

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
(摘要)

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

1.2

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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

§ 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
----------	-------	-------

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。

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_t）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_T）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

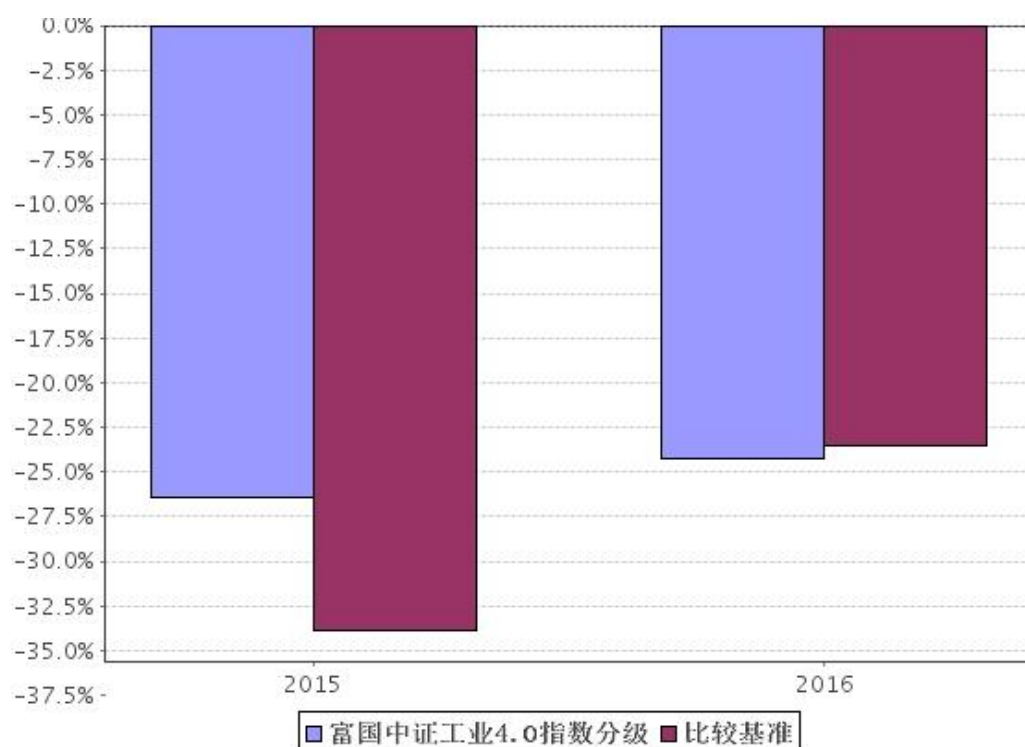
基准收益率变动的比较



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 日未进行利润分配

§ 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	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，

	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				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	本基金基金经理兼任量化投资部量化投资总监助理、富国中证国企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	2015-08-07	—	10	硕士,自2007年7月至2015年3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、富国中证国企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。

	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				
--	-----------------------------------	--	--	--	--

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。

4.7 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。

4.8 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

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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)
资 产：		
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
负债和所有者权益	本期末 (2016 年 12 月 31 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—

应付证券清算款	—	—
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
所有者权益：		
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)
一、收入	-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
减：二、费用	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
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-902,817,113.36	-2,007,534,632.88
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-902,817,113.36	-2,007,534,632.88

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

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金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。

7.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(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

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 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。

7.4.4.1.4 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	—	—

7.4.4.1.5 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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（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。

7.4.4.2.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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	持有的基金份额	持有的	持有的基金份额

	基金份额	额占基金总份 额的比例 (%)	基金份额	额占基金总份 额的比例 (%)
上海海通证券资产 管理有限公司	—	—	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 管理有限公司	—	—	1.00	0.00

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（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

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.5 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.1.1 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	—

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (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	—

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

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。

7.4.5.3.2 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。

7.4.6 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的年度报告正文

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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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前十名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	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	---------	--------	----------

			公允价值(元)	值比例 (%)	
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	2,915,509	4.50

	期货工银量化恒盛精选 D 类 43		
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	习乃伍	1,502,629	2.32
10	中融国际信托有限公司—中融—融晨 3 号证券投资集合资金信托	1,452,000	2.24

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。

