

富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金

二〇二四年第 1 季度报告

2024 年 03 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

报告送出日期：2024 年 04 月 22 日

## § 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。

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 2024 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|                 |  |                 |
|-----------------|--|-----------------|
| 基金简称            | 富国中证工业 4.0 指数  |                 |
| 场内简称            | 工业 40LOF   |                 |
| 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   |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 743,894,343.20 份   |                 |
| 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。本基金的资产配置策略、股票投资组合构建、存托凭证投资策略、债券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与转融通证券出借业务策略详见法律文件。 |                 |
| 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。  |                 |
| 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   |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 富国中证工业 4.0 指数 A  | 富国中证工业 4.0 指数 C |
| 下属分级基金场内简称      | 工业 40LOF   | —               |
| 下属分级基金的交易代码     | 161031   | 014172          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 733,877,293.50 份   | 10,017,049.70 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2024年01月01日-2024年03月31日） |                  |
|-----------------|------------------------------|------------------|
|                 | 富国中证工业4.0指数<br>A             | 富国中证工业4.0指数<br>C |
| 1. 本期已实现收益      | -598,958.81                  | -8,214.01        |
| 2. 本期利润         | -16,353,380.19               | -202,957.92      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0222                      | -0.0259          |
| 4. 期末基金资产净值     | 597,311,647.17               | 8,120,288.75     |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.814                        | 0.811            |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

###### (1) 富国中证工业4.0指数A

| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | -2.63%  | 1.78%     | -2.44%     | 1.79%         | -0.19% | -0.01% |
| 过去六个月      | -7.39%  | 1.50%     | -7.47%     | 1.51%         | 0.08%  | -0.01% |
| 过去一年       | -16.34% | 1.34%     | -17.28%    | 1.34%         | 0.94%  | 0.00%  |
| 过去三年       | -16.51% | 1.43%     | -19.48%    | 1.44%         | 2.97%  | -0.01% |
| 过去五年       | 52.16%  | 1.65%     | 44.22%     | 1.66%         | 7.94%  | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -27.16% | 1.88%     | -34.76%    | 1.95%         | 7.60%  | -0.07% |

###### (2) 富国中证工业4.0指数C

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -2.64% | 1.78%     | -2.44%     | 1.79%         | -0.20% | -0.01% |

|                     |         |       |         |       |       |        |
|---------------------|---------|-------|---------|-------|-------|--------|
| 过去六个月               | -7.42%  | 1.50% | -7.47%  | 1.51% | 0.05% | -0.01% |
| 过去一年                | -16.56% | 1.33% | -17.28% | 1.34% | 0.72% | -0.01% |
| 自基金分级<br>生效日起至<br>今 | -33.58% | 1.44% | -34.92% | 1.45% | 1.34% | -0.01% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准 收益率变动的比较

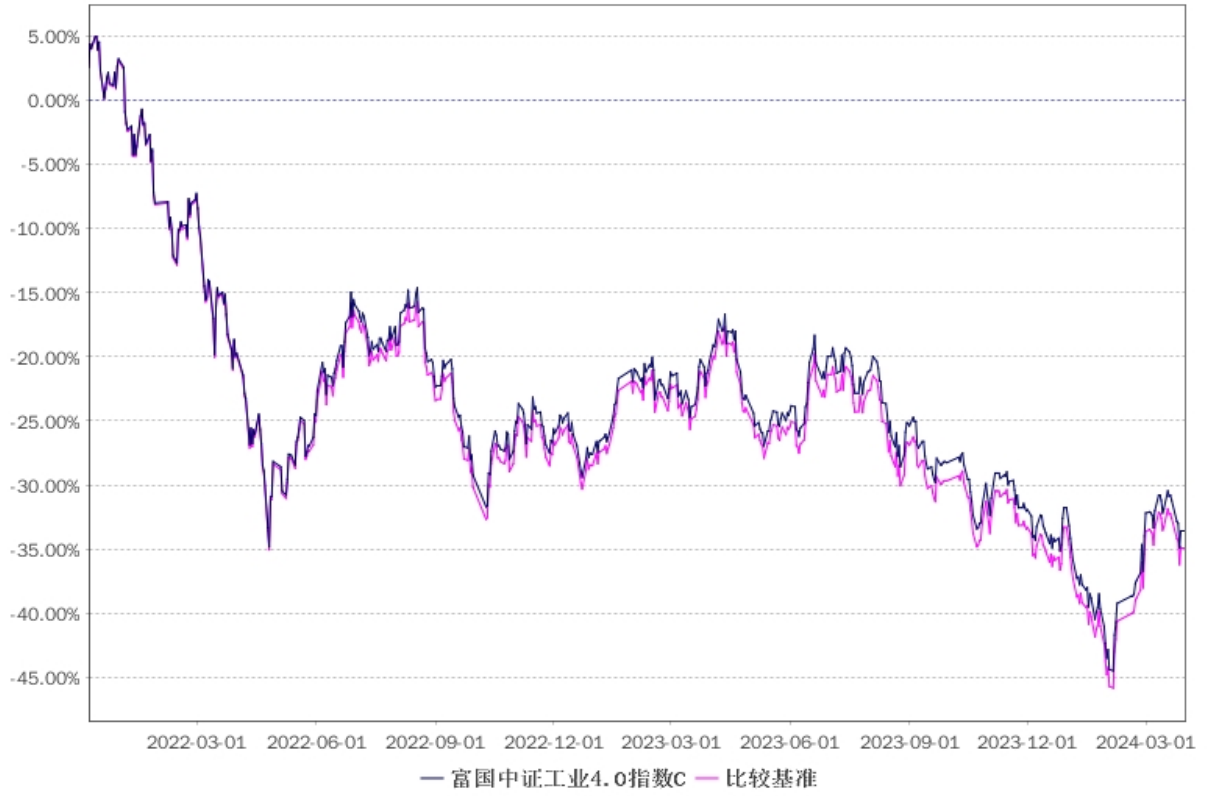
(1) 自基金合同生效以来富国中证工业 4.0 指数 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 3 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。

(2) 自基金合同生效以来富国中证工业 4.0 指数 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2024年3月31日。

2、本基金自2021年12月7日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

## § 4 管理人报告

### 4.1 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 |        |  |
| 张圣贤 | 本基金现任基金经理 | 2015-08-07  | —    | 17     | 硕士，曾任上海申银万国证券研究所有限公司分析师；自2015年3月加入富国基金管理有限公司，历任基金经理助理、定量基金经理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部量化投资副总监兼定量基金经理。自2015年06月起任富国中证军工指数型证券投资基金(原富国中证军工指数分级证券投资基金)基金经理；自2015年06月起任富国中证新能源汽车指数型证券投资基金(原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08月起任富国中证工业4.0指数型证券投资基金(原富国中证工业4.0指数分级证券投资基金)基金经理；自2015年08月起任富国中证体育产业指数型证券投资基金(原富国中证体育产业指数分级证券投资基 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>金)基金经理;自2016年02月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金(LOF)基金经理;自2017年11月起任富国中证煤炭指数型证券投资基金(原富国中证煤炭指数分级证券投资基金)基金经理;自2020年04月起任富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理;自2020年12月起任富国中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理;自2020年12月起任富国中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理;自2021年06月起任富国中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经理;自2021年08月起任富国中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理;自2022年01月起任富国中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理;自2022年01月起任富国中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理;自2022年06月起任富国中证消费电子主题交易型开放</p> |
|--|--|--|--|--|



|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2022 年 08 月起任富国中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证绿色电力交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国中证绿色电力交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 指数型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 指数型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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，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。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。

#### **4.3.2 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未出现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 报告期内基金的投资策略和运作分析**

2024 年开年以来，国内悲观预期加速释放，海外修正抢跑的降息预期。一方面，在 1 月中旬降息预期落空后，市场对国内基本面以及政策力度的中长期担忧在短期集中释放，资金和情绪的负反馈导致市场调整加速；另一方面，美国 12 月物价、非农等多项数据超预期，海外修正抢跑的降息预期，美联储 3 月降息的概

率不足 50%，美元美债再次反弹。尽管月末超预期降准、地产政策优化以及资本市场政策密集出台使得权重股带领市场短暂反弹，但雪球敲入、私募强制平仓等消息面和资金面负反馈仍在持续，中小盘股票继续探底，TMT、军工、医药等成长板块跌幅居前。2 月，随着国内经济与政策预期得到重新修正，风险偏好改善驱动市场快速反弹。2 月初资金面负反馈加剧，市场出现恐慌性下跌。汇金等机构借道 ETF 加大入市力度，同时入市品种扩大至中证 500、中证 1000、中证 2000 为代表的中小盘 ETF。流动性风险解除、筹码压力显著缓解，市场迎来技术性反弹。节后在春节消费数据超预期、1 月金融数据“开门红”，海外 AI 技术迎来突破等信息刺激下，A 股迎来大幅反弹，月末沪指成功站上 3000 点。3 月，市场重新进入以景气和政策为驱动的修复期，指数围绕关键点位震荡。一方面，两会定调全年政策思路，虽然狭义赤字率并未如超市场预期，但增长目标定在 5% 左右、广义财政扩张、新质生产力及大规模设备更新等产业端政策具备想象空间，有效稳定资本市场预期，驱动市场在三月中上旬延续修复；另一方面，1-2 月国内经济仍呈现结构性复苏，工业生产、制造业投资、消费、CPI 等超预期修复。经过前期大幅上涨后，投资者关注点重回现实，市场在三月下旬做多动能减弱，沪指一度下挫至 3000 点以下，但月末在政策预期催化下回到 3000 点上。

总体来看，2024 年 1 季度上证综指上涨 2.23%，沪深 300 上涨 3.1%，创业板指下跌 3.87%，中证 500 指数下跌 2.64%。

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。

#### **4.5 报告期内基金的业绩表现**

本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-2.63%，C 级为-2.64%，同期业绩比较基准收益率 A 级为-2.44%，C 级为-2.44%。

#### **4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 572,468,966.67 | 94.33        |
|    | 其中：股票             | 572,468,966.67 | 94.33        |
| 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      | 34,183,865.20  | 5.63         |
| 7  | 其他资产              | 211,517.22     | 0.03         |
| 8  | 合计                | 606,864,349.09 | 100.00       |

注：本基金通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 43,198,234.00 元，占资产净值比例为 7.14%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | —              | —            |
| C  | 制造业              | 527,723,718.36 | 87.16        |
| 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  | 44,327,697.75  | 7.32         |
| 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            | 572,051,416.11 | 94.49 |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —          | —            |
| B  | 采矿业              | —          | —            |
| C  | 制造业              | 376,595.28 | 0.06         |
| 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  | 12,460.82  | 0.00         |
| J  | 金融业              | —          | —            |
| K  | 房地产业             | —          | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,097.60   | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 15,750.21  | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 9,646.65   | 0.00         |
| 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               | 417,550.56 | 0.07         |

### 5.3 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

#### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|
|----|------|------|-------|---------|-----------|

|    |        |      |           |               | (%)  |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 178,775   | 33,995,854.00 | 5.62 |
| 2  | 002475 | 立讯精密 | 1,046,084 | 30,765,330.44 | 5.08 |
| 3  | 601138 | 工业富联 | 1,330,700 | 30,300,039.00 | 5.00 |
| 4  | 000725 | 京东方A | 7,234,700 | 29,372,882.00 | 4.85 |
| 5  | 000333 | 美的集团 | 453,621   | 29,131,540.62 | 4.81 |
| 6  | 002371 | 北方华创 | 91,495    | 27,960,872.00 | 4.62 |
| 7  | 300124 | 汇川技术 | 451,825   | 27,660,726.50 | 4.57 |
| 8  | 000063 | 中兴通讯 | 967,940   | 27,092,640.60 | 4.47 |
| 9  | 002415 | 海康威视 | 837,200   | 26,924,352.00 | 4.45 |
| 10 | 603501 | 韦尔股份 | 251,749   | 24,774,619.09 | 4.09 |

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

#### 票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量(股) | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 301587 | 中瑞股份  | 3,056 | 66,406.88 | 0.01         |
| 2  | 001359 | C平安电工 | 1,833 | 51,485.96 | 0.01         |
| 3  | 001389 | C广合科技 | 2,219 | 38,677.17 | 0.01         |
| 4  | 601096 | 宏盛华源  | 3,918 | 17,631.00 | 0.00         |
| 5  | 688652 | 京仪装备  | 416   | 17,621.76 | 0.00         |

### 5.4 报告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。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称    | 金额（元）     |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 13,667.68 |

|   |          |            |
|---|----------|------------|
| 2 | 应收证券清算款  | —          |
| 3 | 应收股利     | —          |
| 4 | 应收利息     | —          |
| 5 | 应收申购款    | 172,279.76 |
| 6 | 其他应收款    | —          |
| 7 | 应计出借证券利息 | 25,569.78  |
| 8 | 其他       | —          |
| 9 | 合计       | 211,517.22 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 期末指数投资前十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  | 000333 | 美的集团 | 2,234,856.00   | 0.37          | 转融通流通受限  |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 1,977,664.00   | 0.33          | 转融通流通受限  |
| 3  | 000063 | 中兴通讯 | 1,956,501.00   | 0.32          | 转融通流通受限  |
| 4  | 000725 | 京东方A | 1,923,222.00   | 0.32          | 转融通流通受限  |
| 5  | 300124 | 汇川技术 | 1,787,624.00   | 0.30          | 转融通流通受限  |
| 6  | 002475 | 立讯精密 | 1,732,249.00   | 0.29          | 转融通流通受限  |
| 7  | 002371 | 北方华创 | 1,711,360.00   | 0.28          | 转融通流通受限  |
| 8  | 002415 | 海康威视 | 1,643,376.00   | 0.27          | 转融通流通受限  |
| 9  | 603501 | 韦尔股份 | 1,505,673.00   | 0.25          | 转融通流通受限  |
| 10 | 601138 | 工业富联 | 1,054,251.00   | 0.17          | 转融通流通受限  |

##### 5.11.5.2 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  | 301587 | 中瑞股份 | 59,757.50      | 0.01          | 新股认购     |
| 1  | 301587 | 中瑞股份 | 6,649.38       | 0.00          | 新股限售     |



|   |        |        |           |      |      |
|---|--------|--------|-----------|------|------|
| 2 | 001389 | C 广合科技 | 34,807.71 | 0.01 | 新股认购 |
| 2 | 001389 | C 广合科技 | 3,869.46  | 0.00 | 新股限售 |
| 3 | 601096 | 宏盛华源   | 17,631.00 | 0.00 | 新股限售 |
| 4 | 688652 | 京仪装备   | 17,621.76 | 0.00 | 新股限售 |
| 5 | 001359 | C 平安电工 | 4,456.48  | 0.00 | 新股限售 |

#### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 富国中证工业 4.0 指数<br>A | 富国中证工业 4.0 指数 C |
|-------------------------------|--------------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 738,271,706.13     | 6,890,085.70    |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 14,843,554.35      | 9,434,126.69    |
| 报告期期间基金总赎回份额                  | 19,237,966.98      | 6,307,162.69    |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | —                  | —               |
| 报告期期末基金份额总额                   | 733,877,293.50     | 10,017,049.70   |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 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、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
- 5、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 6、富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金基金合同
- 7、富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金托管协议
- 8、富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金财务报表及报表附注
- 9、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

### 9.3 查阅方式

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：  
<http://www.fullgoal.com.cn>。

富国基金管理有限公司  
2024 年 04 月 22 日