

融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）
（原融通中证全指证券公司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

融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）是由“融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金”转型而来。2020 年 9 月 24 日至 2020 年 10 月 20 日，“融通中证全指证券公司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，会议审议并于 2020 年 10 月 21 日表决通过了《关于融通中证全指证券公司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》，本次基金份额持有人大会决议报中国证监会报备，并自表决之日起生效。“融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金”基金名称相应变更为“融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）”，转型后基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围等部分基金合同内容发生变化。自 2020 年 11 月 20 日起，《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，同日起《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》失效。

详情请参阅 2020 年 10 月 22 日刊登在指定报告信息披露媒体上的《关于融通中证全指证券公司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 19 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（即原融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金）报告期为 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 11 月 19 日止，

转型后（融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF））报告期为 2020 年 11 月 20 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	融通中证精准医疗主题指数（LOF）
------	-------------------

场内简称	精准医疗
基金主代码	161629
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2020 年 11 月 20 日
报告期末基金份额总额	23,703,397.93 份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证精准医疗主题指数。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	$95\% \times \text{中证精准医疗主题指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$
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	融通证券分级
场内简称	融通证券
基金主代码	161629
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 17 日
报告期末基金份额总额	29,415,484.92 份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证全指证券公司指数。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	$95\% \times \text{中证全指证券公司价格指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。
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，融通证券 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；融通证券 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	融通证券分级	证券 A 基	证券 B 基
下属分级基金的场内简称	融通证券	证券 A 基	证券 B 基
下属分级基金的交易代码	161629	150343	150344
报告期末下属分级基金的份额总额	21,681,260.92 份	3,867,112.00 份	3,867,112.00 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。	融通证券 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。	融通证券 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 11 月 20 日-2020 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	388,715.04
2. 本期利润	1,873,922.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0760
4. 期末基金资产净值	31,613,567.59
5. 期末基金份额净值	1.3337

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。

3.1 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 19 日）
1. 本期已实现收益	6,185,748.85
2. 本期利润	244,120.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0075
4. 期末基金资产净值	36,615,483.22
5. 期末基金份额净值	1.245

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。

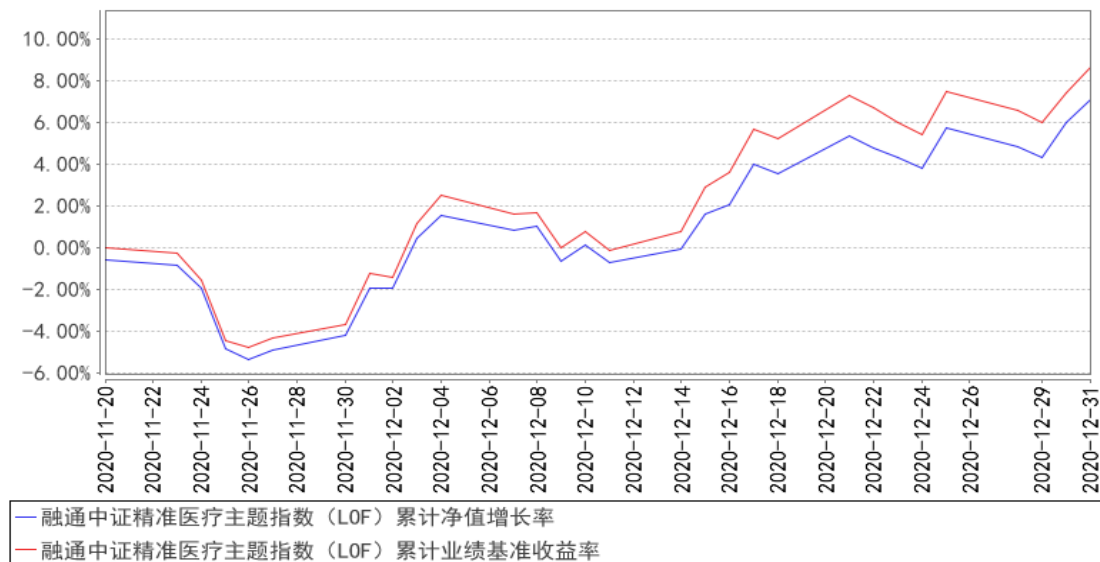
3.2 基金净值表现（转型后）

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
自基金合同 生效起至今	7.12%	1.26%	9.01%	1.33%	-1.89%	-0.07%

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

融通中证精准医疗主题指数（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 11 月 20 日，至报告期末基金转型未满一年。

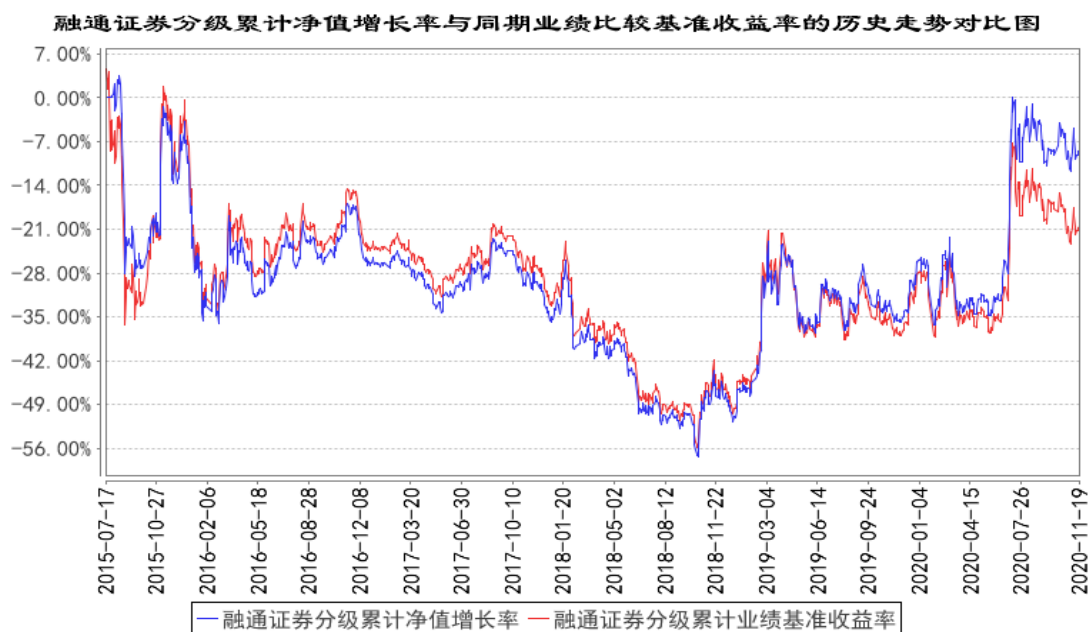
3.2 基金净值表现（转型前）

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
过去三个月	0.57%	1.65%	-1.40%	1.60%	1.97%	0.05%
过去六个月	22.90%	2.46%	16.14%	2.47%	6.76%	-0.01%
过去一年	24.00%	2.24%	13.20%	2.27%	10.80%	-0.03%
过去三年	38.51%	2.04%	20.95%	2.06%	17.56%	-0.02%

过去五年	0.06%	1.89%	-12.06%	1.91%	12.12%	-0.02%
成立至今	-10.66%	1.98%	-18.85%	2.11%	8.19%	-0.13%

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（主持工作）	2020年11月20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、基金业务相关工作的时间为计算标准。

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 17 日	2020 年 11 月 19 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、基金业务相关工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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全指证券公司指数分级基金转型而来，基金合同生效日为 2020 年 11 月 20 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全指证券公司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全指证券公司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精准医疗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精准医疗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 0.16%，年化跟踪误差为 3.15%，符合基金合同约定。转型后，本基金日均跟踪偏离为 0.16%，年化跟踪误差为 2.77%，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 11 月 20 日起至 2020 年 12 月 31 日)截至本报告期末本基金份额净值为 1.3337 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.12%，业绩比较基准收益率为 9.01%。

转型前(2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 11 月 19 日)截至本报告期末本基金份额净值为 1.245 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.57%，业绩比较基准收益率为-1.40%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2020 年 11 月 20 日至本报告期末，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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	29,741,567.67	92.14
	其中：股票	29,741,567.67	92.14
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	2,465,818.66	7.64
8	其他资产	71,741.46	0.22
9	合计	32,279,127.79	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境内股票投资组合

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	17,511,353.00	55.39
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	-	-
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	4,889,428.00	15.47
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	5,604,595.00	17.73
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,005,376.00	88.59

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,736,191.67	5.49
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	-	-

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	1,736,191.67	5.49

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	300347	泰格医药	13,200	2,133,252.00	6.75
2	300760	迈瑞医疗	4,400	1,874,400.00	5.93
3	603259	药明康德	13,700	1,845,664.00	5.84
4	600276	恒瑞医药	15,000	1,671,900.00	5.29
5	000661	长春高新	3,700	1,660,967.00	5.25
6	603882	金域医学	12,200	1,563,064.00	4.94
7	300122	智飞生物	10,300	1,523,473.00	4.82
8	300759	康龙化成	12,300	1,480,920.00	4.68
9	600196	复星医药	27,400	1,479,326.00	4.68
10	300601	康泰生物	7,800	1,361,100.00	4.31

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

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	688981	中芯国际	26,961	1,525,183.77	4.82
2	688528	秦川物联	4,168	68,105.12	0.22
3	688077	大地熊	1,455	54,984.45	0.17
4	688556	高测股份	1,962	52,836.66	0.17
5	688286	敏芯股份	299	35,081.67	0.11

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	33,728.20
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	365.25
5	应收申购款	37,648.01
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	71,741.46

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688981	中芯国际	1,525,183.77	4.82	首发流通受限
2	688528	秦川物联	68,105.12	0.22	首发流通受限
3	688077	大地熊	54,984.45	0.17	首发流通受限
4	688556	高测股份	52,836.66	0.17	首发流通受限
5	688286	敏芯股份	35,081.67	0.11	首发流通受限

§ 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	8,074,897.51	20.97
	其中：股票	8,074,897.51	20.97
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	2,099,690.54	5.45
8	其他资产	28,335,665.00	73.58
9	合计	38,510,253.05	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境内股票投资组合

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	—	—
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	—	—

J	金融业	6,146,232.72	16.79
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	6,146,232.72	16.79

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,928,664.79	5.27
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	—	—
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	1,928,664.79	5.27

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	600030	中信证券	30,383	891,133.39	2.43
2	300059	东方财富	29,720	767,667.60	2.10
3	601688	华泰证券	21,602	406,549.64	1.11
4	600837	海通证券	30,896	405,664.48	1.11
5	600999	招商证券	13,745	307,338.20	0.84
6	601211	国泰君安	15,750	288,067.50	0.79

7	600109	国金证券	10,939	185,634.83	0.51
8	000776	广发证券	10,818	182,066.94	0.50
9	000166	申万宏源	31,416	166,190.64	0.45
10	600958	东方证券	12,964	150,382.40	0.41

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

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	688981	中芯国际	26,961	1,574,252.79	4.30
2	688505	复旦张江	5,493	112,167.06	0.31
3	688528	秦川物联	4,168	84,568.72	0.23
4	688077	大地熊	1,455	66,435.30	0.18
5	688556	高测股份	1,962	55,289.16	0.15

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	22,207.36
2	应收证券清算款	28,303,678.40
3	应收股利	—
4	应收利息	9,779.24
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	28,335,665.00

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688981	中芯国际	1,574,252.79	4.30	首发流通受限
2	688505	复旦张江	112,167.06	0.31	首发流通受限
3	688528	秦川物联	84,568.72	0.23	首发流通受限
4	688077	大地熊	66,435.30	0.18	首发流通受限
5	688556	高测股份	55,289.16	0.15	首发流通受限

§ 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 11 月 20 日）基金份额总额	29,415,484.92
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,003,533.75
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7,715,620.74
报告期期末基金份额总额	23,703,397.93

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	融通证券分级	证券 A 基	证券 B 基
报告期期初基金份额总额	35,240,022.71	3,988,218.00	3,988,218.00
报告期期间基金总申购份额	-	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	13,800,973.79	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	242,212.00	-121,106.00	121,106.00
报告期期末基金份额总额	21,681,260.92	3,867,112.00	3,867,112.00

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

8.1 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	20201001-20201009	9,867,598.00	-	9,867,598.00	0.00	0.00
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）《关于融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金变更注册的批复》
- （二）《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- （三）《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- （四）《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
- （五）中国证监会批准融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金设立的文件
- （六）《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》

- （七）《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》
- （八）《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新
- （九） 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- （十）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、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> 查阅。

融通基金管理有限公司

2021 年 1 月 21 日