

华富强化回报债券型证券投资基金 2010年年度报告摘要

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

1.1 重要提示
本基金管理人、基金托管人及会计师事务所均不存在违法违规或违规行为,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

2.1 基金基本情况
基金名称: 华富强化回报债券型证券投资基金
基金代码: 641005
基金管理人: 华富基金管理有限公司

2.2 基金主要指标
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。
投资范围: 本基金投资组合中除国债、政策性金融债、利率债外,还包括信用债、企业债、短期融资券、中期票据、可转债、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货、股指期货、国债期货、股指期货、国债期货。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

3.1 主要会计数据和财务指标
3.2 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.3 基金净值表现
3.3.1 基金净值增长表及与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with columns: 阶段, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去一个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 自基金合同生效以来.

注: 根据《华富强化回报债券型证券投资基金合同》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资产的比例不低于基金资产的 60%。本基金可参与融资融券,股指期货和股指期货套利交易,并可能使用股指期货等衍生金融工具,持有股指期货合约价值和股指期货合约公允价值不得超过基金资产净值的 10%。

3.3.2 基金净值表现
注: 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资产的比例不低于基金资产的 60%。

3.3.3 基金合同生效以来本基金各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
注: 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资产的比例不低于基金资产的 60%。

注: 根据《华富强化回报债券型证券投资基金合同》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资产的比例不低于基金资产的 60%。

Table with columns: 项目, 实际基金, 业绩比较基准, 所有资产合计. Rows include 一、期初所有者权益(基金份额净值), 二、本期基金净值变动产生的基金份额净值变动数, 三、本期基金净值变动产生的基金份额净值变动数.

注: 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资产的比例不低于基金资产的 60%。

4.1 基金管理人及其基金托管人
4.1.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

4.2 基金管理人及其基金托管人
4.2.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

4.3 基金管理人及其基金托管人
4.3.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

4.4 基金管理人及其基金托管人
4.4.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

4.5 基金管理人及其基金托管人
4.5.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

4.6 基金管理人及其基金托管人
4.6.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

4.7 基金管理人及其基金托管人
4.7.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

4.8 基金管理人及其基金托管人
4.8.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

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
5.3 报告期内本基金管理人及基金托管人履行了各自职责,遵守有关法律法规和基金合同有关规定,对本基金的投资运作和净值计算,基金费用开支等方面进行了认真、客观的监督和检查,未发现任何违法违规行为。
5.4 报告期内,本基金管理人及基金托管人遵守了有关法律法规和基金合同有关规定,对本基金的投资运作和净值计算,基金费用开支等方面进行了认真、客观的监督和检查,未发现任何违法违规行为。

6.1 基金净值表现
6.1.1 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
6.1.2 基金净值表现
注: 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资产的比例不低于基金资产的 60%。

Table with columns: 资产, 期末数 2010年12月31日. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产.

7.1 基金管理人及其基金托管人
7.1.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.2 基金管理人及其基金托管人
7.2.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.3 基金管理人及其基金托管人
7.3.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.4 基金管理人及其基金托管人
7.4.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

Table with columns: 项目, 本期 2010年9月8日至2010年12月31日, 上期 2010年9月8日至2010年12月31日. Rows include 一、收入, 利息收入, 公允价值变动收益, 其他收入.

7.5 基金管理人及其基金托管人
7.5.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.6 基金管理人及其基金托管人
7.6.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.7 基金管理人及其基金托管人
7.7.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.8 基金管理人及其基金托管人
7.8.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.9 基金管理人及其基金托管人
7.9.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.10 基金管理人及其基金托管人
7.10.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.11 基金管理人及其基金托管人
7.11.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.12 基金管理人及其基金托管人
7.12.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.13 基金管理人及其基金托管人
7.13.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.14 基金管理人及其基金托管人
7.14.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.15 基金管理人及其基金托管人
7.15.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.16 基金管理人及其基金托管人
7.16.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.17 基金管理人及其基金托管人
7.17.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.18 基金管理人及其基金托管人
7.18.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.19 基金管理人及其基金托管人
7.19.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.20 基金管理人及其基金托管人
7.20.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

Table with columns: 关联方名称, 持有的基金份额, 持有的基金份额占本基金总份额的比例. Rows include 中国建设银行股份有限公司, 中国工商银行股份有限公司, 中国农业银行股份有限公司.

7.21 基金管理人及其基金托管人
7.21.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.22 基金管理人及其基金托管人
7.22.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.23 基金管理人及其基金托管人
7.23.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.24 基金管理人及其基金托管人
7.24.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.25 基金管理人及其基金托管人
7.25.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.26 基金管理人及其基金托管人
7.26.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.27 基金管理人及其基金托管人
7.27.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.28 基金管理人及其基金托管人
7.28.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

7.29 基金管理人及其基金托管人
7.29.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%). Rows include 1 002531 天顺风能, 2 601086 中国神华, 3 002521 齐腾股份.

注: 买入股票成本占期末基金资产净值比例超过 1% 的股票, 按照买入金额从小到大排序。
注: 卖出股票成本占期末基金资产净值比例超过 1% 的股票, 按照卖出金额从小到大排序。

8.1 基金管理人及其基金托管人
8.1.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.2 基金管理人及其基金托管人
8.2.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.3 基金管理人及其基金托管人
8.3.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.4 基金管理人及其基金托管人
8.4.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.5 基金管理人及其基金托管人
8.5.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

Table with columns: 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(%). Rows include 1 110001 中国铁路, 2 110002 中国石化.

8.6 基金管理人及其基金托管人
8.6.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.7 基金管理人及其基金托管人
8.7.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.8 基金管理人及其基金托管人
8.8.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.9 基金管理人及其基金托管人
8.9.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.10 基金管理人及其基金托管人
8.10.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.11 基金管理人及其基金托管人
8.11.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.12 基金管理人及其基金托管人
8.12.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.13 基金管理人及其基金托管人
8.13.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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

8.14 基金管理人及其基金托管人
8.14.1 基金管理人及其基金托管人的简介
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