

融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）

（原融通中证军工指数分级证券投资基金）

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）是由“融通中证军工指数分级证券投资基金”转型而来。2020 年 10 月 23 日至 2020 年 10 月 29 日，“融通中证军工指数分级证券投资基金”的管理人融通基金管理有限公司以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》，“融通中证军工指数分级证券投资基金”转型为非分级的指数型基金，基金名称相应变更为“融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）”，融通中证军工指数分级证券投资基金之基础份额、军工股 A 份额及军工股 B 份额均转换为融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）份额。自 2020 年 12 月 1 日起，《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，同日起《中证军工指数分级证券投资基金》失效。

详情请参阅 2020 年 10 月 31 日刊登在指定信息披露媒体上的《关于融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2021 年 3 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。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）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 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。其中：

转型前为 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 11 月 30 日止；

转型后为 2020 年 12 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 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	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料（转型后）	8
2.5 其他相关资料（转型前）	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）	8
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）	9
3.2 基金净值表现（转型后）	9
3.2 基金净值表现（转型前）	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）	12
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告（转型后）	18
§ 6 审计报告（转型前）	20
§ 7 年度财务报表（转型后）	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24

7.4 报表附注	25
§7 年度财务报表（转型前）	45
7.1 资产负债表	45
7.2 利润表	46
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	47
7.4 报表附注	48
§8 投资组合报告（转型后）	70
8.1 期末基金资产组合情况	70
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	71
8.3 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	71
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
8.6 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	74
8.7 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	74
8.8 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	74
8.9 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	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12 投资组合报告附注	75
§8 投资组合报告（转型前）	75
8.1 期末基金资产组合情况	75
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	76
8.3 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	76
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
8.6 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	79
8.7 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	79
8.8 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	79
8.9 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	79
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	80
§9 基金份额持有人信息（转型后）	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
9.3 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情况	81
§9 基金份额持有人信息（转型前）	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
9.3 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情况	82
§10 开放式基金份额变动（转型后）	82
§10 开放式基金份额变动（转型前）	82

§ 11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
11.2 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	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)	85
11.8 其他重大事件（转型后）	88
11.8 其他重大事件（转型前）	89
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	91
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	91
§ 13 备查文件目录	91
13.1 备查文件目录	91
13.2 存放地点	92
13.3 查阅方式	92

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）
基金简称	融通中证云计算与大数据主题指数（LOF）
场内简称	云计算
基金主代码	161628
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2020 年 12 月 1 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	41,422,675.44 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金由原融通中证军工指数分级证券投资基金转型而来，上表中合同生效日为转型后本基金起始运作日。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	融通中证军工指数分级证券投资基金		
基金简称	融通军工分级		
场内简称	融通军工		
基金主代码	161628		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 7 月 1 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	48,121,975.67 份		
基金合同存续期	2015 年 7 月 1 日-2020 年 11 月 30 日		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 13 日		
下属分级基金的基金简称	融通军工分级	军工股 A	军工股 B
下属分级基金的场内简称	融通军工	军工股 A	军工股 B
下属分级基金的交易代码	161628	150335	150336
报告期末下属分级基金的份额总额	31,285,957.67 份	8,418,009.00 份	8,418,009.00 份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证云计算与大数据主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。

	当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为导致成份股的构成及权重发生变化时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×中证云计算与大数据主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证军工指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证军工价格指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，融通军工A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；融通军工B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。	融通军工股A份额为稳健收益类份额，具有低预期风险、预期收益相对稳定的风险收益特征	融通军工股B份额为积极收益类份额，具有高预期风险、预期收益相对较高的风险收益特征。

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	李申
	联系电话	(0755) 26948666	(021) 60637102
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	(021) 60637111
传真		(0755) 26935005	(021) 60635778
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、15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	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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

2.5 其他相关资料(转型后)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、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(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	4,948,412.86
本期利润	-150,186.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0035
本期加权平均净值利润率	-0.28%
本期基金份额净值增长率	-0.47%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	-6,955,904.02
期末可供分配基金份额利润	-0.1679
期末基金资产净值	51,371,278.31
期末基金份额净值	1.2402
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-0.47%

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）。

（4）本基金由原融通中证军工指数分级证券投资基金转型而来,上表中合同生效日为转型后本基金起始运作日。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020年1月1日-2020年11月30日	2019年	2018年
本期已实现收益	17,030,278.40	-1,135,021.50	-32,402,279.34
本期利润	30,544,688.67	17,327,336.34	-28,675,294.66
加权平均基金份额本期利润	0.3908	0.1692	-0.2581
本期加权平均净值利润率	39.54%	20.21%	-30.04%
本期基金份额净值增长率	51.77%	23.06%	-27.70%
3.1.2 期末数据和指标	2020年11月30日	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	-12,983,282.42	-59,265,208.09	-77,408,780.32
期末可供分配基金份额利润	-0.2698	-0.5890	-0.7045
期末基金资产净值	59,975,901.07	82,574,581.31	75,792,312.72
期末基金份额净值	1.2460	0.8210	0.6900
3.1.3 累计期末指标	2020年11月30日	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	-7.61%	-39.13%	-50.53%

注：（1）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。

（2）本报告所列示的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。

（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）。

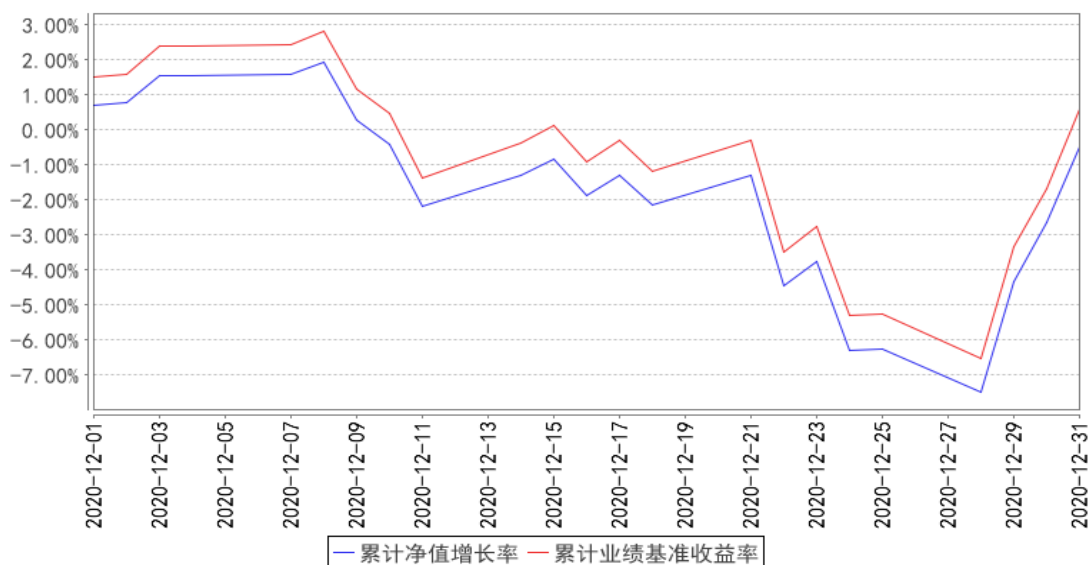
3.2 基金净值表现（转型后）

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
2020.12.1至2020.12.31日	-0.47%	1.52%	0.59%	1.55%	-1.06%	-0.03%

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

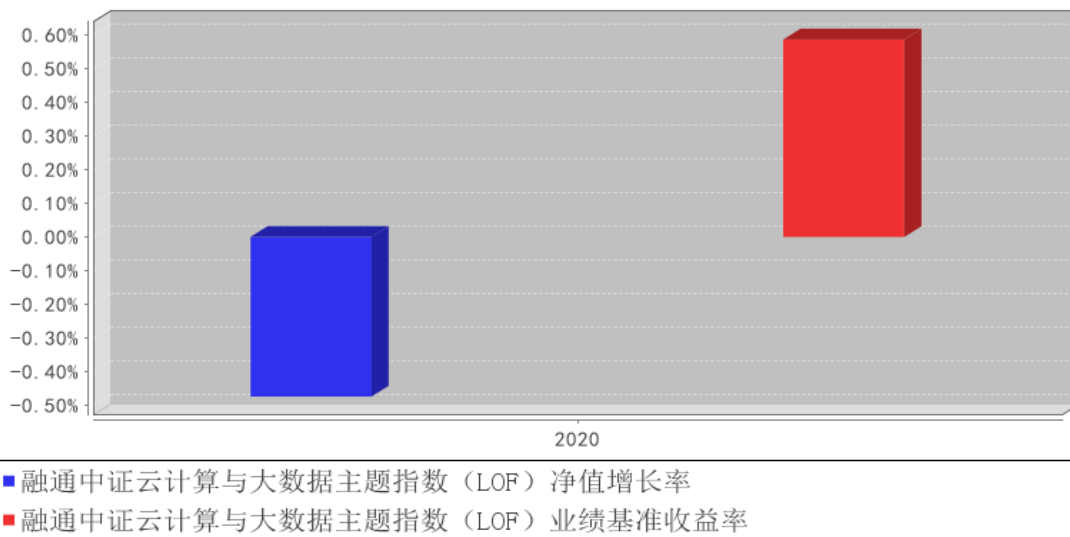
融通中证云计算与大数据主题指数（LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金转型后的基金合同生效日为 2020 年 12 月 1 日，至报告期末基金转型未满一年。

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

融通中证云计算与大数据主题指数（LOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金由原融通中证军工指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2020 年 12 月 1 日，转型当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

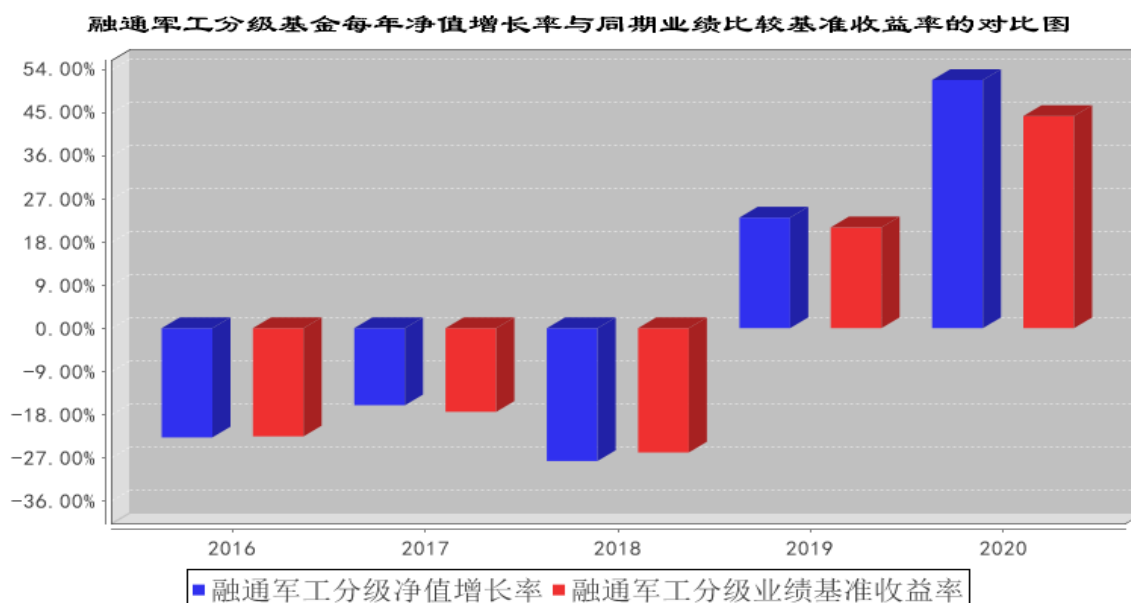
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④

	率①	准差②		④		
2020年10月1日至 2020年11月30日	7.14%	1.60%	3.65%	1.71%	3.49%	-0.11%
过去六个月	38.14%	2.37%	32.10%	2.40%	6.04%	-0.03%
过去一年	51.77%	2.16%	44.26%	2.18%	7.51%	-0.02%
过去三年	35.03%	1.82%	29.33%	1.83%	5.70%	-0.01%
过去五年	-12.50%	1.77%	-17.32%	1.74%	4.82%	0.03%
自基金合同生效起 至今	-7.61%	1.81%	-31.35%	2.01%	23.74%	-0.20%

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



3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

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
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

根据本基金基金合同约定，本基金（包括：融通中证军工份额、军工股 A 份额、军工股 B 份额）不进行收益分配。

§ 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（NikkoAssetManagementCo., Ltd.）40%。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司共管理七十六只开放式基金：即融通新蓝筹证券投资基金、融通债券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)、融通易支付货币市场证券投资基金、融通动力先锋混合型证券投资基金、融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通深证成份指数证券投资基金、融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通医疗保健行业混合型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放

债券型证券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通通鑫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、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇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、融通汇财宝货币市场基金、融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通通和债券型证券投资基金、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券型证券投资基金、融通可转债债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金（LOF）、融通通宸债券型证券投资基金、融通通玺债券型证券投资基金、融通通润债券型证券投资基金、融通中证人工智能主题指数证券投资基金（LOF）、融通收益增强债券型证券投资基金、融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增悦债券型证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、融通研究优选混合型证券投资基金、融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金、融通通慧混合型证券投资基金、融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增强收益债券型证券投资基金、融通消费升级混合型证券投资基金、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增享纯债债券型证券投资基金、融通产业趋势股票型证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通产业趋势先锋股票型证券投资基金、融通通益混合型证券投资基金、融通通远三个月定期开放债券型证券投资基金、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、融通产业趋势臻选股票型证券投资基金、融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）。其中，融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资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（转型后）

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		
何天翔	本基金的基金经理、指数与量化投资部副总监（主持工作）	2020 年 12 月 1 日	-	12 年	何天翔先生，厦门大学经济学硕士，12 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2008 年 7 月至 2010 年 3 月就职于华泰联合证券有限责任公司任金融工程分析师。2010 年 3 月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资经理、融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证军工指数分级证券投资基金基金经理、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，现任指数与量化投资部副总监、融通深证 100 指数证券投资基金基金经理、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、融通中证人工智能主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金经理。

注：任免日期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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

4.1.3 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
何天翔	本基金的基金经理、指数与量化投资部副总监（主持工作）	2015 年 7 月 1 日	2020 年 11 月 30 日	12 年	何天翔先生，厦门大学经济学硕士，12 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2008 年 7 月至 2010 年 3 月就职于华泰联合证券有限责任公司任金融工程分析师。2010 年 3 月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资经理、融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任指数与量化投资部副总监、融通深证 100 指数证券投资基金基金经理、融通中证军

					工指数分级证券投资基金基金经理、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、融通中证人工智能主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：任免日期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、基金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

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 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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

本基金报告期内由原融通中证军工指数分级基金转型而来，基金合同生效日为 2020 年 12 月 1 日，转型前的投资策略为：在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作始终。本基金运用指数化投资策略，通过控制股票投资权重与中证军工指数成份股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供投资中证军工指数的一个有效工具。转型后的投资策略为：在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作始终。本基金运用指数化投资策略，通过控制股票投资权重与中证云计算与大数据主题指数成份股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供投资中证云计算与大数据主题指数的一个有效工具。

本报告期内，转型前基金日均跟踪偏离为 0.07%，年化跟踪误差为 1.99%，符合基金合同约定。转型后，本基金日均跟踪偏离为 0.06%，年化跟踪误差为 2.55%，符合基金合同约定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后（2020 年 12 月 1 日 — 2020 年 12 月 31 日）：

本报告期基金份额净值收益率为-0.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.59%。

转型前（2020 年 1 月 1 日 — 2020 年 11 月 30 日）：

本报告期基金份额净值收益率为 51.77%，同期业绩比较基准收益率为 44.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年宏观经济经受多重因素扰动，最终全年 GDP 实现了 2.3% 的增长，根据最新中央经济工作会议指出，明年宏观政策要保持连续性、稳定性、可持续性，要继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，保持对经济恢复的必要支持力度，政策操作上要更加精准有效，不急转弯，把握好政策时度效。虽然整体经济压力持续，但投资，消费和出口等领域均有细分板块表现出良好的增长，中国甚至在一些全球性的产业趋势机会中，创造出了领先性的优势，这将为中国经济发展提供中长期动力。因此，我们判断 2021 年中国经济或将保持稳定增长。

证券市场在 2020 年整体呈现了不错的收益，但同时结构分化也很大，资金在少数龙头股票集中，从量化多因子视角看，收入和利润增长率，净资产收益率，以及一致预期类等因子的表现较好，且是对 2019 年的大致延续，说明了投资者对高增长、确定性，和稀缺资产的青睐，我们判断这种结构化趋势将长期存在，寻找这类资产将是基金管理人的主要工作之一。

再看中证云计算与大数据主题指数，全年指数收益率 13.48%，涨幅一般，这与市场的整体风格偏好有一定关系，近几年云计算与大数据行业的基础设施建设快速发展，云端服务和大数据运

用也伴随算力、5G、运用场景等不断提升而快速发展，值得中长期看好。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

4.7 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、参考独立第三方估值服务机构的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与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。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。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

4.9 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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（转型后）

普华永道中天审字(2021)第 22165 号

融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金 (LOF) (原融通中证军工指数分级证券投资基金)

全体基金份额持有人：

一、 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金 (LOF) (原融通中证军工指数分级证券投资基金，以下简称“融通中证云计算与大数据指数基金 (LOF)”) 的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 12 月 1 日 (基金转型生效日) 至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国

基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了融通中证云计算与大数据指数基金(LOF)2020年12月31日的财务状况以及2020年12月1日(基金转型生效日)至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于融通中证云计算与大数据指数基金(LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。

三、管理层和治理层对财务报表的责任

融通中证云计算与大数据指数基金(LOF)的基金管理人融通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估融通中证云计算与大数据指数基金(LOF)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算融通中证云计算与大数据指数基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督融通中证云计算与大数据指数基金(LOF)的财务报告过程。

四、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性

发表意见。

（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对融通中证云计算与大数据指数基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致融通中证云计算与大数据指数基金（LOF）不能持续经营。

（五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天

注册会计师 薛 竞

会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师 陈 邈 迺

中国·上海市

2021 年 3 月 25 日

§ 6 审计报告（转型前）

普华永道中天审字(2021)第 22146 号

融通中证军工指数分级证券投资基金全体基金份额持有人：

一、 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了融通中证军工指数分级证券投资基金（以下简称“融通军工分级基金”）的财务报表，包括 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）的资产负债表，2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了融通军工分级基金 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）止期间的经营成果和基金净值变动情况。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于融通军工分级基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

三、管理层和治理层对财务报表的责任

融通军工分级基金的基金管理人融通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估融通军工分级基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算融通军工分级基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督融通军工分级基金的财务报告过程。

四、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，

就可能导致对融通军工分级基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致融通军工分级基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天
会计师事务所(特殊普通合伙)
中国·上海市
2021 年 3 月 25 日

注册会计师 薛 竞
注册会计师 陈 邈 迺

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	3,194,724.80
结算备付金		-
存出保证金		11,878.55
交易性金融资产	7.4.7.2	48,484,732.93
其中：股票投资		48,484,732.93
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		203,243.50
应收利息	7.4.7.5	348.97
应收股利		-

应收申购款		352,912.40
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		52,247,841.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		475,167.93
应付管理人报酬		45,040.25
应付托管费		9,908.86
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	125,567.15
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	220,878.65
负债合计		876,562.84
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	55,843,757.17
未分配利润	7.4.7.10	-4,472,478.86
所有者权益合计		51,371,278.31
负债和所有者权益总计		52,247,841.15

注:1. 报告截止日 2020 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.2402 元,基金份额总额 41,422,675.44 份。

2. 本基金由原融通中证军工指数分级证券投资基金转型而来,基金合同生效日为 2020 年 12 月 1 日,2020 年度实际报告期间为 2020 年 12 月 1 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。截止报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体:融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2020 年 12 月 1 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020 年12月31日
----	-----	---

一、收入		86,847.11
1. 利息收入		1,610.20
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,610.20
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益		5,160,821.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,164,256.69
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-3,435.59
3. 公允价值变动收益	7.4.7.17	-5,098,599.58
4. 汇兑收益		-
5. 其他收入	7.4.7.18	23,015.39
减：二、费用		237,033.83
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	45,040.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,908.86
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	118,702.37
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	63,382.35
三、利润总额		-150,186.72
减：所得税费用		-
四、净利润		-150,186.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 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）	64,875,506.22	-4,899,605.15	59,975,901.07
二、本期经营活动产生	-	-150,186.72	-150,186.72

的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-9,031,749.05	577,313.01	-8,454,436.04
其中：1. 基金申购款	4,655,377.62	-494,814.94	4,160,562.68
2. 基金赎回款	-13,687,126.67	1,072,127.95	-12,614,998.72
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）	55,843,757.17	-4,472,478.86	51,371,278.31

报表附注为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：

张帆

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是由融通中证军工指数分级证券投资基金（以下简称“原基金”）转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1151号《关于准予融通中证军工指数分级证券投资基金注册的批复》核准，由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和由《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 370,629,296.14 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2015）第 846 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 370,677,558.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 48,261.94 份基金份额。原基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原基金经中国证监会证监许可[2018]2037号《关于准予融通中证军工指数分级证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册为本基金。根据基金管理人于 2020 年 10 月 31 日发布的《关于融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》基金份额持有人大会于 2020 年 10 月 30 日表决通过了《关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》。根据该议案，经与基金托管人协商一致，基金管理人将《融通中证军

工指数分级证券投资基金基金合同》、《融通中证军工指数分级证券投资基金托管协议》修订为《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此拟定《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。上述修订后的文件自 2020 年 12 月 1 日起正式生效。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资标的指数成份股和备选成份股不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金业绩比较基准为： $95\% \times$ 中证云计算与大数据主题指数收益率 $+ 5\% \times$ 银行人民币活期存款利率（税后）。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（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〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 12 月 1 日（基金转型生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 12 月 1 日（基金转型生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 12 月 1 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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》、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政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，股票的股息、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，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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	3,194,724.80
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	3,194,724.80

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	48,334,444.72	48,484,732.93	150,288.21
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	48,334,444.72	48,484,732.93	150,288.21

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	343.14
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	5.83
合计	348.97

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	125,567.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	125,567.15

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	878.65
应付证券出借违约金	-
预提费用	120,000.00
应付指数使用费	100,000.00
合计	220,878.65

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	48,121,975.67	64,875,506.22

本期申购	3,453,192.65	4,655,377.62
本期赎回（以“-”号填列）	-10,152,492.88	-13,687,126.67
本期末	41,422,675.44	55,843,757.17

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至 2020 年 12 月 31 日止，本基金托管在深交所场内未上市的基金份额为 13,380,082.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 28,042,593.44 份。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，其中上市的基金份额可选择按市价流通，未上市的基金份额可按基金份额净值申购赎回；场外未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回，通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	-12,983,282.42	8,083,677.27	-4,899,605.15
本期利润	4,948,412.86	-5,098,599.58	-150,186.72
本期基金份额交易产生的变动数	1,078,965.54	-501,652.53	577,313.01
其中：基金申购款	-565,248.62	70,433.68	-494,814.94
基金赎回款	1,644,214.16	-572,086.21	1,072,127.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,955,904.02	2,483,425.16	-4,472,478.86

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,593.79
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	-
其他	16.41
合计	1,610.20

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	30,062,640.49
减：卖出股票成本总额	24,898,383.80
买卖股票差价收入	5,164,256.69

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	-3,435.59
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	-3,435.59

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年12月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-5,098,599.58
股票投资	-5,098,599.58
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,098,599.58

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	22,911.88
基金转换费收入	103.51
合计	23,015.39

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	118,702.37
银行间市场交易费用	-
合计	118,702.37

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	8,618.45
信息披露费	6,775.70
证券出借违约金	-
银行费用	503.69
指数使用费	47,484.51
合计	63,382.35

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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（“融通基金”）	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、基金销售机构
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳市融通资本管理股份有限公司（“融通资本”）	本基金管理人能实施重大影响的联营企业

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、融通资本为融通基金持有 52.575% 股权比例的基金管理公司子公司。

7.4.10 本报告期的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	45,040.25
其中：支付销售机构的客户维护费	10,941.30

注：1、支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 × 1.00% / 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,908.86

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 0.22% 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 × 0.22% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 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 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,194,724.80	1,593.79

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金主要投资于标的指数的成份股票，包括中证云计算与大数据主题指数的成份股和预期将要被选入中证云计算与大数据主题指数的股票。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的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内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略；审议重大事件、重大决策的风险评估意见，审批重大风险的解决方案，批准公司基本风险管理制度；审议公司风险管理报告。在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

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，执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理制度和流程的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标；对风

险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和 risk 管理制度，并对风险管理决策和 risk 管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

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，确保既定的风险管理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。

7.4.13.2 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人中国建设银行，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 2020 年 12 月 31 日，本基金无债券投资。

7.4.13.3 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。

于 2020 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 12 月 31 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	3,194,724.80	-	-	-	3,194,724.80
存出保证金	11,878.55	-	-	-	11,878.55
交易性金融资产	-	-	-	48,484,732.93	48,484,732.93
应收利息	-	-	-	348.97	348.97
应收申购款	-	-	-	352,912.40	352,912.40
应收证券清算款	-	-	-	203,243.50	203,243.50
资产总计	3,206,603.35	-	-	49,041,237.80	52,247,841.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	475,167.93	475,167.93
应付管理人报酬	-	-	-	45,040.25	45,040.25
应付托管费	-	-	-	9,908.86	9,908.86
应付交易费用	-	-	-	125,567.15	125,567.15
其他负债	-	-	-	220,878.65	220,878.65
负债总计	-	-	-	876,562.84	876,562.84
利率敏感度缺口	3,206,603.35	-	-	48,164,674.96	51,371,278.31

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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股票，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。

本基金运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合中证云计算与大数据主题指数的跟踪误差，力求实现对中证云计算与大数据主题指数的有效跟踪。风险管理部负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资标的指数成份股和备选成份股不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	48,484,732.93	94.38
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	48,484,732.93	94.38

7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证云计算与大数据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 （2020 年 12 月 31 日）
1. 中证云计算与大数据指数上升 5%	2,374,865.84
2. 中证云计算与大数据指数下降 5%	-2,374,865.84

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 48,484,732.93 元，无属于第二或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：融通中证军工指数分级证券投资基金

报告截止日：2020年11月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,001,708.14	3,169,909.84
结算备付金		-	-
存出保证金		7,967.75	3,881.81
交易性金融资产	7.4.7.2	20,512,728.55	80,780,756.23
其中：股票投资		20,512,728.55	78,161,256.23
基金投资		-	-
债券投资		-	2,619,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		36,052,799.72	-
应收利息	7.4.7.5	9,842.78	38,554.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	5,308.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		60,585,046.94	83,998,410.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	794,017.64
应付赎回款		344,285.81	361,423.16
应付管理人报酬		51,037.05	69,382.30
应付托管费		11,228.10	15,264.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	44,739.06	12,761.53
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	157,855.85	170,980.41
负债合计		609,145.87	1,423,829.14
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	64,875,506.22	135,664,449.93
未分配利润	7.4.7.10	-4,899,605.15	-53,089,868.62
所有者权益合计		59,975,901.07	82,574,581.31
负债和所有者权益总计		60,585,046.94	83,998,410.45

注：1. 报告截止日 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日），融通中证军工指数分级证券投资基金（以下简称“融通军工分级基金”）之基础份额净值 1.246 元，融通军工分级基金之 A 份额参考净值 1.053 元，融通军工分级基金之 B 份额参考净值 1.439 元；基金份额总额 48,121,975.67 份，其中融通军工分级基金之基础份额 31,285,957.67 份，融通军工分级基金之 A 份额 8,418,009.00 份，融通军工分级基金之 B 份额 8,418,009.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）止期间。

7.2 利润表

会计主体：融通中证军工指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		31,953,493.66	18,827,718.83
1. 利息收入		38,051.49	55,408.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	29,064.54	34,564.46
债券利息收入		8,986.95	20,844.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		18,241,214.99	258,824.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	17,905,667.35	-21,409.94
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	36,598.37	-160.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-

股利收益	7.4.7.16	298,949.27	280,394.46
3. 公允价值变动收益	7.4.7.17	13,514,410.27	18,462,357.84
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.18	159,816.91	51,127.63
减：二、费用		1,408,804.99	1,500,382.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	705,777.08	856,363.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	155,270.97	188,399.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	211,271.45	72,590.69
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.12	-
7. 其他费用	7.4.7.20	336,485.37	383,027.84
三、利润总额		30,544,688.67	17,327,336.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润		30,544,688.67	17,327,336.34

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中证军工指数分级证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年11月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11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)	135,664,449.93	-53,089,868.62	82,574,581.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,544,688.67	30,544,688.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-70,788,943.71	17,645,574.80	-53,143,368.91
其中：1. 基金申购款	101,216,169.49	-15,340,527.47	85,875,642.02
2. 基金赎回款	-172,005,113.20	32,986,102.27	-139,019,010.93
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)	64,875,506.22	-4,899,605.15	59,975,901.07
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	153,201,093.04	-77,408,780.32	75,792,312.72

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,327,336.34	17,327,336.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-17,536,643.11	6,991,575.36	-10,545,067.75
其中：1. 基金申购款	42,665,347.89	-15,865,667.19	26,799,680.70
2. 基金赎回款	-60,201,991.00	22,857,242.55	-37,344,748.45
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）	135,664,449.93	-53,089,868.62	82,574,581.31

报表附注为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：

张帆

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

融通中证军工指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015] 1151 号《关于准予融通中证军工指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 370,629,296.14 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 846 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 370,677,558.08 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,261.94 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,根据对基金财产及收益分配的不同安排,本基金的基金份额具有不同的风险收益特征,本基金的基金份额包括融通中证军工指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“融通军工份额”)、融通中证军工指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“融通军工 A 份额”)及融通中证军工指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“融通军工 B 份额”)。投资人在场外认/申购的融通军工份额不进行基金份额分拆;投资人在场内认购的融通军工份额将在基金发售结束后进行基金份额自动分

离；投资人在场内申购的融通军工份额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆。融通军工 A 份额指融通军工份额按基金合同约定规则所自动分离或分拆的稳健收益类基金份额。融通军工 B 份额指融通军工份额按基金合同约定规则所自动分离或分拆的积极收益类基金份额。融通军工 A 份额、融通军工 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。本基金的基金份额初始公开发售结束后，场外认购的全部份额确认为融通军工份额；场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为融通军工 A 份额与融通军工 B 份额。本基金基金合同生效后，融通军工份额与融通军工 A 份额、融通军工 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的融通军工份额按照 2 份融通军工份额对应 1 份融通军工 A 份额与 1 份融通军工 B 份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的融通军工 A 份额与融通军工 B 份额按照 1 份融通军工 A 份额与 1 份融通军工 B 份额对应 2 份融通军工份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：融通军工份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额的份额数之和。融通军工 A 份额的基金份额净值为融通军工 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份融通军工份额所代表的基金资产净值等于 1 份融通军工 A 份额和 1 份融通军工 B 份额的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日），本基金将进行融通军工 A 份额和融通军工份额的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，融通军工 A 份额与融通军工 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。基金份额折算基准日折算前融通军工 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为融通军工份额的场内份额分配给融通军工 A 份额持有人。融通军工份额持有人持有的每两份融通军工份额将按一份融通军工 A 份额获得新增融通军工份额的分配。持有场外融通军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外融通军工份额的分配；持有场内融通军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内融通军工份额的分配。经过上述份额折算，融通军工 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，融通军工份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在融通军工份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上、融通军工 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下时进行不定期份额折算。当融通军工份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将分别对融通军工 B 份额和融通军工份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的比例为 1:1，份额折算后融通军工 B 份额的基金份额参考净值和融通军工份额的基金份额净值超过融通军工 A 份额的基金份额

参考净值的部分，折算成场内的融通军工份额。份额折算后融通军工份额的基金份额净值、融通军工 B 份额的基金份额参考净值与折算基准日融通军工 A 份额的基金份额参考净值三者相等。当融通军工 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金将分别对融通军工 A 份额、融通军工 B 份额和融通军工份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的比例为 1:1，份额折算后融通军工份额的基金份额净值、融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。融通军工份额、融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第 337 号文审核同意，本基金融通军工 A 份额 98,485,962.00 份基金份额和融通军工 B 份额 98,485,962.00 份基金份额于 2015 年 7 月 13 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的融通军工份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为融通军工 A 份额和融通军工 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的融通军工份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为融通军工 A 份额和融通军工 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证军工指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准：95%X 中证军工价格指数收益率+5%X 银行人民币活期存款利率(税后)。

根据《关于融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》融通中证军工指数分级证券投资基金自 2020 年 12 月 1 日起转型为融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金(LOF)。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准，基金管理人融通基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）止期间的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 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，在存续期内，本基金（包括融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额）不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业

务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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》、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政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，股票的股息、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，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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2020 年 11 月 30 日	
	上年度末	
	2019 年 12 月 31 日	
活期存款	4,001,708.14	3,169,909.84
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	4,001,708.14	3,169,909.84

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2020 年 11 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,263,840.76	20,512,728.55	5,248,887.79
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	15,263,840.76	20,512,728.55	5,248,887.79

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	86,430,418.71	78,161,256.23	-8,269,162.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,615,860.00	2,619,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,615,860.00	2,619,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	89,046,278.71	80,780,756.23	-8,265,522.48

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	9,819.16	516.06
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	-	-
应收债券利息	-	38,036.22
应收资产支持证券利息	-	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	23.62	1.98
合计	9,842.78	38,554.26

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	44,739.06	12,761.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	44,739.06	12,761.53

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	734.51	980.41
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	104,605.85	120,000.00
应付指数使用费	52,515.49	50,000.00
合计	157,855.85	170,980.41

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	100,617,862.80	135,664,449.93
本期申购	75,063,692.56	101,216,169.49
本期赎回（以“-”号填列）	-127,559,578.69	-172,005,113.20
本期末	48,121,975.67	64,875,506.22

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据《关于融通中证军工指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告》、《融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额转换结果公告》、《关于融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的相关规定，为实施转型，基金管理人将向深圳证券交易所申请融通军工 A 份额、融通军工 B 份额终止上市业务。转型后的本基金将不再设置基金份额的分级。基金管理人以 2020 年 11 月 30 日作为份额转换基准日，在份额转换基准日进行本基金的份额转换。在基金份额转换基准日日终，以融通军工份额的基金份额净值为基准，融通军工 A 份额、融通军工 B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成融通军工份额的场内份额。

3. 截至 2020 年 11 月 30 日（基金转型日前日）止，本基金托管在深交所场内未上市的基金份额为 21,236,505.00 份（2019 年 12 月 31 日：6,064,142.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 26,885,470.67 份（2019 年 12 月 31 日：51,828,254.80 份）。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，其中上市的基金份额可选择按市价流通，未上市的基金份额可按基金份额净值申

购赎回；场外未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回，通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 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	-59,265,208.09	6,175,339.47	-53,089,868.62
本期利润	17,030,278.40	13,514,410.27	30,544,688.67
本期基金份额交易产生的变动数	29,251,647.27	-11,606,072.47	17,645,574.80
其中：基金申购款	-38,507,957.17	23,167,429.70	-15,340,527.47
基金赎回款	67,759,604.44	-34,773,502.17	32,986,102.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,983,282.42	8,083,677.27	-4,899,605.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
活期存款利息收入	28,799.47	34,172.92
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	175.81	293.96
其他	89.26	97.58
合计	29,064.54	34,564.46

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
卖出股票成交总额	100,303,829.33	29,300,862.71
减：卖出股票成本总额	82,398,161.98	29,322,272.65
买卖股票差价收入	17,905,667.35	-21,409.94

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,862,382.67	810,609.97
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,778,759.06	804,880.00

减：应收利息总额	47,025.24	5,889.97
买卖债券差价收入	36,598.37	-160.00

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	298,949.27	280,394.46
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	298,949.27	280,394.46

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至 2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
1. 交易性金融资产	13,514,410.27	18,462,357.84
股票投资	13,518,050.27	18,458,717.84
债券投资	-3,640.00	3,640.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	13,514,410.27	18,462,357.84

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
基金赎回费收入	159,112.05	49,777.24
基金转换费收入	704.86	1,350.39
合计	159,816.91	51,127.63

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金赎回费用的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
交易所市场交易费用	211,271.45	72,590.69
银行间市场交易费用	-	-
合计	211,271.45	72,590.69

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
审计费用	31,381.55	40,000.00
信息披露费	73,224.30	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	4,364.03	3,027.84
指数使用费	152,515.49	200,000.00
上市费	55,000.00	60,000.00
律师费	10,000.00	-
公证费	10,000.00	-
合计	336,485.37	383,027.84

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《关于融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，融通中证军工指数分级证券投资基金自 2020 年 12 月 1 日起转型为融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金 (LOF)。

7.4.9 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（“融通基金”）	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、基金销售机构
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东

融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳市融通资本管理股份有限公司（“融通资本”）	本基金管理人能实施重大影响的联营企业

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、融通资本为融通基金持有 52.575% 股权比例的基金管理公司子公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	705,777.08	856,363.99
其中：支付销售机构的客户维护费	134,513.28	173,424.96

注：1、支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 × 1.00% / 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	155,270.97	188,399.97

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 0.22% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年11月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	4,001,708.14	28,799.47	3,169,909.84	34,172.92

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020年11月30日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。本基金采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略；审议重大事件、重大决策的风险评估意见，审批重大风险的解决方案，批准公司基本风险管理制度；审议公司风险管理报告。在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风

险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

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，执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理制度和流程的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标；对风险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和风险管理制度，并对风险管理决策和风险管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

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，确保既定的风险管理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。

7.4.13.2 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人中国建设银行，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 2020 年 11 月 30 日(基金转型日前日)，本基金无债券投资(2019 年 12 月 31 日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

7.4.13.3 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。

于 2020 年 11 月 30 日(基金转型日前日)，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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 11 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 11 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年11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	4,001,708.14	-	-	-	4,001,708.14
存出保证金	7,967.75	-	-	-	7,967.75
交易性金融资产	-	-	-	20,512,728.55	20,512,728.55
应收利息	-	-	-	9,842.78	9,842.78
应收证券清算款	-	-	-	36,052,799.72	36,052,799.72
资产总计	4,009,675.89	-	-	56,575,371.05	60,585,046.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	344,285.81	344,285.81
应付管理人报酬	-	-	-	51,037.05	51,037.05
应付托管费	-	-	-	11,228.10	11,228.10

应付交易费用	-	-	-	44,739.06	44,739.06
其他负债	-	-	-	157,855.85	157,855.85
负债总计	-	-	-	609,145.87	609,145.87
利率敏感度缺口	4,009,675.89	-	-	-55,966,225.18	59,975,901.07
上年度末 2019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	3,169,909.84	-	-	-	3,169,909.84
存出保证金	3,881.81	-	-	-	3,881.81
交易性金融资产	2,619,500.00	-	-	-78,161,256.23	80,780,756.23
应收利息	-	-	-	38,554.26	38,554.26
应收申购款	-	-	-	5,308.31	5,308.31
资产总计	5,793,291.65	-	-	-78,205,118.80	83,998,410.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	361,423.16	361,423.16
应付管理人报酬	-	-	-	69,382.30	69,382.30
应付托管费	-	-	-	15,264.10	15,264.10
应付证券清算款	-	-	-	794,017.64	794,017.64
应付交易费用	-	-	-	12,761.53	12,761.53
其他负债	-	-	-	170,980.41	170,980.41
负债总计	-	-	-	1,423,829.14	1,423,829.14
利率敏感度缺口	5,793,291.65	-	-	-76,781,289.66	82,574,581.31

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年11月30日(基金转型日前日),本基金未持有交易性债券投资(2019年12月31日:本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为3.17%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日:同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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的股票,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。

本基金采用完全复制法进行投资,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,

并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证军工指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月30日		上年度末 2019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	20,512,728.55	34.20	78,161,256.23	94.66
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	20,512,728.55	34.20	78,161,256.23	94.66

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证军工价格指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2020年11月30日）	上年度末 （2019年12月31日）
	1. 中证军工价格指数收益率上升 5%	2,817,811.90	3,883,450.19
2. 中证军工价格指数收益率下降 5%	-2,817,811.90	-3,883,450.19	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 11 月 30 日(基金转型日前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 20,512,728.55 元，无属于第二或第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 77,229,587.91 元，第二层次 3,551,168.32 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 11 月 30 日(基金转型日前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告（转型后）

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	48,484,732.93	92.80
	其中：股票	48,484,732.93	92.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,194,724.80	6.11
8	其他各项资产	568,383.42	1.09
9	合计	52,247,841.15	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,131,599.62	25.56
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	35,044,763.31	68.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	308,370.00	0.60
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	48,484,732.93	94.38

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600570	恒生电子	49,760	5,219,824.00	10.16
2	002410	广联达	56,491	4,448,101.34	8.66
3	600588	用友网络	97,400	4,272,938.00	8.32
4	300454	深信服	11,900	2,951,319.00	5.75
5	000063	中兴通讯	74,100	2,493,465.00	4.85
6	603019	中科曙光	60,500	2,070,915.00	4.03
7	300253	卫宁健康	102,800	1,799,000.00	3.50
8	000977	浪潮信息	60,600	1,628,928.00	3.17

9	000938	紫光股份	75,230	1,538,453.50	2.99
10	300308	中际旭创	29,700	1,510,542.00	2.94
11	300383	光环新网	65,800	1,129,786.00	2.20
12	000988	华工科技	47,900	1,110,801.00	2.16
13	300168	万达信息	49,500	1,073,655.00	2.09
14	600845	宝信软件	15,400	1,062,292.00	2.07
15	300271	华宇软件	39,675	947,042.25	1.84
16	002065	东华软件	111,400	924,620.00	1.80
17	300017	网宿科技	120,900	833,001.00	1.62
18	300502	新易盛	15,000	832,200.00	1.62
19	002281	光迅科技	25,300	734,712.00	1.43
20	300212	易华录	23,300	714,145.00	1.39
21	603039	泛微网络	6,700	676,432.00	1.32
22	300188	美亚柏科	29,900	644,046.00	1.25
23	002396	星网锐捷	27,902	643,420.12	1.25
24	002368	太极股份	24,200	631,862.00	1.23
25	600410	华胜天成	68,400	606,024.00	1.18
26	002153	石基信息	19,100	593,819.00	1.16
27	300348	长亮科技	30,600	581,400.00	1.13
28	300166	东方国信	50,300	550,785.00	1.07
29	002123	梦网集团	38,600	549,278.00	1.07
30	002467	二六三	84,500	501,930.00	0.98
31	600797	浙大网新	64,700	450,312.00	0.88
32	300394	天孚通信	7,600	405,308.00	0.79
33	002261	拓维信息	54,600	390,390.00	0.76
34	300339	润和软件	38,900	380,831.00	0.74
35	603881	数据港	5,800	348,638.00	0.68
36	300170	汉得信息	43,400	341,124.00	0.66
37	300624	万兴科技	5,700	315,723.00	0.61
38	002912	中新赛克	5,400	312,984.00	0.61
39	600756	浪潮软件	19,900	310,241.00	0.60
40	300662	科锐国际	5,700	308,370.00	0.60
41	300738	奥飞数据	8,100	282,690.00	0.55
42	300768	迪普科技	7,200	262,008.00	0.51
43	600602	云赛智联	39,900	224,238.00	0.44
44	300578	会畅通讯	4,700	188,282.00	0.37
45	002530	金财互联	23,300	181,740.00	0.35
46	300229	拓尔思	21,200	177,232.00	0.35
47	603887	城地股份	9,512	167,030.72	0.33
48	300548	博创科技	4,700	162,855.00	0.32

8.3.2 期末积极投资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

无。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600570	恒生电子	5,011,959.00	9.76
2	600588	用友网络	4,863,197.00	9.47
3	002410	广联达	4,240,187.24	8.25
4	000063	中兴通讯	2,844,225.00	5.54
5	300454	深信服	2,703,972.00	5.26
6	603019	中科曙光	2,479,659.00	4.83
7	000938	紫光股份	2,168,385.67	4.22
8	000977	浪潮信息	1,982,023.00	3.86
9	300253	卫宁健康	1,874,862.00	3.65
10	300308	中际旭创	1,620,295.00	3.15
11	300383	光环新网	1,422,972.00	2.77
12	000988	华工科技	1,395,914.00	2.72
13	300168	万达信息	1,341,887.00	2.61
14	002065	东华软件	1,217,524.00	2.37
15	300271	华宇软件	1,178,226.50	2.29
16	600845	宝信软件	1,076,715.00	2.10
17	300017	网宿科技	1,054,323.00	2.05
18	300502	新易盛	952,330.00	1.85
19	002281	光迅科技	875,505.00	1.70
20	300002	神州泰岳	845,563.00	1.65

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000768	中航西飞	1,537,342.24	2.99
2	600893	航发动力	1,478,256.62	2.88
3	002179	中航光电	1,151,371.00	2.24
4	601989	中国重工	1,147,244.97	2.23
5	000547	航天发展	1,025,046.00	2.00
6	600760	中航沈飞	885,264.35	1.72
7	002414	高德红外	813,839.70	1.58
8	002465	海格通信	771,450.28	1.50
9	300002	神州泰岳	725,561.00	1.41

10	600804	鹏博士	725,466.00	1.41
11	600118	中国卫星	704,308.92	1.37
12	002013	中航机电	673,145.16	1.31
13	600570	恒生电子	672,254.00	1.31
14	300699	光威复材	660,622.32	1.29
15	000034	神州数码	623,371.00	1.21
16	000733	振华科技	604,887.00	1.18
17	600316	洪都航空	560,743.00	1.09
18	600588	用友网络	555,406.00	1.08
19	600038	中直股份	549,407.37	1.07
20	002025	航天电器	519,257.90	1.01

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。

8.4.3 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	57,968,987.76
卖出股票收入（成交）总额	30,062,640.49

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 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

无。

8.7 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

无。

8.8 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

无。

8.9 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

无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	11,878.55
2	应收证券清算款	203,243.50
3	应收股利	-
4	应收利息	348.97
5	应收申购款	352,912.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	568,383.42

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 8 投资组合报告（转型前）

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	20,512,728.55	33.86
	其中：股票	20,512,728.55	33.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,001,708.14	6.61
8	其他各项资产	36,070,610.25	59.54
9	合计	60,585,046.94	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,650,419.39	32.76
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	862,309.16	1.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,512,728.55	34.20

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	000768	中航西飞	49,574	1,544,230.10	2.57

2	600893	航发动力	31,706	1,436,915.92	2.40
3	601989	中国重工	266,181	1,155,225.54	1.93
4	002179	中航光电	18,850	1,112,150.00	1.85
5	000547	航天发展	47,100	1,026,780.00	1.71
6	600760	中航沈飞	14,335	870,564.55	1.45
7	002414	高德红外	21,637	821,556.89	1.37
8	002465	海格通信	63,336	779,666.16	1.30
9	600118	中国卫星	20,696	703,664.00	1.17
10	002013	中航机电	62,096	672,499.68	1.12
11	300699	光威复材	8,937	639,889.20	1.07
12	000733	振华科技	13,200	610,500.00	1.02
13	600316	洪都航空	15,300	554,931.00	0.93
14	600038	中直股份	10,137	544,559.64	0.91
15	600879	航天电子	74,120	511,428.00	0.85
16	002025	航天电器	9,462	507,068.58	0.85
17	603678	火炬电子	9,304	465,106.96	0.78
18	600862	中航高科	19,100	445,030.00	0.74
19	000738	航发控制	20,095	410,138.95	0.68
20	600482	中国动力	22,474	397,565.06	0.66
21	002268	卫士通	20,475	382,882.50	0.64
22	600372	中航电子	19,094	343,501.06	0.57
23	603712	七一二	8,300	316,064.00	0.53
24	002413	雷科防务	38,131	305,429.31	0.51
25	600685	中船防务	11,539	300,129.39	0.50
26	600967	内蒙一机	28,879	292,833.06	0.49
27	601698	中国卫通	14,500	281,155.00	0.47
28	300474	景嘉微	4,299	265,076.34	0.44
29	300123	亚光科技	18,025	260,821.75	0.43
30	600562	国睿科技	13,165	218,670.65	0.36
31	300034	钢研高纳	8,300	209,492.00	0.35
32	002544	杰赛科技	12,338	198,271.66	0.33
33	600764	中国海防	5,300	174,370.00	0.29
34	300696	爱乐达	3,200	166,880.00	0.28
35	300581	晨曦航空	3,000	152,790.00	0.25
36	300527	中船应急	12,969	150,181.02	0.25
37	600990	四创电子	3,732	149,130.72	0.25
38	300762	上海瀚讯	3,300	146,091.00	0.24
39	300424	航新科技	6,172	139,672.36	0.23
40	300722	新余国科	1,580	118,452.60	0.20
41	002338	奥普光电	5,600	116,592.00	0.19
42	600184	光电股份	9,200	109,296.00	0.18
43	002935	天奥电子	4,470	105,357.90	0.18
44	601606	长城军工	7,900	101,752.00	0.17

45	000561	烽火电子	10,800	78,084.00	0.13
46	300775	三角防务	2,200	75,482.00	0.13
47	300777	中简科技	1,600	73,360.00	0.12
48	002933	新兴装备	2,000	71,440.00	0.12

8.3.2 期末积极投资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

无。

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	600862	中航高科	1,504,305.00	1.82
2	601989	中国重工	1,392,780.00	1.69
3	603712	七一二	1,259,578.00	1.53
4	600316	洪都航空	992,356.00	1.20
5	002338	奥普光电	727,562.32	0.88
6	300034	钢研高纳	675,680.00	0.82
7	600764	中国海防	580,549.00	0.70
8	300696	爱乐达	486,502.00	0.59
9	300762	上海瀚讯	442,750.00	0.54
10	000561	烽火电子	352,736.00	0.43
11	300777	中简科技	251,125.00	0.30
12	300581	晨曦航空	160,239.00	0.19
13	601698	中国卫通	144,787.00	0.18
14	603195	公牛集团	80,792.55	0.10
15	600918	中泰证券	63,453.06	0.08
16	601778	晶科科技	53,965.13	0.07
17	000768	中航西飞	47,209.00	0.06
18	601827	三峰环境	45,985.32	0.06
19	601696	中银证券	45,800.31	0.06
20	002465	海格通信	44,358.00	0.05

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。

8.4.2 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	601989	中国重工	6,424,436.00	7.78
2	000768	中航西飞	6,339,298.00	7.68
3	600893	航发动力	6,069,166.00	7.35
4	002179	中航光电	5,059,961.00	6.13
5	002465	海格通信	4,462,515.00	5.40
6	002414	高德红外	4,004,407.00	4.85

7	600760	中航沈飞	3,979,729.46	4.82
8	000547	航天发展	3,943,987.00	4.78
9	600118	中国卫星	3,885,702.00	4.71
10	002013	中航机电	3,349,061.00	4.06
11	300699	光威复材	3,168,830.14	3.84
12	600879	航天电子	2,917,365.00	3.53
13	600038	中直股份	2,822,133.00	3.42
14	600482	中国动力	2,559,176.00	3.10
15	002268	卫士通	2,410,234.00	2.92
16	002025	航天电器	2,163,228.00	2.62
17	000733	振华科技	2,148,766.00	2.60
18	603678	火炬电子	2,100,537.00	2.54
19	000738	航发控制	1,918,045.00	2.32
20	002413	雷科防务	1,760,984.00	2.13
21	600316	洪都航空	1,750,148.00	2.12
22	600967	内蒙一机	1,726,480.00	2.09

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。

8.4.3 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	11,231,584.03
卖出股票收入（成交）总额	100,303,829.33

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 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

无。

8.7 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

无。

8.8 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

无。

8.9 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

无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	7,967.75
2	应收证券清算款	36,052,799.72
3	应收股利	-
4	应收利息	9,842.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,070,610.25

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
4,305	9,621.99	148,477.00	0.36	41,274,198.44	99.64

9.2 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	5,619.13	0.01357

9.3 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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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(%)
融通军工分级	2,007	15,588.42	164,292.00	0.53	31,121,666.67	99.47
军工股 A	128	65,765.70	1,555,656.00	18.48	6,862,353.00	81.52
军工股 B	1,143	7,364.84	131.00	0.00	8,417,878.00	100.00
合计	3,278.00	14,680.29	1,720,079.00	3.57	46,401,897.67	96.43

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	融通军工分级	4,832.02	0.01544
	军工股 A	0.00	0.00000
	军工股 B	0.00	0.00000
	合计	4,832.02	0.01004

9.3 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情况

项目	份额级别	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	融通军工分级	0
	军工股 A	0
	军工股 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通军工分级	0
	军工股 A	0
	军工股 B	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2020 年 12 月 1 日）基金份额总额	48,121,975.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,453,192.65
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	10,152,492.88
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	41,422,675.44

§ 10 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	融通军工分级	军工股 A	军工股 B
基金合同生效日（2015 年 7 月 1 日）基金份额总额	173,705,634.08	98,485,962.00	98,485,962.00
本报告期期初基金份额总额	57,892,396.80	21,362,733.00	21,362,733.00
本报告期基金总申购份额	75,063,692.56	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	127,559,579.69	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	25,889,448.00	-12,944,724.00	-12,944,724.00
本报告期期末基金份额总额	31,285,957.67	8,418,009.00	8,418,009.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人于 2020 年 10 月 31 日公告以通讯方式召开融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，审议《关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》，会议议案于 2020 年 10 月 30 日表决通过，大会决议自同日起生效。自 2020 年 12 月 1 日起，“融通中证军工指数分级证券投资基金”正式转型为“融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）”。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大变动

2020年6月22日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经本基金管理人第六届董事会第四次定期会议审议通过，决定由邹曦先生担任公司副总经理职务。

11.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。本基金本年度应支付的审计费用为人民币40,000.00元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

11.7.1 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	
中金公司	3	57,642,588.72	65.48%	52,531.82	64.99%	-
申万宏源	2	27,292,825.93	31.00%	25,417.13	31.45%	-
广发证券	1	2,892,748.60	3.29%	2,693.70	3.33%	-
华泰证券	1	203,465.00	0.23%	185.44	0.23%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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务；
- 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

本报告期内交易单元无变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

11.7.1 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	
中金公司	3	23,273,517.59	21.18%	21,211.69	20.96%	-
长江证券	1	21,101,921.48	19.21%	19,231.69	19.00%	-
申万宏源	2	20,268,892.76	18.45%	18,876.02	18.65%	-
广发证券	1	14,796,636.00	13.47%	13,780.15	13.62%	-
兴业证券	1	9,763,664.28	8.89%	9,092.96	8.98%	-

华创证券	2	9,145,842.53	8.32%	8,482.79	8.38%	-
中信证券	2	5,624,745.57	5.12%	5,126.18	5.06%	-
国海证券	2	3,525,854.94	3.21%	3,252.68	3.21%	-
东北证券	3	1,503,742.44	1.37%	1,370.30	1.35%	-
东吴证券	2	500,501.81	0.46%	456.17	0.45%	-
东方财富	1	362,623.25	0.33%	330.55	0.33%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

中信建投	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务；
- 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

本报告期本基金新增东吴证券、中信证券交易单元各 1 个，终止租用华信证券、中银国际各 1 个，终止租用华宝证券交易单元 2 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	86,900.00	2.87%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	93,575.70	3.09%	-	-	-	-

兴业证券	2,738,765.92	90.53%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	33,460.92	1.11%	-	-	-	-
国海证券	72,580.13	2.40%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金合同等法律文件生效的公告	证券时报、管理人网站	2020-12-01
2	融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额转换结果公告	证券时报、管理人网站	2020-12-02
3	融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金	证券时报、管	2020-12-04

	（LOF）新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	理人网站	
4	融通中证云计算基金（LOF）新增北京唐鼎耀华和嘉实财富为销售机构并开通定投、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-12-09
5	融通关于旗下部分开放式基金参加宁波银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-12-14

11.8 其他重大事件（转型前）

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2020年春节假期延期期间旗下部分基金场内申赎业务安排的公告	证券日报、中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2020-01-30
2	融通基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-01-30
3	融通中证军工指数分级证券投资基金之融通军工B份额溢价风险提示公告	证券时报、管理人网站	2020-02-05
4	融通基金新增玄元保险为销售机构并开通定投、转换及参与其费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2020-02-20
5	融通关于旗下部分开放式基金参加万家财富申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-02-21
6	融通中证军工指数分级证券投资基金之融通军工B份额溢价风险提示公告	证券时报、管理人网站	2020-03-24
7	融通关于旗下部分开放式基金在北京植信基金销售有限公司开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-03-24
8	融通中证军工指数分级证券投资基金之融通军工B份额溢价风险提示公告	证券时报、管理人网站	2020-03-31
9	融通中证军工指数分级证券投资基金之融通军工B份额溢价风险提示公告	证券时报、管理人网站	2020-04-01
10	融通中证军工指数分级证券投资基金之融通军工B份额溢价风险提示公告	证券时报、管理人网站	2020-04-02
11	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增销售机构的公告	证券时报、管理人网站	2020-05-06
12	关于旗下部分开放式基金参与华安证券申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-05-06
13	融通中证军工指数分级证券投资基金暂停申购、定期定额投资、转换转入业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-05-26
14	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、中国证券报、上	2020-06-22

		海证券报、证券时报、管理人网站	
15	关于融通基金管理有限公司旗下基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证券日报、中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2020-06-29
16	融通关于旗下部分开放式基金参加北京展恒基金销售股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-08-05
17	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增销售机构的公告	证券时报、管理人网站	2020-09-28
18	融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同修订对照表	证券时报、管理人网站	2020-09-30
19	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-09-30
20	关于以通讯方式召开融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、管理人网站	2020-09-30
21	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-09
22	关于以通讯方式召开融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-09
23	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-12
24	关于以通讯方式召开融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-12
25	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-13
26	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-14
27	融通中证军工指数分级证券投资基金恢复申购业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-10-14
28	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-15
29	关于融通中证军工指数分级证券投资基金在部分销售机构开展赎回费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-10-15
30	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-16
31	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-19
32	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-20
33	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-21

34	融通中证军工指数分级证券投资基金暂停申购业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-10-22
35	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-22
36	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-23
37	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-26
38	关于融通基金管理有限公司旗下部分基金在国泰君安证券股份有限公司开通转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-10-28
39	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-28
40	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-29
41	关于融通中证军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-30
42	关于融通中证军工指数分级证券投资基金之融通军工 A 份额和融通军工 B 份额停牌的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-30
43	关于融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证券时报、管理人网站	2020-10-31
44	关于融通中证军工指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-10-31
45	融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额转换和变更登记的提示性公告	证券时报、管理人网站	2020-11-25
46	关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型期间申购、赎回等业务安排及终止办理配对转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-11-25
47	融通中证军工指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称及基金类型变更的公告	证券时报、管理人网站	2020-11-27

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20201020-20201030	-	25,103,765.00	25,103,765.00	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

(一) 《关于融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》

- （二）《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- （三）《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金托管协议》
- （四）《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金招募说明书》
- （五）中国证监会批准融通中证军工指数分级证券投资基金设立的文件
- （六）《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》
- （七）《融通中证军工指数分级证券投资基金基金托管协议》
- （八）《融通中证军工指数分级证券投资基金基金招募说明书》及更新
- （九）《融通中证军工指数分级证券投资基金之军工股 A 和军工股 B 上市交易公告书》
- （十）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- （十一）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所。

13.3 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。

融通基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日