

富国中证工业 4.0 指数分级 证券投资基金招募说明书（更新）

（摘要）

（二〇一六年第二号）

富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金的募集申请经中国证监会 2015 年 5 月 12 日证监许可【2015】889 号注册。本基金的基金合同于 2015 年 6 月 15 日生效。

重要提示

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基

金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，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。基金管理人并不承诺或保证富国工业 4.0A 份额的基金份额持有人的本金及约定应得收益，如在基金存续期内本基金资产出现极端损失情况下，富国工业 4.0A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止至 2016 年 12 月 15 日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2016 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：富国基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼

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

法定代表人：薛爱东

总经理：陈戈

成立日期：1999 年 4 月 13 日

电话：（021）20361818

传真：（021）20361616

联系人：范伟隽

注册资本：3 亿元人民币

股权结构（截止于 2016 年 12 月 15 日）：

股东名称	出资比例
------	------

海通证券股份有限公司	27.775%
申万宏源证券有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托股份有限公司	16.675%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理的工作,确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则,防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设二十三个部门、三个分公司和二个子分公司,分别是:权益投资部、固定收益投资部、固定收益专户投资部、固定收益研究部、量化投资部、海外权益投资部、权益专户投资部、养老金投资部、权益研究部、集中交易部、董事会办公室、综合管理部、机构业务部、零售业务部、营销管理部、客户服务部、电子商务部、战略与产品部、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、信息技术部、运营部、北京分公司、成都分公司、广州分公司、富国资产管理(香港)有限公司、富国资产管理(上海)有限公司。权益投资部:负责权益类基金产品的投资管理;固定收益投资部:负责固定收益类公募产品和非固定收益类公募产品的债券部分(包括公司自有资金等)的投资管理;固定收益专户投资部:负责一对一、一对多等非公募固定收益类专户的投资管理;固定收益研究部:负责固定收益类公募产品和非固定收益类公募产品的债券部分的研究管理等;量化投资部:负责公司有关量化投资管理业务;海外权益投资部:负责公司在境外(含香港)的权益投资管理;权益专户投资部:负责社保、保险、QFII、一对一、一对多等非公募权益类专户的投资管理;养老金投资部:负责养老金(企业年金、职业年金、基本养老金、社保等)及类养老金专户等产品的投资管理;权益研究部:负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等;集中交易部:负责投资交易和风险控制;董事会办公室:履行公司章程规定的工作职责,暂与综合管理部合署办公;综合管理部:负责公司董事会日常事务、公司文秘管理、公司(内部)宣传、信息调研、行政后勤管理等工作;机构业务部:负责年金、专户、社保以及共同基金的机构客户营销工作;零售业务部:管理华东营销中心、华中营销中心、华南营销中心(广州分公司)、北方营销中心(北京分公司)、西部营销中心(成都分

公司)、华北营销中心,负责共同基金的零售业务;营销管理部:负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒体关系管理,为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式销售支持;客户服务部:拟定客户服务策略,制定客户服务规范,建设客户服务团队,提高客户满意度,收集客户信息,分析客户需求,支持公司决策;电子商务部:负责基金电子商务发展趋势分析,拟定并落实公司电子商务发展策略和实施细则,有效推进公司电子商务业务;战略与产品部:负责开发、维护公募和非公募产品,协助管理层研究、制定、落实、调整公司发展战略,建立数据搜集、分析平台,为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持;监察稽核部:负责监察、风控、法务和信息披露;信息技术部:负责软件开发与系统维护等;运营部:负责基金会计与清算;计划财务部:负责公司财务计划与管理;人力资源部:负责人力资源规划与管理;富国资产管理(香港)有限公司:证券交易、就证券提供意见和提供资产管理;富国资产管理(上海)有限公司:经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务。

截止到 2016 年 11 月 30 日,公司有员工 362 人,其中 65.5%以上具有硕士以上学历。

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

薛爱东先生,董事长,研究生学历,高级经济师。历任交通银行扬州分行监察室副主任、办公室主任、会计部经理、证券部经理,海通证券股份有限公司扬州营业部总经理,兴安证券有限责任公司托管组组长,海通证券股份有限公司黑龙江管理总部总经理兼党委书记、上海分公司总经理兼党委书记、公司机关党委书记兼总经理办公室主任。

陈戈先生,董事,总经理,研究生学历。历任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员,富国基金管理有限公司研究员、基金经理、研究部总经理、总经理助理、副总经理,2005 年 4 月至 2014 年 4 月任富国天益价值证券投资基金基金经理。

麦陈婉芬女士(Constance Mak),董事,文学及商学学士,加拿大注册会计师。现任 BMO 金融集团亚洲业务总经理(General Manager, Asia, International,

BMO Financial Group), 中加贸易理事会董事和加拿大中文电视台顾问团的成员。历任 St. Margaret' s College 教师, 加拿大毕马威 (KPMG) 会计事务所的合伙人。

方荣义先生, 董事, 研究生学历, 高级会计师。现任申万宏源证券有限公司副总经理、财务总监。历任北京用友电子财务技术有限公司研究所信息中心副主任, 厦门大学工商管理教育中心副教授, 中国人民银行深圳经济特区分行(深圳市中心支行)会计处副处长, 中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构处处长, 中国银行业监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行监管处处长, 申银万国证券股份有限公司财务总监。

裴长江先生, 董事, 研究生学历。现任海通证券股份有限公司副总经理。历任上海万国证券公司研究部研究员、闸北营业部总经理助理、总经理, 申银万国证券公司闸北营业部总经理、浙江管理总部副总经理、经纪总部副总经理, 华宝信托投资有限责任公司投资总监, 华宝兴业基金管理有限公司董事兼总经理。

Edgar Normund Legzdins 先生, 董事, 本科学历, 加拿大特许会计师。现任 BMO 金融集团国际业务全球总裁 (SVP & Managing Director, International, BMO Financial Group)。1980 年至 1984 年在 Coopers & Lybrand 担任审计工作; 1984 年加入加拿大 BMO 银行金融集团蒙特利尔银行。

蒲冰先生, 董事, 本科学历, 中级审计师。现任山东省国际信托股份有限公司自营业务部副总经理。历任山东正源和信会计师事务所审计部、评估部员工, 山东省鲁信置地有限公司计财部业务经理, 山东省国际信托股份有限公司计财部业务经理, 山东省国际信托股份有限公司合规审计部副总经理。

张克均先生, 董事, 研究生学历。现任申万宏源证券有限公司战略规划总部总经理。历任福建兴业银行厦门分行电脑部副经理、计划部副经理、证券部副经理、杏林支行副行长; 申银万国证券股份有限公司厦门证券营业部副经理、经理、深圳分公司副总经理兼厦门夏禾路证券营业部经理、经纪总部总经理。

黄平先生, 独立董事, 研究生学历。现任上海盛源实业(集团)有限公司董事局主席。历任上海市劳改局政治处主任; 上海华夏立向实业有限公司副总经理; 上海盛源实业(集团)有限公司总经理、总裁。

伍时焯 (Cary S. Ng) 先生, 独立董事, 研究生学历, 加拿大特许会计师。现任圣力嘉学院 (Seneca College) 工商系会计及财务金融科教授。1976 年加入加拿大毕马威会计事务所的前身 Thorne Riddell 公司担任审计工作, 有 30 余年财务管理及信息系统项目管理经验, 曾任职在 Neo Materials Technologies Inc. 前身 AMR Technologies Inc., MLJ Global Business Developments Inc., UniLink Tele.com Inc. 等国际性公司为首席财务总监 (CFO) 及财务副总裁。

李宪明先生, 独立董事, 研究生学历。现任上海市锦天城律师事务所律师、高级合伙人。历任吉林大学法学院教师。

2、监事会成员

岳增光先生, 监事长, 本科学历, 高级会计师。现任山东省国际信托股份有限公司纪委书记、风控总监。历任山东省济南市经济发展总公司会计, 山东正源和信有限责任会计师事务所室主任, 山东鲁信实业集团公司财务, 山东省鲁信投资控股集团有限公司财务, 山东省国际信托股份有限公司财务部经理。

沈寅先生, 监事, 本科学历。现任申万宏源证券有限公司合规与风险管理总部总经理助理及公司律师。历任上海市中级人民法院助理审判员、审判员、审判组长; 上海市第二中级人民法院办公室综合科科长。

夏瑾璐女士, 监事, 研究生学历。现任蒙特利尔银行上海代表处首席代表。历任上海大学外语系教师; 荷兰银行上海分行结构融资部经理; 蒙特利尔银行金融机构部总裁助理; 荷兰银行上海分行助理副总裁。

仇夏萍女士, 监事, 研究生学历。现任海通证券股份有限公司计划财务部总经理。历任中国工商银行上海分行杨浦支行所任职; 在华夏证券有限公司东方路营业部任职。

孙琪先生, 监事, 本科学历。现任富国基金管理有限公司 IT 副总监。历任杭州恒生电子股份公司职员, 东吴证券有限公司职员, 富国基金管理有限公司系统管理员、系统管理主管、IT 总监助理。

唐洁女士, 监事, 本科学历, CFA。现任富国基金管理有限公司策略研究员。历任上海夏商投资咨询有限公司研究员, 富国基金管理有限公司研究助理、助理研究员。

王旭辉先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司华东营销中心总经理。历任职于邾县政府办公室职员，邾县国营一厂厂长，富国基金管理有限公司客户经理、高级客户经理。

陆运天先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司电子商务部电子商务总监助理。历任汇添富基金电子商务经理，富国基金管理有限公司资深电子商务经理。

3、督察长

范伟隽先生，研究生学历。现任富国基金管理有限公司督察长。历任毕马威华振会计师事务所项目经理，中国证监会上海监管局主任科员、副处长。

4、经营管理层人员

陈戈先生，总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

林志松先生，本科学历，20 年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理。历任漳州进出口商品检验局秘书、办事处负责人，厦门证券公司业务经理，富国基金管理有限公司监察稽核部稽察员、部门副经理、经理、督察长。

陆文佳女士，研究生学历，14 年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理。历任中国建设银行上海市分支行职员、经理，华安基金管理有限公司上海营销总部投资顾问、总监助理、市场部总监助理、上海分公司总经理助理、市场部总经理、市场总监、公司副营销总裁。

李笑薇女士，研究生学历，高级经济师，14 年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。历任国家教委外资贷款办公室项目官员，摩根士丹利资本国际 Barra 公司 (MSCIBARRA) BARRA 股票风险评估部高级研究员，巴克莱国际投资管理公司 (BarclaysGlobal Investors) 大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员，富国基金管理有限公司量化与海外投资部总经理兼基金经理、总经理助理兼量化与海外投资部总经理兼基金经理。

朱少醒先生，研究生学历，17 年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理兼权益投资部总经理兼基金经理。历任富国基金管理有限公司产品开发主管、基金经理助理、基金经理、研究部总经理兼基金经理、总经理助

理兼研究部总经理兼基金经理、总经理助理兼权益投资部总经理兼基金经理。

5、本基金基金经理

徐幼华，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。

张圣贤，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；兼任量化投资部量化投资总监助理。

6、投资决策委员会

投资决策委员会成员构成如下：公司总经理陈戈先生，主动权益及固定收益投资副总经理朱少醒先生和量化与海外投资副总经理李笑薇女士。

列席人员包括：督察长、集中交易部总经理以及投委会主席邀请的其他人员。

本基金采取集体投资决策制度。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

二、主要人员情况

截至 2016 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 210 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 624 只。自 2003 年以来，中国工商银行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构：富国基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼

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

法定代表人：薛爱东

总经理：陈戈

直销网点：直销中心

直销中心地址：上海市杨浦区大连路 588 号宝地广场 A 座 23 楼

客户服务统一咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

传真：021-80126257、80126253

联系人：孙迪

公司网站：www.fullgoal.com.cn

2、场外销售机构

（1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法人代表：易会满

联系电话：（010）95588

传真电话：（010）95588

联系人员：杨先生

客服电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

（2）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法人代表：周慕冰

联系电话：（010）85108227

传真电话：（010）85109219

联系人员： 曾艳

客服电话： 95599

公司网站： www.abchina.com

(3) 中国银行股份有限公司

注册地址： 北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址： 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法人代表： 田国立

联系电话： (010) 66594946

传真电话： (010) 66594946

联系人员： 陈洪源

客服电话： 95566

公司网站： www.boc.cn

(4) 中国建设银行股份有限公司

注册地址： 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址： 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法人代表： 王洪章

联系电话： (010) 66275654

传真电话： 010—66275654

联系人员： 张静

客服电话： 95533

公司网站： www.ccb.com

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址： 深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址： 深圳市福田区深南大道 7088 号

法人代表： 李建红

联系电话： (0755) 83198888

传真电话： (0755) 83195109

联系人员： 曾里南

客服电话： 95555

公司网站： www.cmbchina.com

(6)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市北京东路 689 号

法人代表：吉晓辉

联系电话： (021) 61618888

传真电话： (021) 63604199

联系人员： 唐小姐

客服电话： 95528

公司网站： www.spdb.com.cn

(7)中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路 4 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法人代表：董文标

联系电话： (010) 58351666

传真电话： (010) 57092611

联系人员： 杨成茜

客服电话： 95568

公司网站： www.cmbc.com.cn

(8)中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法人代表：李国华

联系电话： (010) 68858057

传真电话： (010) 68858057

联系人员： 王硕

客服电话： 95580

公司网站: www.psbc.com

(9)深圳平安银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址: 深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法人代表: 肖遂宁

联系电话: (0755) 22197874

传真电话: (0755) 22197874

联系人员: 蔡宇洲

客服电话: 95511-3

公司网站: www.bank.pingan.com

(10)国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法人代表: 杨德红

联系电话: (021) 38676666

传真电话: (021) 38670666

联系人员: 芮敏琪

客服电话: 400-8888-666/ 95521

公司网站: www.gtja.com

(11)中信建投证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法人代表: 王常青

联系电话: (010) 65183888

传真电话: (010) 65182261

联系人员: 权唐

客服电话: 400-8888-108

公司网站: www.csc108.com

(12)招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

法人代表：宫少林

联系电话：（0755）82943666

传真电话：（0755）82943636

联系人员：林生迎

客服电话：95565、400-8888-111

公司网站：www.newone.com.cn

(13)中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场二期北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法人代表：张佑君

联系电话：（010）84588888

传真电话：（010）84865560

联系人员：顾凌

客服电话：95558

公司网站：www.cs.ecitic.com

(14)中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法人代表：陈有安

联系电话：（010）66568292

传真电话：（010）66568990

联系人员：邓颜

客服电话：4008-888-888

公司网站：www.chinastock.com.cn

(15)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法人代表：王开国

联系电话：（021）23219000

传真电话：（021）23219000

联系人员：李笑鸣

客服电话：95553

公司网站：www.htsec.com

（16）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法人代表：李梅

联系电话：（021）33389888

传真电话：（021）33388224

联系人员：黄莹

客服电话：95523 或 4008895523

公司网站：www.swhysc.com

（17）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法人代表：余维佳

联系电话：023-63786464

传真电话：023-637862121

联系人员：张煜

客服电话：4008096096

公司网站：www.swsc.com.cn

（18）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法人代表：杨宝林

联系电话：0532-85022326

传真电话：0532-85022605

联系人员：吴忠超

客服电话：95548

公司网站：www.citicssd.com

(19) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法人代表：张志刚

联系电话：010-63080985

传真电话：01063080978

联系人员：唐静

客服电话：95321

公司网站：www.cindasc.com

(20) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法人代表：薛峰

联系电话：021-22169999

传真电话：021-22169134

联系人员：刘晨、李芳芳

客服电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

(21) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法人代表：常喆

联系电话：（010）84183333

传真电话：（010）84183311-3389

联系人员：黄静

客服电话：400-818-8118

公司网站：www.guodu.com

（22）第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法人代表：刘学民

联系电话：0755-23838751

传真电话：0755-25838701

联系人员：吴军

客服电话：95358

公司网站：www.firstcapital.com.cn

（23）中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法人代表：王宜四

联系电话：0791-86768681

传真电话：0791-86770178

联系人员：戴蕾

客服电话：400-8866-567

公司网站：www.avicsec.com

（24）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至

21 层

法人代表：高涛

联系电话：（0755）82023442

传真电话：（0755）82026539

联系人员：张鹏

客服电话：95532、400-600-8008

公司网站：www.china-invs.cn

（25）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12-18 层

法人代表：祝献忠

联系电话：010-85556012

传真电话：010-85556053

联系人员：李慧灵

客服电话：400-898-9999

公司网站：www.hrsec.com.cn

（26）天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法人代表：余磊

联系电话：027-87610052

传真电话：027-87618863

联系人员：杨晨

客服电话：4008005000

公司网站：www.tfzq.com

（27）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼

法人代表：汪静波

联系电话：021-3860-0672

传真电话：021-3860-2300

联系人员：张姚杰

客服电话：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

(28)深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法人代表：薛峰

联系电话：0755-33227950

传真电话：0755-82080798

联系人员：汤素娅

客服电话：4006-788-887

公司网站：www.zlfund.cn

(29)上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法人代表：其实

联系电话：021-54509998

传真电话：021-64385308

联系人员：潘世友

客服电话：400-1818-188

公司网站：www.1234567.com.cn

(30)上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法人代表：杨文斌

联系电话：（021）58870011

传真电话：（021）68596916

联系人员：张茹

客服电话：4007009665

公司网站：www.ehowbuy.com

（31）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法人代表：王伟刚

联系电话：010-56282140

传真电话：010-62680827

联系人员：丁向坤

客服电话：400-619-9059

公司网站：www.fundzone.com

（32）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法人代表：陈柏青

联系电话：021-60897840

传真电话：0571-26697013

联系人员：张裕

客服电话：4000766123

公司网站：www.fund123.cn

（33）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法人代表：张跃伟

联系电话：021-58788678 -8201, 13585790204

传真电话： 021—58787698

联系人员： 沈雯斌

客服电话： 400-089-1289

公司网站： www.erichfund.com

(34) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址： 杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址： 浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法人代表： 凌顺平

联系电话： 0571-88911818

传真电话： 0571-86800423

联系人员： 吴强

客服电话： 4008-773-772

公司网站： www.5ifund.com

(35) 上海利得基金销售有限公司

注册地址： 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址： 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法人代表： 沈继伟

联系电话： 021-50583533

传真电话： 021-50583633

联系人员： 曹怡晨

客服电话： 400-067-6266

公司网站： <http://a.leadfund.com.cn>

(36) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址： 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址： 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

法人代表： 梁蓉

联系电话： (010) 66154828

传真电话： (010) 88067526

联系人员： 张旭

客服电话： 400-6262-818

公司网站： www.5irich.com

(37)北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室

办公地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室、海淀北二街 10 号秦鹏大厦 12 层

法人代表：张琪

联系电话：010-62675369

传真电话： 010-62675979

联系人员： 付文红

客服电话： 010-62675369

公司网站： www.xincai.com

(38)上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼

法人代表：燕斌

联系电话：021-52822063

传真电话： 021-52975270

联系人员： 凌秋艳

客服电话： 400-046-6788

公司网站： www.66zichan.com

(39)上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法人代表：陈继武

联系电话：021-63333319

传真电话： 021-63332523

联系人员： 李晓明

客服电话： 4000-178-000

公司网站： www.lingxianfund.com

(40) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址： 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址： 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法人代表： 郭坚

联系电话： 021-20665952

传真电话： 021-22066653

联系人员： 宁博宇

客服电话： 4008219031

公司网站： www.lufunds.com

(41) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址： 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址： 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼
B1201-1203

法人代表： 肖雯

联系电话： 020-89629099

传真电话： 020-89629011

联系人员： 吴煜浩

客服电话： 020-89629066

公司网站： www.yingmi.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加或调整本基金销售机构，并及时公告。

3、场内销售机构：本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位经深圳证券交易所确认后也可代理场内基金份额的发售。

（二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人：周明
电话：（010）59378839
传真：（010）59378907
联系人：朱立元

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人：俞卫锋
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：孙睿
经办律师：黎明、孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所
注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
法定代表人：葛明
联系电话：021-22288888
传真：021-22280000
联系人：徐艳
经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金

五、基金的类型

股票型

六、基金份额的分级

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。

七、基金份额的配对转换

本基金基金合同生效后，在富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额的存续期内，基金管理人将为基金份额持有人办理配对转换业务。

（一）配对转换是指本基金的富国工业 4.0 份额与富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

1、分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份富国工业 4.0 份额的场内份额申请转换成 1 份富国工业 4.0A 份额与 1 份富国工业 4.0B 份额的行为。

2、合并

合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份富国工业 4.0A 份额与 1 份富国工业 4.0B 份额申请转换成 2 份富国工业 4.0 份额的场内份额的行为。

（二）配对转换的业务办理机构

配对转换的业务办理机构见本招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者应当在配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理配对转换。深圳证券交易所、基金登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减配对转换的业务办理机构，并予以公告。

（三）配对转换的业务办理时间

配对转换自基金合同生效后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应

在开始办理配对转换业务的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日(基金管理人公告暂停配对转换时除外),具体的业务办理时间见本招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

八、基金的投资目标

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。

九、投资范围

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%。

十、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。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证工业 4.0 指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、资产配置策略

本基金管理人主要按照中证工业 4.0 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

2、股票投资组合构建

(1) 组合构建方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证工业 4.0 指数的收益表现。

(2) 组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证工业 4.0 指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与中证工业 4.0 指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

①定期调整

根据中证工业 4.0 指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

②不定期调整

A. 当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B. 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪中证工业 4.0 指数;

C. 根据法律、法规的规定,成份股在中证工业 4.0 指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

3、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势,制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,降低跟踪误差。

4、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险、提高投资效率,降低跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。

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。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

（四）投资决策与交易机制

1、本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例、组合基准久期、回购的最高比例等重大投资决策。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略，向集中交易室下达投资指令。

集中交易室设立债券交易员，负责执行投资指令，就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈，并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易控制。

2、投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内，制定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

（1）基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点，并结合基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

（2）投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的投资比例、大类资产分布比例、组合基准久期、回购比例等重要事项。

（3）基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、组合基准久期和个券投资分布方式等。

（4）对已投资品种进行跟踪，对投资组合进行动态调整。

十一、业绩比较基准

$95\% \times \text{中证工业 4.0 指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$

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 $95\% \times \text{中证工业 4.0 指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本

基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。若业绩比较基准和标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若业绩比较基准、标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名、指数编制方案调整等)，则无需召开基金份额持有人大会审议，基金管理人应与基金托管人协商一致后报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

十二、风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，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。

十三、基金投资组合报告

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	2,626,463,651.91	93.38
	其中：股票	2,626,463,651.91	93.38
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	185,495,036.61	6.60
7	其他资产	655,745.35	0.02
8	合计	2,812,614,433.87	100.00

2、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	162,141.57	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	197,434.41	0.01
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	359,575.98	0.01

3、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	2,103,981,520.33	74.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	79,462,332.00	2.83
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	442,660,223.60	15.78
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	2,626,104,075.93	93.60

4、报告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

4.1 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	300124	汇川技术	7,163,056	135,453,388.96	4.83
2	300024	机器人	5,622,715	132,358,711.10	4.72
3	600588	用友网络	5,628,481	127,316,240.22	4.54
4	002008	大族激光	5,955,639	127,093,336.26	4.53
5	002426	胜利精密	11,569,203	121,013,863.38	4.31
6	002230	科大讯飞	4,039,695	114,848,528.85	4.09
7	300115	长盈精密	3,555,143	98,797,423.97	3.52
8	000997	新大陆	5,212,293	94,394,626.23	3.36
9	600699	均胜电子	2,734,479	92,452,734.99	3.30
10	600172	黄河旋风	4,400,357	88,535,182.84	3.16

4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名

股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603189	网达软件	3,898	105,713.76	0.00
2	300541	先进数通	1,467	66,704.49	0.00
3	300534	陇神戎发	996	55,805.88	0.00
4	603313	恒康家居	3,371	51,947.11	0.00
5	002815	崇达技术	2,244	36,599.64	0.00

5、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。

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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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、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。

9、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。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

12、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	173,401.63
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	36,460.74
5	应收申购款	445,882.98
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	655,745.35

(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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603313	恒康家居	51,947.11	0.00	新股认购
2	002815	崇达技术	36,599.64	0.00	新股认购

(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。

十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
2015.6.15-2015.12.31	-26.42%	3.54%	-32.03%	3.97%	5.61%	-0.43%
2016.1.1-2016.9.30	-20.36%	2.53%	-19.45%	2.57%	-0.91%	-0.04%
2015.6.15-2016.9.30	-41.41%	3.00%	-46.75%	3.24%	5.34%	-0.24%

2、自基金合同生效以来基金累计份额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9月30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。

十五、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的标的指数许可使用费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券/期货账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的上市费用和年费；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议

的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的指数许可使用费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。指数许可使用费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，计算方法如下：

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。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数许可使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数许可使用费的收取下限为每季度 5 万元。指数许可使用费将按照上述指数许可协议的约定进行支付。

4、标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介公告。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执

行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

（五）与基金销售有关费用

1、本基金的申购费率由基金管理人决定，基金份额申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者申购本基金份额时，需交纳申购费用，费率按申购金额递减。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

（1）场外申购费率

本基金对通过直销中心场外申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：

- a、全国社会保障基金；
- b、可以投资基金的地方社会保障基金；
- c、企业年金单一计划以及集合计划；
- d、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
- e、企业年金养老金产品。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额M（含申购费）	申购费率
M<100万元	0.36%
100万元≤M<200万元	0.18%
200万元≤M<500万元	0.12%
M≥500万元	每笔1,000元

除上述养老金客户外，其他投资者申购本基金基金份额的场外申购费率见下表：

申购金额M（含申购费）	申购费率
-------------	------

M<100万元	1.20%
100万元≤M<200万元	0.60%
200万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	每笔1,000元

(2) 场内申购费率

本基金的场内申购费率由销售机构参照场外申购费率执行。

2、赎回费率

本基金场内场外赎回费率都为 0.50%。

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低富国工业 4.0 份额的申购费率和赎回费率。

十六、基金份额折算

(一) 定期份额折算

每年的基金份额定期折算基准日，本基金将按以下规则对富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0 份额进行定期份额折算（基金合同另有规定的除外）。

如果基金份额定期折算基准日距上一次不定期折算基准日不足一个月，基金管理人可以选择是否进行定期份额折算。届时，基金管理人将对相关事项进行公告。

1、基金份额定期折算基准日

每个会计年度 12 月第一个工作日。

2、基金份额折算对象

基金份额定期折算基准日登记在册的富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0 份额。

3、基金份额折算频率

每年折算一次。

4、基金份额折算方式

定期份额折算后富国工业 4.0A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前富国工业 4.0A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为富国工业 4.0 份额的场内份额分配给富国工业 4.0A 份额持有人。富国工业 4.0 份额持有人持有的每两份富国工业 4.0 份额将按一份富国工业 4.0A 份额获得新增富国工业 4.0 份额的分配，经过上述份额折算后，富国工业 4.0 份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

有关计算公式如下：

(1) 富国工业 4.0 份额

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前富国工业 4.0 份额的资产净值} - 0.5 \times (\text{NAV}_{\text{A}}^{\text{前}} - 1.000) \times \text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}{\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

富国工业 4.0 份额持有人新增的富国工业 4.0 份额 =

$$\frac{\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{\text{A}}^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$ ：折算后富国工业 4.0 份额的基金份额净值，下同

$NAV_{\text{A}}^{\text{前}}$ ：折算前富国工业 4.0A 份额的基金份额参考净值，下同

$\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}$ ：折算前富国工业 4.0 份额的份额数，下同

持有场外富国工业 4.0 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外富国工业 4.0 份额的分配；持有场内富国工业 4.0 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内富国工业 4.0 份额的分配。

(2) 富国工业 4.0A 份额

定期份额折算后富国工业 4.0A 份额的基金份额参考净值=1.000 元

定期份额折算后富国工业 4.0A 份额的份额数=定期份额折算前富国工业 4.0A 份额的份额数

富国工业 4.0A 份额持有人新增的场内富国工业 4.0 份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_A^{\text{前}} \times (\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.000)}{\text{NAV}_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$\text{NUM}_A^{\text{前}}$ ：折算前富国工业 4.0A 份额的份额数，下同

(3) 富国工业 4.0B 份额

定期份额折算不改变富国工业 4.0B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

(4) 折算后的富国工业 4.0 份额总份额数

折算后富国工业 4.0 份额的总份额数=折算前富国工业 4.0 份额的份额数+富国工业 4.0 份额持有人新增的富国工业 4.0 份额的份额数+富国工业 4.0A 份额持有人新增的场内富国工业 4.0 份额的份额数

(5) 按照上述折算和计算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

(二) 不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：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。

1、当富国工业 4.0 份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将按以下规则进行不定期份额折算：

(1) 基金份额不定期折算基准日

富国工业 4.0 份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，基金管理人将确定不定期折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额和富国工业 4.0 份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当富国工业 4.0 份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将分别对富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额和富国工业 4.0 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额的比例为 1:1，份额折算后富国工业 4.0A 份额的基金份额参考净值、富国工业 4.0B 份额的基金份额参考净值和富国工业 4.0 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。基金份额折算基准日折算前富国工业 4.0 份额的基金份额净值及富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为富国工业 4.0 份额分别分配给富国工业 4.0 份额、富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额的持有人。

1) 富国工业 4.0 份额

富国工业 4.0 份额持有人新增的富国工业 4.0 份额数=

$$\frac{\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}} \times (\text{NAV}_{\text{基础}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

持有场外富国工业 4.0 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外富国工业 4.0 份额的分配；持有场内富国工业 4.0 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内富国工业 4.0 份额的分配。

2) 富国工业 4.0A 份额

折算后富国工业 4.0A 份额的份额数保持不变，即 $\text{NUM}_A^{\text{后}} = \text{NUM}_A^{\text{前}}$

富国工业 4.0A 份额持有人新增的场内富国工业 4.0 份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_A^{\text{前}} \times (\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$: 折算后富国工业 4.0A 份额的份额数, 下同

3) 富国工业 4.0B 份额

折算后富国工业 4.0B 份额的份额数保持不变, 即 $NUM_B^{\text{后}} = NUM_B^{\text{前}}$

富国工业 4.0B 份额持有人新增的场内富国工业 4.0 份额的份额数=

$$\frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中,

$NUM_B^{\text{后}}$: 折算后富国工业 4.0B 份额的份额数, 下同

$NUM_B^{\text{前}}$: 折算前富国工业 4.0B 份额的份额数, 下同

$NAV_B^{\text{前}}$: 折算前富国工业 4.0B 份额的基金份额参考净值, 下同

4) 折算后富国工业 4.0 份额的总份额数

折算后富国工业 4.0 份额的总份额数=折算前富国工业 4.0 份额的份额数+富国工业 4.0 份额持有人新增的富国工业 4.0 份额数+富国工业 4.0A 份额持有人新增的场内富国工业 4.0 份额数+富国工业 4.0B 份额持有人新增的场内富国工业 4.0 份额数

5) 按照上述折算和计算方法, 可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差, 视为未改变基金份额持有人的资产净值。

2、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, 本基金将按以下规则进行不定期份额折算:

(1) 基金份额不定期折算基准日

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, 基金管理人将确定不定期折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的富国工业 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额、富国工业 4.0 份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

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 4.0A 份额、富国工业 4.0B 份额和富国工业 4.0 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额的比例为 1:1，份额折算后富国工业 4.0 份额的基金份额净值、富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。富国工业 4.0 份额、富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额的份额数将相应缩减。

1) 富国工业 4.0B 份额

$$\text{NUM}_B^{\text{后}} = \frac{\text{NUM}_B^{\text{前}} \times \text{NAV}_B^{\text{前}}}{1.000}$$

2) 富国工业 4.0A 份额

折算后富国工业 4.0A 份额与富国工业 4.0B 份额的份额配比保持 1:1 不变，

$$\text{即 NUM}_A^{\text{后}} = \text{NUM}_B^{\text{后}}$$

富国工业 4.0A 份额持有人新增的场内富国工业 4.0 份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_A^{\text{前}} \times \text{NAV}_A^{\text{前}} - \text{NUM}_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

3) 富国工业 4.0 份额

$$\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}} \times \text{NAV}_{\text{基础}}^{\text{前}}}{1.000}$$

$\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{后}}$ ：富国工业 4.0 份额持有人持有的折算后的富国工业 4.0 份额的份额数，下同

4) 折算后富国工业 4.0 份额的总份额数

折算后富国工业 4.0 份额的总份额数=富国工业 4.0 份额持有人持有的折算后的富国工业 4.0 份额的份额数+富国工业 4.0A 份额持有人新增的场内富国工业 4.0 份额数

5) 按照上述折算和计算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

(三) 折算份额数的处理方式

折算后，场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产；场内份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

（四）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停相关份额的上市交易和富国工业 4.0 份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（五）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告，并报中国证监会备案。

（六）特殊情形的处理

- 1、基金合同生效不满三个月，基金管理人可以不进行定期份额折算；
- 2、若在定期份额折算基准日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据实际情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

（七）其他事项

基金管理人、深圳证券交易所、基金登记机构有权调整上述规则，本基金基金合同将相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

十七、对招募说明书更新部分的说明

富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、“重要提示”中，更新了招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期。
- 2、“第三部分 基金管理人”中，更新了基金管理人概况及主要人员情况。

3、“第四部分 基金托管人”中，更新了基金托管人的基本情况、主要人员情况、基金托管业务经营情况等内容。

4、“第五部分 相关服务机构”中，更新了直销机构、代销机构部分信息。

5、“第十三部分 基金的投资”中，更新了基金投资组合报告，内容截止至 2016 年 9 月 30 日。

6、“第十四部分 基金的业绩”中，更新了业绩表现数据及历史走势图，内容截止至 2016 年 9 月 30 日。

7、“第二十七部分 其他应披露事项”中，更新了本报告期内的其他应披露事项。

富国基金管理有限公司

2017 年 1 月 26 日