

融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

2016年半年度报告

2016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：2016年8月29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混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金合同规定，于2016年8月25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2016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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
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.....	12
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.....	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	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.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	36
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.....	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.12 投资组合报告附注.....	36

§ 8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
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.....	38
§ 9 开放式基金份额变动	38
§ 10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	38
10.6 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.7 其他重大事件.....	40
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	41
§ 12 备查文件目录	41

§ 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	5,168,187,334.04 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%+中债综合全价(总值)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)	(010) 67595096

	26948088	
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	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基金管理人互联网网址	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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-1,451,459,582.96
本期利润	-1,883,680,981.22
加权平均基金份额本期利润	-0.3616
本期加权平均净值利润率	-38.02%
本期基金份额净值增长率	-24.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-1,881,460,185.10
期末可供分配基金份额利润	-0.3640
期末基金资产净值	4,886,457,009.41
期末基金份额净值	0.945
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	22.70%

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)。

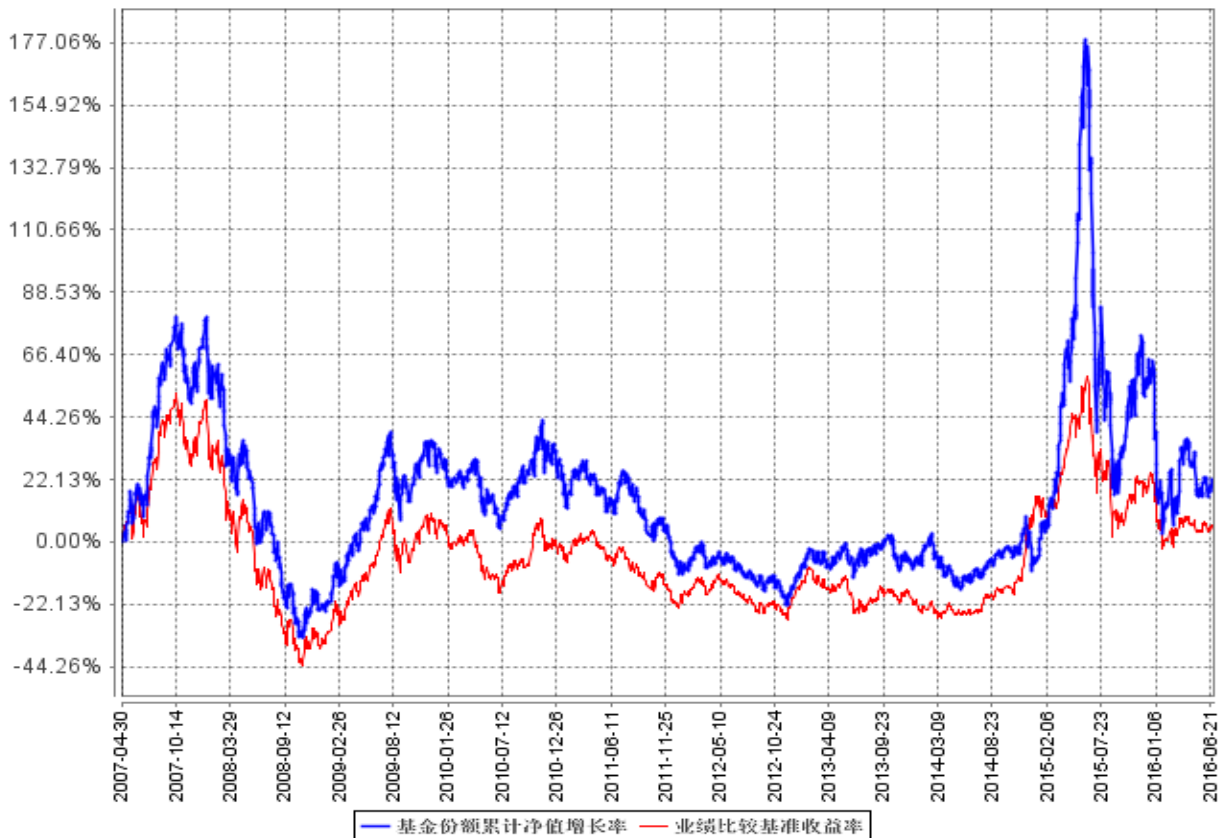
3.2 基金净值表现

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	0.32%	1.52%	-0.31%	0.79%	0.63%	0.73%
过去三个月	-8.61%	1.72%	-1.65%	0.81%	-6.96%	0.91%
过去六个月	-24.10%	2.87%	-12.32%	1.47%	-11.78%	1.40%
过去一年	-38.36%	3.14%	-23.06%	1.84%	-15.30%	1.30%
过去三年	34.62%	2.35%	39.71%	1.47%	-5.09%	0.88%
自基金合同生效起至今	22.70%	1.92%	6.10%	1.55%	16.60%	0.37%

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



§ 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：新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2016年6月30日，公司管理的基金共有四十五只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；四十四只开放式基金，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、融通动力先锋股票基金、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、融通汇财宝货币市场基金、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、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长30混合基金、融通中国风1号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金和融通新消费混合基金。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	融通领先成长混合型证券投资基金（LOF）、融通互联网传	2014年12月24日	-	6	刘格菘先生，中国人民银行研究生部经济学博士、金融学硕士，东北财经大学国际金融学士，6年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司权益投资部总

	<p>媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通成长30灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>				<p>经理。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的基金经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司，2014年12月24日起至今任“融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)”基金经理，2015年4月16日起至今任“融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，2015年5月20日起至今任“融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，2015年6月29日起至今任“融通新能源灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，2015年12月11日起至今任“融通成长30灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。</p>
伍文友	<p>融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金的基金经理</p>	2015年8月29日	-	5	<p>伍文友先生，中国人民银行研究部金融学硕士、中国科学技术大学金融学学士，5年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任中国人寿资产管理有限公司助理研究员、建信基金管理有限公司研究员。2015年5月加入融通基金管理有限公司，2015年8月29日起至今任“融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)”基金经理，2015年11月17日起至今任“融通互联网传媒灵活配置混合</p>

					型证券投资基金”基金经理。
--	--	--	--	--	---------------

注： 1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

随着稳增长政策的逐步落实及改革的不断推进，2016年上半年我国宏观经济已经开始出现企稳的迹象，市场对经济前景的信心正在恢复。同时，随着供给侧改革的逐步推进，市场对改革的信心有了恢复的迹象。货币政策方面，松紧适度，为稳增长和促改革提供了良好的环境。汇率方面，合理引导市场预期，积极维护外汇市场稳定，预期管理的效果较好。财政政策方面，稳增长的主线没有改变，种种迹象表明，只要经济需要，财政政策还是有空间的。综合来看，改革、转型、升级和创新仍然是我国经济发展的主线，决策层推动供给侧改革、国企改革、新消费、战略新兴产业的政策意图较为明显。

本基金的主要投资策略是围绕宏观经济转型的大背景，寻找中长期成长趋势确定性较强及景

气拐点向上的行业，自下而上精选个股，按照行业景气度、行业细分市场空间、企业战略、管理层执行力、企业竞争力等几个角度，挖掘优质成长个股及高景气行业板块，并以此获得长期投资回报。尽管 2015 年资本市场大幅波动，但从中长期角度看，宏观经济从投资主导向消费主导转型的趋势不会改变，新经济占宏观经济的比例逐步提升，传统行业则将实现优胜劣汰。在这一过程中，一些优秀的企业（企业家）会抓住新的产业趋势以及政策趋势，在经济转型过程中不断将自身做大做强。我们的投资思路，就是在这一个确定性的中长期趋势中，寻找能够在未来成为中国经济新的支柱性行业内的优秀企业，并提前布局，分享企业成长及行业景气红利，为投资人带来回报。

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-24.10%，同期业绩比较基准收益率为-12.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，市场经历了较大幅度的震荡，整体风险偏好在降低，市场对于业绩确定性的偏好在提升，因此行业及公司内生性成长的质量将是关键，同时还要求合理的估值即“好价格”，我们将围绕这两个核心要素进行行业和个股选择。我们认为，中长期成长性比较确定的行业包括智能汽车、物联网、小家电、云计算、新材料、半导体、精品内容制作等，中期比较确定的投资机会可能来自农产品、资源品的价格复苏，汛期水电行业的业绩提升以及 PPI 由负转正过程中对于部分上游行业的业绩推动等。我们认为供给侧改革有利于从中长期角度扭转产能过剩的局面，部分传统行业可能面临景气拐点。

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及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：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	424,292,859.04	687,611,878.08
结算备付金		15,889,772.50	33,802,394.22
存出保证金		3,571,835.10	6,403,564.06
交易性金融资产	6.4.7.2	4,514,454,003.45	6,868,286,258.37
其中：股票投资		4,514,454,003.45	6,868,286,258.37
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	15,000,142.50
应收证券清算款		-	261,350,688.78
应收利息	6.4.7.5	101,354.63	172,289.90
应收股利		-	-
应收申购款		1,639,482.14	6,751,643.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,959,949,306.86	7,879,378,859.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		35,772,545.64	-
应付赎回款		18,647,513.10	220,644,334.71
应付管理人报酬		5,984,252.78	9,994,654.37
应付托管费		997,375.49	1,665,775.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,152,888.57	14,600,137.37
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	872,072.74	1,429,811.85
负债合计		73,492,297.45	248,400,363.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,007,334,634.92	2,380,480,439.05
未分配利润	6.4.7.10	2,879,122,374.49	5,250,498,057.30
所有者权益合计		4,886,457,009.41	7,630,978,496.35

负债和所有者权益总计		4,959,949,306.86	7,879,378,859.50
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.945 元，基金份额总额 5,168,187,334.04 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-1,808,028,054.49	1,360,503,247.77
1. 利息收入		3,038,048.68	3,646,735.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,879,323.01	2,361,614.41
债券利息收入		-	1,282,035.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		158,725.67	3,085.45
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-1,381,336,728.32	840,427,609.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,394,587,809.16	825,550,217.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-93,793.42
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	13,251,080.84	14,971,184.94
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-432,221,398.26	506,757,976.83
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	2,492,023.41	9,670,926.04
减：二、费用		75,652,926.73	82,900,175.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	36,984,185.03	43,018,763.97
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,164,030.83	7,169,793.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	32,163,247.41	32,441,614.55
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	341,463.46	270,002.66
三、利润总额		-1,883,680,981.22	1,277,603,072.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-1,883,680,981.22	1,277,603,072.63

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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	2,380,480,439.05	5,250,498,057.30	7,630,978,496.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,883,680,981.22	-1,883,680,981.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-373,145,804.13	-487,694,701.59	-860,840,505.72
其中：1.基金申购款	461,150,644.10	694,135,554.41	1,155,286,198.51
2.基金赎回款	-834,296,448.23	-1,181,830,256.00	-2,016,126,704.23
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)	2,007,334,634.92	2,879,122,374.49	4,886,457,009.41
项目	上年度可比期间 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

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
基金管理人负责人

颜锡廉
主管会计工作负责人

刘美丽
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动作管理办法》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。本基金原业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 \times 80%+中信标普全债指数收益率 \times 20%, 根据本基金的基金管理人于 2015 年 11 月 11 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变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》, 自 2015 年 10 月 1 日起, 本基金业绩比较基准变更为: 沪深

300 指数收益率×80%+中债综合全价（总值）指数收益率×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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	424,292,859.04
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	424,292,859.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,480,839,577.78	4,514,454,003.45	33,614,425.67
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	4,480,839,577.78	4,514,454,003.45	33,614,425.67

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 2016年6月30日
应收活期存款利息	92,596.93
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	7,150.40
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	1,607.30
合计	101,354.63

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	11,152,888.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,152,888.57

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00

应付赎回费	68,126.80
应付其他	612.00
预提费用	303,333.94
合计	872,072.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,129,152,901.41	2,380,480,439.05
本期申购	1,187,276,620.27	461,150,644.10
本期赎回（以“-”号填列）	-2,148,242,187.64	-834,296,448.23
本期末	5,168,187,334.04	2,007,334,634.92

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	-583,095,705.89	5,833,593,763.19	5,250,498,057.30
本期利润	-1,451,459,582.96	-432,221,398.26	-1,883,680,981.22
本期基金份额交易产生的变动数	153,095,103.75	-640,789,805.34	-487,694,701.59
其中：基金申购款	-298,502,538.53	992,638,092.94	694,135,554.41
基金赎回款	451,597,642.28	-1,633,427,898.28	-1,181,830,256.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,881,460,185.10	4,760,582,559.59	2,879,122,374.49

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	2,697,618.46
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	137,542.56
其他	44,161.99
合计	2,879,323.01

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	10,860,587,327.96
减：卖出股票成本总额	12,255,175,137.12
买卖股票差价收入	-1,394,587,809.16

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,251,080.84
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,251,080.84

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-432,221,398.26
——股票投资	-432,221,398.26
——债券投资	-
——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	-432,221,398.26

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	2,488,268.60
转换费收入	3,754.81
其他	-
印花税返还	-
合计	2,492,023.41

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	32,163,247.41
银行间市场交易费用	-
合计	32,163,247.41

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	74,590.88
信息披露费	198,907.80
其他	600.00
上市费	29,835.26
银行费用	19,529.52
债券托管户维护费	18,000.00
合计	341,463.46

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
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）	基金托管人、基金代销机构
新时代证券股份有限公司（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

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 2016年1月1日至2016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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付 的管理费	36,984,185.03
其中：支付销售机构的客 户维护费	12,773,394.45	9,053,760.50

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,164,030.83	7,169,793.96

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自有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至 2016年6月30日	2015年1月1日至 2015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	12,253,508.07	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	12,253,508.07	8,244,122.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.24%	0.13%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
新时代证券	1,567,398.12	0.03%	-	-

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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	424,292,859.04	2,697,618.46	582,852,392.76	1,993,737.55

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

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016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

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
000802	北京文化	2016/6/1	重大事项	23.03	2016/8/22	21.86	18,000,000	434,036,933.85	414,540,000.00	-

			停牌								
601599	鹿港文化	2016/4/11	重大事项停牌	10.94	2016/7/6	10.21	25,948,440	230,460,362.15	283,875,933.60		-
600614	鼎立股份	2016/4/26	重大事项停牌	8.48	-	-	30,009,735	231,043,483.90	254,482,552.80		-
300332	天壕环境	2016/4/11	重大事项停牌	9.01	2016/7/29	9.91	25,906,624	266,588,048.13	233,418,682.24		-
300282	汇冠股份	2016/4/22	重大事项停牌	39.71	2016/7/26	36.78	1,801,777	52,800,543.76	71,548,564.67		-
300242	明家联合	2016/5/9	重大事项停牌	34.99	2016/8/12	36.69	1,529,189	53,934,066.57	53,506,323.11		-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2015 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 2016 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 2016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	424,292,859.04	-	-	-	424,292,859.04
结算备付金	15,889,772.50	-	-	-	15,889,772.50
存出保证金	3,571,835.10	-	-	-	3,571,835.10
交易性金融资产	-	-	-	4,514,454,003.45	4,514,454,003.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	101,354.63	101,354.63
应收申购款	-	-	-	1,639,482.14	1,639,482.14
资产总计	443,754,466.64	-	-	4,516,194,840.22	4,959,949,306.86
负债					
应付证券清算款	-	-	-	35,772,545.64	35,772,545.64
应付赎回款	-	-	-	18,647,513.10	18,647,513.10
应付管理人报酬	-	-	-	5,984,252.78	5,984,252.78
应付托管费	-	-	-	997,375.49	997,375.49
应付交易费用	-	-	-	11,152,888.57	11,152,888.57
应交税费	-	-	-	65,649.13	65,649.13
其他负债	-	-	-	872,072.74	872,072.74
负债总计	-	-	-	73,492,297.45	73,492,297.45
利率敏感度缺口	443,754,466.64	-	-	4,442,702,542.77	4,886,457,009.41
上年度末 2015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	687,611,878.08	-	-	-	687,611,878.08
结算备付金	33,802,394.22	-	-	-	33,802,394.22
存出保证金	6,403,564.06	-	-	-	6,403,564.06
交易性金融资产	-	-	-	6,868,286,258.37	6,868,286,258.37
买入返售金融资产	15,000,142.50	-	-	-	15,000,142.50
应收证券清算款	-	-	-	261,350,688.78	261,350,688.78
应收利息	-	-	-	172,289.90	172,289.90
应收申购款	-	-	-	6,751,643.59	6,751,643.59
资产总计	742,817,978.86	-	-	7,136,560,880.64	7,879,378,859.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	220,644,334.71	220,644,334.71
应付管理人报酬	-	-	-	9,994,654.37	9,994,654.37
应付托管费	-	-	-	1,665,775.72	1,665,775.72
应付交易费用	-	-	-	14,600,137.37	14,600,137.37
应交税费	-	-	-	65,649.13	65,649.13

其他负债	-	-	-	1,429,811.85	1,429,811.85
负债总计	-	-	-	248,400,363.15	248,400,363.15
利率敏感度缺口	742,817,978.86	-	-	6,888,160,517.49	7,630,978,496.35

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2016年6月30日，本基金未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015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 2016年6月30日	上年度末 2015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	4,514,454,003.45	92.39	6,868,286,258.37	90.01
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,514,454,003.45	92.39	6,868,286,258.37	90.01

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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	沪深300指数上升5%	319,592,112.08	337,331,311.01
	沪深300指数下降5%	-319,592,112.08	-337,331,311.01

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	4,514,454,003.45	91.02
	其中: 股票	4,514,454,003.45	91.02
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	440,182,631.54	8.87

7	其他各项资产	5,312,671.87	0.11
8	合计	4,959,949,306.86	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	150,698,996.82	3.08
C	制造业	2,932,587,553.30	60.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	314,219,740.48	6.43
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	184,580,000.00	3.78
G	交通运输、仓储和邮政业	95,903,132.84	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,018,227.84	1.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	182,384,289.67	3.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	574,062,062.50	11.75
S	综合	-	-
	合计	4,514,454,003.45	92.39

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	000802	北京文化	18,000,000	414,540,000.00	8.48
2	601599	鹿港文化	25,948,440	283,875,933.60	5.81
3	600614	鼎立股份	30,009,735	254,482,552.80	5.21

4	300332	天壕环境	25,906,624	233,418,682.24	4.78
5	000333	美的集团	8,009,872	189,994,163.84	3.89
6	002032	苏泊尔	4,958,474	170,819,429.30	3.50
7	600713	南京医药	20,000,000	168,400,000.00	3.45
8	000911	南宁糖业	6,563,677	164,617,019.16	3.37
9	002624	完美世界	4,225,750	159,522,062.50	3.26
10	300140	启源装备	6,099,902	135,417,824.40	2.77
11	002183	怡亚通	8,999,858	128,877,966.56	2.64
12	002156	通富微电	8,999,888	126,898,420.80	2.60
13	002371	七星电子	2,977,502	124,519,133.64	2.55
14	000059	华锦股份	12,743,361	118,513,257.30	2.43
15	600436	片仔癀	2,400,000	108,024,000.00	2.21
16	000983	西山煤电	11,999,940	97,799,511.00	2.00
17	600538	国发股份	6,895,601	90,470,285.12	1.85
18	002488	金固股份	4,000,000	84,080,000.00	1.72
19	002669	康达新材	3,373,240	81,632,408.00	1.67
20	600236	桂冠电力	12,023,967	80,801,058.24	1.65
21	002185	华天科技	5,999,940	76,379,236.20	1.56
22	300398	飞凯材料	999,855	74,789,154.00	1.53
23	300282	汇冠股份	1,801,777	71,548,564.67	1.46
24	000687	华讯方舟	3,509,033	69,478,853.40	1.42
25	002664	信质电机	1,891,577	64,351,449.54	1.32
26	600273	嘉化能源	7,044,750	62,768,722.50	1.28
27	300077	国民技术	2,999,929	59,398,594.20	1.22
28	300378	鼎捷软件	2,000,000	57,440,000.00	1.18
29	300242	明家联合	1,529,189	53,506,323.11	1.09
30	000821	京山轻机	2,999,942	52,858,978.04	1.08
31	300236	上海新阳	999,910	50,585,446.90	1.04
32	600029	南方航空	7,000,000	49,420,000.00	1.01
33	002242	九阳股份	2,661,719	48,390,051.42	0.99
34	002705	新宝股份	2,999,762	46,856,282.44	0.96
35	600115	东方航空	7,032,244	46,483,132.84	0.95
36	000933	*ST神火	10,000,000	46,000,000.00	0.94
37	000807	云铝股份	6,999,884	45,849,240.20	0.94
38	600584	长电科技	1,999,979	40,579,573.91	0.83
39	600667	太极实业	4,000,000	39,960,000.00	0.82
40	300174	元力股份	1,500,000	36,360,000.00	0.74
41	601225	陕西煤业	6,000,000	31,020,000.00	0.63
42	000404	华意压缩	2,999,950	28,859,519.00	0.59

43	300367	东方网力	1,000,000	24,830,000.00	0.51
44	601908	京运通	3,000,000	23,010,000.00	0.47
45	600797	浙大网新	2,003,392	22,578,227.84	0.46
46	000811	烟台冰轮	2,000,000	22,440,000.00	0.46
47	600188	兖州煤业	1,999,953	21,879,485.82	0.45
48	000417	合肥百货	2,000,000	16,180,000.00	0.33
49	600183	生益科技	1,504,796	13,949,458.92	0.29

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	000802	北京文化	466,522,452.27	6.11
2	002624	完美世界	314,838,403.33	4.13
3	600713	南京医药	234,897,973.73	3.08
4	300364	中文在线	231,740,138.42	3.04
5	600614	鼎立股份	231,043,483.90	3.03
6	601599	鹿港文化	230,460,362.15	3.02
7	002488	金固股份	216,274,513.73	2.83
8	000687	华讯方舟	215,662,255.32	2.83
9	002456	欧菲光	201,635,729.90	2.64
10	002425	凯撒股份	195,656,454.55	2.56
11	600030	中信证券	192,603,525.16	2.52
12	000333	美的集团	184,005,287.61	2.41
13	000402	金融街	171,159,813.87	2.24
14	002032	苏泊尔	168,473,345.81	2.21
15	600029	南方航空	167,259,939.18	2.19
16	000911	南宁糖业	162,208,547.49	2.13
17	300034	钢研高纳	160,532,439.52	2.10
18	600115	东方航空	156,051,497.51	2.04
19	600436	片仔癀	155,341,172.53	2.04
20	002276	万马股份	152,531,233.19	2.00

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	002174	游族网络	722,843,676.14	9.47
2	002488	金固股份	690,707,563.31	9.05
3	002055	得润电子	636,335,962.71	8.34
4	002153	石基信息	452,353,239.62	5.93
5	300367	东方网力	421,877,840.14	5.53
6	002183	怡亚通	364,076,936.11	4.77
7	002217	合力泰	330,592,066.21	4.33
8	600030	中信证券	223,810,161.05	2.93
9	300364	中文在线	213,225,695.56	2.79
10	002456	欧菲光	207,328,380.14	2.72
11	600718	东软集团	201,064,597.05	2.63
12	002425	凯撒股份	163,258,754.20	2.14
13	000402	金融街	162,898,694.93	2.13
14	600756	浪潮软件	153,042,795.17	2.01
15	002624	完美世界	151,272,445.12	1.98
16	300034	钢研高纳	150,403,099.27	1.97
17	300144	宋城演艺	147,895,509.84	1.94
18	002343	慈文传媒	146,390,516.31	1.92
19	300378	鼎捷软件	137,814,886.21	1.81
20	300031	宝通科技	132,576,040.29	1.74

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	10,333,564,280.46
卖出股票收入（成交）总额	10,860,587,327.96

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	3,571,835.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	101,354.63
5	应收申购款	1,639,482.14
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,312,671.87

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

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	000802	北京文化	414,540,000.00	8.48	重大事项停牌
2	601599	鹿港文化	283,875,933.60	5.81	重大事项停牌
3	600614	鼎立股份	254,482,552.80	5.21	重大事项停牌
4	300332	天壕环境	233,418,682.24	4.78	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
239,724	21,558.91	596,882,185.47	11.55%	4,571,305,148.57	88.45%

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	4.02%
2	天津证券登记公司	5,379,614.00	2.62%
3	叶风	1,873,909.00	0.91%
4	王金明	1,668,000.00	0.81%
5	李萍	1,278,187.00	0.62%
6	吴颂今	1,228,070.00	0.60%
7	卢砺锋	1,178,034.00	0.57%
8	许玉明	1,068,572.00	0.52%
9	李玲	950,646.00	0.46%
10	江晓文	942,972.00	0.46%

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	790,106.57	0.0153%

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	50~100
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	6,129,152,901.41
本报告期基金总申购份额	1,187,276,620.27
减：本报告期基金总赎回份额	2,148,242,187.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	5,168,187,334.04

§ 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

10.2.1 基金管理人重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变更。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无

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），该事务所自本基金合同生效以来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	
中泰证券	1	4,514,759,070.19	21.30%	4,204,596.97	21.65%	-
国泰君安	1	3,432,379,711.35	16.19%	3,127,947.27	16.10%	-
国金证券	1	3,146,303,573.45	14.85%	2,867,246.81	14.76%	-
西南证券	2	2,451,008,596.11	11.56%	2,233,639.00	11.50%	-
招商证券	1	2,282,437,499.88	10.77%	2,079,990.55	10.71%	-
国信证券	1	2,077,705,969.74	9.80%	1,893,416.27	9.75%	-
兴业证券	1	1,836,237,331.40	8.66%	1,673,381.11	8.62%	-
中金公司	1	550,306,475.57	2.60%	512,493.42	2.64%	-
中银国际	2	529,968,793.53	2.50%	482,963.10	2.49%	-
申万宏源	1	343,225,988.10	1.62%	319,643.61	1.65%	-
银河证券	1	29,818,599.10	0.14%	27,173.74	0.14%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	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
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

本报告期内，本基金新增兴业证券、银河证券交易单元各1个。

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	关于交通银行股份有限公司新增代销融通基金管理有限公司旗下开放式基金并开通定期定额投资及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016-1-5
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016-2-25
3	融通基金管理有限公司关于融通领先成长混合型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资、转换转入）业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016-2-26
4	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司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	2016-3-7
5	融通关于旗下部分开放式基金新增代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016-3-24
6	关于融通基金管理有限公司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	2016-3-31
7	融通基金管理有限公司关于融通领先成长混合型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额投资、转换转入）业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016-4-20
8	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司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	2016-4-20

9	融通基金管理有限公司关于对通过本公司直销中心赎回公司旗下部分基金的养老金客户实施特定赎回费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016-5-9
10	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016-5-13
11	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金新增奕丰金融服务（深圳）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	2016-5-13
12	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行“基金通”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	2016-5-20
13	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在深圳市新兰德证券投资咨询有限公司开通定期定额投资业务及参加基金申购	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016-5-24
14	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加其申购费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016-6-24
15	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司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	2016-6-30

§ 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) 《融通领先成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- (三) 《融通领先成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- (四) 《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
- (五) 《融通领先成长混合型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》
- (六) 《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》
- (七) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (八) 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:基金管理人处、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。