

富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金
二〇一八年年度报告
(摘要)

2018 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：2019 年 03 月 29 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 2019 年 3 月 27 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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	1, 218, 805, 525. 01 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)	7,481,498.00	7,481,498.00	1,203,842,529.01

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、预期收益相对稳定的特征。	富国工业 4.0B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。	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。

			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	赵瑛	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：公司已于 2019 年 03 月 28 日发布《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，裴长江先生自 2019 年 03 月 27 日起担任公司董事长。

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

注：信息披露报纸为截止至本报告期末信息。

§ 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-355,298,056.70	-561,836,889.29	-509,760,601.69
本期利润	-583,819,495.34	-106,954,934.90	-902,817,113.36
加权平均基金份额本期利润	-0.3259	-0.0437	-0.3052
本期基金份额净值增长率	-34.19%	-5.25%	-24.25%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	-1.6442	-0.8896	-0.7424
期末基金资产净值	1,065,158,519.94	1,878,652,610.57	2,506,755,514.43
期末基金份额净值	0.874	0.864	0.935

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	-13.18%	2.04%	-12.64%	2.12%	-0.54%	-0.08%
过去六个月	-19.80%	1.89%	-19.05%	1.97%	-0.75%	-0.08%
过去一年	-34.19%	1.84%	-33.64%	1.89%	-0.55%	-0.05%
过去三年	-52.77%	1.79%	-50.75%	1.82%	-2.02%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	-65.25%	2.15%	-67.44%	2.29%	2.19%	-0.14%

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:

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

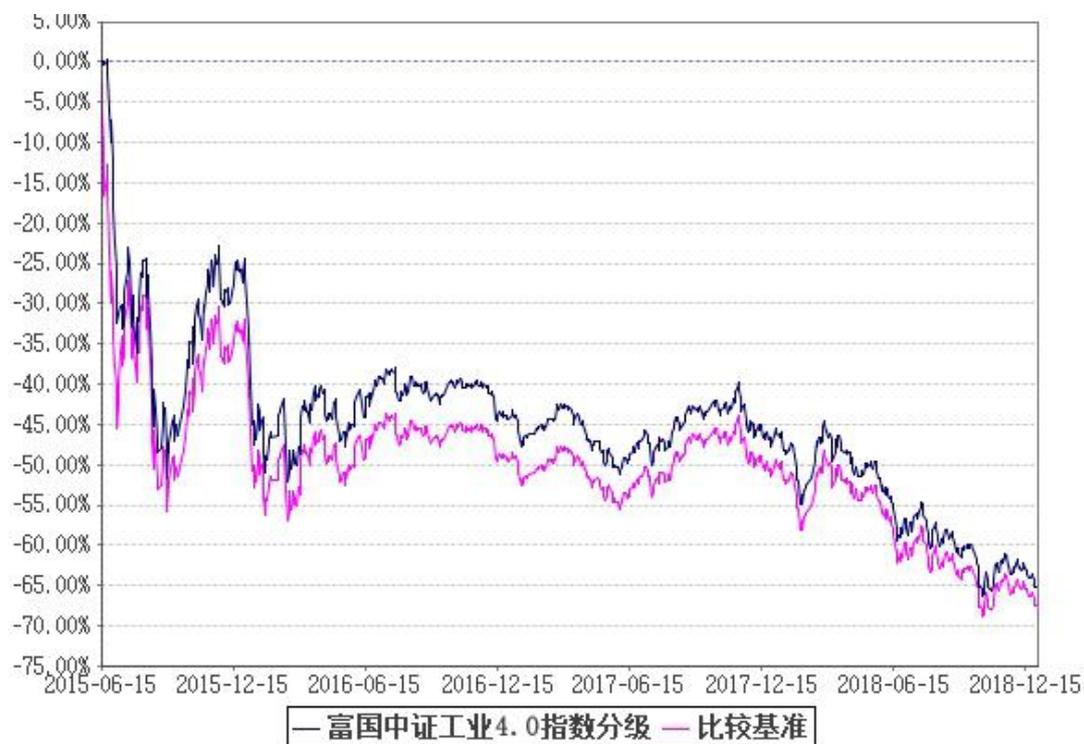
其中,t=1,2,3,⋯,T,T表示时间截至日;

期间T日收益率(benchmark_T)按下列公式计算:

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

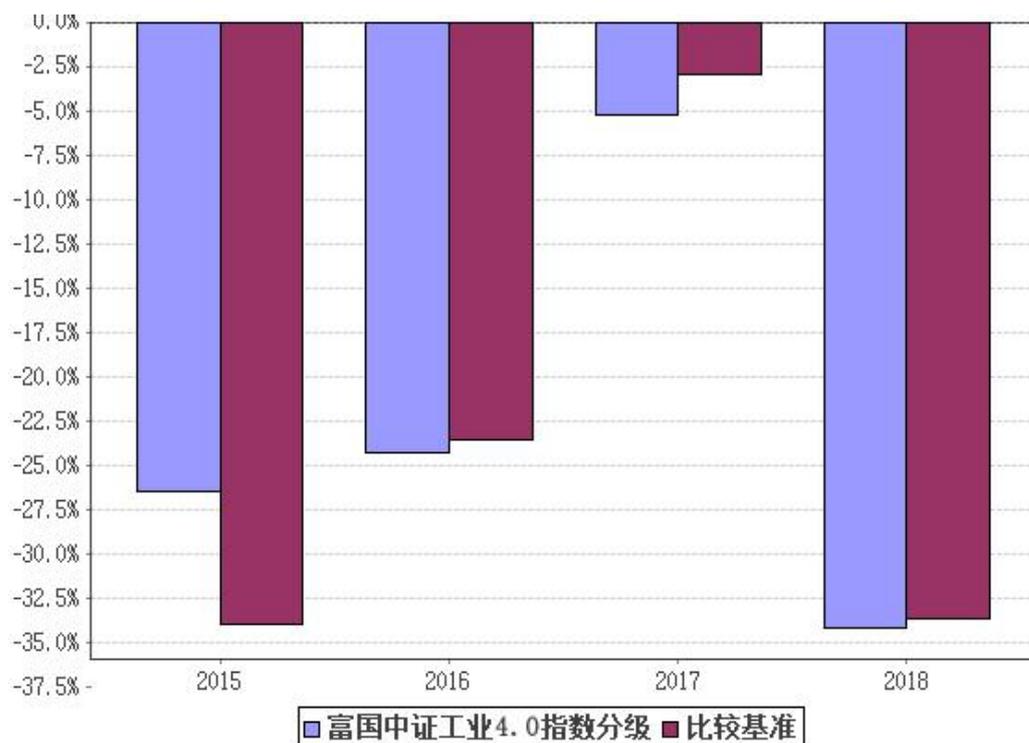
其中,T=2,3,4,⋯; $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示t日至T日的(1+benchmark_t)数学连乘。

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2018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（2018 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	1.003
期末工业 4A 份额累计参考净值	1.162
期末工业 4B 份额参考净值	0.745
期末工业 4B 份额累计参考净值	0.029
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

注：过往三年本基金未进行利润分配。

§ 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。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省国际信托股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2018 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、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等一百二十四只公开募集证券投资基金。

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		
王乐乐	本基金基金经理	2017-11-27	—	9	博士，自 2010 年 6 月至 2011 年 11 月在上海证券有限责任公司任研究员；自 2011 年 11 月至 2012 年 6 月在华泰联合证券有限责任公司任研究员；自 2012 年 7 月至 2015 年 5 月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，2015 年 8 月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 7 月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017 年 10 月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 11 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，2018 年 11 月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 12 月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理；兼任量化投资部量化投资总监助理。具有基金从业资格。
张圣贤	本基金基金经理	2015-08-07	—	12	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，2017 年 7 月起任富国

					新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年11月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理；兼任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决定确定的聘任日期，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合规守信情况的说明

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、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，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，风险管理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

2018年以来，A股市场内忧外患，全年震荡下跌。从外部影响来看，进入2月，市场对美联储货币政策加速收紧产生担忧，美股带动全球市场迎来一轮深幅调整。3月起，贸易摩擦阴霾笼罩全球资本市场。美国先后对500亿、2000亿美元的中国进口商品增加关税，市场对全球贸易担忧加剧，全球股指调整幅度加大。从内部影响来看，5月以来，金融去杠杆导致民企融资困难加剧，部分上市公司债券违约。进入9月，部分公司股权质押被迫平仓，导致A股出现严重的流动性风险。进入4季度，各方情况有所缓解。外部环境来看，美联储加息预期放缓，中美贸易摩擦迎来新的谈判窗口。内部环境来看，金融去杠杆暂告一段落，财政政策、货币政策放松将成为未来一段时间政策的主基调。4季度以来，市场恐慌情绪明显缓解。总体来看，2018年上证综指下跌24.59%，沪深300下跌25.31%，创业板指下跌28.65%。其中，中证工业4.0指数2018年下跌35.23%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日，本基金份额净值为0.874元；份额累计净值为0.360元；本报告期，本基金份额净值增长率为-34.19%，同期业绩比较基准收益率为-33.64%

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2019年，经过2018年的大幅下跌后，目前A股市场总体估值处于历史较低水平，从全球横向来看，也具有较高的吸引力。总体来看，2019年中美贸易摩擦有望阶段性缓和，同时政府也将陆续释放更加宽松的财政及货币政策信号来对冲经济下滑带来的冲击，投资者恐慌情绪有望进一步缓解，市场结构性机会将明显增加。其中，有可能影响市场的重要因素包括中美双方贸易谈判进展、美联储加息进展、中国财政及货币政策刺激力度等。

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

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

本基金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 2018 年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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
资 产：		
银行存款	78,920,204.65	131,536,966.85
结算备付金	—	653,899.64
存出保证金	94,738.94	182,996.11
交易性金融资产	988,580,651.18	1,751,018,934.69
其中：股票投资	988,580,651.18	1,751,018,934.69
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	—	—
应收利息	15,969.32	28,008.29
应收股利	—	—
应收申购款	136,449.54	354,538.36
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,067,748,013.63	1,883,775,343.94
负债和所有者权益	本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 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	692,539.93	1,708,359.68
应付管理人报酬	956,375.79	1,645,409.20
应付托管费	210,402.65	361,990.01
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	369,952.90	996,081.52
应交税费	—	—

应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	360,222.42	410,892.96
负债合计	2,589,493.69	5,122,733.37
所有者权益：		
实收基金	3,066,464,420.49	3,557,359,587.69
未分配利润	-2,001,305,900.55	-1,678,706,977.12
所有者权益合计	1,065,158,519.94	1,878,652,610.57
负债和所有者权益总计	1,067,748,013.63	1,883,775,343.94

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.874 元，基金份额总额 1,218,805,525.01 份。其中：富国中证工业 4.0 指数分级份额净值 0.874 元，份额总额 1,203,842,529.01 份；工业 4A 份额参考净值 1.003 元，份额总额 7,481,498.00 份；工业 4B 份额参考净值 0.745 元，份额总额 7,481,498.00 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：2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)
一、收入	-561,510,369.54	-73,633,386.57
1. 利息收入	834,148.44	1,077,268.59
其中：存款利息收入	800,402.93	1,063,037.83
债券利息收入	—	55.72
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	33,745.51	14,175.04
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-334,327,681.07	-530,515,866.06
其中：股票投资收益	-343,382,365.63	-540,396,884.15
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	111,488.78
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	9,054,684.56	9,769,529.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-228,521,438.64	454,881,954.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	504,601.73	923,256.51
减：二、费用	22,309,125.80	33,321,548.33

1. 管理人报酬	14,543,755.41	22,309,026.67
2. 托管费	3,199,626.18	4,907,985.79
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	3,914,145.15	5,297,612.36
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	—	—
7. 其他费用	651,599.06	806,923.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-583,819,495.34	-106,954,934.90
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-583,819,495.34	-106,954,934.90

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：2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 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）	3,557,359,587.69	-1,678,706,977.12	1,878,652,610.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-583,819,495.34	-583,819,495.34
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）	-490,895,167.20	261,220,571.91	-229,674,595.29
其中：1. 基金申购款	300,947,725.59	-156,827,777.42	144,119,948.17
2. 基金赎回款	-791,842,892.79	418,048,349.33	-373,794,543.46
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）	3,066,464,420.49	-2,001,305,900.55	1,065,158,519.94
项目	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 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）	4,496,675,733.10	-1,989,920,218.67	2,506,755,514.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-106,954,934.90	-106,954,934.90
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）	-939,316,145.41	418,168,176.45	-521,147,968.96

其中：1. 基金申购款	415,471,830.49	-198,105,175.54	217,366,654.95
2. 基金赎回款	-1,354,787,975.90	616,273,351.99	-738,514,623.91
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）	3,557,359,587.69	-1,678,706,977.12	1,878,652,610.57

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
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、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

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(2018年01月01日至2018年12月31日)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017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	33,969,630.16	1.33	3,356,613.36	0.10
申万宏源	50,062,372.47	1.97	100,785,454.50	3.01

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

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回购交易。

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（2018年01月01日至2018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 (%)
申万宏源	45,622.34	1.97	248.42	0.07
海通证券	30,953.03	1.33	—	—
关联方名称	上年度可比期间（2017年01月01日至2017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	3,125.89	0.10	3,125.89	0.31
申万宏源	92,178.35	3.02	92,178.35	9.25

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（2018年01月01日至	上年度可比期间（2017年01月
----	-----------------	------------------

	2018年12月31日)	01日至2017年12月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	14,543,755.41	22,309,026.67
其中：支付销售机构的客户维护费	6,711,255.70	10,142,638.71

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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2018年01月01日至 2018年12月31日)	上年度可比期间(2017年01 月01日至2017年12月31日)
当期发生的基金应支付的 托管费	3,199,626.18	4,907,985.79

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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（2018年01月01日至2018年12月31日）		上年度可比期间（2017年01月01日至2017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	78,920,204.65	776,914.66	131,536,966.85	1,041,910.15

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

7.4.4.7.1 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（2018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
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股认购	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	—

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2018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2018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2018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988,530,505.38元，属于第二层次的余额为人民币50,145.80元，属于第三层次余额为人民币0.00元（于2017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1,750,902,749.69元，属于第二层次的余额为人民币116,185.00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	988,580,651.18	92.59
	其中：股票	988,580,651.18	92.59
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	78,920,204.65	7.39
8	其他各项资产	247,157.80	0.02
9	合计	1,067,748,013.63	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	108,552.67	0.01
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	4,878.72	0.00
J	金融业	50,145.80	0.01
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	163,577.19	0.02

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	762,348,260.29	71.57
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	226,068,813.70	21.22
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	988,417,073.99	92.80

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	601766	中国中车	5,842,100	52,695,742.00	4.95
2	000063	中兴通讯	2,689,340	52,684,170.60	4.95
3	300124	汇川技术	2,566,435	51,688,000.90	4.85
4	300750	宁德时代	688,400	50,803,920.00	4.77
5	002008	大族激光	1,653,687	50,205,937.32	4.71
6	603019	中科曙光	1,395,000	50,052,600.00	4.70
7	002202	金风科技	5,008,060	50,030,519.40	4.70
8	601012	隆基股份	2,837,830	49,491,755.20	4.65
9	600588	用友网络	2,318,983	49,394,337.90	4.64
10	300024	机器人	3,633,474	48,034,526.28	4.51

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	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.01
2	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.00
3	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.00

4	002230	科大讯飞	198	4,878.72	0.00
5	002415	海康威视	71	1,828.96	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	601012	隆基股份	99,026,992.40	5.27
2	600703	三安光电	94,487,236.06	5.03
3	002202	金风科技	91,627,640.80	4.88
4	600588	用友网络	87,168,893.33	4.64
5	601766	中国中车	81,441,222.09	4.34
6	603019	中科曙光	69,825,152.03	3.72
7	000977	浪潮信息	66,732,254.06	3.55
8	300433	蓝思科技	65,162,494.95	3.47
9	300750	宁德时代	55,075,307.24	2.93
10	300316	晶盛机电	50,495,848.98	2.69
11	002439	启明星辰	41,989,971.14	2.24
12	300170	汉得信息	34,464,843.97	1.83
13	300166	东方国信	34,128,965.55	1.82
14	600760	中航沈飞	32,631,790.14	1.74
15	000063	中兴通讯	29,747,123.76	1.58
16	601100	恒立液压	28,148,481.48	1.50
17	300188	美亚柏科	26,239,081.94	1.40
18	002368	太极股份	24,575,207.87	1.31
19	600967	内蒙一机	23,131,434.13	1.23
20	600845	宝信软件	21,381,588.58	1.14

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	000988	华工科技	80,249,412.17	4.27
2	002415	海康威视	78,550,517.44	4.18
3	300207	欣旺达	74,073,457.08	3.94
4	600699	均胜电子	72,147,662.81	3.84
5	002426	胜利精密	68,900,718.62	3.67
6	002185	华天科技	68,388,380.89	3.64
7	002230	科大讯飞	64,056,193.20	3.41
8	300115	长盈精密	60,063,711.44	3.20

9	000725	京东方 A	57,568,364.40	3.06
10	600172	黄河旋风	56,090,126.98	2.99
11	300450	先导智能	55,126,663.25	2.93
12	000997	新大陆	50,294,142.57	2.68
13	300367	东方网力	47,731,838.20	2.54
14	300083	劲胜智能	47,233,467.20	2.51
15	600038	中直股份	46,871,929.64	2.49
16	300433	蓝思科技	40,741,891.88	2.17
17	300124	汇川技术	39,954,321.80	2.13
18	002371	北方华创	39,708,595.19	2.11
19	601012	隆基股份	32,209,443.69	1.71
20	300097	智云股份	30,422,133.18	1.62

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	1,178,986,294.82
卖出股票收入（成交）总额	1,369,520,774.06

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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“中兴通讯”的发行主体中兴通讯股份有限公司（以下简称“公司”）于2018年6月13日公告，公司已与美国BIS达成《替代的和解协议》，根据协议，公司将支付合计14亿美元民事罚款。

中兴通讯为本基金跟踪标的指数成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未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。

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	94,738.94
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	15,969.32
5	应收申购款	136,449.54
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	247,157.80

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	601860	紫金银行	50,145.80	0.00	认购新股

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	337	22,200.29	4,889,489.00	65.35	2,592,009.00	34.65

富国中证工业 4.0 指数分级 B	1,849	4,046.24	143,987.00	1.92	7,337,511.00	98.08
富国中证工业 4.0 指数分级	68,735	17,514.26	2,134,706.31	0.18	1,201,707,822.70	99.82
合计	70,921	17,185.40	7,168,182.31	0.59	1,211,637,342.70	99.41

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	2,930,293	39.17
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —传统—普通保险产品	885,287	11.83
3	丁碧霞	577,268	7.72
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —分红—个人分红	449,964	6.01
5	陈永诚	408,900	5.47
6	太平洋资管—建设银行—太平洋卓 越第三极稳定增值二号产品	337,360	4.51
7	陈龙	320,600	4.29
8	孟本先	275,048	3.68
9	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —万能—个人万能	168,737	2.26
10	廖义玲	115,649	1.55

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	赵守运	458,382	6.13
2	程杨	271,090	3.62
3	周荣国	203,920	2.73
4	刘卫兵	199,773	2.67
5	邹晓东	151,822	2.03
6	朱德润	144,489	1.93
7	刘洋	135,367	1.81
8	厦门德莱科仪实业有限公司	133,787	1.79
9	朱增源	129,754	1.73
10	张晓惠	128,832	1.72

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	富国中证工业 4.0 指数分级	—	—

本基金	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	20,787.55	0.0017
	合计	20,787.55	0.0017

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	31,571,882.00	31,571,883.00	2,110,221,748.80
本报告期基金总申购份额	—	—	175,400,539.60
减：本报告期基金总赎回份额	—	—	450,372,751.35
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-24,090,384.00	-24,090,385.00	-631,407,008.04
报告期期末基金份额总额	7,481,498.00	7,481,498.00	1,203,842,529.01

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

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 16 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

2018 年 10 月，公司收到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。公司对此高度重视，成立专项整改小组逐条落实整改要求，强化公司内控制度建设和合规管理措施，进一步提升全员合规意识。报告期内公司已通过上海证监局的整改验收。

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	6,459,454.15	0.25	—	—	48,000,000.00	100.00	—	—	5,887.83	0.25	—
川财证券	2	291,699,330.21	11.46	—	—	—	—	—	—	265,826.68	11.46	—
方正证券	1	190,947,818.65	7.50	—	—	—	—	—	—	174,011.18	7.50	—
广发证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国都证券	2	525,950.63	0.02	—	—	—	—	—	—	479.30	0.02	—
国海证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	33,969,630.16	1.33	—	—	—	—	—	—	30,953.03	1.33	—
华创证券	1	45,188,065.20	1.78	—	—	—	—	—	—	41,183.35	1.78	—
江海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	146,628,149.60	5.76	—	—	—	—	—	—	133,623.62	5.76	—
上海证券	2	125,027,091.27	4.91	—	—	—	—	—	—	113,938.73	4.91	—
申万宏源	4	50,062,372.47	1.97	—	—	—	—	—	—	45,622.34	1.97	—
西部证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

新时代证券	2	1,091,029,423.81	42.88	—	—	—	—	—	—	994,264.63	42.88	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	563,012,738.88	22.13	—	—	—	—	—	—	513,076.98	22.13	—

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。本报告期本基金退租券商交易单元：国海证券（233306）。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。