

# 富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

2020 年 11 月 24 日（信息截至：2020 年 11 月 23 日）

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	富国中证工业 4.0 指数分级	基金代码	161031
分级 A 简称	富国中证工业 4.0 指数分级 A	分级 A 代码	150315
分级 B 简称	富国中证工业 4.0 指数分级 B	分级 B 代码	150316
场内简称	工业 4		
上市交易所	深圳证券交易所	上市日期	2015 年 6 月 25 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
基金合同生效日	2015 年 06 月 15 日	基金类型	股票型
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	人民币		
基金经理	张圣贤	任职日期	2015-08-07
		证券从业日期	2007-07-01

### 二、基金投资与净值表现

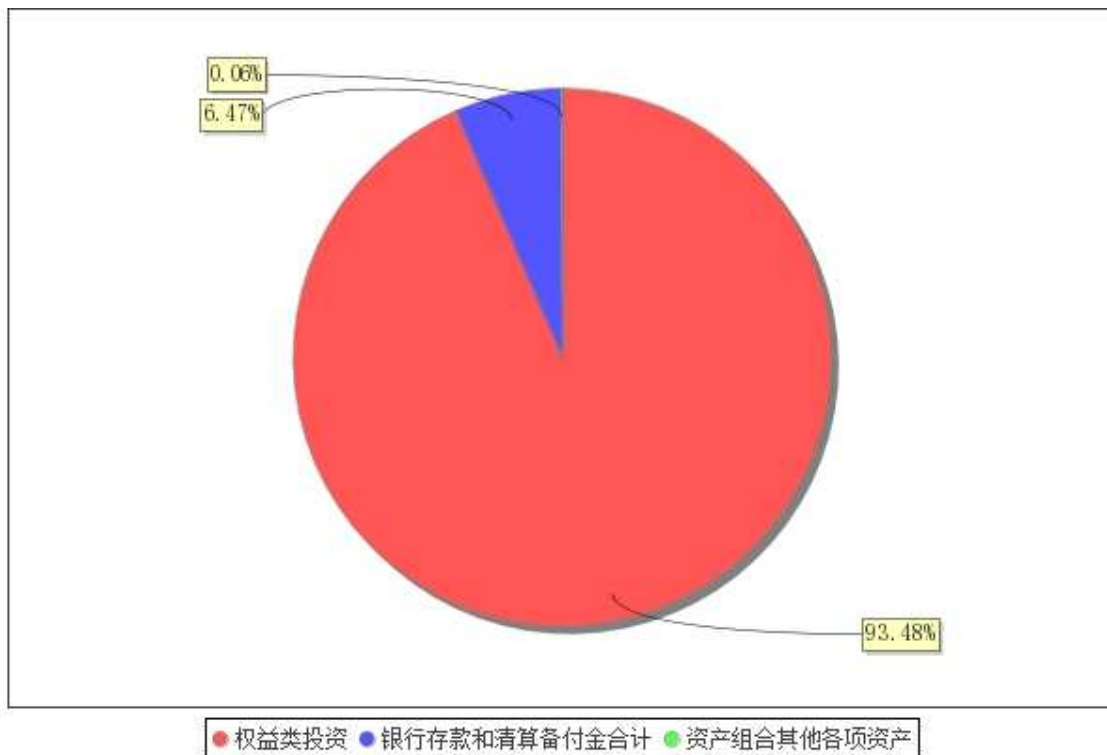
#### （一）投资目标与投资策略

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）。 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%。
主要投资策略	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、债券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
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。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。

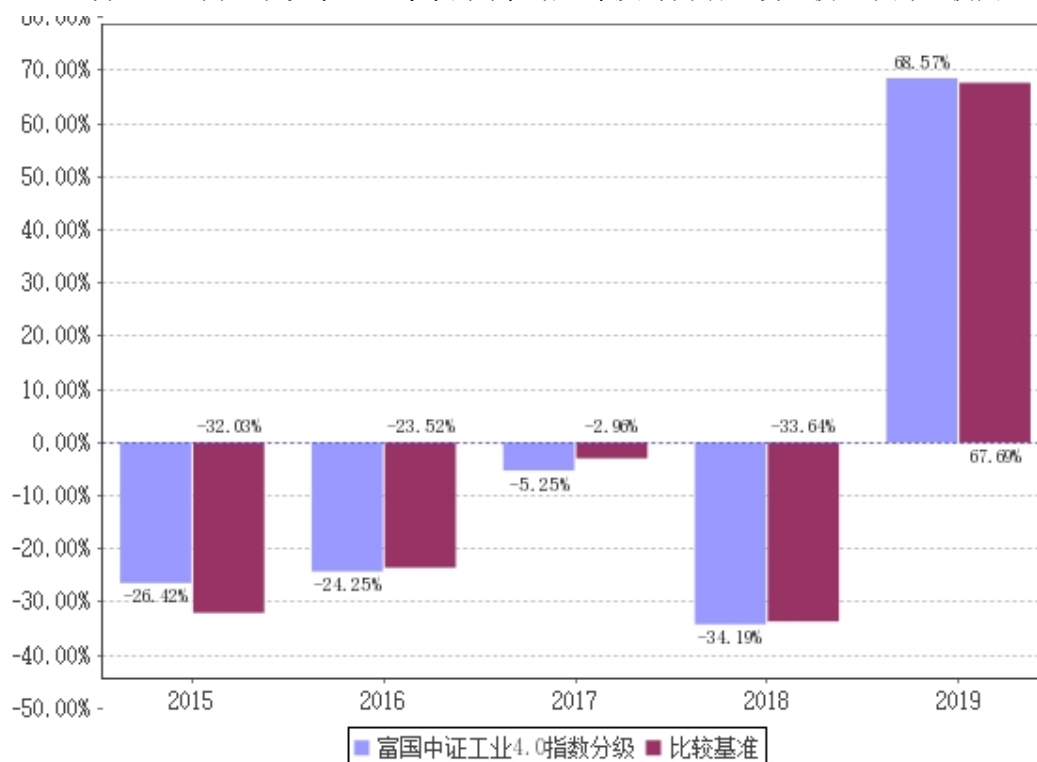
注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

## （二）投资组合资产配置图表



注：截止日期 2020 年 09 月 30 日。

## （三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金合同生效日 2015 年 06 月 15 日。业绩表现截止日期 2019 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

费用类型	金额 (M) /持有期限 (N)	费率 (普通客户)	费率 (特定客户)
申购费 (前端)	M<100 万	1.2%	0.12%
	100 万≤M<200 万	0.6%	0.06%
	200 万≤M<500 万	0.4%	0.04%
	M≥500 万	1000 元/笔	1000 元/笔
赎回费	N<7 天	1.5%	
	N≥7 天	0.5%	

注：以上费用在投资者场外申购/赎回基金过程中收取，场内申购费率由销售机构参照场外申购费率执行。特定客户的具体含义请见《招募说明书》相关内容。场内交易费用以证券公司实际收取为准。

#### (二) 基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式
管理费	1.00%
托管费	0.22%
指数许可使用费	0.02%

注：以上费用将从基金资产中扣除；本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

### 四、风险揭示与重要提示

#### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金投资中的风险包括：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。

本基金的特定风险包括：1、杠杆机制风险

本基金为复制指数的股票型基金，具有较高风险、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。由于富国工业 4.0B 份额内含杠杆机制的设计，富国工业 4.0B 份额的参考净值的变动幅度将大于富国工业 4.0 份额的净值和富国工业 4.0A 份额的参考净值的变动幅度，即富国工业 4.0B 份额的参考净值变动的波动性要高于其他两类份额。

2、折/溢价交易风险

富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额上市交易后，由于受市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能发生偏离而出现折/溢价交易风险。尽管份额配对转换机制有助于将折/溢价交易风险降低至较低水平，但富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于份额配对转换机制的影响，富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额的交易价格可能会相互影响。

3、风险收益特征变化风险

根据本基金份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施基金份额折算后，富国工业 4.0A 份额持有人或富国工业 4.0B 份额持有人将会获得一定比例的富国工业

4.0 份额的场内份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

#### 4、份额折算风险

①在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。场外份额

②份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

#### 5、份额配对转换业务中存在的风险

基金合同生效后，在分级存续期内，基金管理人将根据基金合同的约定办理富国工业 4.0 份额、富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

#### 6、终止分级运作的风险提示

基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于 2020 年底完成分级基金的整改，取消分级运作机制，将分级运作的富国工业 4.0A 份额和富国工业 4.0B 份额按照基金份额参考净值折算为基础份额的场内份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

除以上风险外，本基金还可能存在指数投资风险、上市交易风险、科创板股票投资风险、基金折算新增份额的收益风险等基金运作的特有风险。

## （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。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。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，均应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，并对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告、定期公告等披露文件。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站(www.fullgoal.com.cn)，客户服务热线：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费）

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料