华富收益增强债券型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009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:2009年8月29日

§1 重要提示

1.1 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2009年8月28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2009年1月1日起至2009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	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年05月28日	
报告期末基金份额总额	922,429,208.93份	
下属两级基金的基金简称	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
下属两级基金的交易代码	410004	410005
报告期末下属两级基金的份额总额	649,845,518.03份	272,583,690.90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	尹东
	联系电话	021-68886996	010-67595003
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yindong@ccb.cn
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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)	
	A类	B类
本期已实现收益	21,175,660.64	8,150,833.20
本期利润	38,624,158.46	13,147,851.17
加权平均基金份额本期利润	0.0734	0.0596
本期基金份额净值增长率	7.56%	7.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)	
	A类	B类
期末可供分配基金份额利润	0.0262	0.0211
期末基金资产净值	714,568,703.97	298,300,913.98
期末基金份额净值	1.0996	1.0943

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

A类:

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	-0.13%	0.15%	-0.10%	0.03%	-0.03%	0.12%
过去三个月	2.11%	0.25%	0.42%	0.05%	1.69%	0.20%
过去六个月	7.56%	0.27%	0.42%	0.08%	7.14%	0.19%
过去一年	16.07%	0.22%	7.92%	0.11%	8.15%	0.11%
自基金合同生效起至今	16.22%	0.21%	7.65%	0.11%	8.57%	0.10%

B类:

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	-0.17%	0.15%	-0.10%	0.03%	-0.07%	0.12%
过去三个月	2.00%	0.25%	0.42%	0.05%	1.58%	0.20%
过去六个月	7.32%	0.27%	0.42%	0.08%	6.90%	0.19%
过去一年	15.57%	0.22%	7.92%	0.11%	7.65%	0.11%
自基金合同生效起至今	15.68%	0.21%	7.65%	0.11%	8.03%	0.10%

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。本基金建仓期为2008年5月28日至11月28日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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,由华安证券有限责任公司、安徽省创新投资有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司共同出资设立。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。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴圣涛	本基金基金经理、华富成长趋势基金基金经理	2008年05月28日	-	八年	武汉大学商学院硕士,历任汉唐证券有限责任公司研究所高级研究员、资产管理部投资经理,国泰人寿保险有限公司投资部副主任、投资部经理。
曾刚	本基金基金经理、华富货币基金基金经理	2008年05月28日	-	九年	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。

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、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 业绩表现

本基金于2008年5月28日正式成立。华富收益增强A本报告期的份额净值增长率为7.56%,华富收益增强B本报告期的份额净值增长率为7.32%。

4.4.2 2009上半年投资运作

2009年上半年信贷投放保持在高位,宽松的货币政策带动固定资产投资增速逐月提高,消费数据也较为乐观,上半年GDP增长7.1%,经济见底回升的趋势得以确立。在此基础上,股票、转债继续上涨,债券市场则略有回落,其中短端收益率升幅较大,长端收益率窄幅波动。其中,二季度交易所和银行间债券都出现了先扬后抑的走势,股市上扬、新债发行量增加和IPO重启助推了债市的调整。本基金维持年初以来的配置思路,组合久期略有下降,保持债券的流动性,适度兑现涨幅较多的转债,后期积极参与新股申购,取得了较好的业绩。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场的分歧在于超量信贷投放是否必然带来远期通胀,货币政策何时转向,这两个问题对于下阶段的资产配置意义重大。我们认为经济回升的力度仍需要就业、消费、进出口等数据的进一步支持,V型反转可能性不大,呈现复合形态的概率更大。在此基础上,宽松型货币政策基调年内不会改变,央行货币政策委员会二季度例会将"落实适度宽松的货币政策,保持政策的连续性和稳定性,引导货币信贷合理增长"。近日一年期央票恢复发行目的在于对冲到期央票,引导资金利率回到合理区间,而从新股发行制度改革的实际影响来看,机构打新资金需求量仅是过去的20%,IPO对回购利率的影响低于预期,我们认为短端利率应该上升,但空间不会过大。同时,我们认为2010年CPI低于3%仍是大概率事件,通胀压力不大,而信用风险偏低,预测长端的收益率仍将以窄幅波动为主,信用债的区间持有期收益要高于短期融资券,仍具较高的配置价值。本基金将着手完善内部评级体系,把握信用风险和流动性风险,稳健投资。可转债已经进入风险性收益阶段,在此阶段可以适度兑现收益。分离式转债的债券投资将提高新发转债的质地,使之更具长线价值。

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45,629,149.60元;本报告期内共实施两次分红,分别为2009年3月24日实施利润分配19,457,943.13元,2009年6月3日实施利润分配13,814,622.43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22,793,456.89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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为33,272,565.56元,其中A类分配23,040,170.91元,B类分配10,232,394.65元。

5.3 托管人对本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:2009年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产:		
银行存款	13,578,612.12	919,616.83
结算备付金	2,856,977.91	1,008,303.94
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	1,072,789,147.70	516,044,932.58
其中:股票投资	55,312,965.00	18,765,236.08
债券投资	1,017,476,182.70	497,279,696.50
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	182,917,224.28	387,638.58
应收利息	18,038,756.91	4,880,999.98
应收股利	-	-
应收申购款	8,434,497.77	223,732.92
其他资产	-	-
资产总计	1,298,865,216.69	523,715,224.83
负债和所有者权益	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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	258,900,000.00	89,039,760.69
应付证券清算款	10,100,078.07	1,115,649.59
应付赎回款	15,793,799.88	566,038.93
应付管理人报酬	515,313.52	224,650.96
应付托管费	171,771.18	74,883.64
应付销售服务费	111,949.13	23,924.41
应付交易费用	60,115.30	12,931.58
应交税费	-	-
应付利息	31,898.29	5,155.32
应付利润	-	-
其他负债	310,673.37	300,159.94
负债合计	285,995,598.74	91,363,155.06
所有者权益:		
实收基金	922,429,208.93	408,152,644.46
未分配利润	90,440,409.02	24,199,425.31
所有者权益合计	1,012,869,617.95	432,352,069.77
负债和所有者权益总计	1,298,865,216.69	523,715,224.83

注:报告截止日2009年6月30日,A类基金份额净值1.0996元,B类基金份额净值1.0943元,基金份额总额922,429,208.93份,A类基金份额总额649,845,518.03份,B类基金份额总额272,583,690.90份。

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:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年5月28日至2008年6月30日
一、收入	56,584,121.67	1,675,834.03
1.利息收入	15,694,749.00	1,326,769.84
其中:存款利息收入	107,223.06	220,466.65
债券利息收入	15,582,925.94	582,503.47
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,600.00	523,799.72
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	18,395,095.64	298,325.98
其中:股票投资收益	3,172,000.33	303,109.38
债券投资收益	14,663,980.13	-4,783.40
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	559,115.18	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	22,445,515.79	35,600.96
4.其他收入(损失以"-"号填列)	48,761.24	15,137.25
二、费用(以"-"号填列)	-4,812,112.04	-719,783.17
1.管理人报酬	-2,407,600.43	-402,297.86
2.托管费	-802,533.48	-134,099.32
3.销售服务费	-468,356.47	-46,642.95
4.交易费用	-149,362.26	-4,679.67
5.利息支出	-735,447.72	-80,324.61
其中:卖出回购金融资产支出	-735,447.72	-80,324.61
6.其他费用	-248,811.68	-51,738.76
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	51,772,009.63	956,050.86
所得税费用(以"-"号填列)	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	51,772,009.63	956,050.86

注:本基金合同于2008年5月28日生效,上年度可比期间为2008年5月28日至2008年6月30日。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:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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(以"-"号填列)	-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

项目	上年度可比期间 2008年5月28日至2008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)	757,093,068.65	-	757,093,068.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	956,050.86	956,050.86
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)	-96,259,531.44	-112,361.07	-96,371,892.51
其中:1.基金申购款	576,053.01	235.03	576,288.04
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-96,835,584.45	-112,596.10	-96,948,180.55
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	660,833,537.21	843,689.79	661,677,227.00

注:本基金合同于2008年5月28日生效,上年度可比期间为2008年5月28日至2008年6月30日。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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(现已更名为天健光华(北京)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2009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2009年6月30日的财务状况以及2009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、会计估计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:

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 基金买卖股票、债券的差价收入,从2004年1月1日起,继续免征营业税。

6.4.6.3 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。)

6.4.6.4 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‰。

6.4.6.5 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 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年5月28日至2008年6月30日
当期应支付的管理费	2,407,600.43	402,297.86
其中:当期已支付	1,892,286.91	37,237.64
期末未支付	515,313.52	365,060.22

注:基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率费每日计提,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 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年5月28日至2008年6月30日
当期应支付的托管费	802,533.48	134,099.32
其中:当期已支付	630,762.30	12,412.55
期末未支付	171,771.18	121,686.77

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×年托管费率÷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 2009年1月1日至2009年6月30日			
	当期应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	合计	
			A类	B类
中国建设银行股份有限公司	128,804.87	40,213.85	-	169,018.72
华安证券有限责任公司	1,078.62	170.58	-	1,249.20
华富基金管理有限公司	24,673.08	2,594.08	-	27,267.16
合计	154,556.57	42,978.51	-	197,535.08

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2008年5月28日至2008年6月30日			
	当期应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	合计	
			A类	B类
中国建设银行股份有限公司	3,016.51	22,404.40	-	25,420.91
华安证券有限责任公司	136.20	976.51	-	1,112.71
华富基金管理有限公司	9.75	71.45	-	81.20
合计	3,162.46	23,452.36	-	26,614.82

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×年销售服务费率÷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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日					
	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

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2008年5月28日至2008年6月30日					
	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
-	-	-	-	-	-	-

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

份额单位:份

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	
	A类	B类
期初持有的基金份额	-	-
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2008年5月28日至2008年6月30日	
	A类	B类
期初持有的基金份额	-	-
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

关联方名称	A类		B类	
	本期末2009年6月30日		本期末2009年6月30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	21,203,363.90	2.30%	-	-

关联方名称	A类		B类	
	上年度末2008年12月31日		上年度末2008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	20,451,629.05	5.01%	-	-

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。

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 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年5月28日至2008年6月30日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国建设银行股份有限公司	13,578,612.12	39,019.55	41,112,937.06	220,466.65

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

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:张)	总金额
本期 2009年1月1日至2009年6月30日					
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
上年度可比期间 2008年5月28日至2008年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量(单位:)	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.9 期末(2009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

6.4.12.1.1 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.1.2 受限证券类别:债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额
122954	09武进债	2009年6月12日	2009年7月24日	新债未流通	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

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2009年6月30日止,本基金无银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009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258,900,000.00元,分别于2009年7月1日到期25,000,000.00元,2009年7月2日到期45,000,000.00元,2009年7月3日到期188,900,000.00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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§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	55,312,965.00	4.26
	其中:股票	55,312,965.00	4.26
2	固定收益投资	1,017,476,182.70	78.34
	其中:债券	1,017,476,182.70	78.34
	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	16,435,590.03	1.27
6	其他资产	209,640,478.96	16.14
7	合计	1,298,865,216.69	100.00

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	6,365,000.00	0.63
B	采掘业	-	-
C	制造业	39,364,965.00	3.89
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	8,321,000.00	0.82
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	20,618,400.00	2.04
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	10,176,000.00	1.00
C8	医药、生物制品	249,565.00	0.02
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	9,583,000.00	0.95
	合计	55,312,965.00	5.46

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	600227	赤天化	2,130,000	20,618,400.00	2.04
2	000572	海马股份	1,850,000	9,583,000.00	0.95
3	600875	东方电气	180,000	7,002,000.00	0.69
4	600598	北大荒	500,000	6,365,000.00	0.63
5	600232	金鹰股份	950,000	4,921,000.00	0.49
6	000726	鲁泰A	400,000	3,400,000.00	0.34
7	601766	中国南车	600,000	3,174,000.00	0.31
8	002252	上海莱士	9,500	249,565.00	0.02

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	600227	赤天化	40,484,383.03	9.36
2	600232	金鹰股份	20,159,211.97	4.66
3	600598	北大荒	17,727,756.92	4.10
4	000572	海马股份	17,043,125.44	3.94

注:"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	600227	赤天化	20,673,487.57	4.78
2	600232	金鹰股份	15,548,514.54	3.60
3	600598	北大荒	9,457,015.84	2.19
4	000572	海马股份	6,837,566.34	1.58
5	002269	美邦服饰	1,788,747.94	0.41
6	600875	东方电气	1,261,656.00	0.29
7	002267	陕天然气	853,552.30	0.20
8	002263	大东南	632,500.00	0.15
9	000726	鲁泰A	623,350.00	0.14
10	002261	拓维信息	608,932.00	0.14
11	601766	中国南车	597,997.48	0.14
12	002273	水晶光电	595,485.00	0.14
13	002271	东方雨虹	550,451.00	0.13
14	002259	升达林业	425,310.00	0.10
15	002268	卫士通	399,367.05	0.09
16	002262	恩华药业	383,624.95	0.09
17	002251	步步高	341,129.00	0.08
18	002252	上海莱士	291,636.00	0.07

注:"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

买入股票的成本(成交)总额	95,414,477.36
卖出股票的收入(成交)总额	61,870,323.01

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、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	-	-
2	央行票据	77,192,000.00	7.62
3	金融债券	234,601,000.00	23.16
	其中:政策性金融债	234,601,000.00	23.16
4	企业债券	597,894,852.70	59.03
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	107,788,330.00	10.64
7	其他	-	-
8	合计	1,017,476,182.70	100.45

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	020206	02国开06	900,000	92,871,000.00	9.17
2	110002	南山转债	618,000	86,495,280.00	8.54
3	080221	08国开21	800,000	80,200,000.00	7.92
4	0801095	08央票95	800,000	77,192,000.00	7.62
5	098050	09绵阳投控债	400,000	41,472,000.00	4.09

7.7 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

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 其他资产构成

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	182,917,224.28
3	应收股利	-
4	应收利息	18,038,756.91
5	应收申购款	8,434,497.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209,640,478.96

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110002	南山转债	86,495,280.00	8.54
2	110003	新钢转债	14,642,950.00	1.45
3	110598	大荒转债	6,650,100.00	0.66

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

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
A类	2296	283,033.76	535,430,147.55	82.39%	114,415,370.48	17.61%
B类	3446	79,101.48	43,925,582.76	16.11%	228,658,108.14	83.89%
合计	5742	160,645.98	579,355,730.31	62.81%	343,073,478.62	37.19%

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	A	-	-
	B	9,717.91	0.0011%
	合计	9,717.91	0.0011%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	A类	B类
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
报告期期初基金份额总额	307,107,175.89	101,045,468.57
报告期期间基金总申购份额	788,099,972.73	669,401,212.42
报告期期间基金总赎回份额	-445,361,630.59	-497,862,990.09
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	649,845,518.03	272,583,690.90

§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

经华富基金管理有限公司第二届四次董事会审议通过,聘任邹牧先生担任公司副总经理。邹牧先生的任职资格已经中国证监会证监许可[2009]207号文件核准。

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,未改聘为其审计的会计师事务所。

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交易的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		回购交易	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期交易所债券成交总额的比例	成交金额	占当期交易所回购成交总额的比例
中国建银投资证券有限责任公司	2	61,870,323.01	100.00%	577,576,427.15	100.00%	3,035,000,000.00	100.00%

券商名称	交易单元数量	权证交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期权证成交总额的比例	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	-	-	65,723.01	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。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

1、2009年1月16日,本基金托管人公告中国建设银行股份有限公司(以下简称建行)聘请胡哲一先生担任建行副行长;

2、2009年5月14日,美国银行公告关于建行股权变动报告书;

3、2009年5月26日,中国建银投资有限责任公司公告关于建行股权变动报告书;

4、2009年5月26日,中央汇金投资有限责任公司公告关于建行股权变动报告书;

5、2009年8月2日,本基金托管人公告,自2009年7月24日起陈佐夫先生就任建行执行董事。