

富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金  
二〇一六年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2017 年 03 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 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.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	其他指标.....	9
3.4	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4	管理人报告.....	10
4.1	基金管理人及基金经理.....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5	托管人报告.....	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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 16	
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.....	16
§6	审计报告.....	16
6.1	审计报告基本信息.....	16
6.2	审计报告的基本内容.....	16
§7	年度财务报表.....	17
7.1	资产负债表.....	18
7.2	利润表.....	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4	报表附注.....	21
§8	投资组合报告.....	43
8.1	期末基金资产组合情况.....	43
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	44
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	46

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	48
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
8.12	投资组合报告附注 .....	49
§9	基金份额持有人信息 .....	50
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	50
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	51
§10	开放式基金份额变动 .....	52
§11	重大事件揭示 .....	52
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
11.4	基金投资策略的改变 .....	52
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
11.8	其他重大事件 .....	56
§12	备查文件目录 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金		
基金简称	富国中证工业 4.0 指数分级		
基金主代码	161031		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 06 月 15 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,680,495,191.73 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 6 月 29 日		
下属三级基金的基金简称	富国中证工业 4.0 指数分级 A	富国中证工业 4.0 指数分级 B	富国中证工业 4.0 指数分级
下属三级基金场内简称	工业 4A	工业 4B	工业 4
下属三级基金的交易代码	150315	150316	161031
报告期末下属三级基金的份额总额 (单位:份)	64,841,652.00	64,841,653.00	2,550,811,886.73

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证工业 4.0 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	本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在中证工业 4.0 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证工业 4.0 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金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。		
业绩比较基准	95%×中证工业 4.0 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。		
下属三级基金的风险收益特征	富国工业 4.0A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定	富国工业 4.0B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高

	的特征。	特征。	预期收益的特征。
--	------	-----	----------

### 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		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	郭明
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		薛爱东	易会满

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 6 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-509,760,601.69	-1,819,431,956.21
本期利润	-902,817,113.36	-2,007,534,632.88
加权平均基金份额本期利润	-0.3052	-0.4593
本期加权平均净值利润率	-30.94%	-48.51%
本期基金份额净值增长率	-24.25%	-26.42%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	-1,989,920,218.67	-1,644,906,445.91
期末可供分配基金份额利润	-0.7424	-0.5276
期末基金资产净值	2,506,755,514.43	3,933,188,302.44
期末基金份额净值	0.935	1.262
3.1.3 累计期末指标	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-44.27%	-26.42%

注：上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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.88%	0.93%	-5.05%	0.90%	0.17%	0.03%
过去六个月	-7.28%	1.02%	-7.35%	1.03%	0.07%	-0.01%
过去一年	-24.25%	2.24%	-23.52%	2.27%	-0.73%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	-44.27%	2.77%	-49.44%	2.99%	5.17%	-0.22%

注：本基金业绩比较基准为：95%×中证工业 4.0 指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。

由于本基金投资标的指数为中证工业 4.0 指数，且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，投资于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 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 95%×中证工业 4.0 指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmark<sub>t</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 95\% * [\text{中证工业 4.0 指数}_t / (\text{中证工业 4.0 指数}_{t-1}) - 1] + 5\% * \text{银行人民币活期存款利率（税后）} / 360;$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日；

期间  $T$  日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。

### 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

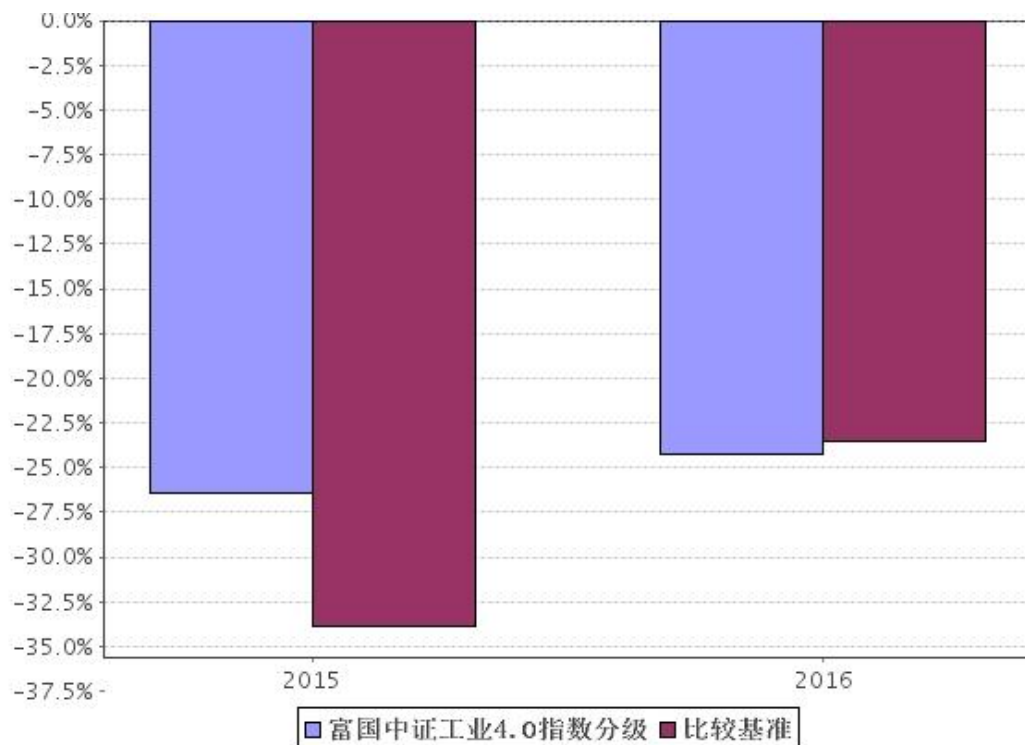


注：1、截止日期为 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2015 年 6 月 15 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 6 月 15 日起至 2015 年 12 月 14 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2015 年按实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	本期末（2016 年 12 月 31 日）
工业 4A 与工业 4B 基金份额配比	1:1
期末工业 4A 份额参考净值	1.004
期末工业 4A 份额累计参考净值	1.073
期末工业 4B 份额参考净值	0.866
期末工业 4B 份额累计参考净值	0.129
2016 年富国工业 4A 的预计年收益率	4.5%

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	—	—	—	—	—
2015年	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

注：本基金 2015 年 6 月 15 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日未进行

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国汇利回报分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国沪港深

价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育指数分级证券投资基金、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金等七十八只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

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		
徐幼华	本基金基金经理兼任量化投资部副总经理、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理	2015-06-15	—	16	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理；2006年7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员，2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理，2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年6月起任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2016年11月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；兼任量化投资部副总经理。具有基金从业资格。
张圣贤	本基金基	2015-08-07	—	10	硕士，自2007年7月至2015年3

	金 经 理 兼 任 量 化 投 资 部 量 化 投 资 总 监 助 理、富 国 中 证 国 有 企 业 改 革 指 数 分 级 证 券 投 资 基 金、富 国 中 证 军 工 指 数 分 级 证 券 投 资 基 金、富 国 中 证 新 能 源 汽 车 指 数 分 级 证 券 投 资 基 金、富 国 中 证 体 育 产 业 指 数 分 级 证 券 投 资 基 金、富 国 中 证 智 能 汽 车 指 数 证 券 投 资 基 金 （LOF）基 金 经 理				月任上海申银万国证券研究所有限 公司分析师；自 2015 年 3 月至 2015 年 6 月任富国基金管理有限 公司基金经理助理；2015 年 6 月 起任富国中证军工指数分级证券 投资基金、富国中证国有企业改 革指数分级证券投资基金、富国 中证新能源汽车指数分级证券投 资基金基金经理；自 2015 年 8 月 起任富国中证工业 4.0 指数分级 证券投资基金、富国中证体育产 业指数分级证券投资基金基金经 理，2016 年 2 月起任富国中证智 能汽车指数证券投资基金（LOF） 基金经理，兼量化投资部量化投 资总监助理。具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

### 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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现1次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年初以来,受人民币汇率快速贬值的影响,同时叠加美联储加息预期,国内流动性进一步宽松的环境受到限制,A股市场出现大幅调整。由于央行提示注意防范宏观风险,避免企业杠杆率过快上升,引起市场对货币政策收紧的再度担忧,同时叠加债券市场的信用风险暴露,4月下旬A股市场再度迎来一轮调整。7月,由于英国脱欧,市场预期英国及欧洲央行可能采取更加宽松的货币政策来应对经济的恶化,同时伴随着美联储加息延后,国内货币政策也有望迎来喘息,A股及全球市场震荡上涨。随着国债利率进一步下行,国内资产荒现象凸显,股市上的高分红资产受到投资者的青睐。12月以来,随着监管层加强对保险举牌行为的监管,前期推动大盘上涨的资产荒逻辑受到抑制,相关举牌概念股出现明显回调。同时,央行持续收紧资金引发债市去杠杆行情,国债期货出现跌停现象,国债利率及银行间回购利率均出现明显上升,由此也导致股市资金紧张,带动股市回调,进入休整期。总体来看,2016年上证综指下跌12.31%,沪深300下跌11.28%,创业板指下跌27.71%。其中,中证工业4.0指数2016年下跌24.88%。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为0.935元;份额累计净值为0.559元;本报告期,本基金份额净值增长率为-24.25%,同期业绩比较基准收益率为-23.52%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年,随着美国进入加息周期,各国央行持续多年的量化宽松告一段落,全球流动性或迎来阶段性拐点。从国内政策看,在防泡沫、去杠杆的背景下,宽财政、稳货币将成为政策主基调。在增量资金进场之前,市场将处于存量博弈的环境中,估值会成为市场上涨和下跌的重要约束,改革则成为提升风险偏好的主要动力。总体来看,预计市场仍将以震荡为主,继续关注结构性机会,受益于改革力度加大的国企改革、军工等主题或行业值得重点关注。

在投资管理上,本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略,采用量化和人工管理相结合的方法,处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人始终将加强内部控制,促进公司诚信、合法、有效经营,保障基金持有人利益作为己任。在监察稽核基础性工作基础上,2016年本基金管理人着重开展了如下与监察稽核有关的工作:

### (一) 全面制度梳理,强化制度建设

监察稽核部组织开展了对于全公司各部门规章制度的全面评估梳理。截止2016年底,公司完成十二项基本制度修订工作;完成管理制度类别及有效性的统计、分析。公司各部门基于自身业务实际,从业务开展需要、管理需要、内控需要和流程需要出发,针对基本管理制度、部门规章制度、业务流程/操作守则等进行了初步评估,并提出了制度修订的工作计划。

### (二) 监测例外事项,发布风险提示

监察稽核部持续对公司日常例外事项报告进行跟踪监测,通过例外事项发生、报告情况的分析回溯,有针对性梳理出主要风险事件和对应的改进事项,并

敦促相关部门后期改进。同时，监察稽核部还根据内外部风险环境的变化和公司的实际情况，陆续在全公司范围内发布了合规或风险提示函，对员工行为、投资权限等环节存在的风险进行提示。

### （三）积极开展合规培训，提升全员合规意识

2016 年监察稽核部积极配合人力资源部做好新员工的入职合规培训。从员工入司伊始，便向其灌输公司的合规文化并不断强化；对于新任组合经理，公司专门安排风控业务培训、督察长岗前谈话等，以重点提升组合经理的合规风控意识。除此之外，2016 年公司还组织了各类专题培训、内控行业实践交流、新法律法规培训等各种形式的合规培训交流活动。通过上述针对不同培训对象组织开展的培训活动，以提高合规培训的针对性与有效性，从而在整个公司营造合规文化氛围、提高员工合规意识。

### （四）着重开展专项审计，提高内部控制有效性

为加强审计工作的有效性，不至于流于形式，2016 年监察稽核部结合常规季度监察稽核工作，有针对性地开展了 11 项专项审计。审计范围覆盖了投资研究、市场销售、运营 IT 等前、中、后台业务。通过专项审计，有效发现现有业务流程中存在的问题缺陷；通过事后改进工作，查漏补缺，持续提高内部控制的有效性和内部风险防控能力。

### （五）加强员工行为监督，开展合规考核

监察稽核部对员工日常行为开展合规监测。对于合规监测过程中发现的问题，及时督促相关人员整改、提交解释说明。同时，根据员工违规情况的严重程度按照公司《投资管理人员一般风险合规事件登记及认定办法》进行后续处罚。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定，“在存续期内，本基金（包括富国工业 4.0 份额、富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额）不进行收益分配。”因此本报告期内本基金未进行收益分配。

## 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

本报告期无需要说明的相关情形。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金 2016 年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60467606_B60 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人富国基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）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



	错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	朱宝钦   濮晓达
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
审计报告日期	2017 年 03 月 21 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2016 年 12 月 31 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
<b>资 产：</b>		
银行存款	130,275,290.36	228,747,086.49
结算备付金	—	—
存出保证金	146,088.63	3,670,036.84
交易性金融资产	2,378,342,535.78	3,722,096,755.00
其中：股票投资	2,378,342,535.78	3,722,096,755.00
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	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	4,073,145.02	—
应收利息	27,454.71	55,661.83
应收股利	—	—
应收申购款	37,444.53	2,681,031.74
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	2,512,901,959.03	3,957,250,571.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2016 年 12 月 31 日)</b>	<b>上年度末 (2015 年 12 月 31 日)</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	2,772,471.98	18,139,096.67
应付管理人报酬	2,196,627.33	3,383,402.25
应付托管费	483,258.03	744,348.50
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	339,420.46	1,311,254.73
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—

其他负债	354,666.80	484,167.31
负债合计	6,146,444.60	24,062,269.46
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	4,496,675,733.10	5,347,618,115.94
未分配利润	-1,989,920,218.67	-1,414,429,813.50
所有者权益合计	2,506,755,514.43	3,933,188,302.44
负债和所有者权益总计	2,512,901,959.03	3,957,250,571.90

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.935 元，基金份额总额 2,680,495,191.73 份。其中：富国中证工业 4.0 指数分级份额净值 0.935 元，份额总额 2,550,811,886.73 份；工业 4A 份额参考净值 1.004 元，份额总额 64,841,652.00 份；工业 4B 份额参考净值 0.866 元，份额总额 64,841,653.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日)	上年度可比期间(2015 年 6 月 15 日(基金合同 生效日)至 2015 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	-862,413,763.25	-1,961,874,969.90
1. 利息收入	1,393,601.51	5,455,706.83
其中：存款利息收入	1,390,734.69	4,134,594.84
债券利息收入	116.82	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	2,750.00	1,321,111.99
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-472,370,381.38	-1,784,431,724.76
其中：股票投资收益	-486,153,365.92	-1,785,414,745.31
基金投资收益	—	—
债券投资收益	241,105.98	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	13,541,878.56	983,020.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-393,056,511.67	-188,102,676.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,619,528.29	5,203,724.70
<b>减：二、费用</b>	40,403,350.11	45,659,662.98
1. 管理人报酬	29,223,505.70	22,272,215.58

2. 托管费	6,429,171.34	4,899,887.44
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	3,805,130.90	17,756,097.80
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	945,542.17	731,462.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-902,817,113.36</b>	<b>-2,007,534,632.88</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-902,817,113.36</b>	<b>-2,007,534,632.88</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2016 年 01 月 01 日至 2016 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）	5,347,618,115.94	-1,414,429,813.50	3,933,188,302.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-902,817,113.36	-902,817,113.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-850,942,382.84	327,326,708.19	-523,615,674.65
其中：1. 基金申购款	1,393,975,143.71	-622,048,049.82	771,927,093.89
2. 基金赎回款	-2,244,917,526.55	949,374,758.01	-1,295,542,768.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	4,496,675,733.10	-1,989,920,218.67	2,506,755,514.43
项目	上年度可比期间(2015 年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 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）	6,787,122,558.81	—	6,787,122,558.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-2,007,534,632.88	-2,007,534,632.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,439,504,442.87	593,104,819.38	-846,399,623.49

其中：1. 基金申购款	4,788,053,005.21	-1,474,748,418.88	3,313,304,586.33
2. 基金赎回款	-6,227,557,448.08	2,067,853,238.26	-4,159,704,209.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	5,347,618,115.94	-1,414,429,813.50	3,933,188,302.44

注：所附附注为本会计报表的组成部分。

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：

陈 戈	林志松	徐 慧
-----	-----	-----
基金管理公司负责人	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

富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”),系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]889 号文《关于准予富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金注册的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集。基金合同于 2015 年 6 月 15 日生效,首次设立募集规模为 6,787,122,558.81 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金之基础份额(即“富国工业 4.0 份额”)、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“富国工业 4.0A 份额”)与富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“富国工业 4.0B 份额”)。其中,富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。基金发售结束后,本基金将投资者在场内认购的全部富国工业 4.0 份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别,即富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额。基金合同生效后,富国工业 4.0 份额接受场内与场外的申购和赎回。富国工业 4.0A 份额与富国工业 4.0B 份额只可在深圳证券交易所上市交易,不接受申购或赎回。

每年的基金份额定期折算基准日,本基金将按规则对富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0 份额进行定期份额折算;当富国工业 4.0 份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上或当富国工业 4.0B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下,本基金还将进行不定期份额折算。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证工业 4.0 指数的成份股、备选成份股、固定收益资产(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(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等)、衍生工具(股指期货、权证

等)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的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于中证工业4.0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%,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为:95%×中证工业4.0指数收益率+5%×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**

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2016年12月31日的财务状况以及2016年1月1日至2016年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

###### **(1) 金融资产分类**

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

##### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

##### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

#### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (6) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### (1) 存在活跃市场的金融工具

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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

#### (2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金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，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收



基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 权证投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22%的年费率逐日计提；

(3) 指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02%的年费率计提。指数许可

使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

在存续期内，本基金（包括富国工业 4.0 份额、富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额）不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### **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**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### **7.4.6 税项**

#### **1. 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### **2. 营业税、增值税**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017年7月1日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 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（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
活期存款	130,275,290.36	228,747,086.49
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	130,275,290.36	228,747,086.49

注：本基金本报告期内及上年度内未投资于定期存款。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2016年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,959,501,724.12	2,378,342,535.78	-581,159,188.34
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	—	—	—
其他	—	—	—
合计	2,959,501,724.12	2,378,342,535.78	-581,159,188.34
项目	上年度末（2015年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,910,199,431.67	3,722,096,755.00	-188,102,676.67
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	3,910,199,431.67	3,722,096,755.00	-188,102,676.67

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
应收活期存款利息	27,388.91	54,010.33
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	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	65.80	1,651.50
合计	27,454.71	55,661.83

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
交易所市场应付交易费用	339,420.46	1,311,254.73
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	339,420.46	1,311,254.73

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	17,070.05	68,464.05
应付指数使用费	137,596.75	195,703.26
预提审计费	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	100,000.00	120,000.00
合计	354,666.80	484,167.31

#### 7.4.7.9 实收基金

母基金：

金额单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,117,771,709.21	5,347,618,115.94
本期申购	798,961,988.26	1,370,441,233.37
本期赎回（以“-”号填列）	-1,252,241,517.19	-2,147,895,483.30
2016年12月01日基金拆分/份额折算前	2,664,492,180.28	4,570,163,866.01
基金拆分/份额折算调整	59,812,487.92	-
本期申购	14,031,512.39	23,533,910.34
本期赎回（以“-”号填列）	-57,840,988.86	-97,022,043.25
本期末	2,680,495,191.73	4,496,675,733.10

注：（1）本基金的基金份额包括富国工业 4.0 份额、富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额。

（2）申购含配对转换入份额，赎回含配对转换出份额。

（3）根据《富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金基金合同》，每年的基金份额定期折算基准日，即每个会计年度 12 月第一个工作日，本基金将对富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0 份额进行定期份额折算。当富国工业 4.0 份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上；当富国工业 4.0B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金将分别对富国工业 4.0 份额、富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额进行不定期份额折算。

（4）本基金于 2016 年 12 月 1 日进行定期份额折算，对富国工业 4.0 份额及富国工业 4.0A 份额按照基金合同规定的定期份额折算方法进行份额调整。根据基金管理人于 2016 年 12 月 5 日发布的《关于富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，折算前富国工业 4.0 份额为 2,527,371,671.28

份，富国工业 4.0A 份额为 68,560,254.00 份；折算后富国工业 4.0 份额为 2,587,184,159.20 份，富国工业 4.0A 份额为 68,560,254.00 份。

#### 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	-1,644,906,445.91	230,476,632.41	-1,414,429,813.50
本期利润	-509,760,601.69	-393,056,511.67	-902,817,113.36
本期基金份额交易产生的变动数	325,145,673.95	2,181,034.24	327,326,708.19
其中：基金申购款	-456,950,096.38	-165,097,953.44	-622,048,049.82
基金赎回款	782,095,770.33	167,278,987.68	949,374,758.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,829,521,373.65	-160,398,845.02	-1,989,920,218.67

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)	上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)
活期存款利息收入	1,364,694.05	3,544,456.76
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	13,181.57	160,434.24
其他	12,859.07	429,703.84
合计	1,390,734.69	4,134,594.84

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)	上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)
卖出股票成交总额	1,422,062,464.29	4,014,940,758.61
减：卖出股票成本总额	1,908,215,830.21	5,800,355,503.92
买卖股票差价收入	-486,153,365.92	-1,785,414,745.31

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)	上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	1,228,222.80	—
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	987,000.00	—
减：应收利息总额	116.82	—
买卖债券差价收入	241,105.98	—

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期和上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)	上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)
股票投资产生的股利收益	13,541,878.56	983,020.55
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	13,541,878.56	983,020.55

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)	上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)
1. 交易性金融资产	-393,056,511.67	-188,102,676.67
股票投资	-393,056,511.67	-188,102,676.67
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	—	—
合计	-393,056,511.67	-188,102,676.67

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)	上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)
基金赎回费收入	1,514,839.58	4,959,962.30
基金转换费收入	104,688.71	239,794.24



其他	—	3,968.16
合计	1,619,528.29	5,203,724.70

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)	上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)
交易所市场交易费用	3,805,130.90	17,756,097.80
银行间市场交易费用	—	—
合计	3,805,130.90	17,756,097.80

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)	上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	200,000.00	120,000.00
其他费用	—	400.00
上市费	60,000.00	65,000.00
银行汇划费用	1,072.00	617.84
指数使用费	584,470.17	445,444.32
合计	945,542.17	731,462.16

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除7.4.6 税项中披露的事项外，本基金无其他需要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
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
富国量化增强1号混合型资产管理计划	基金管理人控制的资产管理计划

上海海通证券资产管理有限公司	基金管理人的股东控制的子公司
----------------	----------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)		上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
海通证券	34,587,467.79	1.46	364,041,942.11	2.65
申万宏源	31,863,114.58	1.34	1,338,862,331.96	9.75

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)		上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
海通证券	5,000,000.00	100.00	—	—

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	32,210.89	1.48	5,446.13	1.60
申万宏源	29,039.51	1.34	25,997.65	7.66
关联方名称	上年度可比期间(2015年6月15日(基金合同生效日)至2015年12月31日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	331,422.37	2.70	0.00	0.00
申万宏源	1,198,820.96	9.78	0.00	0.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取

证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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（2016年01月01日至2016年12月31日）	上年度可比期间（2015年6月15日（基金合同生效日）至2015年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	29,223,505.70	22,272,215.58
其中：支付销售机构的客户维护费	14,226,140.98	11,737,808.28

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年12月31日）	上年度可比期间（2015年6月15日（基金合同生效日）至2015年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	6,429,171.34	4,899,887.44

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.22%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

富国中证工业4.0指数分级B：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2016年12月31日）		上期末（2015年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份

		额的比例 (%)		额的比例 (%)
上海海通证券资产管理	—	—	2,306,328.00	2.01

富国中证工业 4.0 指数分级：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2016 年 12 月 31 日）		上期末（2015 年 12 月 31 日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
富国量化增强 1 号混合型资产管理计划	—	—	12,306,878.60	0.43
上海海通证券资产管理	—	—	1.00	0.00

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2015 年 6 月 15 日（基金合同生效日）至 2015 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
中国工商银行股份有限公司	130,275,290.36	1,364,694.05	228,747,086.49	3,544,456.76

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016 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

##### 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	------	--------	------	--------	--------------	--------	--------	----

300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股认购	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	—
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股认购	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	—
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股认购	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	—
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股认购	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	—
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股认购	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	—
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股认购	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	—

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000821	京山轻机	2016-12-05	重大事项停牌	16.24	—	—	2,157,592	50,612,495.70	35,039,294.08	—
300076	GQY 视讯	2016-10-17	重大事项停牌	15.26	2017-03-01	13.73	2,018,171	30,313,353.29	30,797,289.46	—
300150	世纪瑞尔	2016-11-08	重大事项停牌	9.97	2017-03-21	10.97	2,532,917	36,274,826.07	25,253,182.49	—
300223	北京君正	2016-12-19	重大事项停牌	48.40	—	—	998,687	27,316,517.93	48,336,450.80	—
300367	东方网力	2016-12-15	重大事项停牌	20.04	—	—	3,110,987	97,313,964.29	62,344,179.48	—

#### 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

注：截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **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**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2016年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	130,275,290.36	—	—	—	—	—	130,275,290.36
存出保证金	146,088.63	—	—	—	—	—	146,088.63
交易性金融资产	—	—	—	—	—	2,378,342,535.78	2,378,342,535.78
应收证券清算款	—	—	—	—	—	4,073,145.02	4,073,145.02
应收利息	—	—	—	—	—	27,454.71	27,454.71
应收申购款	1,463.98	—	—	—	—	35,980.55	37,444.53
资产总计	130,422,842.97	—	—	—	—	2,382,479,116.06	2,512,901,959.03
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,772,471.98	2,772,471.98
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,196,627.33	2,196,627.33
应付托管费	—	—	—	—	—	483,258.03	483,258.03
应付交易费用	—	—	—	—	—	339,420.46	339,420.46
其他负债	—	—	—	—	—	354,666.80	354,666.80
负债总计	—	—	—	—	—	6,146,444.60	6,146,444.60
利率敏感度缺口	130,422,842.97	—	—	—	—	2,376,332,671.46	2,506,755,514.43
上年度末（2015年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	228,747,086.49	—	—	—	—	—	228,747,086.49

存出保证金	3,670,036.84	—	—	—	—	—	3,670,036.84
交易性金融资产	—	—	—	—	—	3,722,096,755.00	3,722,096,755.00
应收利息	—	—	—	—	—	55,661.83	55,661.83
应收申购款	28,933.34	—	—	—	—	2,652,098.40	2,681,031.74
资产总计	232,446,056.67	—	—	—	—	3,724,804,515.23	3,957,250,571.90
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付赎回款	—	—	—	—	—	18,139,096.67	18,139,096.67
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	3,383,402.25	3,383,402.25
应付托管费	—	—	—	—	—	744,348.50	744,348.50
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,311,254.73	1,311,254.73
其他负债	—	—	—	—	—	484,167.31	484,167.31
负债总计	—	—	—	—	—	24,062,269.46	24,062,269.46
利率敏感度缺口	232,446,056.67	—	—	—	—	3,700,742,245.77	3,933,188,302.44



#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产(不含可转债)，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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证工业 4.0 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%，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%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2016年12月31日）		上年度末（2015年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,378,342,535.78	94.88	3,722,096,755.00	94.63
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	2,378,342,535.78	94.88	3,722,096,755.00	94.63

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
1. 业绩比较基准增加 1%	24,692,951.12	33,197,176.56
2. 业绩比较基准减少 1%	-24,692,951.12	-33,197,176.56

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 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人民币 2,176,360,991.53 元，属于第二层次的余额为人民币 201,981,544.25 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2015 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人民币 3,638,892,515.49 元，属于第二层次的余额为人民币 83,204,239.51 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.3 其他事项

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

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,378,342,535.78	94.65
	其中：股票	2,378,342,535.78	94.65
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	130,275,290.36	5.18
7	其他各项资产	4,284,132.89	0.17
8	合计	2,512,901,959.03	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	758,375.36	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
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	25,488,057.49	1.02
J	金融业	106,780.00	0.00
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	26,406,722.74	1.05

### 8.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,853,439,236.10	73.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	89,751,459.20	3.58
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	408,745,117.74	16.31
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	2,351,935,813.04	93.82

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 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	002008	大族激光	5,443,139	123,014,941.40	4.91
2	300124	汇川技术	6,017,156	122,328,781.48	4.88
3	002230	科大讯飞	4,344,195	117,684,242.55	4.69
4	300024	机器人	5,284,215	112,976,516.70	4.51
5	600588	用友网络	5,340,481	111,188,814.42	4.44
6	002426	胜利精密	12,184,203	100,763,358.81	4.02
7	300115	长盈精密	3,851,343	100,365,998.58	4.00
8	600699	均胜电子	2,959,679	97,935,778.11	3.91

9	000997	新大陆	4,817,393	93,601,945.99	3.73
10	000961	中南建设	8,629,948	89,751,459.20	3.58
11	600172	黄河旋风	4,067,957	72,735,071.16	2.90
12	000988	华工科技	4,574,658	71,593,397.70	2.86
13	300367	东方网力	3,110,987	62,344,179.48	2.49
14	002185	华天科技	4,696,809	56,737,452.72	2.26
15	002073	软控股份	4,827,064	54,787,176.40	2.19
16	300170	汉得信息	4,401,623	51,983,167.63	2.07
17	002224	三力士	3,376,389	50,780,890.56	2.03
18	600765	中航重机	3,429,307	49,141,969.31	1.96
19	300223	北京君正	998,687	48,336,450.80	1.93
20	600835	上海机电	2,369,981	46,262,029.12	1.85
21	002161	远望谷	3,804,219	43,862,645.07	1.75
22	002367	康力电梯	2,929,940	38,704,507.40	1.54
23	300034	钢研高纳	1,844,228	35,944,003.72	1.43
24	000821	京山轻机	2,157,592	35,039,294.08	1.40
25	300221	银禧科技	1,709,961	33,754,630.14	1.35
26	300076	GQY 视讯	2,018,171	30,797,289.46	1.23
27	002527	新时达	2,278,026	30,548,328.66	1.22
28	002559	亚威股份	2,052,249	30,475,897.65	1.22
29	300097	智云股份	548,888	30,084,551.28	1.20
30	002698	博实股份	1,882,987	29,318,107.59	1.17
31	300173	智慧松德	1,722,496	28,438,408.96	1.13
32	300171	东富龙	1,864,718	27,765,651.02	1.11
33	002009	天奇股份	1,905,535	27,573,091.45	1.10
34	300048	合康新能	3,262,030	26,813,886.60	1.07
35	300161	华中数控	950,578	24,715,028.00	0.99
36	002577	雷柏科技	804,693	24,414,385.62	0.97
37	300337	银邦股份	2,415,239	23,814,256.54	0.95
38	300358	楚天科技	1,311,559	22,611,277.16	0.90
39	002529	海源机械	955,000	20,188,700.00	0.81
40	002232	启明信息	1,500,665	19,973,851.15	0.80
41	002747	埃斯顿	607,832	19,827,479.84	0.79
42	300400	劲拓股份	512,835	19,662,093.90	0.78
43	002380	科远股份	662,945	19,072,927.65	0.76
44	002472	双环传动	1,657,607	18,797,263.38	0.75
45	002184	海得控制	879,406	18,203,704.20	0.73
46	600845	宝信软件	811,400	14,313,096.00	0.57
47	300293	蓝英装备	793,463	13,330,178.40	0.53
48	002721	金一文化	574,200	9,577,656.00	0.38

### 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

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	300150	世纪瑞尔	2,532,917	25,253,182.49	1.01
2	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
3	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.00
4	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
5	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
6	603878	武进不锈	2,000	80,000.00	0.00
7	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
8	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
9	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
10	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
11	603389	亚振家居	1,963	47,327.93	0.00
12	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
13	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
14	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
15	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
16	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
17	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
18	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
19	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
20	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00

### 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	002426	胜利精密	127,069,255.55	3.23
2	002230	科大讯飞	125,603,436.97	3.19
3	600699	均胜电子	122,565,696.42	3.12
4	600172	黄河旋风	80,738,175.63	2.05
5	300221	银禧科技	43,516,220.52	1.11
6	002577	雷柏科技	31,419,529.22	0.80
7	600588	用友网络	30,698,661.72	0.78
8	300097	智云股份	26,545,708.33	0.67
9	002380	科远股份	24,965,268.23	0.63
10	300024	机器人	23,521,788.63	0.60

11	300400	劲拓股份	21,446,929.61	0.55
12	002747	埃斯顿	20,800,983.65	0.53
13	002472	双环传动	19,948,579.57	0.51
14	300115	长盈精密	18,783,813.69	0.48
15	600845	宝信软件	16,294,403.50	0.41
16	002721	金一文化	11,201,454.82	0.28
17	000961	中南建设	9,773,555.27	0.25
18	000988	华工科技	9,709,638.06	0.25
19	300367	东方网力	9,604,029.11	0.24
20	002698	博实股份	9,183,964.61	0.23

#### 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	002444	巨星科技	104,476,926.20	2.66
2	000410	沈阳机床	85,240,467.95	2.17
3	300134	大富科技	75,190,429.43	1.91
4	002063	远光软件	64,947,276.47	1.65
5	002008	大族激光	48,451,865.94	1.23
6	300124	汇川技术	46,227,772.35	1.18
7	600288	大恒科技	46,160,497.03	1.17
8	300278	华昌达	45,664,478.50	1.16
9	600588	用友网络	42,484,295.55	1.08
10	002334	英威腾	42,155,274.65	1.07
11	300276	三丰智能	39,703,676.23	1.01
12	300004	南风股份	37,402,102.03	0.95
13	000988	华工科技	34,102,362.66	0.87
14	300115	长盈精密	31,531,300.37	0.80
15	002161	远望谷	31,515,515.49	0.80
16	000997	新大陆	30,158,217.79	0.77
17	000837	秦川机床	29,447,056.49	0.75
18	000961	中南建设	29,148,335.85	0.74
19	300307	慈星股份	28,833,881.00	0.73
20	300024	机器人	27,861,651.40	0.71

#### 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	957,518,122.66
卖出股票收入（成交）总额	1,422,062,464.29

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 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

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

## 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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。



## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 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	146,088.63
2	应收证券清算款	4,073,145.02
3	应收股利	—
4	应收利息	27,454.71
5	应收申购款	37,444.53
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,284,132.89

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300150	世纪瑞尔	25,253,182.49	1.01	筹划重大事项
2	601375	中原证券	106,780.00	0.00	新股认购

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 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(%)
富国中证工业4.0指数分级A	606	106,999.43	46,253,648.00	71.33	18,588,004.00	28.67
富国中证工业4.0指数分级B	3,487	18,595.25	1,161,547.00	1.79	63,680,106.00	98.21
富国中证工业4.0指数分级	86,995	29,321.36	3,564,092.74	0.14	2,547,247,793.99	99.86
合计	91,088	29,427.53	50,979,287.74	1.90	2,629,515,903.99	98.10

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证工业4.0指数分级A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001深	12,812,687	19.76
2	中国银河证券股份有限公司	8,058,784	12.43
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	5,770,881	8.90
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	3,957,200	6.10
5	五矿经易期货有限公司—五矿经易期货工银量化恒盛精选D类43	2,915,509	4.50
6	丁碧霞	2,574,665	3.97
7	民生通惠资产—中信银行—民生通惠聚利3号资产管理产品	1,890,000	2.91
8	丁瑞金	1,678,400	2.59
9	刁乃伍	1,502,629	2.32
10	中融国际信托有限公司—中融—融	1,452,000	2.24

	晨 3 号证券投资集合资金信托		
富国中证工业 4.0 指数分级 B			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	杨健英	2,670,100	4.12
2	赖奎	1,480,897	2.28
3	程杨	1,044,632	1.61
4	蒋格英	1,000,000	1.54
5	苏白凡	958,800	1.48
6	运志涛	865,692	1.34
7	郑延丽	856,900	1.32
8	海通证券资管—招商证券—海通怡然恒旭 1 号集合资产管理计划	700,000	1.08
9	李亨堃	608,700	0.94
10	李丽佳	608,600	0.94

### 9.3 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（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国中证工业 4.0 指数分级 A	—	—
	富国中证工业 4.0 指数分级 B	—	—
	富国中证工业 4.0 指数分级	31,073.25	0.0012
	合计	31,073.25	0.0012

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	富国中证工业 4.0 指数分级 A	0
	富国中证工业 4.0 指数分级 B	0
	富国中证工业 4.0 指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证工业 4.0 指数分级 A	0
	富国中证工业 4.0 指数分级 B	0
	富国中证工业 4.0 指数分级	0

	合计	0
--	----	---

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国中证工业 4.0 指数分级 A	富国中证工业 4.0 指数分级 B	富国中证工业 4.0 指数分级
基金合同生效日(2015年06月15日)基金份额总额	—	—	6,787,122,558.81
报告期期初基金份额总额	114,820,205.00	114,820,206.00	2,888,131,298.21
本报告期基金总申购份额	—	—	812,993,500.65
减：本报告期基金总赎回份额	—	—	1,310,082,506.05
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-49,978,553.00	-49,978,553.00	159,769,593.92
报告期期末基金份额总额	64,841,652.00	64,841,653.00	2,550,811,886.73

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本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

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 10 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 14 年。

### 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

2016 年 6 月，针对上海证监局向公司出具的《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，认真

---

落实整改要求，加强制度和风控措施，着力进一步加强公司内部控制和风险管理能力。2016年10月，公司已通过上海证监局的检查验收。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)	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 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	815,640,958.84	34.35	—	—	—	—	—	—	745,385.03	34.31	—
川财证券	2	158,026,083.32	6.65	—	—	—	—	—	—	144,010.26	6.63	—
方正证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	49,282,792.16	2.08	1,228,222.80	100.00	—	—	—	—	44,911.54	2.07	—
国都证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	176,654,362.83	7.44	—	—	—	—	—	—	161,579.98	7.44	—
国元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	34,587,467.79	1.46	—	—	5,000,000.00	100.00	—	—	32,210.89	1.48	—
华创证券	1	93,396,316.15	3.93	—	—	—	—	—	—	86,933.92	4.00	—
江海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	215,528,033.41	9.08	—	—	—	—	—	—	197,031.76	9.07	—
瑞银证券	2	799,709,073.74	33.68	—	—	—	—	—	—	731,278.24	33.66	—
上海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	4	31,863,114.58	1.34	—	—	—	—	—	—	29,039.51	1.34	—

---

西部证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年01月29日
2	富国基金管理有限公司关于停止办理电话交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年03月05日
3	关于富国基金管理有限公司淘宝官方旗舰店关闭认申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年05月05日
4	富国基金管理有限公司关于开展京东官方旗舰店基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年06月30日
5	关于富国中证工业4.0指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	中国证券报、证券时报	2016年11月28日
6	关于富国中证工业4.0指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报	2016年11月28日
7	关于富国中证工业4.0指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间富国工业4.0A份额停复牌的公告	中国证券报、证券时报	2016年12月02日
8	关于富国中证工业4.0指数分级证券投资基金之富国工业4.0A份额约定年基准收益率调整的公告	中国证券报、证券时报	2016年12月05日
9	关于富国工业4.0A份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	中国证券报、证券时报	2016年12月05日
10	关于富国中证工业4.0指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证券报、证券时报	2016年12月05日



11	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年12月13日
----	---------------------------------	-----------------------	-------------

## § 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金的文件 2、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金基金合同 3、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。 咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司网址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>