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:2012年3月26日

融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

2011年度报告摘要

2011年12月31日

§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2012年3月23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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通领先成长股票(LOF)	
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	3,858,458,765.70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	本基金认为股价的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成长,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	尹东
	联系电话	0755-26948666	010-67595003
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088、0755-26948088	010-67595096
传真		0755-26935005	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-549,506,839.97	434,402,085.56	134,186,044.40
本期利润	-1,048,846,634.32	-200,693,666.18	2,530,344,105.75
加权平均基金份额本期利润	-0.2748	-0.0480	0.5172
本期基金份额净值增长率	-27.26%	-3.93%	75.41%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	0.0056	0.1831	0.1572
期末基金资产净值	2,798,725,617.81	3,985,445,267.96	4,992,526,187.25
期末基金份额净值	0.725	1.035	1.163

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;

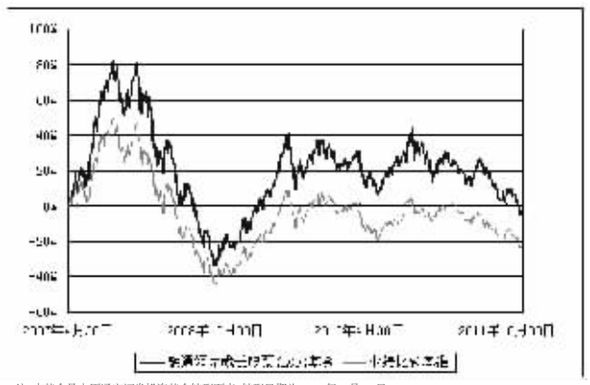
(3)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

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

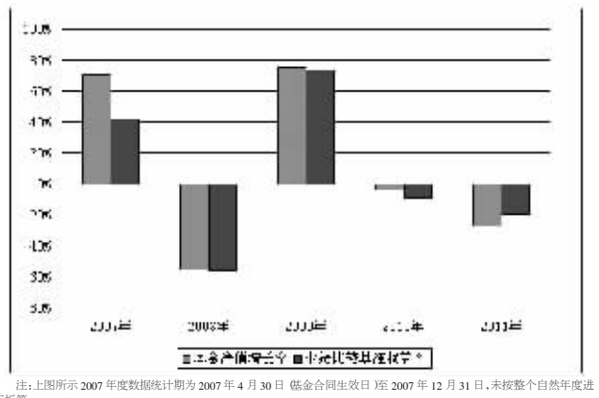
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.60%	1.23%	-6.78%	1.13%	-2.82%	0.10%
过去六个月	-20.07%	1.18%	-18.27%	1.09%	-1.80%	0.09%
过去一年	-27.26%	1.23%	-19.71%	1.04%	-7.55%	0.19%
过去三年	22.58%	1.52%	26.18%	1.35%	-3.60%	0.17%
自基金合同生效起至今	-5.86%	1.81%	-21.52%	1.71%	15.66%	0.10%

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。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:上图所示2007年度数据统计期为2007年4月30日(基金合同生效日)至2007年12月31日,未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2011	0.350	83,399,844.27	50,881,572.71	134,281,416.98	-
2010	0.800	214,138,796.14	124,923,088.59	339,061,884.73	-
2009	-	-	-	-	-
合计	1.150	297,538,640.41	175,804,661.30	473,343,301.71	-

§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12月31日,公司管理的基金共有十二只,一只封闭式基金,即融通通乾封闭基金,十一只开放式基金,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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
管文浩	本基金的基金经理	2010年3月13日	-	19	经济学硕士,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	18	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;历任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、公司副总经理。

注:任职日期和离职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

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	-35.34%
融通动力先锋股票基金	-30.77%
融通内需驱动股票基金	-40.20%
本基金	-27.26%

注:(1)本基金与融通行业景气混合基金净值增长率的差异为8.08%,其中0.14%来自资产配置,-2.32%来自行业配置,13.65%来自股票选择,-3.39%来自其他因素。

(2)本基金与融通内需驱动股票基金净值增长率的差异为12.94%,其中-0.01%来自资产配置,0.07%来自行业配置,19.17%来自股票选择,-6.29%来自其他因素。

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年是A股市场相当艰难的一年。全年来看,除了4月中旬之前大盘监筹股走出一波估值修复行情之外,其余时间基本上是单边下跌,6月中旬至7月中旬以及10月下旬至11月中旬的反弹行情均是昙花一现,力度有限。资金空前紧张、中小企业成本压力空前加大是2011年宏观经济的两大难题,亦是资本市场面临的最突出问题,流动性短缺致使A股估值水平受到严重挤压,而中小盘上市公司估值体系几乎遭受颠覆性破坏。外围形势不稳,日本地震、中东北非部分国家内乱、欧债危机、美债问题等给国内市场造成了一定冲击。

大类资产配置上,本基金大部分时间基本保持较高(85%以上)的股票投资比例,只是在较短的时间内一度降低了股票仓位。在A股估值水平快速下移的情况下,高仓位策略在下半年遭受较大的压力和挑战,亦是本基金最大的失误所在。短时间内估值如此快的下移,几乎是08年金融危机再现,超出了本基金的预期。

行业配置上,本基金重点配置食品饮料、医药、化工、IT等下游行业,保持了对指数较高的偏离度,尽管食品饮料获得了较好的超额收益,但其他几个超配行业表现欠佳。对金融、地产等有较好表现的行业配置较低,是行业配置最大的失误。8月份开始,本基金对行业配置逐渐进行调整,逐步减少医药、化工、有色等周期性行业配置,加大了对金融行业的配置,产生了一定的积极效果。

个股选择和操作上,有得有失。重仓股中,贵州茅台、张裕等获得了较大的超额收益;但一些重仓医药、化工股和中小盘股收益率欠佳。本基金较成功的个股操作是较早果断减持了一度配置较多的有色行业个股。但对重仓医药、化工股以及部分中小盘股减持不够果断,这与这些个股流动性欠缺有一定关系,流动性管理仍然是本基金在组合管理中需要加强的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期中本基金净值增长率为-27.26%,业绩比较基准增长率为-19.71%,业绩落后的主要原因是对全年表现较好的金融、地产等行业配置较少,而重点配置的医药、化工、IT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

尽管前途仍然充满很多不确定性,但2012年总体形势可能好于2011年。主要有利因素包括:1、通胀下行乃大势所趋,流动性紧张局面会有所缓和。未来几个月央行释放流动性是大概率事件。2、目前来看,外围形势趋于稳定。欧债危机正在向好的方面发展,而美国经济复苏势头良好。3、随着资金短缺问题缓解和成本压力减轻,国内企业经营最困难的阶段可能已经过去。4、下半年地产调控可能回归常态化,购房贷款和限购都有可能放松,宏观经济可能重新进入扩张周期。5、部分新兴产业个股估值已经回到长期合理水平,具备可参与的价值。主要不利因素包括:1、外汇占款下降、国内资金外流部分对冲了流动性放松的效果。2、伊朗核危机可能触发局部战争,从而推高油价。3、工资上涨刚性和公用事业收费调价等因素使通胀压力短期内难以明显减轻。4、新股发行制度改革可能对中小盘股带来估值扰动。但这些不利因素都是相对短期的、可控的。

2012年本基金将重点关注三大类行业:1、通胀下行趋势下的受益行业,主要是大众消费品行业、公用事业和中游行业;2、经济进入新一轮扩张周期预期受益的行业,主要是金融、地产、化工等周期性行业;3、具备技术创新能力、业绩有望保持高增长的新兴产业。这三类行业可能在不同时间段表现优异,本基金已经提前进行了一些布局,希望能够创造超额收益。

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

依据本基金基金合同的约定,本基金本报告期出现亏损,不进行利润分配。本基金管理人于2011年1月18日对基金份额持有人实施的每10份基金份额派发现金红利0.35元,是对2010年度利润进行的分配。

§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 审计报告

本基金2011年年度财务会计报告已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2012)第20446号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产:		
银行存款	207,564,422.47	74,212,244.32
结算备付金	8,184,054.20	4,308,807.61
存出保证金	1,766,044.14	1,696,177.19
交易性金融资产	2,579,225,997.52	3,918,725,401.24
其中:股票投资	2,434,075,997.52	3,718,115,401.24
基金投资	-	-
债券投资	145,150,000.00	200,610,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	6,864,639.07	-
应收利息	3,506,241.17	6,872,780.59
应收股利	-	-
应收申购款	31,976.71	304,638.66
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,807,143,375.28	4,006,120,049.61
负债和所有者权益	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	9,289,610.39
应付赎回款	380,558.16	1,070,192.97
应付管理人报酬	3,746,313.60	5,202,760.81
应付托管费	624,385.60	867,126.80
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,965,582.69	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	635,268.29	675,261.30
负债合计	8,417,757.47	20,674,781.65
所有者权益:		
实收基金	1,498,600,044.81	1,496,236,867.69
未分配利润	1,300,125,573.00	2,489,208,400.27
所有者权益合计	2,798,725,617.81	3,985,445,267.96
负债和所有者权益总计	2,807,143,375.28	4,006,120,049.61

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.725元,基金份额总额3,858,458,765.70份。

7.2 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-973,105,705.71	-92,788,886.03
1.利息收入	8,308,335.96	12,430,918.01
其中:存款利息收入	1,394,130.77	3,742,679.46
债券利息收入	6,813,507.52	8,229,698.62
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	100,697.67	458,539.93
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-482,175,412.30	529,664,890.68
其中:股票投资收益	-501,559,915.28	505,590,772.48
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,908,100.00	-2,252,000.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	24,292,602.98	26,326,118.20
3.公允价值变动收益	-499,339,794.35	-635,095,751.74
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	101,164.98	211,057.02
减:二、费用	75,740,928.61	107,904,780.15
1.管理人报酬	51,344,636.32	63,030,657.00
2.托管费	8,557,439.45	10,505,109.44
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	15,314,488.17	33,784,244.04
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	524,364.67	584,769.67
三、利润总额	-1,048,846,634.32	-200,693,666.18
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-1,048,846,634.32	-200,693,666.18

7.3 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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)	-	-1,048,846,634.32	-1,048,846,634.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,363,177.12	-5,954,775.97	-3,591,598.85
其中:1.基金申购款	156,354,949.40	209,242,253.19	365,597,202.59
2.基金赎回款	-153,991,772.28	-215,197,029.16	-369,188,801.44
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)	1,498,600,044.81	1,300,125,573.00	2,798,725,617.81
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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)	-	-200,693,666.18	-200,693,666.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-171,549,746.75	-295,775,621.63	-467,325,368.38
其中:1.基金申购款	93,383,907.31	151,381,722.08	244,765,629.39
2.基金赎回款	-264,933,654.06	-447,157,343.71	-712,090,997.77
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)	1,496,236,867.69	2,489,208,400.27	3,985,445,267.96

后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:奚星华　主管会计工作负责人:颜锡廉　会计机构负责人:刘美丽

7.4 报表附注

7.4.1 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相一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

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
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	934,220,084.91	9.37	2,933,017,683.23	13.34

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 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12月31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	794,089.27	9.54	469,028.81	15.82
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	2,493,049.89	13.59	479,464.50	13.68

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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	51,344,636.32	63,030,657.00
其中:支付销售机构的客户维护费	10,051,802.42	12,564,789.81

注: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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,557,439.45	10,505,109.44

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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	1.15%	1.15%

7.4.4.4.2 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。

7.4.4.5 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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	207,564,422.47	1,319,496.01	74,212,244.32	3,623,891.69

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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.5 期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601336	新华保险	2011年12月9日	2012年3月16日	新股流通受限	23.25	27.87	17,488	406,596.00	487,390.56	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.5.2 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
600332	广州药业	2011年11月7日	重大资产重组	10.89	-	-	4,379,898	93,807,340.40	47,697,089.22	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 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。

7.4.5.3.2 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	2,434,075,997.52	86.71
	其中:股票	2,434,075,997.52	86.71
2	固定收益投资	145,150,000.00	5.17
	其中:债券	145,150,000.00	5.17
	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	215,748,476.67	7.69
6	其他各项资产	12,168,901.09	0.43
7	合计	2,807,143,375.28	100.00

8.2 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	34,824,655.52	1.24
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,265,407,736.51	45.21
C0	食品、饮料	613,249,153.36	21.91
C1	纺织、服装、皮毛	40,454,556.79	1.45
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	274,186,386.29	9.80
C5	电子	73,186,440.45	2.61
C6	金属、非金属	23,700,000.00	0.85
C7	机械、设备、仪表	192,934,110.40	6.89
C8	医药、生物制品	47,697,089.22	1.70
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	53,841,191.22	1.92
E	建筑业	49,080,000.00	1.75
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	157,145,031.71	5.61
H	批发和零售贸易	59,243,353.92	2.12
I	金融、保险业	564,225,645.08	20.16
J	房地产业	108,265,862.68	3.87
K	社会服务业	89,605,721.82	3.20
L	传播与文化产业	52,436,799.06	1.87
M	综合类	-	-
	合计	2,434,075,997.52	86.97

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	1,380,673	266,884,090.90	9.54
2	600143	金发科技	15,143,875	195,810,303.75	7.00
3	000869	张裕A	1,781,275	192,199,572.50	6.87
4	600036	招商银行	16,000,000	189,920,000.00	6.79
5	601318	中国平安	3,999,883	137,755,970.52	4.92
6	600475	华光股份	9,437,000	122,586,630.00	4.38
7	000858	五粮液	2,946,497	96,645,101.60	3.45
8	600000	浦发银行	10,631,600	90,262,284.00	3.23
9	601166	兴业银行	6,000,000	75,120,000.00	2.68
10	600016	民生银行	12,000,000	70,680,000.00	2.53

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站(http://www.rtfund.com)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票投资明细

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	600143	金发科技	355,299,491.57	8.91
2	002001	新和成	247,140,013.79	6.20
3	000869	张裕A	224,359,369.01	5.63
4	600036	招商银行	207,806,060.22	5.21
5	601318	中国平安	159,812,057.14	4.01
6	000960	锡业股份	157,877,957.70	3.96
7	601166	兴业银行	139,002,327.67	3.