CPI 较为意外地低于预期，带动债市大幅上涨，此外股市大幅调整，资金趋向避险心态，新发行债券较少，不能满足银行保险等大型机构的配置需求，而在欧洲债务危机爆发后，进一步刺激债市走高。相对于债市的强势，可转债指数跌幅在 15%左右，而上半年的打新操作中，多次出现破发现象，中签率大幅提高，打新风险较大。

上半年本基金较好地分享了债市上涨的成果，其中信用债比例较高，对净值有较大贡献。从去年底本基金判断可转债整体上难以支撑过高的转股溢价率，基本清仓，有效地规避了损失。打新股方面，基于对打新氛围的良好把握，我们较早地放弃了绝大多数超大盘新股的网下询价，规避了风险，在中小板和创业板新股上，缩减打新融资规模、每批次四只新股只报 2-3 家、对全部股票分两档报价，这些主动的调整降低了风险，而在公司研究部的支持下，提高了对优质新股的把握能力。尽管上半年股票指数跌幅较大，但经初步测算，本基金来自于新股的收益仍在 1.5 个百分点左右。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2008 年 5 月 28 日正式成立。截止到 2010 年 6 月 30 日，华富收益增强 A 类基金份额净值为 1.1258 元，累计份额净值为 1.2658 元，本报告期的份额累计净值增长率为 5.82%，华富收益增强 B 基金份额净值为 1.1255 元，累计份额净值为 1.2555 元，本报告期的份额累计净值增长率为 5.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从新开工项目数量、消费增速和进出口增长趋势看，下半年 GDP 增速应进一步回落至 9-10% 区间，尽管 6 月份 CPI 提前回落，但劳动力成本升高、服务业占比提升、自然灾害等将抬升未来的通胀水平。我们认为，货币政策将保持稳定，加息适度延后，公开市场操作力度可能略有加大，对于债市我们持中性判断；可转债市场仍值得关注，工行和中石化这 2 只大规模转债的发行上市将使转债市场达到 1000 亿规模，存在较为确定的投资机会，但对其潜在收益不可估计过高，同时有可能出现波段性交易的空间。在新股询价逐步回归理性之后，打新股整体上仍将有正的收益，但须谨慎选择。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位，在较低风险程度下，认真研究各个潜在投资领域的机会，发挥管理人的综合优势，积极稳健地做好配置策略，均衡投资，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司运作保障部总监，成员包括总经理、督察长、投资部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富收益增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，在本报告期内共实现可分配利润 60,751,036.21 元；本报告期内共实施 2 次分红，分别为 2010 年 1 月 28 日实施利润分配 22,020,386.44 元，2010 年 6 月 28 日实施利润分配 41,132,968.29 元，符合基金合同所要求的收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50% 的约定；本报告期末，尚存可供分配的利润共 25,218,767.57 元，滚存

至下一期进行分配。

§ 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投资运作遵规守信、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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金 A 类实施利润分配的金额为 41,474,151.89 元，B 类实施利润分配的金额为 21,679,202.84 元。

5.3 托管人对半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：华富收益增强债券型证券投资基金
报告截止日：2010年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资产：		

银行存款	11,250,831.63	11,257,175.18
结算备付金	9,078,882.88	6,037,973.95
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	2,560,756,496.29	924,679,286.33
其中：股票投资	281,500,034.09	87,081,803.91
基金投资	-	-
债券投资	2,279,256,462.20	808,899,155.10
资产支持证券投资	-	28,698,327.32
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	293,961,842.51	748,331.07
应收利息	36,407,734.47	13,755,079.04
应收股利	-	-
应收申购款	33,049,627.47	12,844,695.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,944,755,415.25	969,572,540.78
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2010年6月30日	2009年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	580,999,855.00	140,000,000.00
应付证券清算款	-	4,790,205.76
应付赎回款	11,612,443.22	4,011,422.26
应付管理人报酬	1,156,936.77	460,892.36
应付托管费	385,645.59	153,630.79
应付销售服务费	320,319.44	97,879.45
应付交易费用	56,982.82	231,218.02
应交税费	-	-
应付利息	186,501.57	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	974,918.09	974,980.05
负债合计	595,693,602.50	150,720,228.69
所有者权益：		
实收基金	2,086,813,109.24	737,662,294.31
未分配利润	262,248,703.51	81,190,017.78
所有者权益合计	2,349,061,812.75	818,852,312.09
负债和所有者权益总计	2,944,755,415.25	969,572,540.78

注：报告截止日2010年6月30日，A类基金份额净值1.1258元、B类基金份额净值1.1255元，基金份额总额2,086,813,109.24份，其中A类基金份额总额1,204,320,010.85份、B类基金份额总额882,493,098.39份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富收益增强债券型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009 年6月30日
一、收入	73,184,966.55	56,584,121.67
1. 利息收入	25,505,287.50	15,694,749.00
其中：存款利息收入	582,192.33	107,223.06
债券利息收入	24,616,606.81	15,582,925.94
资产支持证券利息收入	10,590.91	-
买入返售金融资产收入	295,897.45	4,600.00
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	13,965,385.52	18,395,095.64
其中：股票投资收益	4,118,312.82	3,172,000.33
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,083,471.80	14,663,980.13
资产支持证券投资收益	51,172.73	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	712,428.17	559,115.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	33,542,962.18	22,445,515.79
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	171,331.35	48,761.24
5. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	11,801,144.22	4,812,112.04
1. 管理人报酬	5,011,337.60	2,407,600.43
2. 托管费	1,670,445.84	802,533.48
3. 销售服务费	1,241,376.04	468,356.47
4. 交易费用	114,278.94	149,362.26
5. 利息支出	3,511,028.66	735,447.72
其中：卖出回购金融资产支出	3,511,028.66	735,447.72
6. 其他费用	252,677.14	248,811.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	61,383,822.33	51,772,009.63
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	61,383,822.33	51,772,009.63

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富收益增强债券型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30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)	737,662,294.31	81,190,017.78	818,852,312.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	61,383,822.33	61,383,822.33
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)	1,349,150,814.93	182,828,218.13	1,531,979,033.06
其中：1.基金申购款	3,074,066,516.49	426,208,582.09	3,500,275,098.58
2.基金赎回款	-1,724,915,701.56	-243,380,363.96	-1,968,296,065.52
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)	-	-63,153,354.73	-63,153,354.73
五、期末所有者权益(基金净值)	2,086,813,109.24	262,248,703.51	2,349,061,812.75
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30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)	408,152,644.46	24,199,425.31	432,352,069.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,772,009.63	51,772,009.63
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)	514,276,564.47	47,741,539.64	562,018,104.11
其中：1.基金申购款	1,457,501,185.15	138,564,339.61	1,596,065,524.76
2.基金赎回款	-943,224,620.68	-90,822,799.97	-1,034,047,420.65
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)	-	-33,272,565.56	-33,272,565.56
五、期末所有者权益(基金净值)	922,429,208.93	90,440,409.02	1,012,869,617.95

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

姚怀然

谢庆阳

陈大毅

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富收益增强债券型证券投资基金由华富基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关规定和《华富收益增强债券型证券投资基金基金合同》发起，经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]320号文批准募集设立。本基金自2008年4月16日起公开向社会发行，至2008年5月23日募集结束。经天健华证中洲（北京）会计师事务所（现已合并为天健正信会计师事务所）验资并出具天健华证中洲验（2008）JR字第070001号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本次募集的净认购金额为756,843,512.69元人民币，其中A类（基金代码：410004）625,880,740.81元，B类（基金代码：410005）130,962,771.88元；有效认购款项在基金募集期间产生的利息共计249,555.96元人民币，其中A类196,448.50元，B类53,107.46元，折成基金份额，归投资人所有。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司；有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于2008年5月28日生效，该日的基金份额为757,093,068.65份基金单位。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、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》、《华富收益增强债券型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010半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2010年6月30日的财务状况以及2010半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估值与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策问题的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项如下：

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。

基金买卖股票、债券的差价收入，从2004年1月1日起，继续免征收营业税。

对基金买卖股票、债券的差价收入，从2004年1月1日起，继续免征收企业所得税；对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20.00%的个人所得税。（注：自2005年6月13日起，基金从上市公司取得的股息红利所得减按50.00%计算应纳税所得额。）

基金买卖股票，经国务院批准，从2008年4月24日起证券（股票）交易印花税税率由3%调整为1%。经国务院批准，从2008年9月19日起，对证券交易印花税政策进行调整，由双边

征收改为向卖方单边征收，税率保持 1%。

基金作为流通股股东，在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券有限责任公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金截止至本报告期末及上年度可比期间未租用关联方交易单元。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年6月30日	2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,011,337.60	2,407,600.43
其中：支付给销售机构的客户维护费	479,299.13	193,680.99

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率每日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年6月30日	2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,670,445.84	802,533.48

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率每日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.8.2.3 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		
	2010年1月1日至2010年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富收益增强债券 A	华富收益增强债券 B	合计
华富基金管理有限公司	-	137,371.32	137,371.32
中国建设银行股份有限公司	-	391,247.06	391,247.06
华安证券有限责任公司	-	578.10	578.10
合计	-	529,196.48	529,196.48

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富收益增强债券 A	华富收益增强债券 B	合计
华富基金管理有限公司	-	27,267.16	27,267.16
中国建设银行股份有限公司	-	169,018.72	169,018.72
华安证券有限责任公司	-	1,249.20	1,249.20
合计	-	197,535.08	197,535.08

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；B 类基金份额的销售服务费按前一日 B 类基金资产净值的 0.40% 年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式 $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （H 为 B 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值）。

6.4.8.3 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 2010年1月1日至2010年6月30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
中国建设银行股份有限公司	-	-	-	-	2,618,750,000.00	473,243.03
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30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
中国建设银行股份有限公司	-	-	-	-	6,097,920,000.00	215,740.45

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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

华富收益增强债券 A				
关联方名称	本期末 2010年6月30日		上年度末 2009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
华安证券有限责任公司	22,796,082.97	1.89%	21,801,652.95	4.16%

华富收益增强债券 B				
关联方名称	本期末 2010年6月30日		上年度末 2009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
-	-	-	-	-

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。本表列示“持有的基金份额占基金总份额的比例”为下属分级基金占各自级别份额的比例。

6.4.8.5 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 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	11,250,831.63	449,813.32	13,578,612.12	39,019.55

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
华安证券有限责任公司	111052	09哈城投	网下发行 认购	70,000	7,000,000.00

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.9 期末（2010年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	可流通日	流通受限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量 （单位： 股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
002422	科伦药业	2010年5月 26日	2010年9月 3日	新股认购未 流通	83.36	93.80	326,678	27,231,878.08	30,642,396.40	-
002415	海康威视	2010年5月 19日	2010年8月 30日	新股认购未 流通	68.00	69.30	187,934	12,779,512.00	13,023,826.20	-

002430	杭氧股份	2010年6月2日	2010年9月10日	新股认购未流通	18.00	24.85	316,893	5,704,074.00	7,874,791.05	-
601000	唐山港	2010年6月22日	2010年10月5日	新股认购未流通	8.20	8.20	941,176	7,717,643.20	7,717,643.20	-
002419	天虹商场	2010年5月21日	2010年9月1日	新股认购未流通	40.00	34.19	210,987	8,439,480.00	7,213,645.53	-
300094	国联水产	2010年6月30日	2010年10月8日	新股认购未流通	14.38	14.38	439,938	6,326,308.44	6,326,308.44	-
300070	碧水源	2010年4月12日	2010年7月21日	新股认购未流通	69.00	93.20	62,675	4,324,575.00	5,841,310.00	-
300077	国民技术	2010年4月23日	2010年8月2日	新股认购未流通	87.50	116.75	46,007	4,025,612.50	5,371,317.25	-
300082	奥克股份	2010年5月10日	2010年8月20日	新股认购未流通	85.00	67.55	76,135	6,471,475.00	5,142,919.25	-
002443	金洲管道	2010年6月25日	2010年10月8日	新股认购未流通	22.00	22.00	232,638	5,118,036.00	5,118,036.00	-
300080	新大新材	2010年5月10日	2010年9月27日	新股认购未流通	43.40	36.00	129,049	5,600,726.60	4,645,764.00	-
002394	联发股份	2010年4月16日	2010年7月23日	新股认购未流通	45.00	38.45	108,927	4,901,715.00	4,188,243.15	-
002438	江苏神通	2010年6月9日	2010年9月23日	新股认购未流通	22.00	25.57	162,500	3,575,000.00	4,155,125.00	-
002427	尤夫股份	2010年5月28日	2010年9月8日	新股认购未流通	13.50	15.18	273,650	3,694,275.00	4,154,007.00	-
300086	康芝药业	2010年5月17日	2010年8月26日	新股认购未流通	60.00	52.52	64,683	3,880,980.00	3,397,151.16	-
300091	金通灵	2010年6月18日	2010年9月27日	新股认购未流通	28.20	28.56	116,828	3,294,549.60	3,336,607.68	-
002386	天原集团	2010年3月31日	2010年7月9日	新股认购未流通	15.36	16.53	200,581	3,080,924.16	3,315,603.93	-
002385	大北农	2010年3月31日	2010年7月9日	新股认购未流通	35.00	32.32	97,108	3,398,780.00	3,138,530.56	-
300068	南都电源	2010年4月12日	2010年7月21日	新股认购未流通	33.00	25.67	119,018	3,927,594.00	3,055,192.06	-
002420	毅昌股份	2010年5月21日	2010年9月1日	新股认购未流通	13.80	11.50	265,041	3,657,565.80	3,047,971.50	-
002431	棕榈园林	2010年6月2日	2010年9月10日	新股认购未流通	45.00	54.89	54,970	2,473,650.00	3,017,303.30	-
300078	中瑞思创	2010年4月23日	2010年7月30日	新股认购未流通	58.00	69.88	40,761	2,364,138.00	2,848,378.68	-
300089	长城集团	2010年6月18日	2010年9月27日	新股认购未流通	20.50	19.78	142,045	2,911,922.50	2,809,650.10	-
002410	广联达	2010年5月13日	2010年8月25日	新股认购未流通	58.00	52.15	50,833	2,948,314.00	2,650,940.95	-

002384	东山精密	2010年3月31日	2010年7月9日	新股认购未流通	26.00	57.67	45,263	1,176,838.00	2,610,317.21	-
002405	四维图新	2010年5月6日	2010年8月18日	新股认购未流通	25.60	33.18	67,838	1,736,652.80	2,250,864.84	-
002387	黑牛食品	2010年4月2日	2010年7月13日	新股认购未流通	27.00	36.96	57,367	1,548,909.00	2,120,284.32	-
300072	三聚环保	2010年4月16日	2010年7月27日	新股认购未流通	32.00	40.82	49,377	1,580,064.00	2,015,569.14	-
002425	凯撒股份	2010年5月28日	2010年9月8日	新股认购未流通	22.00	23.21	85,992	1,891,824.00	1,995,874.32	-
002383	合众思壮	2010年3月26日	2010年7月2日	新股认购未流通	37.00	48.45	41,124	1,521,588.00	1,992,457.80	-
002393	力生制药	2010年4月15日	2010年7月23日	新股认购未流通	45.00	40.12	46,670	2,100,150.00	1,872,400.40	-
002428	云南锗业	2010年5月28日	2010年9月8日	新股认购未流通	30.00	41.54	44,635	1,339,050.00	1,854,137.90	-
002389	南洋科技	2010年4月2日	2010年7月13日	新股认购未流通	30.00	55.19	33,497	1,004,910.00	1,848,699.43	-
300088	长信科技	2010年5月17日	2010年8月26日	新股认购未流通	24.00	28.40	64,990	1,559,760.00	1,845,716.00	-
002378	章源钨业	2010年3月23日	2010年7月1日	新股认购未流通	13.00	26.34	69,786	907,218.00	1,838,163.24	-
300076	宁波GQY	2010年4月23日	2010年7月30日	新股认购未流通	65.00	53.96	33,556	2,181,140.00	1,810,681.76	-
002382	蓝帆股份	2010年3月26日	2010年7月2日	新股认购未流通	35.00	34.19	51,981	1,819,335.00	1,777,230.39	-
002403	爱仕达	2010年4月30日	2010年8月11日	新股认购未流通	18.80	16.16	104,933	1,972,740.40	1,695,717.28	-
002432	九安医疗	2010年6月2日	2010年9月10日	新股认购未流通	19.38	23.06	73,232	1,419,236.16	1,688,729.92	-
300074	华平股份	2010年4月16日	2010年7月27日	新股认购未流通	72.00	63.41	24,953	1,796,616.00	1,582,269.73	-
002442	龙星化工	2010年6月25日	2010年10月8日	新股认购未流通	12.50	12.50	126,071	1,575,887.50	1,575,887.50	-
002421	达实智能	2010年5月26日	2010年9月3日	新股认购未流通	20.50	31.79	49,230	1,009,215.00	1,565,021.70	-
002407	多氟多	2010年5月6日	2010年8月18日	新股认购未流通	39.39	41.65	37,099	1,461,329.61	1,545,173.35	-
300067	安诺其	2010年4月12日	2010年7月23日	新股认购未流通	21.20	18.52	79,131	1,677,577.20	1,465,506.12	-
300090	盛运股份	2010年6月18日	2010年9月27日	新股认购未流通	17.00	24.12	60,341	1,025,797.00	1,455,424.92	-
300075	数字政通	2010年4月16日	2010年7月27日	新股认购未流通	54.00	47.65	28,000	1,512,000.00	1,334,200.00	-

002397	梦洁家纺	2010年4月21日	2010年7月29日	新股认购未流通	51.00	53.76	12,841	654,891.00	690,332.16	-
300071	华谊嘉信	2010年4月12日	2010年7月21日	新股认购未流通	25.00	29.82	19,668	491,700.00	586,499.76	-
002402	和而泰	2010年4月30日	2010年8月11日	新股认购未流通	35.00	32.80	14,375	503,125.00	471,500.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601989	中国重工	2010年5月6日	重大资产重组	7.50	2010年7月16日	6.71	1,004,651	7,414,324.38	7,534,882.50	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,999,855.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
020206	02 国开 06	2010 年 7 月 1 日	101.34	500,000	50,670,000.00
合计				500,000	50,670,000.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 531,000,000.00 元，分别于 2010 年 7 月 1 日到期 50,000,000.00 元，2010 年 7 月 2 日到期 390,000,000.00 元，2010 年 7 月 6 日到期 50,000,000.00 元，2010 年 7 月 7 日到期 41,000,000.00 元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	权益投资	281,500,034.09	9.56
	其中：股票	281,500,034.09	9.56
2	固定收益投资	2,279,256,462.20	77.40
	其中：债券	2,279,256,462.20	77.40

	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	20,329,714.51	0.69
6	其他各项资产	363,669,204.45	12.35
7	合计	2,944,755,415.25	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.9.3 期末其他各项资产构成。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,451,808.44	0.49
B	采掘业	1,724,300.16	0.07
C	制造业	194,313,229.49	8.27
C0	食品、饮料	10,026,117.58	0.43
C1	纺织、服装、皮毛	11,962,159.46	0.51
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,066,316.48	0.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	33,592,739.16	1.43
C5	电子	28,525,111.89	1.21
C6	金属、非金属	24,446,893.43	1.04
C7	机械、设备、仪表	42,277,227.65	1.80
C8	医药、生物制品	40,453,786.04	1.72
C99	其他制造业	1,962,877.80	0.08
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,964,497.21	0.25
F	交通运输、仓储业	1,592,657.00	0.07
G	信息技术业	28,422,916.00	1.21
H	批发和零售贸易	12,092,337.53	0.51
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	12,435,302.28	0.53
L	传播与文化产业	2,250,518.76	0.10
M	综合类	11,252,467.22	0.48
	合计	281,500,034.09	11.98

注：300094 国联水产于 2010 年 7 月 8 日上市交易，所属行业类别由制造业—食品饮料更新为农、林、牧、渔业，本表按照更新后的行业类别列示。

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002422	科伦药业	326,678	30,642,396.40	1.30
2	002415	海康威视	187,934	13,023,826.20	0.55
3	002430	杭氧股份	316,893	7,874,791.05	0.34
4	601000	唐山港	941,176	7,717,643.20	0.33
5	601989	中国重工	1,004,651	7,534,882.50	0.32
6	002419	天虹商场	210,987	7,213,645.53	0.31
7	300094	国联水产	439,938	6,326,308.44	0.27
8	300070	碧水源	62,675	5,841,310.00	0.25
9	002362	汉王科技	50,000	5,555,000.00	0.24
10	300077	国民技术	46,007	5,371,317.25	0.23

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002422	科伦药业	27,231,878.08	3.33
2	002415	海康威视	12,779,512.00	1.56
3	002419	天虹商场	8,439,480.00	1.03
4	601000	唐山港	7,717,643.20	0.94
5	600598	北大荒	7,636,592.47	0.93
6	300082	奥克股份	6,471,475.00	0.79
7	300094	国联水产	6,326,308.44	0.77
8	002430	杭氧股份	5,704,074.00	0.70
9	300080	新大新材	5,600,726.60	0.68
10	002443	金洲管道	5,118,036.00	0.63
11	002394	联发股份	4,901,715.00	0.60
12	300070	碧水源	4,324,575.00	0.53
13	300077	国民技术	4,025,612.50	0.49
14	300068	南都电源	3,927,594.00	0.48
15	300086	康芝药业	3,880,980.00	0.47
16	002427	尤夫股份	3,694,275.00	0.45

17	002420	毅昌股份	3,657,565.80	0.45
18	002438	江苏神通	3,575,000.00	0.44
19	600227	赤天化	3,510,069.81	0.43
20	002385	大北农	3,398,780.00	0.42

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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	601788	光大证券	3,410,986.60	0.42
2	002311	海大集团	2,320,225.84	0.28
3	601618	中国中冶	1,979,500.00	0.24
4	002370	亚太药业	1,856,691.73	0.23
5	002362	汉王科技	1,826,411.87	0.22
6	601268	二重重装	1,712,468.26	0.21
7	002299	圣农发展	1,687,479.85	0.21
8	002339	积成电子	1,588,435.50	0.19
9	002318	久立特材	1,500,476.40	0.18
10	002317	众生药业	1,442,516.32	0.18
11	002325	洪涛股份	1,352,770.95	0.17
12	002303	美盈森	1,344,189.60	0.16
13	002332	仙琚制药	1,324,496.05	0.16
14	002300	太阳电缆	1,254,130.16	0.15
15	300031	宝通带业	1,209,985.25	0.15
16	002355	兴民钢圈	1,184,323.07	0.14
17	601801	皖新传媒	1,166,635.00	0.14
18	600598	北大荒	1,140,343.75	0.14
19	600227	赤天化	1,139,029.34	0.14
20	002338	奥普光电	1,052,104.25	0.13

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	217,180,814.75
卖出股票收入（成交）总额	38,937,579.32

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	354,439,523.00	15.09
2	央行票据	423,566,000.00	18.03
3	金融债券	345,174,000.00	14.69
	其中：政策性金融债	345,174,000.00	14.69
4	企业债券	888,626,372.70	37.83
5	企业短期融资券	40,003,000.00	1.70
6	可转债	227,447,566.50	9.68
7	其他	-	-
8	合计	2,279,256,462.20	97.03

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010110	21 国债(10)	2,147,710	217,563,023.00	9.26
2	113001	中行转债	2,004,040	202,688,605.60	8.63
3	0901044	09 央票 44	2,000,000	196,300,000.00	8.36
4	010112	21 国债(12)	1,350,000	136,876,500.00	5.83
5	1001029	10 央票 29	1,000,000	99,610,000.00	4.24

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 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。

7.9.3 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	250,000.00
2	应收证券清算款	293,961,842.51
3	应收股利	-
4	应收利息	36,407,734.47
5	应收申购款	33,049,627.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	363,669,204.45

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002422	科伦药业	30,642,396.40	1.30	新股认购未流通
2	002415	海康威视	13,023,826.20	0.55	新股认购未流通
3	002430	杭氧股份	7,874,791.05	0.34	新股认购未流通
4	601000	唐山港	7,717,643.20	0.33	新股认购未流通
5	601989	中国重工	7,534,882.50	0.32	重大资产重组
6	002419	天虹商场	7,213,645.53	0.31	新股认购未流通
7	300094	国联水产	6,326,308.44	0.27	新股认购未流通
8	300070	碧水源	5,841,310.00	0.25	新股认购未流通
9	300077	国民技术	5,371,317.25	0.23	新股认购未流通

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
华富收益增强债券 A	6,977	172,612.87	743,812,081.09	61.76%	460,507,929.76	38.24%
华富收益增强	8,710	101,319.53	233,836,033.45	26.50%	648,657,064.94	73.50%

债券 B						
合计	15,687	133,028.18	977,648,114.54	46.85%	1,109,164,994.70	53.15%

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 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	华富收益增强债券 A	-	-
	华富收益增强债券 B	10,356.63	0.0012%
	合计	10,356.63	0.0005%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富收益增强债券 A	华富收益增强债券 B
基金合同生效日（2008年5月28日） 基金份额总额	626,077,189.31	131,015,879.34
本报告期期初基金份额总额	524,590,258.85	213,072,035.46
本报告期基金总申购份额	1,694,972,827.36	1,379,093,689.13
减：本报告期基金总赎回份额	1,015,243,075.36	709,672,626.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,204,320,010.85	882,493,098.39

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 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、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，曾刚先生不再担任华富货币市场基金基金经理的职务。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘张琦先生为华富竞争力优选混合型证券投资基金的基金经理。

3、报告期内基金托管人的托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金原会计师事务所天健光华会计师事务所被吸收合并为天健正信会计师事务所，为保证基金审计的连续性，本基金聘用天健正信会计师事务所为本基金的审计机构。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中国建银投资证券有限责任公司	2	38,937,579.32	100.00%	49,222.82	100.00%	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元，本报告期本基金租用券商交易单元无变更。

10.7.2 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		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中国建银投资证券有限责任公司	1,147,361,090.40	100.00%	10,405,500,000.00	100.00%

券商名称	资产支持证券交易		权证交易	
	成交金额	占当期资产支持证券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国建银投资证券有限责任公司	28,866,000.00	100.00%	-	-

注：债券及资产支持证券交易成交金额按照全价统计。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。