

**融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)**

**2011年半年度报告**

**2011年6月30日**

**基金管理人：融通基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

**送出日期：2011年8月25日**

## § 1 重要提示及目录

### 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融通领先成长股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金合同规定，于2011年8月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	7
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	8
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	9
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>9</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	9
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	9
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.....	9
<b>§6 半年度财务报表(未经审计)</b> .....	<b>9</b>
6.1 资产负债表.....	9
6.2 利润表.....	10
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	11
6.4 报表附注.....	12
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>24</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	24
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	25
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	25
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	26
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	28
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.....	28
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	28
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.....	28
7.9 投资组合报告附注.....	28
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>29</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	29
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	29
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	30

<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>30</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>30</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	30
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.....	30
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	30
10.4 基金投资策略的改变.....	30
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	30
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.....	31
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	31
10.8 其他重大事件.....	32
<b>§ 11 备查文件目录.....</b>	<b>32</b>

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)	
基金简称	融通领先成长股票(LOF)	融通领先(场内简称)
基金主代码	161610	
交易代码	161610(前端收费模式)	161660(后端收费模式)
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2007年4月30日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
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	3,707,300,556.66份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2007年7月18日	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能持续高速增长的上市公司,通过积极主动的分散化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定时期表现出较高的成长性,但只有符合产业结构发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业,才能保持业绩持续高速增长,而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

### 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	融通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	(010) 67595096
传真	(0755) 26935005	(010) 66275853
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518053	100033
法定代表人	田德军	郭树清

## 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、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.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	-52,314,045.06
本期利润	-348,022,895.76
加权平均基金份额本期利润	-0.0916
本期加权平均净值利润率	-9.75%
本期基金份额净值增长率	-9.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	500,594,172.51
期末可供分配基金份额利润	0.1350
期末基金资产净值	3,361,262,328.36
期末基金份额净值	0.907
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	17.77%

注：(1) 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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2) 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；

(3) 期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

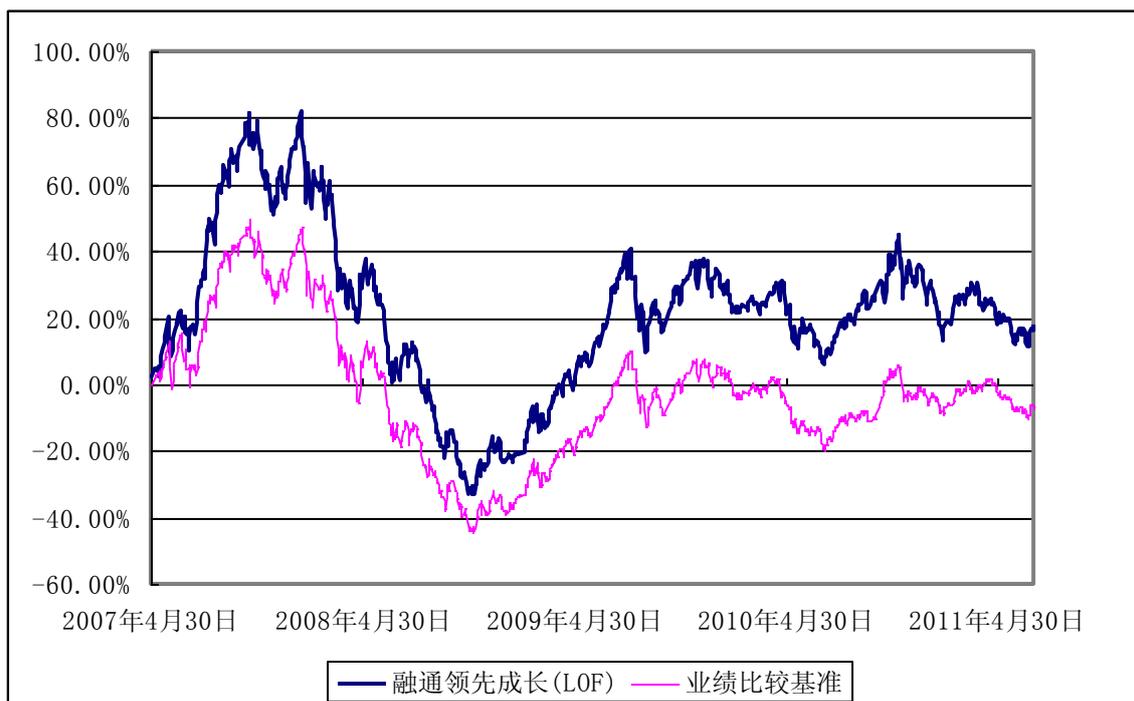
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	3.54%	1.24%	1.13%	0.96%	2.41%	0.28%
过去三个月	-4.73%	1.13%	-4.32%	0.88%	-0.41%	0.25%

过去六个月	-9.00%	1.29%	-1.76%	0.99%	-7.24%	0.30%
过去一年	9.01%	1.44%	15.28%	1.13%	-6.27%	0.31%
过去三年	13.60%	1.74%	12.16%	1.61%	1.44%	0.13%
自基金合同生效起至今	17.77%	1.87%	-3.97%	1.78%	21.74%	0.09%

### 3.2.2 自基金转型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：本基金是由原通宝证券投资基金转型而来，转型日期为 2007 年 4 月 30 日。

## § 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

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2011年6月30日，公司管理的基金共有十二只，一只封闭式基金：融通乾封封闭式基金，十一只开放式基金：融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长股票基金（LOF）、融通内需驱动股票基金和融通深证成份指数基金，其中融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

#### 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	说明
----	----	-----------------	----	----

		任职日期	离任日期	从业年限	
管文浩	本基金的基金经理	2010年3月13日	-	18	经济学硕士,具有证券从业资格。具有证券从业资格。历任中国国际期货公司高级分析师、北京世华金融信息公司证券投资研究部门经理、国泰君安证券行业研究员、国信证券市场策略研究员、泰信基金管理有限公司投资管理部投资总监兼基金经理、鹏华基金管理有限公司基金管理部副总监兼基金经理;2009年3月加入融通基金管理有限公司,历任研究部行业研究员。
刘模林	本基金的基金经理、融通新蓝筹混和基金的基金经理、公司副总经理	2007年4月30日	2011年1月22日	17	机械工程硕士,具有证券从业资格。历任武汉市信托投资公司证券总部研究部经理、花桥证券营业部经理;融通基金管理有限公司研究部策略和行业研究员、总监、机构理财部总监,基金管理部总监。

注:任职日期和离任日期均根据基金管理人对外披露的任免日期填写,证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

#### 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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,并制定了相应的制度和流程,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

##### 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

本报告期,本基金与公司管理的投资风格相似的基金之间的净值增长率差异均未超过5%。

基金名称	本报告期基金份额净值增长率
融通行业景气混合基金	-5.32%
融通动力先锋股票基金	-11.98%
融通内需驱动股票基金	-7.89%
本基金	-9.00%

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

## 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

2011 年上半年资本市场行情迭宕起伏，四月中旬之前基本上呈现曲折向上格局，四月中旬至六月中旬单边剧烈下跌，六月中旬之后迅速反弹。整个上半年基本上是估值修复行情，相比去年，市场投资风格偏好出现较大变化，低估值的金融、地产、建材、家电、钢铁等行业表现优异，而 IT、有色、医药等行业表现较差；大盘蓝筹股表现稳健，而中小盘股纷纷出现大跳水。本基金立足于对全年国内通胀保持较高水平、宏观调控从紧格局年内难以转变的认识，回避配置地产产业链的主要行业，重点配置在通胀形势下竞争格局良好、具有定价权和成本转嫁能力的资源品和高档消费品行业核心公司，辅以配置具有核心竞争力的化工、环保、医药、IT 等行业龙头公司。上半年本基金资产配置比例基本维持在 90%左右，在保持较低换手率的情况下，实行重点行业（医药、化工、食品饮料、有色金属）超额配置、重点个股集中配置的操作策略。

一季度初本基金对证券等行业个股实施了清仓，同时减持了新兴产业配置，一季度末适度减少了对食品饮料行业的配置，增加了对有色和医药行业的配置。二季度本基金配置比较稳定，基本没有做大的调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-9.00%，同期业绩比较基准收益率为-1.76%。

业绩落后的主要原因是对上半年表现较好的金融、地产、建材、家电、钢铁等行业配置较少，而重点配置的医药、有色金属等行业表现较差。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济仍将处于压通胀还是保增长的纠结局面之中，在通胀压力没有明显缓解的情况下，宏观政策很难放松，资金面将保持偏紧格局，资本市场难以走出可观的上涨行情。但短期来看，政策处于观望期，资本市场获得喘息之机。本基金坚持认为，考虑到过去几年投放过多流动性的累积效应，国内通胀在较长时间内仍会保持在较高水平，而国际流动性的充裕将继续推高资源品价格。未来一段时间还是要坚持配置具有定价权和成本转嫁能力的资源品和高档消费品行业。本基金相信，这些行业具备创造超额收益的潜力。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定人员共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值

方法的法规等进行搜集并整理汇总,供估值委员会参考,监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定,参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突,截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于2011年1月18日进行了利润分配,以2010年12月31日的可分配利润为基准,每10份基金份额派发红利0.35元。

### § 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,本基金实施利润分配的金额为134,281,416.98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 半年度财务报表(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体:融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	165,209,143.81	74,212,244.32
结算备付金		1,484,509.02	4,308,807.61
存出保证金		1,497,985.96	1,696,177.19
交易性金融资产	6.4.7.2	3,211,891,473.38	3,918,725,401.24
其中:股票投资		3,018,751,473.38	3,718,115,401.24
基金投资		-	-
债券投资		193,140,000.00	200,610,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,505,348.92	6,872,780.59
应收股利		-	-
应收申购款		24,222.13	304,638.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,381,612,683.22	4,006,120,049.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,919,658.19	9,289,610.39
应付赎回款		1,147,023.83	1,070,192.97
应付管理人报酬		4,044,752.86	5,202,760.81
应付托管费		674,125.46	867,126.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	750,154.74	3,504,180.25
应交税费		65,649.13	65,649.13
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	748,990.65	675,261.30
负债合计		20,350,354.86	20,674,781.65
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,439,865,366.11	1,496,236,867.69
未分配利润	6.4.7.10	1,921,396,962.25	2,489,208,400.27
所有者权益合计		3,361,262,328.36	3,985,445,267.96
负债和所有者权益总计		3,381,612,683.22	4,006,120,049.61

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值0.907元，基金份额总额3,707,300,556.66份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、收入		-312,452,400.33	-874,576,579.60
1. 利息收入		4,440,625.07	6,387,127.46

其中：存款利息收入	6.4.7.11	587,758.67	2,322,083.72
债券利息收入		3,752,168.73	3,632,219.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		100,697.67	432,824.56
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-21,247,077.43	178,229,011.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-35,135,288.69	162,783,756.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,889,800.00	-2,252,000.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	18,778,011.26	17,697,255.03
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-295,708,850.70	-1,059,273,004.75
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	62,902.73	80,286.08
<b>减：二、费用</b>		35,570,495.43	58,734,013.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,596,784.82	32,087,425.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,432,797.46	5,347,904.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,277,013.94	21,009,068.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	263,899.21	289,615.56
<b>三、利润总额</b>		-348,022,895.76	-933,310,592.96
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-348,022,895.76	-933,310,592.96

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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）	1,496,236,867.69	2,489,208,400.27	3,985,445,267.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-348,022,895.76	-348,022,895.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-56,371,501.58	-85,507,125.28	-141,878,626.86
其中：1. 基金申购款	44,721,810.04	62,202,360.86	106,924,170.90
2. 基金赎回款	-101,093,311.62	-147,709,486.14	-248,802,797.76

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-134,281,416.98	-134,281,416.98
五、期末所有者权益(基金净值)	1,439,865,366.11	1,921,396,962.25	3,361,262,328.36
项目	上年度可比期间 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)	1,667,786,614.44	3,324,739,572.81	4,992,526,187.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-933,310,592.96	-933,310,592.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-16,311,288.59	-32,060,638.71	-48,371,927.30
其中: 1. 基金申购款	71,677,500.34	115,596,319.79	187,273,820.13
2. 基金赎回款	-87,988,788.93	-147,656,958.50	-235,645,747.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-339,061,884.73	-339,061,884.73
五、期末所有者权益(基金净值)	1,651,475,325.85	2,020,306,456.41	3,671,781,782.26

报表附注为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:

奚星华	奚星华	刘美丽
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

融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)由通宝证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监基金字[2007]113号文核准的通宝证券投资基金持有人大会决议,通宝证券投资基金由封闭式基金转为上市开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同,并更名为“融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)”。2007年4月30日,《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”),注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司。

根据上述证监基金字[2007]113号文的核准,本基金自2007年5月11日至2007年5月25日公开集中申购。经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2007)验字第60468686\_H01号验资报告,于集中申购验资日(2007年5月30日),集中申购收到的实收基金总计人民币1,772,157,457.04元,折合基金份额1,772,157,457.04份。集中申购验资结束日同时为原通宝证券投资基金的基金份额转换日。融通基金管理有限公司按照基金转换基准日(2007年5月30日)的份额净值,对原通宝证券投资基金进行了基金份额转换。经基金托管人确认,原500,000,000.00份通宝证券投资基金基金份额转换为1,287,429,150.00份本基金基金份额。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的各类股票、权证、债

券、货币市场工具、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》和《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉及其他中国证监会颁布的相关规定编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金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一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

##### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题

的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	165,209,143.81
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	165,209,143.81

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	3,081,586,294.54	3,018,751,473.38	-62,834,821.16	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	193,700,000.00	193,140,000.00	-560,000.00
	合计	193,700,000.00	193,140,000.00	-560,000.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,275,286,294.54	3,211,891,473.38	-63,394,821.16	

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末各项衍生金融资产/负债期末余额为零。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产余额为零。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	26,202.22
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	668.10
应收债券利息	1,478,415.30
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	63.30
合计	1,505,348.92

注：表中“其他”为应收权证保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	749,164.74
银行间市场应付交易费用	990.00
合计	750,154.74

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	895.20
应付其他	612.00
预提审计费	64,464.96
预提上市费	29,752.78
预提信息披露费	148,765.71
预提账户维护费	4,500.00
合计	748,990.65

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,852,426,869.01	1,496,236,867.69
本期申购	115,160,277.27	44,721,810.04
本期赎回	-260,286,589.62	-101,093,311.62
本期末	3,707,300,556.66	1,439,865,366.11

注：“本期申购”含红利再投份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	705,259,676.54	1,783,948,723.73	2,489,208,400.27
本期利润	-52,314,045.06	-295,708,850.70	-348,022,895.76
本期基金份额交易产生的变动数	-18,070,041.99	-67,437,083.29	-85,507,125.28
其中：基金申购款	15,274,064.49	46,928,296.37	62,202,360.86
基金赎回款	-33,344,106.48	-114,365,379.66	-147,709,486.14
本期已分配利润	-134,281,416.98	-	-134,281,416.98
本期末	500,594,172.51	1,420,802,789.74	1,921,396,962.25

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	567,048.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,660.46
其他	1,049.27
合计	587,758.67

注：其他为权证保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	1,538,946,028.75
减：卖出股票成本总额	1,574,081,317.44
买卖股票差价收入	-35,135,288.69

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	209,120,000.00
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	204,889,800.00
减：应收利息总额	9,120,000.00
债券投资收益	-4,889,800.00

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无买卖权证和权证行权产生的收益/损失。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,778,011.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,778,011.26

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-295,708,850.70
——股票投资	-299,428,650.70
——债券投资	3,719,800.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-295,708,850.70

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	62,890.06
其他	12.67
合计	62,902.73

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	4,276,213.94
银行间市场交易费用	800.00
合计	4,277,013.94

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	64,464.96
信息披露费	148,765.71
上市费	29,752.78
银行费用	11,915.76
债券托管户维护费	9,000.00

合计	263,899.21
----	------------

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 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
新时代证券有限责任公司（新时代证券）	基金管理人股东、基金代销机构
融通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年06月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
新时代证券	55,643,550.71	2.06	1,924,682,362.79	14.38

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比 例 (%)
新时代证券	47,296.18	2.11	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
新时代证券	1,635,963.72	14.70	886,689.44	11.99

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,596,784.82	32,087,425.38
其中：支付销售机构的客户维护费	5,315,070.08	6,386,133.94

注：（1）基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$ ；H为每日应支付的基金管理费；E为前一日的基金资产净值。

（2）基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,432,797.46	5,347,904.23

注：（1）基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$ ；H为每日应支付的基金托管费；E为前一日的基金资产净值。

（2）基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
基金合同生效日（2007年4月30日）持有的基金份额	44,418,366.00	44,418,366.00
期初持有的基金份额	44,418,366.00	44,418,366.00

期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	44,418,366.00	44,418,366.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.20%	1.04%

注：上述基金份额的交易费用按交易所公布的公允的基金交易费率计算并支付。

#### 6.4.10.4.2 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

本报告期末和上年度末，本基金除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	165,209,143.81	567,048.94	861,496,408.53	2,269,526.07

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

(1) 本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

(2) 本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的股票。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2011-1-18	2011-1-19	2011-1-18	0.350	83,399,844.27	50,881,572.71	134,281,416.98	-
合计	-	-	-	0.350	83,399,844.27	50,881,572.71	134,281,416.98	-

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期无认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 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
600216	浙江医药	2011-6-27	重大事项停牌	31.39	2011-7-4	32.60	9,999,899	347,747,397.82	313,896,829.61	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立风险控制与审计委员会，主要负责公司运行合规性的监督、核查以及公司内外部审计的沟通、监督和核查工作。委员会对董事会负责；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的直接责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由总经理办公会决定的投资专业人员和金融工程人员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
未评级	193,140,000.00	-

注：未评级债券为央票，债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
未评级	-	200,610,000.00

注：未评级债券为央票，债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金属于开放式基金，一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。于资产负债表日，本基金所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理小组设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证保证金及债券投资等。

下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
银行存款	165,209,143.81	-	-	-	165,209,143.81
结算备付金	1,484,509.02	-	-	-	1,484,509.02
存出保证金	140,741.00	-	-	1,357,244.96	1,497,985.96
交易性金融资产	193,140,000.00	-	-	3,018,751,473.38	3,211,891,473.38
应收利息	-	-	-	1,505,348.92	1,505,348.92
应收申购款	-	-	-	24,222.13	24,222.13
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	359,974,393.83	-	-	3,021,638,289.39	3,381,612,683.22
负债	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	12,919,658.19	12,919,658.19
应付赎回款	-	-	-	1,147,023.83	1,147,023.83
应付管理人报酬	-	-	-	4,044,752.86	4,044,752.86
应付托管费	-	-	-	674,125.46	674,125.46
应付交易费用	-	-	-	750,154.74	750,154.74
应交税费	-	-	-	65,649.13	65,649.13
其他负债	-	-	-	748,990.65	748,990.65
负债总计	-	-	-	20,350,354.86	20,350,354.86
利率敏感度缺口	359,974,393.83	-	-	-	-
上年度末 2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
银行存款	74,212,244.32	-	-	-	74,212,244.32
结算备付金	4,308,807.61	-	-	-	4,308,807.61
存出保证金	140,741.00	-	-	1,555,436.19	1,696,177.19
交易性金融资产	200,610,000.00	-	-	3,718,115,401.24	3,918,725,401.24
应收利息	-	-	-	6,872,780.59	6,872,780.59
应收申购款	-	-	-	304,638.66	304,638.66
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	279,271,792.93	-	-	3,726,848,256.68	4,006,120,049.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,289,610.39	9,289,610.39
应付赎回款	-	-	-	1,070,192.97	1,070,192.97
应付管理人报酬	-	-	-	5,202,760.81	5,202,760.81
应付托管费	-	-	-	867,126.80	867,126.80
应付交易费用	-	-	-	3,504,180.25	3,504,180.25
应交税费	-	-	-	65,649.13	65,649.13
其他负债	-	-	-	675,261.30	675,261.30
负债总计	-	-	-	20,674,781.65	20,674,781.65
利率敏感度缺口	279,271,792.93	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2011年6月30日)	上年度末(2010年12月31日)
	市场利率上升25个基点	-357,965.47	-122,587.64
	市场利率下降25个基点	359,497.66	122,960.90

注:上表为利率风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,利率发生合理、可能的变动时,基金所持债券的公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值,负数表示可能减少基金资产净值。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通

过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金股票投资比例范围为基金资产的60%~95%；权证投资比例范围为0~3%；债券与货币市场工具的投资比例范围为5%~40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。于2011年6月30日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	3,018,751,473.38	89.81	3,718,115,401.24	93.29
交易性金融资产—债券投资	193,140,000.00	5.75	200,610,000.00	5.03
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,211,891,473.38	95.56	3,918,725,401.24	98.33

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加净值，负数表示可能减少净值。

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2011年6月30日)	上年度末 (2010年12月31日)
	沪深300指数上升5个基点	144,534,280.12	151,446,920.18
沪深300指数下降5个基点	-144,534,280.12	-151,446,920.18	

#### 6.4.14 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	3,018,751,473.38	89.27
	其中：股票	3,018,751,473.38	89.27
2	固定收益投资	193,140,000.00	5.71
	其中：债券	193,140,000.00	5.71
	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	166,693,652.83	4.93
6	其他各项资产	3,027,557.01	0.09
7	合计	3,381,612,683.22	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	19,896,000.00	0.59
B	采掘业	100,771,950.00	3.00
C	制造业	2,785,841,279.92	82.88
C0	食品、饮料	548,242,916.00	16.31
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	964,551,339.86	28.70
C5	电子	133,509,289.13	3.97
C6	金属、非金属	437,176,513.98	13.01
C7	机械、设备、仪表	172,654,630.66	5.14
C8	医药、生物制品	529,706,590.29	15.76
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	100,167,563.70	2.98
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	12,074,679.76	0.36
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,018,751,473.38	89.81

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	1,500,000	318,945,000.00	9.49
2	600216	浙江医药	9,999,899	313,896,829.61	9.34
3	002001	新和成	9,500,000	279,775,000.00	8.32
4	600143	金发科技	12,422,838	204,479,913.48	6.08

5	600352	浙江龙盛	17,999,921	172,439,243.18	5.13
6	600475	华光股份	8,710,094	165,404,685.06	4.92
7	000792	盐湖股份	2,800,000	165,200,000.00	4.91
8	600362	江西铜业	4,500,000	159,480,000.00	4.74
9	000869	张裕A	1,500,000	148,200,000.00	4.41
10	000960	锡业股份	4,640,100	135,026,910.00	4.02
11	601899	紫金矿业	13,800,000	99,912,000.00	2.97
12	300102	乾照光电	2,554,198	75,578,718.82	2.25
13	600309	烟台万华	3,900,000	72,969,000.00	2.17
14	600518	康美药业	5,000,000	65,800,000.00	1.96
15	000422	湖北宜化	3,000,000	62,790,000.00	1.87
16	600332	广州药业	3,679,908	57,884,952.84	1.72
17	000630	铜陵有色	2,300,000	55,430,000.00	1.65
18	600702	沱牌舍得	2,500,000	51,650,000.00	1.54
19	002281	光迅科技	1,596,519	51,567,563.70	1.53
20	000597	东北制药	3,679,339	51,473,952.61	1.53
21	000060	中金岭南	3,750,000	49,875,000.00	1.48
22	002230	科大讯飞	1,200,000	48,600,000.00	1.45
23	300136	信维通信	2,389,333	44,369,913.81	1.32
24	000650	仁和药业	2,856,701	40,650,855.23	1.21
25	600331	宏达股份	2,807,258	37,364,603.98	1.11
26	600095	哈高科	3,023,400	29,447,916.00	0.88
27	600251	冠农股份	600,000	19,896,000.00	0.59
28	300015	爱尔眼科	377,806	12,074,679.76	0.36
29	300131	英唐智控	476,894	9,418,656.50	0.28
30	600378	天科股份	542,310	6,898,183.20	0.21
31	002414	高德红外	200,000	4,142,000.00	0.12
32	300123	太阳鸟	177,440	3,777,697.60	0.11
33	002551	尚荣医疗	120,900	3,472,248.00	0.10
34	600497	驰宏锌锗	39,000	859,950.00	0.03

#### 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	000960	锡业股份	157,877,957.70	3.96
2	002001	新和成	129,549,159.65	3.25
3	000869	张裕A	96,700,098.44	2.43

4	600332	广州药业	83,287,250.98	2.09
5	600143	金发科技	71,464,124.42	1.79
6	000630	铜陵有色	70,034,091.35	1.76
7	000060	中金岭南	69,381,723.73	1.74
8	600309	烟台万华	68,676,342.69	1.72
9	002281	光迅科技	67,226,286.41	1.69
10	000597	东北制药	65,262,074.98	1.64
11	601668	中国建筑	37,476,757.87	0.94
12	600702	沱牌舍得	34,822,710.86	0.87
13	000792	盐湖股份	28,761,841.65	0.72
14	600475	华光股份	25,939,369.14	0.65
15	600518	康美药业	23,482,833.62	0.59
16	600216	浙江医药	15,533,523.99	0.39
17	300015	爱尔眼科	13,802,300.98	0.35
18	600331	宏达股份	13,256,122.97	0.33
19	601899	紫金矿业	13,031,840.73	0.33
20	300136	信维通信	11,900,040.13	0.30

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 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	002069	獐子岛	245,464,626.96	6.16
2	002001	新和成	173,000,926.28	4.34
3	000858	五粮液	157,806,009.64	3.96
4	600030	中信证券	119,711,332.90	3.00
5	600132	重庆啤酒	108,547,390.87	2.72
6	600519	贵州茅台	105,894,172.72	2.66
7	601899	紫金矿业	87,656,439.27	2.20
8	000783	长江证券	57,993,900.47	1.46
9	600251	冠农股份	51,343,618.68	1.29
10	600497	驰宏锌锗	45,840,248.04	1.15
11	600096	云天化	43,308,285.64	1.09
12	000407	胜利股份	41,298,230.32	1.04
13	000650	仁和药业	40,332,641.52	1.01
14	000792	盐湖股份	40,224,882.47	1.01
15	601668	中国建筑	38,650,000.00	0.97

16	600702	沱牌舍得	34,189,659.23	0.86
17	000911	南宁糖业	32,698,563.41	0.82
18	600362	江西铜业	21,015,156.77	0.53
19	000869	张裕A	16,495,702.22	0.41
20	600095	哈高科	16,286,273.11	0.41

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 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	1,174,146,040.28
卖出股票收入（成交）总额	1,538,946,028.75

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 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	193,140,000.00	5.75
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	193,140,000.00	5.75

#### 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	1101018	11 央行票据 18	1,000,000	96,590,000.00	2.87
2	1101022	11 央行票据 22	1,000,000	96,550,000.00	2.87

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

### 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	1,497,985.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,505,348.92
5	应收申购款	24,222.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,027,557.01

### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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	600216	浙江医药	313,896,829.61	9.34	重大事项停牌

## § 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

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
208,752	17,759.35	59,318,716.12	1.60%	3,647,981,840.54	98.40%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	融通基金管理有限公司	44,418,366.00	18.48%
2	天津证券登记公司	5,732,448.00	2.39%
3	吴颂今	2,724,973.00	1.13%
4	国投信托有限公司-国投瑞兴证券投资资金信托	2,076,768.00	0.86%
5	魏曙光	2,030,427.00	0.84%
6	王金明	1,969,900.00	0.82%
7	叶风	1,850,000.00	0.77%

8	魏宏	1,391,508.00	0.58%
9	刘桂云	1,248,800.00	0.52%
10	汪若清	1,227,268.00	0.51%

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 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	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	433,435.83	0.0117%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年4月30日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,852,426,869.01
本报告期基金总申购份额	115,160,277.27
减：本报告期基金总赎回份额	260,286,589.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,707,300,556.66

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 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

#### 10.2.1 基金管理人的重大变动

1) 自2011年1月22日起，刘模林先生不再担任本基金的基金经理，管文浩先生继续担任本基金的基金经理。

具体内容请参阅2011年1月22日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的相关公告。

#### 10.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

1) 本基金托管人2011年1月31日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

2) 本基金托管人2011年2月9日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批证监许可（2011）115号。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，仍为安永华明会计师事务所。

## 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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
中银国际	1	535,741,735.52	19.79%	435,295.22	19.43%	-
国泰君安	1	493,309,645.69	18.23%	400,816.35	17.89%	-
齐鲁证券	1	424,575,526.19	15.69%	360,889.53	16.11%	-
国金证券	1	389,168,096.35	14.38%	316,200.74	14.12%	-
高华证券	1	256,848,857.00	9.49%	218,313.40	9.75%	-
华泰联合证券	1	220,984,755.75	8.17%	187,835.84	8.39%	-
国信证券	1	199,869,220.64	7.38%	162,393.95	7.25%	-
宏源证券	1	130,345,881.18	4.82%	110,793.43	4.95%	-
新时代证券	1	55,643,550.71	2.06%	47,296.18	2.11%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- 1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
- 2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- 4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；
- 6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

（2）选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- 1) 券商服务评价；
- 2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- 3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- 4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

（3）交易单元变更情况

本报告期内，本基金未新增和终止租用交易单元。

### 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

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通领先成长股票 (LOF) 分红预告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-1-13
2	关于融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-1-22
3	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的盐湖钾肥估值方法调整的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-3-1
4	融通基金管理有限公司关于中信证券股份有限公司新增代销融通旗下开放式基金及开通定投业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-3-28
5	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的盐湖钾肥恢复采用收盘价估值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-3-29
6	融通基金管理有限公司关于融通旗下开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-3-30
7	融通基金管理有限公司关于融通基金管理有限公司开展“E路春风”第四期活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-4-18
8	融通基金管理有限公司关于新增恒泰长财证券有限责任公司代理融通旗下开放式基金销售业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-5-16
9	关于融通旗下开放式基金在天相投资顾问有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-5-31
10	融通基金管理有限公司关于2011年端午节放假期间暂停网站及客服系统服务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-6-3
11	融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-6-10
12	关于融通旗下部分开放式基金继续参加交通银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2011-6-29

### § 11 备查文件目录

- (一) 中国证监会《关于核准通宝证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》
- (二) 融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- (三) 《融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》
- (四) 《融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF) 托管协议》
- (五) 《融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》及其更新
- (六) 《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》
- (七) 基金托管人中国建设银行业务资格批件和营业执照

存放地点：基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人

网站 <http://www.rtfund.com> 查询。