

华富强化回报债券型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9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

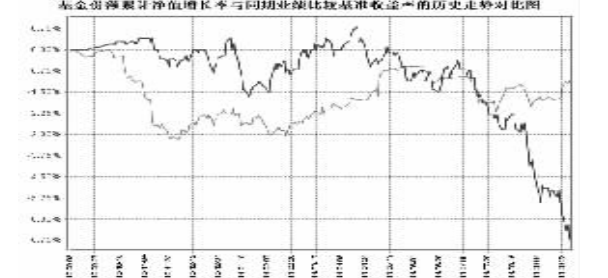
重要提示
基金管理人的董事会及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金概况
基金简称: 华富强化回报债券(场内简称: 华富债增)
基金代码: 164105
交易代码: 164105

主要财务指标
1.本期已实现收益: 2,065,381.32
2.本期利润: -115,044,548.81
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0575

基金经理
姓名: 宋茜
职务: 基金经理

投资组合
1. 权益类资产: 81,850,619.28
2. 固定收益类资产: 2,615,822,889.02



投资策略
本基金通过综合国内外宏观经济状况、政策法规、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、估值风险、信用风险等因素,研判固定收益类资产价格走势,并适时调整资产配置比例。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 81,850,619.28 2.90

5.2 报告期末按行业分类的股权投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔 4,766,077.00 0.26

5.3 报告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
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 天顺风能 1,800,000 29,538,000.00 1.58

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国债债券 49,755,000.00 2.66

5.5 报告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
序号 债券品种 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 113002 工行转债 1,960,790 199,922,148.40 10.70

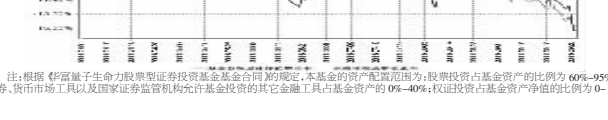
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
序号 资产支持证券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 113001 中行转债 1,773,960 161,412,620.40 8.64

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 110015 石化转债 1,375,350 129,219,343.50 6.43

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.8.2 本基金投资的前十名证券,没有涉及被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9 管理人报告
5.9.1 基金经理简介
姓名: 宋茜
性别: 女
学历: 硕士
从业年限: 九年

5.9.2 基金经理简介
姓名: 宋茜
性别: 女
学历: 硕士
从业年限: 九年



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

华富收益增强债券型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9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

重要提示
基金管理人的董事会及董事承诺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责任。

基金概况
基金简称: 华富收益增强债券(场内简称: 华富债增)
基金代码: 410004
交易代码: 410004

主要财务指标
1.本期已实现收益: -18,917,736.75
2.本期利润: -133,609,907.53
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0001

基金经理
姓名: 宋茜
职务: 基金经理

投资组合
1. 权益类资产: 1,121,932,136.79
2. 固定收益类资产: 777,644,860.18



投资策略
本基金主要投资于信用评级较高的固定收益类资产,在保持资产较高流动性的同时,严格控制投资风险,获得高于基金收益的基础上,积极利用市场中的非对称性金融工具和投资渠道,力争基金资产的持续增值。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 386,122,336.00 13.04

5.2 报告期末按行业分类的股权投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔 10,220,490.00 0.52

5.3 报告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
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 002422 科伦药业 600,000 32,765,600.00 1.65

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国债债券 19,332,000.00 0.98

5.5 报告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
序号 债券品种 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 113001 中行转债 3,249,900 295,708,400.00 14.93

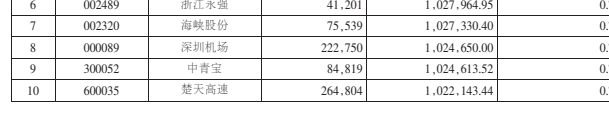
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
序号 资产支持证券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 113001 中行转债 1,773,960 161,412,620.40 8.64

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 110015 石化转债 1,375,350 129,219,343.50 6.43

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.8.2 本基金投资的前十名证券,没有涉及被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9 管理人报告
5.9.1 基金经理简介
姓名: 宋茜
性别: 女
学历: 硕士
从业年限: 九年

5.9.2 基金经理简介
姓名: 宋茜
性别: 女
学历: 硕士
从业年限: 九年



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

华富量子生命力股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9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

重要提示
基金管理人的董事会及董事承诺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责任。

基金概况
基金简称: 华富量子生命力股票
基金代码: 410009
交易代码: 410009

主要财务指标
1.本期已实现收益: -12,681,695.58
2.本期利润: -40,079.76
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0079

基金经理
姓名: 宋茜
职务: 基金经理

投资组合
1. 权益类资产: 99,893,581.18
2. 固定收益类资产: 99,893,581.18

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 99,893,581.18 73.90

5.2 报告期末按行业分类的股权投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔 99,893,581.18 73.90

5.3 报告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
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 000727 华谊兄弟 248,947 1,100,345.74 0.82

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国债债券 64,601,721.07 48.24

5.5 报告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
序号 债券品种 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 113001 中行转债 1,960,790 199,922,148.40 10.70

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
序号 资产支持证券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 113001 中行转债 1,773,960 161,412,620.40 8.64

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 110015 石化转债 1,375,350 129,219,343.50 6.43

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.8.2 本基金投资的前十名证券,没有涉及被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9 管理人报告
5.9.1 基金经理简介
姓名: 宋茜
性别: 女
学历: 硕士
从业年限: 九年

5.9.2 基金经理简介
姓名: 宋茜
性别: 女
学历: 硕士
从业年限: 九年



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

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

重要提示
基金管理人的董事会及董事承诺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责任。

基金概况
基金简称: 华富量子生命力股票
基金代码: 410009
交易代码: 410009

主要财务指标
1.本期已实现收益: -12,681,695.58
2.本期利润: -40,079.76
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0079

基金经理
姓名: 宋茜
职务: 基金经理

投资组合
1. 权益类资产: 99,893,581.18
2. 固定收益类资产: 99,893,581.18

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 99,893,581.18 73.90

5.2 报告期末按行业分类的股权投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔 99,893,581.18 73.90

5.3 报告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
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 000727 华谊兄弟 248,947 1,100,345.74 0.82

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国债债券 64,601,721.07 48.24

5.5 报告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
序号 债券品种 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 113001 中行转债 1,960,790 199,922,148.40 10.70

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
序号 资产支持证券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 113001 中行转债 1,773,960 161,412,620.40 8.64

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 110015 石化转债 1,375,350 129,219,343.50 6.43

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.8.2 本基金投资的前十名证券,没有涉及被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9 管理人报告
5.9.1 基金经理简介
姓名: 宋茜
性别: 女
学历: 硕士
从业年限: 九年

5.9.2 基金经理简介
姓名: 宋茜
性别: 女
学历: 硕士
从业年限: 九年



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