

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 年第 4 季度报告

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

报告送出日期：2021 年 1 月 21 日

§ 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及董事保证本报告中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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。其中：

转型前为 2020 年 10 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。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

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

报告期末基金份额总额	41,422,675.44 份
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。
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

2.1 基金基本情况（转型前）

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
报告期末基金份额总额	48,121,975.67 份
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。
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		
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
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。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 12 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	4,948,412.86
2. 本期利润	-150,186.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0035
4. 期末基金资产净值	51,371,278.31
5. 期末基金份额净值	1.2402

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 10 月 1 日-2020 年 11 月 30 日）
1. 本期已实现收益	12,287,493.42
2. 本期利润	2,401,115.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0373
4. 期末基金资产净值	59,975,901.07
5. 期末基金份额净值	1.2460

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。

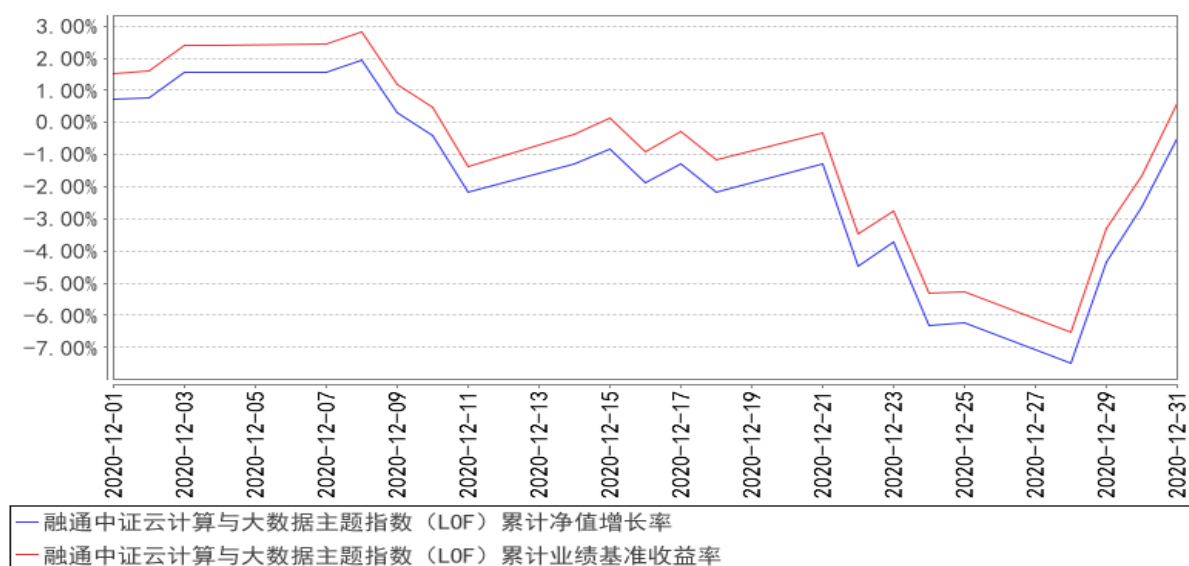
3.2 基金净值表现（转型后）

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	净值增长率 ①	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。

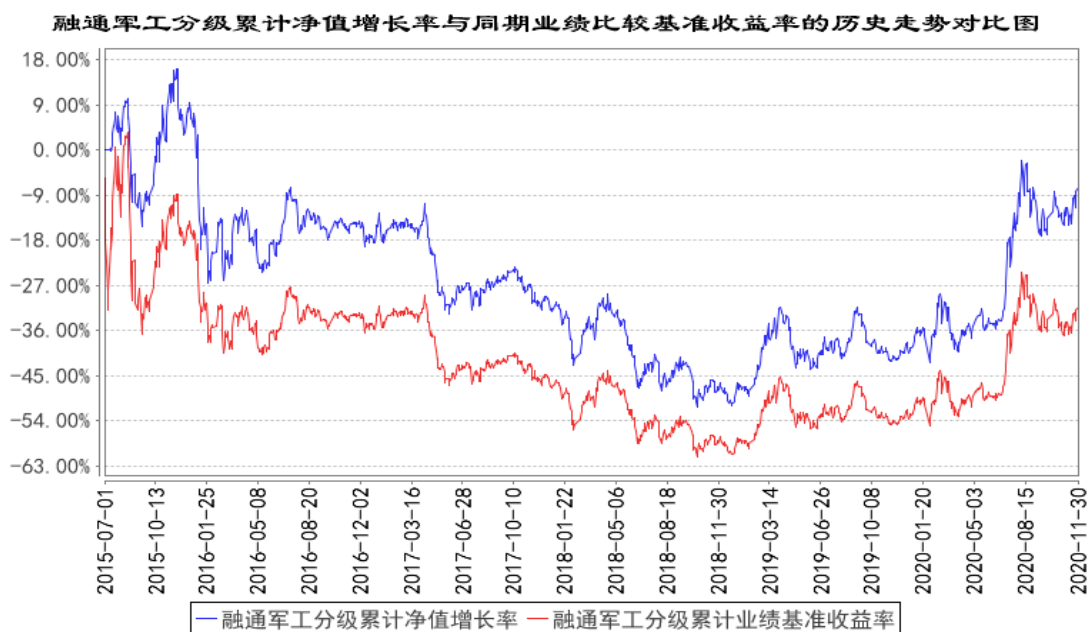
3.2 基金净值表现（转型前）

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	净值增长率 ①	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 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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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 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 报告期内基金的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0.17%，年化跟踪误差为4.42%，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。

4.5 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10月1日—2020年11月30日）：

本报告期基金份额净值收益率为7.14%，同期业绩比较基准收益率为3.65%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	其他资产	568,383.42	1.09
9	合计	52,247,841.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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

5.3 报告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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
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

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 5 投资组合报告 (转型前)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	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	其他资产	36,070,610.25	59.54
9	合计	60,585,046.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	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

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

无。

5.3 报告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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
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

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 6 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）	-
报告期期末基金份额总额	41,422,675.44

§ 6 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
报告期期初基金份额总额	33,488,706.99	13,295,982.00	13,295,982.00
报告期期间基金总申购份额	63,086,218.52	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	75,044,913.84	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	9,755,946.00	-4,877,973.00	-4,877,973.00
报告期期末基金份额总额	31,285,957.67	8,418,009.00	8,418,009.00

注：拆分变动份额为本报告期发生的配对转换份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

无。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

1.1 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所。

9.3 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 1 月 21 日