

融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)
(原融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF))

2015 年半年度报告

2015 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：2015 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。

根据本基金的管理人融通基金管理有限公司于2015年8月7日发布的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，经与基金托管人协商，并报中国证监会备案，自2015年8月7日起，“融通领先成长股票型证券投资基金（LOF）”更名为“融通领先成长混合型证券投资基金（LOF）”，本次基金更名不改变基金投资范围，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。所以，本半年度报告中的相关基金名称及基金简称均以变更后的新的基金名称和基金简称进行表述，请投资者知晓。

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混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金合同规定，于2015年8月17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2015年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	31
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	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
7.6 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	37
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	37
7.8 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贵金属投资明细	37
7.9 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	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37

§ 8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末上市基金前十名持有人	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	39
§ 9 开放式基金份额变动	39
§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	39
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	41
§ 11 备查文件目录	43
11.1 备查文件目录	43
11.2 存放地点	43
11.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	融通领先成长混合(LOF)
场内简称	融通领先
基金主代码	161610
前端交易代码	161610
后端交易代码	161660
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	6,135,745,283.64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	田青
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqingl.zh@ccb.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、	北京市西城区闹市口大街1号院1

	14 层	号楼
邮政编码	518053	100033
法定代表人	高峰	王洪章

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(2015 年 1 月 1 日-2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	770,845,095.80
本期利润	1,277,603,072.63
加权平均基金份额本期利润	0.3199
本期加权平均净值利润率	21.52%
本期基金份额净值增长率	110.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,183,481,446.38
期末可供分配基金份额利润	0.1929
期末基金资产净值	9,407,892,504.58
期末基金份额净值	1.533
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	99.06%

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）。

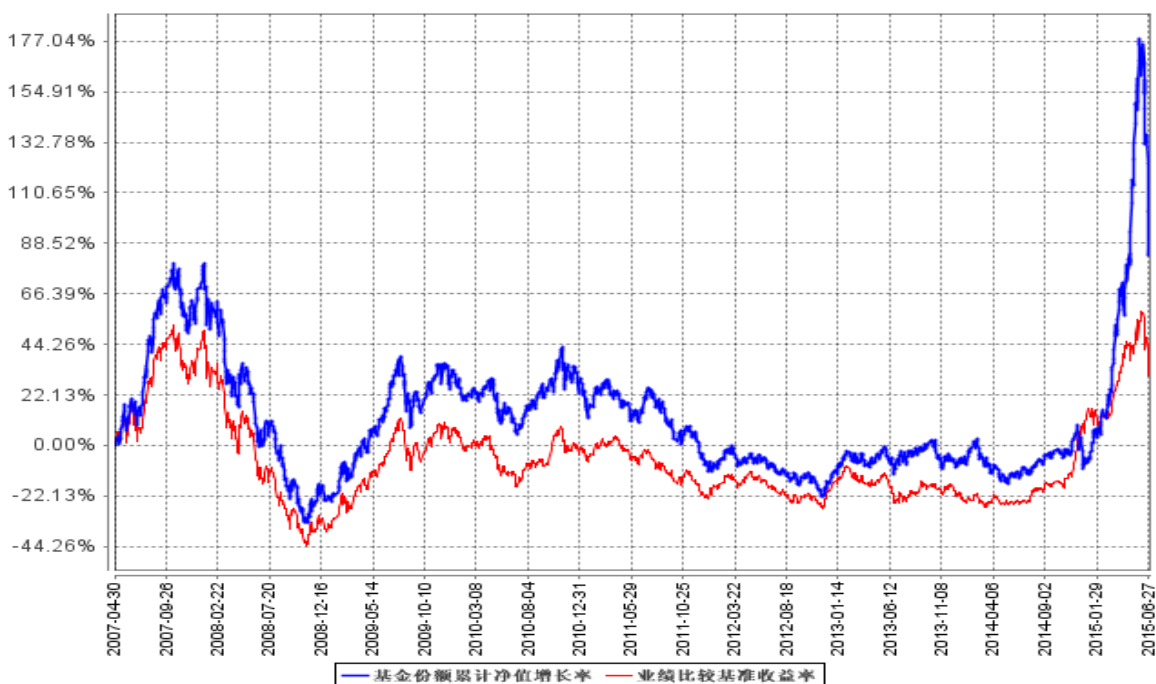
3.2 基金净值表现

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	-22.93%	4.48%	-5.90%	2.80%	-17.03%	1.68%
过去三个月	31.03%	3.63%	8.87%	2.09%	22.16%	1.54%
过去六个月	110.58%	2.92%	21.77%	1.82%	88.81%	1.10%
过去一年	119.00%	2.26%	82.39%	1.48%	36.61%	0.78%
过去三年	116.83%	1.64%	67.83%	1.20%	49.00%	0.44%
自基金合同生效起至今	99.06%	1.72%	37.90%	1.51%	61.16%	0.21%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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2015年6月30日，公司管理的基金共有三十一只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；三十只开放式基金，即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、融通动力先锋混合基金、融通领先成长混合基金（LOF）、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健行业混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通七天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利定期开放债券基金、融通健康产业灵活配置混合基金、融通转型三动力灵活配置混合基金、融通互联网传媒灵活配置混合基金、融通新区新经济灵活配置混合基金、融通通鑫灵活配置混合基金和融通新能源灵活配置混合基金。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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘格菘	本基金的基金经理、融通新区新经济、融通互联网传媒、融通新能源基金的基金经理	2014年12月24日	-	5	经济学博士，毕业于中国人民银行研究生部，具有基金从业资格。曾任职于中国人民银行营业管理部，历任中邮创业基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司。

注：任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写，证券从业年限以从事证券业务相关

的工作时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，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，本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投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

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 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

2015 年上半年，我国宏观经济仍未见复苏迹象，但稳增长政策持续加码，充分体现了决策层稳定经济增长的决心。货币政策方面，支持力度尤其明显，数量工具与价格工具并用，实行了“实质性宽松”的货币政策。财政政策方面，信贷资产证券化试点、地方债置换、PPP 模式创新、加快批复投资项目等多重举措并举，但宽松力度有待进一步加大。与此同时，转型升级仍然是经济发展的主线。今年“两会”期间，李克强总理从国家战略高度提出了“互联网+”战略，上半年的国务院常务会议多次提及培育新经济、促进经济结构转型的议题：“确定加快发展电子商务的措施，培育经济新动力”；“部署进一步促进就业鼓励创业，以稳就业惠民生助发展”；“部署促进跨境电子商务健康快速发展，推动开放型经济发展升级”；“部署推进‘互联网+’行动，促进形成经济发展新动能”，等等。

本基金继续围绕稳定经济增长及转型升级的大背景，寻找中长期成长趋势确定性较强的行业，自下而上精选个股，按照企业家战略、管理层执行力、所在行业细分市场空间、企业竞争力几个

角度，挖掘成长空间巨大的公司，伴随其成长并获得长期投资回报。继“两会”期间李总理提出“互联网+”战略以后，六月下旬国务院再次部署推进“互联网+”行动，这充分说明互联网经济对于我国宏观经济的战略意义十分突出。从2012年以来，互联网相关行业的商业模式创新不断，传统行业也积极拥抱互联网，利用互联网改造传统的商业模式，既提升了企业运作效率，也提升了企业价值。我们认为，在这个确定性趋势的行业中会产生很多具备中长期投资价值的公司，本基金的投资紧紧围绕互联网相关的行业展开。从上半年的市场表现看，本基金自14年年底以来制定的重仓投资互联网等新经济相关板块优质个股的策略比较成功，上半年的基金净值及基金规模均有明显的增长。

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110.58%，同期业绩比较基准收益率为21.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，在宏观经济企稳复苏之前，稳增长的政策将会继续加码，尤其是财政政策的宽松力度有望进一步加大，而货币政策的宽松方向也不会改变。随着稳增长政策的出台和落实，宏观经济有望企稳，企业的经营状况有望好转，这是我国证券市场健康发展的基石。与此同时，国内居民资产配置转移以及国家治理效率的提升是我国证券市场中长期发展的制度红利，只要这两个要素不发生方向性的变化，A股市场中长期向好的趋势就不会发生改变。虽然近期市场出现一定幅度的回调，但是我们对中长期前景仍然乐观。

从行业角度，一方面，我们认为对于传统行业中的优质企业，机遇与挑战并存。不断改革创新、释放活力的企业将在激烈的竞争中胜出并且生存得更好，这为我们提供了潜在的投资机会。另一方面，我们坚信转型升级是中国经济实现中长期可持续发展的必由之路，因而更加看好转型经济下孕育的投资机会。中国经济从旧的均衡（房地产、基建及相关行业推动的经济增长）向新的均衡（居民收入增加带来的内需驱动的经济增长）转变过程中，势必会产生新的宏观经济支柱性产业，例如高端装备制造、生物医药、医疗养老、教育、体育文化娱乐产业、新能源等战略新兴产业，这些产业会在转型升级的大背景下不断发展壮大，其在宏观经济的占比会不断提高，是中国经济实现可持续发展的保障。在此背景下，本基金将积极寻找未来3-5年能够成长为新的支柱行业内的优秀公司进行长期投资。我们长期看好的、未来空间广阔的行业包括：车联网、汽车后市场、企业互联网、工业4.0、智慧能源、普惠金融、高效物流、电子商务、环境大数据、人工智能等。

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、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部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、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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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，本基金未实施利润分配。

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：融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	582,852,392.76	35,486,111.60
结算备付金		50,879,966.43	12,346,637.59
存出保证金		3,342,195.89	659,007.76
交易性金融资产	6.4.7.2	9,306,463,727.90	1,730,418,659.45
其中：股票投资		9,306,463,727.90	1,630,260,659.45
基金投资		-	-
债券投资		-	100,158,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	5,700,128.55
应收证券清算款		546,818,120.50	16,268,902.93
应收利息	6.4.7.5	162,824.04	3,526,593.01
应收股利		-	-
应收申购款		22,044,492.08	107,033.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,512,563,719.60	1,804,513,074.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债：			
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		-	18,429,976.21
应付赎回款		1,064,817,273.38	6,698,760.19
应付管理人报酬		17,677,663.12	2,463,156.99
应付托管费		2,946,277.20	410,526.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,395,425.50	5,686,856.98
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	4,768,926.69	602,566.62
负债合计		1,104,671,215.02	34,357,492.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,383,046,633.05	944,821,872.49
未分配利润	6.4.7.10	7,024,845,871.53	825,333,709.66
所有者权益合计		9,407,892,504.58	1,770,155,582.15
负债和所有者权益总计		10,512,563,719.60	1,804,513,074.45

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.533元，基金份额总额6,135,745,283.64份。

6.2 利润表

会计主体：融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日 至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日 至2014年6月30日
一、收入		1,360,503,247.77	-72,226,624.95
1. 利息收入		3,646,735.48	2,467,876.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,361,614.41	748,704.67
债券利息收入		1,282,035.62	1,652,432.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,085.45	66,739.26
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		840,427,609.42	52,742,945.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	825,550,217.90	34,904,206.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-93,793.42	262,384.47
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	14,971,184.94	17,576,354.66

3. 公允价值变动收益	6. 4. 7. 17	506, 757, 976. 83	-127, 480, 011. 05
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6. 4. 7. 18	9, 670, 926. 04	42, 564. 61
减：二、费用		82, 900, 175. 14	24, 902, 713. 75
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	43, 018, 763. 97	15, 928, 307. 19
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	7, 169, 793. 96	2, 654, 717. 81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	32, 441, 614. 55	6, 080, 128. 30
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	270, 002. 66	239, 560. 45
三、利润总额		1, 277, 603, 072. 63	-97, 129, 338. 70
减：所得税费用		-	-
四、净利润		1, 277, 603, 072. 63	-97, 129, 338. 70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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）	944, 821, 872. 49	825, 333, 709. 66	1, 770, 155, 582. 15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1, 277, 603, 072. 63	1, 277, 603, 072. 63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1, 438, 224, 760. 56	4, 921, 909, 089. 24	6, 360, 133, 849. 80
其中：1. 基金申购款	3, 750, 135, 104. 99	12, 404, 673, 597. 42	16, 154, 808, 702. 41
2. 基金赎回款	-2, 311, 910, 344. 43	-7, 482, 764, 508. 18	-9, 794, 674, 852. 61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2, 383, 046, 633. 05	7, 024, 845, 871. 53	9, 407, 892, 504. 58
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	1,204,359,620.00	1,065,744,824.78	2,270,104,444.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-97,129,338.70	-97,129,338.70
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-86,180,326.16	-71,879,207.64	-158,059,533.80
其中：1.基金申购款	2,947,030.29	2,473,405.09	5,420,435.38
2.基金赎回款	-89,127,356.45	-74,352,612.73	-163,479,969.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,118,179,293.84	896,736,278.44	2,014,915,572.28

注：后附 6.4 报表附注为本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：

_____ 孟朝霞	_____ 颜锡廉	_____ 刘美丽
基金管理人负责人	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”)2007年4月17日证监基金字[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)”。自2007年4月30日起,《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,注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司,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”)。

根据2014年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十条的相关规定,经于基金托管人协商,并报中国证监会备案,自2015年8月7日起,本基金名称由原“融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)”更名为“融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)”,本次基金更名不改变基金投资范围,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

详见本基金管理人2015年8月7日在指定信息披露媒体上刊登的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》。

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)原通宝证券投资基金的份额净值,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,原通宝证券投资基金的基金总份额由500,000,000.00份转换为1,287,429,150.00份。

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 \times 80%+中信标普全债指数收益率 \times 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015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与最近一期年度报告一致,会计估计与最近一期年度报告不一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有

限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2015年6月30日
活期存款	582,852,392.76
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	582,852,392.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,853,450,948.56	9,306,463,727.90	453,012,779.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,853,450,948.56	9,306,463,727.90	453,012,779.34

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额均为零。

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中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	138,416.30
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	22,903.74
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,504.00
合计	162,824.04

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	14,395,425.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,395,425.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	3,940,205.82
预提费用	328,108.87
应付其他	612.00
合计	4,768,926.69

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,432,760,950.13	944,821,872.49
本期申购	9,655,729,869.24	3,750,135,104.99
本期赎回(以“-”号填列)	-5,952,745,535.73	-2,311,910,344.43
本期末	6,135,745,283.64	2,383,046,633.05

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	-35,697,013.58	861,030,723.24	825,333,709.66
本期利润	770,845,095.80	506,757,976.83	1,277,603,072.63
本期基金份额交易产生的变动数	448,333,364.16	4,473,575,725.08	4,921,909,089.24
其中：基金申购款	1,365,356,212.73	11,039,317,384.69	12,404,673,597.42
基金赎回款	-917,022,848.57	-6,565,741,659.61	-7,482,764,508.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,183,481,446.38	5,841,364,425.15	7,024,845,871.53

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	1,993,737.55
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	168,296.96
其他	199,579.90
合计	2,361,614.41

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	8,653,013,963.00
减：卖出股票成本总额	7,827,463,745.10
买卖股票差价收入	825,550,217.90

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	104,774,000.00
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	100,093,793.42
减：应收利息总额	4,774,000.00
买卖债券差价收入	-93,793.42

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资产生的收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,971,184.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,971,184.94

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	506,757,976.83
——股票投资	506,822,183.41
——债券投资	-64,206.58
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	506,757,976.83

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	9,670,926.04
合计	9,670,926.04

注：本基金的场内赎回费率为赎回金额的0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	32,441,614.55
银行间市场交易费用	-
合计	32,441,614.55

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
上市费	29,752.78
银行费用	23,693.79
债券托管户维护费	18,000.00
其他	200.00

合计	270,002.66
----	------------

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

截至本财务报表批准日，本基金无需要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
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
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

注：下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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6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	205,505,497.16	0.87%	-	-

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 2015年1月1日至2015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	187,093.48	0.89%	187,093.48	1.30%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	43,018,763.97	15,928,307.19
其中：支付销售机构的客户维护费	9,053,760.50	3,134,787.28

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,169,793.96	2,654,717.81

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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固有资金投资本基金的情况**

项目	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014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	-	-
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	36,174,244.00	-
期末持有的基金份额	8,244,122.00	44,418,366.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.13%	1.54%

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

本报告期末及上年度末,基金管理人主要股东及其控制的机构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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	582,852,392.76	1,993,737.55	202,018,937.45	715,736.77

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

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、本基金本报告期及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、本基金本报告期及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)在承销期内承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002183	怡亚通	2015-6-1	重大事项停牌	65.78	-	-	14,231,875	539,905,641.08	936,172,737.50	-
002739	万达院线	2015-5-14	重大事项停牌	221.86	2015-7-3	219.68	1,649,887	175,486,560.85	366,043,929.82	-
600869	智慧能源	2015-5-11	重大事项停牌	32.06	2015-7-31	26.23	6,020,800	106,237,577.41	193,026,848.00	-
300203	聚光科技	2015-4-20	重大事项停牌	41.19	2015-8-12	33.88	2,000,080	68,536,194.98	82,383,295.20	-
300419	浩丰科技	2015-4-24	重大事项停牌	228.45	2015-8-14	216.41	60,652	10,413,760.48	13,855,949.40	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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。本基金的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，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；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第一责任人，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；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2015年6月30日，本基金未持有信用类债券(2014年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的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的10%。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，其余均能以合理价格适时变现。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债券投资的公允价值。

于2015年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	582,852,392.76	-	-	-	582,852,392.76
结算备付金	50,879,966.43	-	-	-	50,879,966.43
存出保证金	3,342,195.89	-	-	-	3,342,195.89
交易性金融资产	-	-	-	9,306,463,727.90	9,306,463,727.90
应收证券清算款	-	-	-	546,818,120.50	546,818,120.50
应收利息	-	-	-	162,824.04	162,824.04
应收申购款	-	-	-	22,044,492.08	22,044,492.08
资产总计	637,074,555.08	-	-	9,875,489,164.52	10,512,563,719.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,064,817,273.38	1,064,817,273.38
应付管理人报酬	-	-	-	17,677,663.12	17,677,663.12
应付托管费	-	-	-	2,946,277.20	2,946,277.20
应付交易费用	-	-	-	14,395,425.50	14,395,425.50
应交税费	-	-	-	65,649.13	65,649.13
其他负债	-	-	-	4,768,926.69	4,768,926.69
负债总计	-	-	-	1,104,671,215.02	1,104,671,215.02
利率敏感度缺口	637,074,555.08	-	-	8,770,817,949.50	9,407,892,504.58
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,486,111.60	-	-	-	35,486,111.60
结算备付金	12,346,637.59	-	-	-	12,346,637.59
存出保证金	659,007.76	-	-	-	659,007.76
交易性金融资产	100,158,000.00	-	-	1,630,260,659.45	1,730,418,659.45
买入返售金融资产	5,700,128.55	-	-	-	5,700,128.55
应收证券清算款	-	-	-	16,268,902.93	16,268,902.93
应收利息	-	-	-	3,526,593.01	3,526,593.01
应收申购款	-	-	-	107,033.56	107,033.56
资产总计	154,349,885.50	-	-	1,650,163,188.95	1,804,513,074.45
负债					
应付证券清算款	-	-	-	18,429,976.21	18,429,976.21
应付赎回款	-	-	-	6,698,760.19	6,698,760.19
应付管理人报酬	-	-	-	2,463,156.99	2,463,156.99

应付托管费	-	-	-	410,526.18	410,526.18
应付交易费用	-	-	-	5,686,856.98	5,686,856.98
应交税费	-	-	-	65,649.13	65,649.13
其他负债	-	-	-	602,566.62	602,566.62
负债总计	-	-	-	34,357,492.30	34,357,492.30
利率敏感度缺口	154,349,885.50	-	-	1,615,805,696.65	1,770,155,582.15

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资 (2014 年 12 月 31 日：5.66%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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	9,306,463,727.90	98.92	1,630,260,659.45	92.10
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,306,463,727.90	98.92	1,630,260,659.45	92.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	沪深300指数上升5%	390,427,538.94	51,334,511.88
	沪深300指数下降5%	-390,427,538.94	-51,334,511.88

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	9,306,463,727.90	88.53
	其中:股票	9,306,463,727.90	88.53
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	633,732,359.19	6.03
7	其他各项资产	572,367,632.51	5.44
8	合计	10,512,563,719.60	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	484,279.65	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,723,283,944.52	60.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,874,117,067.93	19.92
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	936,172,737.50	9.95
M	科学研究和技术服务业	406,361,768.48	4.32
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	366,043,929.82	3.89
S	综合	-	-
	合计	9,306,463,727.90	98.92

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	002055	得润电子	17,893,505	1,035,676,069.40	11.01
2	002183	怡亚通	14,231,875	936,172,737.50	9.95
3	002488	金固股份	25,260,452	820,459,480.96	8.72
4	300367	东方网力	12,021,034	694,214,713.50	7.38
5	002174	游族网络	7,187,919	666,751,366.44	7.09
6	002690	美亚光电	15,212,586	597,398,252.22	6.35
7	002383	合众思壮	9,576,492	433,144,733.16	4.60
8	300378	鼎捷软件	5,106,149	414,312,929.86	4.40
9	300379	东方通	5,057,230	406,449,575.10	4.32

10	300332	天壕节能	16,092,784	405,538,156.80	4.31
11	300337	银邦股份	14,127,724	372,689,359.12	3.96
12	002739	万达院线	1,649,887	366,043,929.82	3.89
13	002331	皖通科技	11,462,658	336,772,892.04	3.58
14	600804	鹏博士	11,009,777	328,751,941.22	3.49
15	002373	千方科技	6,603,249	285,854,649.21	3.04
16	600869	智慧能源	6,020,800	193,026,848.00	2.05
17	300174	元力股份	6,601,425	180,350,931.00	1.92
18	300370	安控科技	7,264,516	162,579,868.08	1.73
19	002394	联发股份	7,717,700	119,469,996.00	1.27
20	002407	多氟多	4,088,320	116,558,003.20	1.24
21	002318	久立特材	1,700,000	89,046,000.00	0.95
22	002280	联络互动	1,653,267	88,119,131.10	0.94
23	300203	聚光科技	2,000,080	82,383,295.20	0.88
24	300358	楚天科技	1,865,632	79,793,080.64	0.85
25	300263	隆华节能	3,438,844	76,686,221.20	0.82
26	300419	浩丰科技	60,652	13,855,949.40	0.15
27	002763	汇洁股份	84,064	3,055,726.40	0.03
28	002776	柏堡龙	20,296	823,611.68	0.01
29	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.01

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	002055	得润电子	861,826,933.10	48.69
2	300367	东方网力	743,345,210.01	41.99
3	002174	游族网络	622,302,636.02	35.16
4	601328	交通银行	599,532,351.58	33.87
5	002383	合众思壮	585,463,265.02	33.07
6	002183	怡亚通	539,905,641.08	30.50
7	002331	皖通科技	532,418,238.59	30.08
8	600804	鹏博士	489,793,775.97	27.67
9	002373	千方科技	451,749,692.46	25.52
10	000768	中航飞机	434,017,668.29	24.52
11	600038	中直股份	430,522,432.10	24.32
12	300379	东方通	416,176,774.68	23.51

13	002690	美亚光电	405,208,175.95	22.89
14	601989	中国重工	394,564,077.06	22.29
15	002488	金固股份	369,488,145.18	20.87
16	300332	天壕节能	343,748,861.46	19.42
17	600893	中航动力	316,025,357.54	17.85
18	300337	银邦股份	311,968,635.26	17.62
19	002407	多氟多	242,552,934.63	13.70
20	002625	龙生股份	235,090,595.98	13.28
21	600016	民生银行	216,210,618.84	12.21
22	000821	京山轻机	215,661,362.83	12.18
23	300174	元力股份	210,595,482.99	11.90
24	300378	鼎捷软件	210,444,213.75	11.89
25	000062	深圳华强	204,493,226.00	11.55
26	300017	网宿科技	203,596,357.57	11.50
27	002394	联发股份	184,610,103.64	10.43
28	002739	万达院线	175,486,560.85	9.91
29	300263	隆华节能	168,477,003.44	9.52
30	002281	光迅科技	167,392,889.37	9.46
31	601607	上海医药	161,431,221.37	9.12
32	300137	先河环保	155,656,055.86	8.79
33	600030	中信证券	155,507,141.73	8.78
34	002318	久立特材	148,654,044.64	8.40
35	600869	智慧能源	141,157,446.33	7.97
36	300358	楚天科技	129,697,066.35	7.33
37	002280	联络互动	128,665,751.57	7.27
38	600048	保利地产	124,659,809.09	7.04
39	300284	苏交科	116,799,093.37	6.60
40	002124	天邦股份	105,164,393.93	5.94
41	300209	天泽信息	100,816,652.33	5.70
42	000758	中色股份	96,654,911.45	5.46
43	601988	中国银行	87,618,602.36	4.95
44	000069	华侨城A	87,068,004.22	4.92
45	002540	亚太科技	86,134,999.87	4.87
46	002065	东华软件	80,572,110.02	4.55
47	600466	蓝光发展	80,203,488.69	4.53
48	300007	汉威电子	78,324,746.66	4.42

49	002701	奥瑞金	74,849,893.43	4.23
50	002385	大北农	74,156,484.59	4.19
51	600588	用友网络	71,604,750.92	4.05
52	300198	纳川股份	71,584,805.21	4.04
53	300058	蓝色光标	70,088,091.28	3.96
54	300203	聚光科技	68,536,194.98	3.87
55	300104	乐视网	67,410,866.28	3.81
56	300370	安控科技	66,181,603.30	3.74
57	002375	亚厦股份	65,460,985.65	3.70
58	000793	华闻传媒	60,173,530.53	3.40
59	002284	亚太股份	59,846,250.30	3.38
60	300059	东方财富	58,824,562.96	3.32
61	002081	金螳螂	58,321,835.62	3.29
62	300403	地尔汉宇	57,235,340.88	3.23
63	601992	金隅股份	51,285,653.25	2.90
64	600153	建发股份	50,798,672.17	2.87
65	300162	雷曼光电	48,555,683.78	2.74
66	600970	中材国际	46,901,067.60	2.65
67	002527	新时达	45,455,112.41	2.57
68	601688	华泰证券	45,376,324.84	2.56
69	600837	海通证券	44,131,999.10	2.49
70	300248	新开普	43,494,183.39	2.46
71	601390	中国中铁	43,438,765.31	2.45
72	002514	宝馨科技	43,196,914.39	2.44
73	601669	中国电建	37,483,600.80	2.12
74	601628	中国人寿	37,002,900.53	2.09

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	601328	交通银行	600,052,637.56	33.90
2	000821	京山轻机	415,013,096.33	23.45
3	002540	亚太科技	413,806,677.00	23.38
4	000768	中航飞机	409,384,969.95	23.13
5	601989	中国重工	357,734,639.59	20.21

6	600038	中直股份	331,356,978.00	18.72
7	002625	龙生股份	269,723,773.52	15.24
8	300017	网宿科技	250,391,657.73	14.15
9	600893	中航动力	242,480,934.25	13.70
10	000062	深圳华强	226,773,297.51	12.81
11	600016	民生银行	210,295,437.83	11.88
12	002281	光迅科技	199,665,815.80	11.28
13	300209	天泽信息	186,001,556.18	10.51
14	601607	上海医药	184,133,964.27	10.40
15	601988	中国银行	176,910,803.00	9.99
16	300137	先河环保	169,308,984.30	9.56
17	600030	中信证券	155,646,219.38	8.79
18	002124	天邦股份	133,334,209.79	7.53
19	300284	苏交科	130,754,155.97	7.39
20	600048	保利地产	121,121,942.12	6.84
21	002065	东华软件	107,595,915.09	6.08
22	600466	蓝光发展	103,188,382.73	5.83
23	002385	大北农	102,444,086.98	5.79
24	000758	中色股份	101,214,867.62	5.72
25	601628	中国人寿	100,722,301.39	5.69
26	601166	兴业银行	99,788,929.49	5.64
27	300358	楚天科技	96,371,007.01	5.44
28	002701	奥瑞金	95,092,199.41	5.37
29	600588	用友网络	94,884,752.14	5.36
30	300007	汉威电子	91,191,986.68	5.15
31	300248	新开普	90,252,783.88	5.10
32	300006	莱美药业	88,037,534.47	4.97
33	300104	乐视网	86,675,116.40	4.90
34	600036	招商银行	81,644,050.21	4.61
35	000002	万科A	80,186,881.36	4.53
36	002407	多氟多	79,623,552.54	4.50
37	000069	华侨城A	76,780,034.84	4.34
38	002514	宝馨科技	75,189,593.02	4.25
39	002284	亚太股份	71,744,925.61	4.05
40	300337	银邦股份	71,537,428.77	4.04
41	300198	纳川股份	71,374,152.08	4.03
42	000793	华闻传媒	70,445,550.76	3.98
43	300059	东方财富	69,805,768.08	3.94

44	002375	亚厦股份	69,766,491.27	3.94
45	300058	蓝色光标	67,601,951.74	3.82
46	002394	联发股份	65,958,201.29	3.73
47	600584	长电科技	63,571,899.69	3.59
48	002363	隆基机械	62,432,478.15	3.53
49	300263	隆华节能	62,378,940.03	3.52
50	300403	地尔汉宇	57,475,675.73	3.25
51	000402	金融街	55,829,507.67	3.15
52	002081	金螳螂	53,367,881.38	3.01
53	000718	苏宁环球	52,293,165.99	2.95
54	600270	外运发展	51,996,506.01	2.94
55	600970	中材国际	48,833,711.41	2.76
56	600153	建发股份	48,668,752.29	2.75
57	601992	金隅股份	46,992,862.78	2.65
58	002488	金固股份	46,950,158.00	2.65
59	002527	新时达	46,609,661.34	2.63
60	601688	华泰证券	44,961,769.69	2.54
61	600869	智慧能源	42,554,291.48	2.40
62	600837	海通证券	42,442,365.99	2.40
63	601390	中国中铁	42,364,977.02	2.39
64	300162	雷曼光电	41,872,218.46	2.37
65	300430	诚益通	41,466,749.50	2.34
66	002665	首航节能	37,747,827.89	2.13
67	601669	中国电建	35,997,718.48	2.03
68	300369	绿盟科技	35,458,032.11	2.00

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	14,996,844,630.14
卖出股票收入（成交）总额	8,653,013,963.00

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	3,342,195.89
2	应收证券清算款	546,818,120.50
3	应收股利	-
4	应收利息	162,824.04
5	应收申购款	22,044,492.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	572,367,632.51

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002183	怡亚通	936,172,737.50	9.95	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

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
280,159	21,900.94	1,484,816,364.78	24.20%	4,650,928,918.86	75.80%

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	8,244,122.00	3.22%
2	天津证券登记公司	5,433,569.00	2.12%
3	王金明	1,715,900.00	0.67%
4	叶风	1,577,889.00	0.62%
5	张玫	1,256,400.00	0.49%
6	吴颂今	1,228,070.00	0.48%
7	卢砺锋	1,160,034.00	0.45%
8	陶隽	1,155,500.00	0.45%
9	袁秀云	1,104,913.00	0.43%
10	许玉明	1,068,572.00	0.42%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	525,245.12	0.0086%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 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	2,432,760,950.13
本报告期基金总申购份额	9,655,729,869.24
减：本报告期基金总赎回份额	5,952,745,535.73
本报告期期末基金份额总额	6,135,745,283.64

§ 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，本基金未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**（1）基金管理人的重大变动**

本报告期内，本基金的基金管理人无重大人事变更。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金的基金托管人中国建设银行2015年1月4日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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、基金财产及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

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自2011

年 10 月 20 日起为本基金提供审计服务至今。

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，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门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	
国信证券	1	7,249,694,629.67	30.66%	6,415,288.15	30.40%	-
国泰君安	1	6,798,200,182.71	28.75%	6,015,755.76	28.50%	-
齐鲁证券	1	4,519,163,388.90	19.11%	4,114,236.27	19.49%	-
国金证券	1	1,628,949,511.13	6.89%	1,441,451.03	6.83%	-
华泰证券	1	1,175,513,508.14	4.97%	1,070,182.03	5.07%	-
中银国际	1	923,148,362.57	3.90%	816,902.72	3.87%	-
申万宏源	2	752,469,227.24	3.18%	685,043.75	3.25%	-
中金公司	1	395,362,400.38	1.67%	359,936.93	1.71%	-
新时代证券	1	205,505,497.16	0.87%	187,093.48	0.89%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	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) 财力雄厚，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
要，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

本基金本报告期内原申银万国证券吸收合并宏源证券后变更为申万宏源证券。

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	融通基金管理有限公司关于融通领先成长股票型证券投资基金暂停大额申购(含定投)业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-3-20
2	关于融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-3-24
3	融通基金管理有限公司关于融通领先成长股票型证券投资基金暂停申购及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-3-27
4	融通基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-3-28
5	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、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-3-31
6	融通基金管理有限公司关于融通领先成长股票型证券投资基金恢复申购及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-4-7
7	关于融通旗下部分开放式基金参加银河证券基金申购(含定投)费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-4-20
8	融通基金管理有限公司关于融通领先成长股票型证券投资基金限制大额申购、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-4-30
9	融通基金管理有限公司关于融通领先成长股票型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-19

10	融通基金管理有限公司关于融通领先成长股票型证券投资基金限制大额申购、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-23
11	融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF) 场内交易价格波动的提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-26
12	关于融通领先成长股票型证券投资基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-26
13	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加农业银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-30
14	关于融通领先成长股票型证券投资基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-6-1
15	融通基金管理有限公司关于融通领先成长股票型证券投资基金暂停申购及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-6-10
16	融通基金关于新增国金证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-6-15
17	融通基金管理有限公司关于融通领先成长股票型证券投资基金恢复申购及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-6-24
18	融通基金关于新增中国国际金融股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-6-26
19	融通基金管理有限公司在网上直销开通汇款交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-4-20
20	融通基金关于开通网上交易企业版业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-4-20
21	关于网上直销恢复融通领先成长基金正常申购业务的通知	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-27
22	融通基金关于网上直销费率优惠的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，经与托管银行、会计师事务所协商一致，自 2015 年 3 月 27 日起本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

具体内容请参阅 2015 年 3 月 28 日刊登在指定信息披露媒体上刊登的《融通基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

2、本基金的基金管理人融通基金管理有限公司 2015 年 7 月 25 日刊登高管人员变更公告，田德军先生因个人原因辞去公司董事长职务，由高峰先生担任公司董事长职务。

具体内容请参阅 2015 年 7 月 25 日刊登在指定信息披露媒体上刊登的《融通基金管理有限公司关于高管人员变更的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《融通领先成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- (二)《融通领先成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- (三)《融通领先成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
- (四)《融通领先成长混合型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》
- (五)《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》
- (六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (七)基金托管人中国建设银行业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

12.3 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。