

华富强化回报债券型证券投资基金招募说明书

(2011年第1号)

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

更新摘要

| 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 | 雅鲁能源 | 2,300,000 | 58,236,000.00 | 2.92 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 740,000 | 30,266,000.00 | 1.52 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 440,000 | 25,080,000.00 | 1.26 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 2,900,000 | 22,678,000.00 | 1.14 |
| 5 | 600800 | 亚星客车 | 280,689 | 6,034,813.50 | 0.30 |
| 6 | 600642 | 中顺农业 | 700,000 | 5,341,000.00 | 0.27 |
| 7 | 601933 | 永新股份 | 108,825 | 3,399,693.00 | 0.17 |
| 8 | 601118 | 海南橡胶 | 554,195 | 3,319,628.05 | 0.17 |
| 9 | 601126 | 四方股份 | 86,344 | 2,686,161.84 | 0.13 |
| 10 | 300142 | 沃森生物 | 500 | 66,600.00 | 0.00 |

| 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 | 49,800,000.00 | 2.50 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| 4 | 其中:政策性金融债 | 498,102,000.00 | 24.99 |
| 5 | 企业债券 | 547,851,000.00 | 27.48 |
| 6 | 可转债 | 403,218,353.90 | 20.23 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 1,498,971,353.90 | 75.19 |

| 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 | 111901 | 央行票据 | 1,883,400 | 206,910,324.00 | 10.38 |
| 2 | 111902 | 央行票据 | 1,610,700 | 190,208,730.60 | 9.65 |
| 3 | 108122 | 09中债02 | 1,200,000 | 119,340,000.00 | 5.99 |
| 4 | 1081295 | 10国开01 | 1,000,000 | 99,420,000.00 | 4.99 |
| 5 | 1081074 | 10国开04 | 600,000 | 60,150,000.00 | 3.02 |

| 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 | 111901 | 央行票据 | 2,606,910,324.00 | 10.38 |
| 2 | 111902 | 央行票据 | 2,066,075,600.60 | 0.28 |

| 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 | 111901 | 央行票据 | 2,606,910,324.00 | 10.38 |
| 2 | 111902 | 央行票据 | 2,066,075,600.60 | 0.28 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.05 | 0.17 | 新股锁定 |
| 7 | 601126 | 四方股份 | 2,686,161.84 | 0.13 | 新股锁定 |

| 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 | 002531 | 雅鲁能源 | 58,236,000.00 | 2.92 | 新股锁定 |
| 2 | 002521 | 齐腾股份 | 30,266,000.00 | 1.52 | 新股锁定 |
| 3 | 300157 | 恒春文音 | 25,080,000.00 | 1.26 | 新股锁定 |
| 4 | 601096 | 大冶特钢 | 6,034,813.50 | 0.30 | 新股锁定 |
| 5 | 601933 | 永新股份 | 3,399,693.00 | 0.17 | 新股锁定 |
| 6 | 601118 | 海南橡胶 | 3,319,628.0 | | |