

# 富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金

## 二〇二三年中期报告

2023 年 06 月 30 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： 2023 年 08 月 31 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。本中期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 2023 年 8 月 29 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§4	管理人报告	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6	中期财务报告（未经审计）	19
6.1	资产负债表	19
6.2	利润表	20
6.3	净资产（基金净值）变动表	21
6.4	报表附注	22
§7	投资组合报告	58
7.1	期末基金资产组合情况	58

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
7.3	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.....	59
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
7.6	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.....	65
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	65
7.8	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.....	65
7.9	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.....	65
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	65
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12	投资组合报告附注.....	66
§8	基金份额持有人信息.....	68
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	68
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
8.4	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.....	68
§9	开放式基金份额变动.....	70
§10	重大事件揭示.....	71
10.1	基金份额持有人大会决议.....	71
10.2	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.....	71
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4	基金投资策略的改变.....	71
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	71
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8	其他重大事件.....	74
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	75
11.1	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.....	75
§12	备查文件目录.....	76



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金	
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	
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	752,510,346.59 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	2021 年 1 月 19 日	
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	747,666,399.52 份	4,843,947.07 份

### 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。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。

### 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
注册地址	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		北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层		北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120		100140
法定代表人	裴长江		陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A类：中国证券登记结算有限责任公司；C类：富国基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

##### (1) 富国中证工业 4.0 指数 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	13,140,676.60
本期利润	72,326,042.80
加权平均基金份额本期利润	0.0953
本期加权平均净值利润率	10.08%
本期基金份额净值增长率	10.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	-94,989,873.37
期末可供分配基金份额利润	-0.1270
期末基金资产净值	732,487,016.87
期末基金份额净值	0.980
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-12.30%

##### (2) 富国中证工业 4.0 指数 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	81,584.47
本期利润	373,594.18
加权平均基金份额本期利润	0.0922
本期加权平均净值利润率	9.76%
本期基金份额净值增长率	10.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	-628,787.14
期末可供分配基金份额利润	-0.1298
期末基金资产净值	4,734,283.28
期末基金份额净值	0.977
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-19.98%

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。期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

### 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	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
过去一个月	6.18%	1.32%	5.70%	1.33%	0.48%	-0.01%
过去三个月	0.72%	1.20%	-0.10%	1.21%	0.82%	-0.01%
过去六个月	10.73%	1.15%	9.90%	1.16%	0.83%	-0.01%
过去一年	-4.95%	1.21%	-5.97%	1.21%	1.02%	0.00%
过去三年	15.40%	1.57%	11.84%	1.58%	3.56%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-12.30%	1.92%	-21.20%	2.00%	8.90%	-0.08%

##### (2) 富国中证工业 4.0 指数 C

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
过去一个月	6.08%	1.31%	5.70%	1.33%	0.38%	-0.02%
过去三个月	0.51%	1.20%	-0.10%	1.21%	0.61%	-0.01%
过去六个月	10.52%	1.15%	9.90%	1.16%	0.62%	-0.01%
过去一年	-5.24%	1.21%	-5.97%	1.21%	0.73%	0.00%
自基金分级生效日起至今	-19.98%	1.47%	-21.40%	1.48%	1.42%	-0.01%

注: 本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建, 能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理, 并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

#### 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

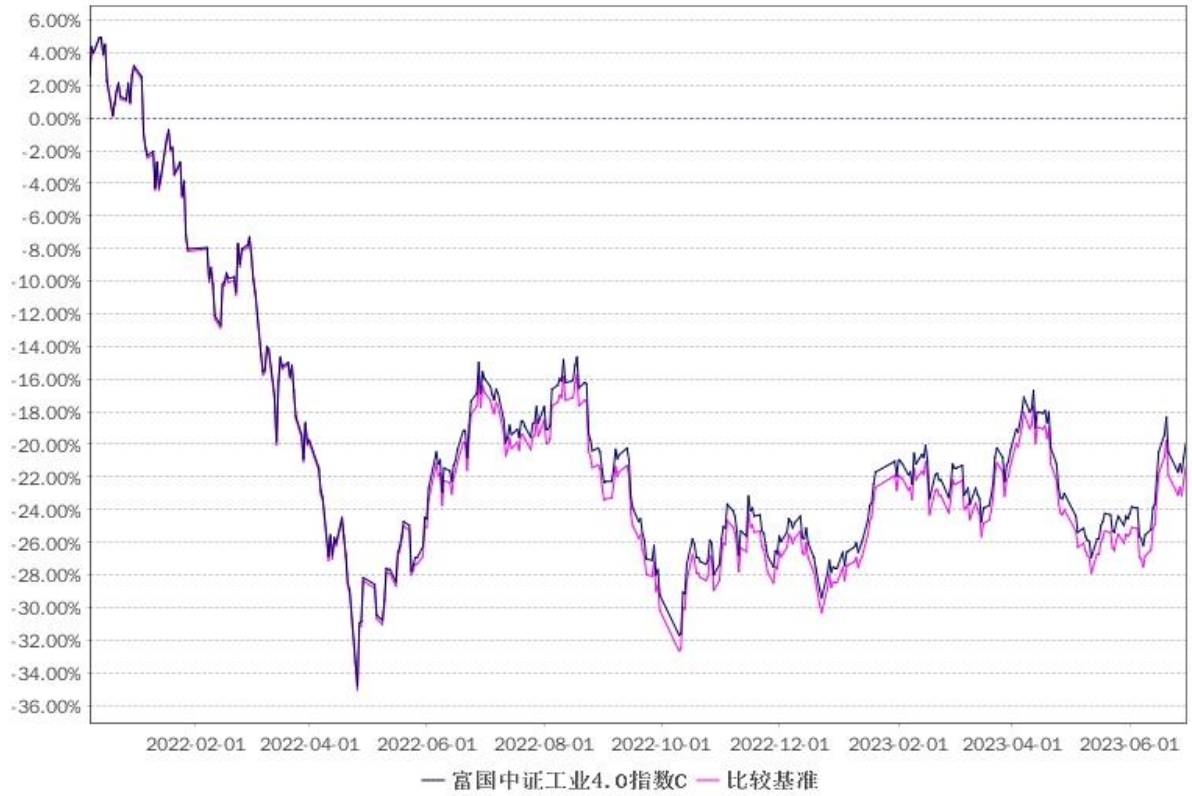
(1) 自基金合同生效以来富国中证工业 4.0 指数 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2023 年 6 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。

(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2023年6月30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 基金管理人及基金经理情况

#### 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金融资产管理股份有限公司。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 2023 年 6 月 30 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、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 304 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）及基金经理助理简介

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	—	16	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

				<p>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；</p>
--	--	--	--	---

					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；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 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 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**

年初以来，随着主要城市疫情高峰过去，疫情对经济的冲击逐步减小，投资者对 2023 年经济复苏预期变动更加乐观，A 股迎来开门红。进入 3 月，由于两会政府工作报告公布的 GDP 增速目标低于市场预期，市场迎来一轮快速调整。海外方面，美国公布的 2 月通胀数据超预期，加息预期再次升温，全球资本市场迎来调整。4 月以来，尽管 1-2 月工业企业利润下降一度压制市场情绪，但 3 月 PMI 验证经济进一步向好，提振市场信心。在经济弱复苏，流动性宽裕的背景下，人工智能相关板块迎来加速上涨。石油化工、建筑等板块在中特估及一带一路等主题概念的驱动下也迎来靓丽表现。进入 5 月中旬，由于金融、通胀数据均回落，指向经济内生动能不强，复苏斜率放缓压制市场情绪，同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。6 月初，虽然国内方面经济数据维持弱势，但结构性政策开始落地，结合外资巨头接连访华为经济注入新动力，提振市场信心。6 月下旬，随着短期宏观政策兑现，同时部分 TMT 公司涨幅过大，投资者选择获利了结，叠加人民币进一步贬值及节前避险情绪升温，A 股迎来调整。

总体来看，2023 年上半年上证综指上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，创业板指下跌 5.61%，中证 500 指数上涨 2.29%。

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。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 0.98 元，C 级为 0.977 元；份额累计净值 A 级为 0.784 元，C 级为 0.977 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 10.73%，C 级为 10.52%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 9.90%，C 级为 9.90%。

#### **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 2023 下半年，积极因素正进一步累积，悲观预期将逐步修正。首先，外部的扰动将逐步缓解。当前市场已将 7 月美联储会议的加息预期较充分地计入，并且后续 8 月没有美联储议息会议的情况下，市场将阶段性进入鹰派信息的“空窗期”，来自美债利率上行、汇率贬值等外部压力已在缓和。其次，6 月份多项经济数据已经止跌企稳、甚至拐头向上，市场对于经济增长的悲观预期仍有望逐步修正。2 季度 GDP 数据虽略不及预期，但 6 月经济数据已经边际回暖。生产端，尽管工业增加值、服务业生产指数两年复合增速仍低于疫情前水平，但 5-6 月已出现持续改善。消费端，边际上居民收入改善，5-6 月商品消费加速。投资端，基建、制造业投资维持强势。近期各项经济政策也在密集加码落地，如促进家居消费若干措施、促民营经济、城中村改造等政策密集加码。此外，当前市场本身仍处在一个隐含风险溢价较高、多数行业拥挤度较低的位置，具备整体修复的空间。

#### **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



外公布。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### **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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、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。

### 5.3 托管人对本中期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本基金 2023 年中期报告中财务指标、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 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	39,577,581.72	40,330,528.94
结算备付金	27,208.48	—
存出保证金	8,431.48	11,997.92
交易性金融资产	697,661,053.64	643,151,013.78
其中：股票投资	697,661,053.64	643,151,013.78
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	123,846.64	—
应收股利	11,709.00	—
应收申购款	1,241,220.72	145,989.69
递延所得税资产	—	—
其他资产	27,452.06	36,445.93
资产总计	738,678,503.74	683,675,976.26
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2023 年 06 月 30 日	<b>上年度末</b> 2022 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
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	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	428,828.92	312,187.37
应付管理人报酬	587,192.96	588,188.14
应付托管费	129,182.45	129,401.38
应付销售服务费	788.11	429.91
应付投资顾问费	—	—
应交税费	5,211.67	4,846.97

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	305,999.48	282,586.38
负债合计	1,457,203.59	1,317,640.15
<b>净资产：</b>		
实收基金	832,839,960.66	853,169,092.17
其他综合收益	—	—
未分配利润	-95,618,660.51	-170,810,756.06
净资产合计	737,221,300.15	682,358,336.11
负债和净资产总计	738,678,503.74	683,675,976.26

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.980 元，基金份额总额 752,510,346.59 份。其中：富国中证工业 4.0 指数 A 份额净值 0.980 元，份额总额 747,666,399.52 份；富国中证工业 4.0 指数 C 份额净值 0.977 元，份额总额 4,843,947.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日)
<b>一、营业总收入</b>	<b>77,257,760.49</b>	<b>-174,168,019.01</b>
1.利息收入	997,433.32	843,649.92
其中：存款利息收入	72,328.82	11,937.55
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	925,104.50	831,712.37
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	16,723,371.46	34,253,888.33
其中：股票投资收益	10,719,694.26	27,797,901.42
基金投资收益	—	—
债券投资收益	225,191.74	554,005.65
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	5,778,485.46	5,901,981.26
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	—	—

其他投资收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	59,477,375.91	-209,361,205.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	59,579.80	95,648.67
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>4,558,123.51</b>	<b>4,999,098.41</b>
1. 管理人报酬	3,581,483.67	3,940,937.96
2. 托管费	787,926.47	867,006.38
3. 销售服务费	3,766.01	557.10
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	3,331.75	2,994.89
8. 其他费用	181,615.61	187,602.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>72,699,636.98</b>	<b>-179,167,117.42</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>72,699,636.98</b>	<b>-179,167,117.42</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>72,699,636.98</b>	<b>-179,167,117.42</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产（基金净值）	853,169,092.17	170,810,756.06	682,358,336.11
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	853,169,092.17	170,810,756.06	682,358,336.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-20,329,131.51	75,192,095.55	54,862,964.04
（一）、综合收益总额	—	72,699,636.98	72,699,636.98
（二）、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）	-20,329,131.51	2,492,458.57	-17,836,672.94
其中：1. 基金申购款	42,800,568.35	-6,115,855.44	36,684,712.91
2. 基金赎回款	-63,129,699.86	8,608,314.01	-54,521,385.85
（三）、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）			
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产（基金净值）	832,839,960.66	-95,618,660.51	737,221,300.15
项目	上年度可比期间 (2022年01月01日至2022年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	874,007,117.37	120,834,125.50	994,841,242.87
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	874,007,117.37	120,834,125.50	994,841,242.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,011,068.89	—	—
（一）、综合收益总额	—	179,618,521.30	194,629,590.19
（二）、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）	-15,011,068.89	179,167,117.42	179,167,117.42
其中：1.基金申购款	61,960,317.04	-451,403.88	-15,462,472.77
2.基金赎回款	-76,971,385.93	-5,155,008.16	56,805,308.88
（三）、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）	—	4,703,604.28	-72,267,781.65
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产（基金净值）	858,996,048.48	-58,784,395.80	800,211,652.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人  
基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富国中证工业 4.0 指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）由富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来，富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证

监许可[2015]889号文《关于准予富国中证工业4.0指数分级证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于2015年6月15日生效，首次设立募集规模为6,787,122,558.81份基金份额。根据《富国中证工业4.0指数型证券投资基金基金合同》、《关于富国中证工业4.0指数分级证券投资基金之A类份额和B类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，富国中证工业4.0指数分级证券投资基金于2020年12月31日进行不定期份额折算，对富国工业4.0A份额和富国工业4.0B份额办理向场内富国工业4.0份额折算业务。根据基金管理人于2021年1月5日发布的《关于富国中证工业4.0指数分级证券投资基金之富国工业4.0A份额和富国工业4.0B份额基金份额折算结果的公告》，折算前富国工业4.0份额为1,800,000,384.60份，富国工业4.0A份额为4,795,758.00份，富国工业4.0B份额为4,795,758.00份；折算后富国工业4.0份额为1,800,000,383.60份。富国中证工业4.0指数分级证券投资基金自2021年1月1日起更名为富国中证工业4.0指数型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于2021年11月30日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自2021年12月7日起，本基金增加C类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，A类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C类基金份额的注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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（均含存托凭证）、存托凭证、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）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。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。

本基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证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（均含存托凭

证)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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证工业 4.0 指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 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**

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### **6.4.5 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。

#### **6.4.6 税项**

##### **1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税



率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂

减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2023 年 06 月 30 日)
活期存款	39,577,581.72
等于：本金	39,573,601.79
加：应计利息	3,979.93
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	39,577,581.72

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 (2023 年 06 月 30 日)			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	582,811,402.33	—	697,661,053.64	114,849,651.31
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—

资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	582,811,402.33	—	697,661,053.64	114,849,651.31

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）
应收利息	—
其他应收款	—
待摊费用	—
转融通证券出借利息	27,452.06
合计	27,452.06

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	798.92
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	68,876.95
其中：交易所市场	68,876.95
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	76,323.61
应付指数使用费	100,000.00
合计	305,999.48

#### 6.4.7.7 实收基金

富国中证工业4.0指数A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	768,058,473.78	850,046,637.14
本期申购	26,873,219.68	29,744,024.84
本期赎回（以“-”号填列）	-47,265,293.94	-52,313,771.74
本期末	747,666,399.52	827,476,890.24

富国中证工业4.0指数C:

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,819,669.37	3,122,455.03
本期申购	11,790,681.93	13,056,543.51
本期赎回（以“-”号填列）	-9,766,404.23	-10,815,928.12
本期末	4,843,947.07	5,363,070.42

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8未分配利润

富国中证工业4.0指数A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	94,369,997.19	-	-170,181,113.49
本期利润	13,140,676.60	59,185,366.20	72,326,042.80
本期基金份额交易产生的变动数	-2,591,006.81	5,456,204.13	2,865,197.32
其中：基金申购款	3,392,620.67	-7,666,429.00	-4,273,808.33
基金赎回款	-5,983,627.48	13,122,633.13	7,139,005.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	104,919,666.98	-	-94,989,873.37
		199,909,540.35	

富国中证工业4.0指数C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	341,597.49	-971,240.06	-629,642.57
本期利润	81,584.47	292,009.71	373,594.18
本期基金份额交易产生的变动数	243,545.22	-616,283.97	-372,738.75
其中：基金申购款	1,456,635.62	-	-1,842,047.11
基金赎回款	-	3,298,682.73	
	1,213,090.40	2,682,398.76	1,469,308.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	666,727.18	-	-628,787.14

		1,295,514.32	
--	--	--------------	--

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
活期存款利息收入	71,808.70
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	456.21
其他	63.91
合计	72,328.82

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,719,694.26
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	10,719,694.26

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出股票成交总额	83,227,098.76
减：卖出股票成本总额	72,313,581.16
减：交易费用	193,823.34
买卖股票差价收入	10,719,694.26

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
债券投资收益——利息收入	130.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	225,061.16
合计	225,191.74

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	502,716.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	277,500.00
减：应计利息总额	135.02
减：交易费用	20.12
债券投资收益-差价收入	225,061.16

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
股票投资产生的股利收益	5,778,485.46
其中：证券出借权益补偿收入	376,010.93
基金投资产生的股利收益	—
合计	5,778,485.46

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
1. 交易性金融资产	59,477,375.91
股票投资	59,477,375.91
债券投资	—

资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	59,477,375.91

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
基金赎回费收入	58,157.43
基金转换费收入	1,422.37
合计	59,579.80

#### 6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
审计费用	21,323.61
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	292.00
指数使用费	100,000.00
合计	181,615.61

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。



#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	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
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30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	34,448,161.57	24.90	7,866,821.41	4.49
申万宏源	49,903,908.60	36.07	3,861,142.36	2.20

##### 6.4.10.1.2 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。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	—	—	10,248,675.60	70.92
申万宏源	502,716.30	100.00	—	—

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30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	24,848.64	25.66	23,545.57	34.18
申万宏源	35,995.50	37.18	35,160.79	51.05
关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30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	3,520.49	2.19	409.17	0.38
海通证券	7,183.59	4.47	5,055.92	4.67

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	3,581,483.67	3,940,937.96
其中：支付销售机构的客户维护费	1,541,987.26	1,688,106.78

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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	787,926.47	867,006.38

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。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证工业4.0指数 A	富国中证工业4.0指数 C	合计
富国基金管理有限公司	—	435.76	435.76
合计	—	435.76	435.76

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证工业4.0指数 A	富国中证工业4.0指数 C	合计
富国基金管理有限公司	—	179.96	179.96
合计	—	179.96	179.96

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.3 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均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期（2023年01月01日至2023年06月30日）				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	19,755,427.00	12,162.84	—	—
申万宏源	2,527,820.00	1,668.95	—	—
上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
申万宏源	17,879,900.00	10,486.59	7,644,230.00	1,268.06

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

金额单位：人民币元

本期（2023年01月01日至2023年06月30日）										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	2023010300001111	信维通信	2023年01月03日	682,992.00	40,800.00	14	3.20	825.17	—	—
海通证券	2023013000001799	东方国信	2023年01月30日	334,230.00	39,000.00	14	3.20	403.75	—	—
海通证券	2023021300065228	东方国信	2023年02月13日	368,160.00	39,000.00	14	3.20	444.85	—	—

			日							
海通证 券	202302 220000 0513	东方国 信	2023 年 02 月 22 日	54,492 .00	5,70 0.00	14	3.50	72.07	—	—
海通证 券	202302 280000 1017	东方国 信	2023 年 02 月 28 日	230,83 8.00	23,7 00.0 0	14	3.50	305.10	—	—
海通证 券	202303 010000 0870	绿的谐 波	2023 年 03 月 01 日	718,20 0.00	5,40 0.00	14	5.60	1,518. 58	—	—
海通证 券	202303 080000 5926	东方国 信	2023 年 03 月 08 日	55,176 .00	5,70 0.00	14	3.50	72.86	—	—
海通证 券	202303 130000 1035	绿的谐 波	2023 年 03 月 13 日	115,91 0.00	1,00 0.00	14	5.60	245.01	—	—
海通证 券	202303 140002 1436	东方国 信	2023 年 03 月 14 日	240,31 8.00	23,7 00.0 0	14	3.50	317.58	—	—
海通证 券	202303 150000 1679	东方国 信	2023 年 03 月 15 日	209,94 5.00	21,1 00.0 0	14	3.40	269.47	—	—
海通证 券	202303 150001 9629	绿的谐 波	2023 年 03 月 15 日	622,62 0.00	5,40 0.00	14	5.60	1,316. 45	—	—
海通证 券	202303 170000 1137	东方国 信	2023 年 03 月 17 日	68,952 .00	6,80 0.00	14	3.40	88.51	—	—
海通证 券	202303 220000 9203	东方国 信	2023 年 03 月 22 日	61,560 .00	5,70 0.00	14	3.50	87.23	—	—
海通证 券	202303 280002 1071	东方国 信	2023 年 03 月 28 日	317,58 0.00	23,7 00.0 0	14	3.50	419.66	—	—

			日							
海通证 券	202303 290001 7122	东方国 信	2023 年 03 月 29 日	288,43 7.00	21,1 00.0 0	14	3.40	370.32	—	—
海通证 券	202303 290001 8254	绿的谐 波	2023 年 03 月 29 日	610,25 4.00	5,40 0.00	14	5.60	1,290. 22	—	—
海通证 券	202303 310000 8521	东方国 信	2023 年 03 月 31 日	102,47 6.00	6,80 0.00	14	3.40	131.58	—	—
海通证 券	202304 060001 2656	东方国 信	2023 年 04 月 06 日	79,230 .00	5,70 0.00	14	3.50	104.76	—	—
海通证 券	202304 120002 9624	东方国 信	2023 年 04 月 12 日	284,85 0.00	21,1 00.0 0	14	3.40	365.72	—	—
海通证 券	202304 130000 3338	闻泰科 技	2023 年 04 月 13 日	2,013, 368.00	31,4 00.0 0	7	3.60	1,368. 34	—	—
海通证 券	202304 140000 7789	东方国 信	2023 年 04 月 14 日	86,224 .00	6,80 0.00	14	3.40	110.65	—	—
海通证 券	202304 180000 3470	东方国 信	2023 年 04 月 18 日	80,448 .00	6,40 0.00	14	4.88	169.36	—	—
海通证 券	202304 200000 8265	闻泰科 技	2023 年 04 月 20 日	1,994, 214.00	31,4 00.0 0	7	3.60	1,355. 28	—	—
海通证 券	202304 200000 9419	东方国 信	2023 年 04 月 20 日	74,328 .00	5,70 0.00	14	3.50	98.23	—	—
海通证 券	202304 270002 2134	闻泰科 技	2023 年 04 月 27 日	1,623, 694.00	31,4 00.0 0	7	3.60	1,103. 48	—	—

			日							
海通证 券	202304 280000 1835	宏力达	2023 年 04 月 28 日	99,400 .00	2,00 0.00	14	4.01	150.53	—	—
海通证 券	202304 280000 6204	东方国 信	2023 年 04 月 28 日	77,860 .00	6,80 0.00	14	3.40	100.01	—	—
海通证 券	202305 040002 7633	东方国 信	2023 年 05 月 04 日	72,832 .00	6,40 0.00	14	4.88	134.16	—	—
海通证 券	202305 050000 2783	精测电 子	2023 年 05 月 05 日	187,62 5.00	1,90 0.00	14	4.01	284.05	—	—
海通证 券	202305 120001 1586	宏力达	2023 年 05 月 12 日	94,120 .00	2,00 0.00	14	4.01	142.43	—	—
海通证 券	202305 120001 2554	东方国 信	2023 年 05 月 12 日	76,160 .00	6,80 0.00	14	3.40	97.76	—	—
海通证 券	202305 180003 7832	东方国 信	2023 年 05 月 18 日	72,512 .00	6,40 0.00	14	4.88	133.55	—	—
海通证 券	202305 190001 0959	精测电 子	2023 年 05 月 19 日	205,23 8.00	1,90 0.00	14	4.01	310.68	—	—
海通证 券	202305 250000 3980	奥特维	2023 年 05 月 25 日	224,31 6.00	1,20 0.00	14	3.20	271.03	—	—
海通证 券	202306 020000 2383	东方国 信	2023 年 06 月 02 日	46,410 .00	3,90 0.00	14	3.40	59.54	—	—
海通证 券	202306 160001 8891	东方国 信	2023 年 06 月 16	50,466 .00	3,90 0.00	14	3.40	64.77	—	—

			日							
海通证 券	202306 300001 7623	东方国 信	2023 年 06 月 30 日	43,836 .00	3,90 0.00	14	3.40	—	43,836 .00	—
申万宏 源	202303 080000 0874	信维通 信	2023 年 03 月 08 日	483,97 5.00	22,5 00.0 0	14	3.50	639.56	—	—
申万宏 源	202303 220000 9301	信维通 信	2023 年 03 月 22 日	468,00 0.00	22,5 00.0 0	14	3.50	662.55	—	—
申万宏 源	202304 170000 3818	北方华 创	2023 年 04 月 17 日	1,973, 400.00	6,00 0.00	14	3.00	2,714. 22	—	—
申万宏 源	202305 040005 3917	北方华 创	2023 年 05 月 04 日	1,933, 920.00	6,00 0.00	14	3.00	2,190. 58	—	—
申万宏 源	202305 180001 6980	北方华 创	2023 年 05 月 18 日	1,807, 440.00	6,00 0.00	14	3.00	2,047. 22	—	—
申万宏 源	202306 010002 2788	北方华 创	2023 年 06 月 01 日	1,779, 900.00	6,00 0.00	14	3.00	2,016. 07	—	—
申万宏 源	202306 150003 8577	北方华 创	2023 年 06 月 15 日	1,904, 700.00	6,00 0.00	14	3.00	2,157. 47	—	—
上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）										
关联 方名 称	合约 编号	证券名 称	成 交 时 间	交易 金 额	交易 数 量 （单 位： 股）	出 借 期 限（单 位： 天）	费 率	利 息 收 入	期 末 证 券 出 借 业 务 余 额	期 末 应 收 利 息 余 额
申万宏 源	202206 060000 1021	先 导 智 能	2022 年 06 月 06 日	1,070, 000.00	20,0 00.0 0	14.00	3.20	1,292. 78	—	—
申万宏	202206	先 导 智	2022	1,226,	20,0	14.00	3.20	1,058.	1,263,	1,089.8



源	200001 1704	能	年 06 月 20 日	000.00	00.0 0			10	600.00	0
---	----------------	---	-------------------	--------	-----------	--	--	----	--------	---

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间 (2022年01月01日至2022年06月30日)	
	富国中证工业4.0 指数A	富国中证工业4.0 指数C	富国中证工业 4.0指数A	富国中证工业 4.0指数C
基金合同生效日（2015年06月15日）持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	819.00	—	819.00
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	819.00	—	819.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.02%	—	0.06%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30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	39,577,581.72	71,808.70	8,715,274.48	10,183.68

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2023年01月01日至2023年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO网下申购	2,537	386,588.06
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO网下申购	3,406	314,918.76

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688267	中触媒	IPO网下申购	3,390	142,751.21
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO网下申购	22,158	774,953.89
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO网下申购	5,139	849,798.92

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1.1 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	受限期	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
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	—
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股限售	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	—
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股限售	11.88	21.02	1,056	12,545.28	22,197.12	—
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	—
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	—
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	—
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股限售	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	—

300804	广康生化	2023-06-15	6个月	新股限售	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	—
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	—
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内 (含)	新股认购	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	—
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	—
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新股限售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	—
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股限售	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	—
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	新股限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	—
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新股限售	50.00	30.71	807	40,350.00	24,782.97	—
301260	格力博	2023-01-20	6个月	新股限售	30.85	23.63	1,262	38,932.70	29,821.06	—
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内 (含)	新股认购	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	—
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	—
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	新股限售	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	—
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股限售	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	—
301281	科源制药	2023-05-26	5个月	新股限售_转增	—	25.10	97	—	2,434.70	—
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	—
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	—
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	新股限售	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	—
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	—
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新股限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	—
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	新股限售	131.11	53.24	238	31,204.18	12,671.12	—
301322	绿通科技	2023-05-25	4个月	新股限售_转增	—	53.24	119	—	6,335.56	—
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	—
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	—
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	—
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股限售	73.45	46.64	262	19,243.90	12,219.68	—
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股限售	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	—
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	1,008	23,960.16	43,233.12	—
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新股限售	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	—
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	—
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	—
301383	天键股份	2023-05-31	6个月	新股限售	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	—
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	—
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	—
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内 (含)	新股认购	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	—
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	—
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股限售	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	—

301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	—
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股限售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	—
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新股限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	—
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股认购	57.66	57.66	3,983	229,659.78	229,659.78	—
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	57.66	443	25,543.38	25,543.38	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内 (含)	新股认购	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	—
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	740	7,666.40	8,761.60	—
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	—
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	新股限售	36.15	38.13	661	23,895.15	25,203.93	—
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	3,801	75,487.86	68,646.06	—
688352	顾中科技	2023-04-11	6个月	新股限售	12.10	12.07	1,988	24,054.80	23,995.16	—
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	701	16,543.60	45,333.67	—
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	—
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新股限售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	—
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	—
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	2,873	31,890.30	48,955.92	—
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	新股限售	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	—
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	—
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新股限售	39.99	36.71	673	26,913.27	24,705.83	—
688506	百利天恒	2022-12-28	6个月	新股限售	24.70	71.38	15,622	385,863.40	1,115,098.36	—
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	—
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	254	38,704.52	34,536.38	—
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	—
688539	高华科技	2023-04-11	6个月	新股限售	38.22	43.49	5,334	203,865.48	231,975.66	—
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	—
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	新股限售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	—
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	新股限售	30.26	25.33	734	22,210.84	18,592.22	—
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新股限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	—
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	153	19,247.40	18,058.59	—
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	—
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股认购	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	—
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	—
688623	二元科技	2023-05-31	6个月	新股限售	125.88	86.79	170	21,399.60	14,754.30	—
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	—

#### 6.4.12.2 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。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（单位： 股）	期末估值总额
1	000063	中兴通讯	2023 年 07 月 03 日-2023 年 07 月 10 日	45.54	310,000	14,117,400.0 0
2	002236	大华股份	2023 年 07 月 10 日-2023 年 07 月 13 日	19.75	147,700	2,917,075.00
3	002202	金风科技	2023 年 07 月 03 日-2023 年 07 月 25 日	10.62	140,600	1,493,172.00
4	300048	合康新能	2023 年 07 月 05 日	5.98	114,700	685,906.00
5	300024	机器人	2023 年 07 月 05 日-2023 年 07 月 11 日	16.67	113,300	1,888,711.00
6	000977	浪潮信息	2023 年 07 月 14 日	48.50	94,800	4,597,800.00
7	600745	闻泰科技	2023 年 07 月 04 日-2023 年 07 月 12 日	48.90	89,700	4,386,330.00
8	300278	华昌达	2023 年 07 月 10 日	4.47	88,100	393,807.00
9	601138	工业富联	2023 年 07 月 10 日	25.20	71,000	1,789,200.00
10	002008	大族激光	2023 年 07 月	26.20	69,800	1,828,760.00

			04日-2023年07月13日			
11	002334	英威腾	2023年07月10日-2023年07月11日	12.74	68,800	876,512.00
12	300083	创世纪	2023年07月05日-2023年07月13日	7.31	52,300	382,313.00
13	300604	长川科技	2023年07月04日	47.49	38,900	1,847,361.00
14	002690	美亚光电	2023年07月04日-2023年07月14日	25.75	36,700	945,025.00
15	688777	中控技术	2023年07月10日	62.78	34,500	2,165,910.00
16	300166	东方国信	2023年07月13日-2023年07月14日	11.24	26,600	298,984.00
17	600845	宝信软件	2023年07月11日-2023年07月14日	50.81	21,000	1,067,010.00
18	600416	湘电股份	2023年07月04日-2023年07月05日	19.09	20,400	389,436.00
19	000333	美的集团	2023年07月12日	58.92	20,000	1,178,400.00
20	301029	怡合达	2023年07月05日-2023年07月12日	44.68	17,200	768,496.00
21	002747	埃斯顿	2023年07月04日-2023年07月05日	28.00	16,800	470,400.00
22	603986	兆易创新	2023年07月04日-2023年07月14日	106.25	16,600	1,763,750.00

			日			
23	002957	科瑞技术	2023年07月05日-2023年07月10日	20.27	16,600	336,482.00
24	688006	杭可科技	2023年07月10日	30.47	16,500	502,755.00
25	300751	迈为股份	2023年07月03日-2023年07月12日	169.38	14,400	2,439,072.00
26	603160	汇顶科技	2023年07月25日	46.25	14,000	647,500.00
27	300316	晶盛机电	2023年07月03日-2023年07月12日	70.90	12,000	850,800.00
28	002371	北方华创	2023年07月04日-2023年07月13日	317.65	11,100	3,525,915.00
29	603025	大豪科技	2023年07月04日-2023年07月13日	12.36	11,000	135,960.00
30	603283	赛腾股份	2023年07月05日	44.50	10,800	480,600.00
31	688697	纽威数控	2023年07月05日-2023年07月10日	25.83	10,200	263,466.00
32	300776	帝尔激光	2023年07月03日-2023年07月14日	64.90	10,100	655,490.00
33	002049	紫光国微	2023年07月04日	93.25	10,000	932,500.00
34	300457	赢合科技	2023年07月14日	17.66	10,000	176,600.00
35	603290	斯达半导	2023年07月03日-2023年07月10日	215.20	7,800	1,678,560.00
36	601882	海天精工	2023年07月	33.30	7,300	243,090.00

			03日-2023年07月13日			
37	688516	奥特维	2023年07月03日-2023年07月14日	188.40	6,300	1,186,920.00
38	603583	捷昌驱动	2023年07月04日-2023年07月05日	21.54	6,200	133,548.00
39	688333	铂力特	2023年07月04日-2023年07月13日	105.74	6,000	634,440.00
40	688188	柏楚电子	2023年07月10日-2023年07月12日	188.56	5,900	1,112,504.00
41	002698	博实股份	2023年07月13日	17.49	5,500	96,195.00
42	688017	绿的谐波	2023年07月04日-2023年07月13日	162.40	5,100	828,240.00
43	300567	精测电子	2023年07月03日-2023年07月05日	95.15	4,800	456,720.00
44	688305	科德数控	2023年07月10日	100.26	4,200	421,092.00
45	688162	巨一科技	2023年07月03日-2023年07月13日	41.48	4,100	170,068.00
46	688083	中望软件	2023年07月04日-2023年07月13日	144.89	4,100	594,049.00
47	688320	禾川科技	2023年07月10日-2023年07月11日	48.22	3,900	188,058.00
48	300747	锐科激光	2023年07月	30.48	3,600	109,728.00



			11日			
49	301195	北路智控	2023年07月10日-2023年07月11日	46.56	3,500	162,960.00
50	301328	维峰电子	2023年07月10日	56.94	3,400	193,596.00
51	688559	海目星	2023年07月11日	47.01	3,200	150,432.00
52	603416	信捷电气	2023年07月04日-2023年07月05日	41.31	2,700	111,537.00
53	688330	宏力达	2023年07月14日	35.08	1,300	45,604.00
54	300136	信维通信	2023年07月04日	20.08	1,100	22,088.00
合计	-	-	-	-	1,846,200.00	65,738,327.00

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%，但标的指数成分券不受此限。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，

以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

#### **6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日内可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，

确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2023年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	39,577,581.72	—	—	—	—	—	39,577,581.72
结算备付金	27,208.48	—	—	—	—	—	27,208.48
存出保证金	8,431.48	—	—	—	—	—	8,431.48
交易性金融资产	—	—	—	—	—	697,661,053.64	697,661,053.64
应收清算款	—	—	—	—	—	123,846.64	123,846.64
应收股利	—	—	—	—	—	11,709.00	11,709.00
其他资产	—	—	—	—	—	27,452.06	27,452.06
应收申购款	6,510.00	—	—	—	—	1,234,710.72	1,241,220.72
资产总计	39,619,731.68	—	—	—	—	699,058,772.06	738,678,503.74
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	428,828.92	428,828.92
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	587,192.96	587,192.96
应付托管费	—	—	—	—	—	129,182.45	129,182.45
应付销售服务费	—	—	—	—	—	788.11	788.11
应交税费	—	—	—	—	—	5,211.67	5,211.67
其他负债	—	—	—	—	—	305,999.48	305,999.48
负债总计	—	—	—	—	—	1,457,203.59	1,457,203.59
利率敏感度缺口	39,619,731.68	—	—	—	—	697,601,568.47	737,221,300.15
上年度末（2022年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	40,330,528.94	—	—	—	—	—	40,330,528.94
存出保证金	11,997.92	—	—	—	—	—	11,997.92
交易性金融资产	—	—	—	—	—	643,151,013.78	643,151,013.78
其他资产	—	—	—	—	—	36,445.93	36,445.93
应收申购款	2,073.00	—	—	—	—	143,916.69	145,989.69
资产总计	40,344,599.86	—	—	—	—	643,331,376.40	683,675,976.26
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	312,187.37	312,187.37
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	588,188.14	588,188.14
应付托管费	—	—	—	—	—	129,401.38	129,401.38
应付销售服务费	—	—	—	—	—	429.91	429.91
应交税费	—	—	—	—	—	4,846.97	4,846.97
其他负债	—	—	—	—	—	282,586.38	282,586.38
负债总计	—	—	—	—	—	1,317,640.15	1,317,640.15
利率敏感度缺口	40,344,599.86	—	—	—	—	642,013,736.25	682,358,336.11

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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（均含存托凭证）、存托凭证、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）。

本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证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（均含存托凭证）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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2023 年 06 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31
----	-----------------------	---------------------

			日)	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	697,661,053.64	94.63	643,151,013.78	94.25
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	697,661,053.64	94.63	643,151,013.78	94.25

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型 (CAPM) 对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2023 年 06 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准增加 1%	7,342,009.76	6,748,182.42
2. 业绩比较基准减少 1%	-7,342,009.76	-6,748,182.42	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输

入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2023年06月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
第一层次	694,530,472.49	636,218,082.39
第二层次	726,294.38	4,936,967.23
第三层次	2,404,286.77	1,995,964.16
合计	697,661,053.64	643,151,013.78

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 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。

#### 6.4.15.2 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	697,661,053.64	94.45
	其中：股票	697,661,053.64	94.45
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	39,604,790.20	5.36
8	其他各项资产	1,412,659.90	0.19
9	合计	738,678,503.74	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 65,738,327.00 元，占资产净值比例为 8.92%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 7.2.1.1 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	3,455,132.92	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	46,550.37	0.01
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	144,611.96	0.02
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	22,566.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	3,728,092.15	0.51

### 7.2.1.2 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	645,619,282.11	87.57
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	46,575,259.38	6.32
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	1,738,420.00	0.24
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	693,932,961.49	94.13

### 7.3 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

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

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	000063	中兴通讯	918,040	41,807,541.60	5.67
2	002475	立讯精密	1,169,084	37,936,775.80	5.15
3	000333	美的集团	615,345	36,256,127.40	4.92
4	300750	宁德时代	151,208	34,594,878.32	4.69
5	000725	京东方A	8,366,000	34,216,940.00	4.64
6	300124	汇川技术	528,925	33,962,274.25	4.61
7	601012	隆基绿能	1,120,991	32,138,811.97	4.36
8	002415	海康威视	915,700	30,318,827.00	4.11
9	601138	工业富联	1,144,200	28,833,840.00	3.91
10	002371	北方华创	76,195	24,203,341.75	3.28
11	603501	韦尔股份	237,449	23,279,499.96	3.16
12	603986	兆易创新	192,161	20,417,106.25	2.77
13	002049	紫光国微	195,720	18,250,890.00	2.48
14	603019	中科曙光	337,376	17,172,438.40	2.33
15	000977	浪潮信息	296,827	14,396,109.50	1.95
16	600760	中航沈飞	317,436	14,284,620.00	1.94
17	300316	晶盛机电	188,465	13,362,168.50	1.81
18	600703	三安光电	718,491	12,386,784.84	1.68
19	600745	闻泰科技	249,392	12,195,268.80	1.65
20	600588	用友网络	593,263	12,161,891.50	1.65
21	300450	先导智能	315,788	11,422,051.96	1.55
22	600845	宝信软件	207,322	10,534,030.82	1.43
23	601100	恒立液压	156,014	10,036,380.62	1.36
24	688777	中控技术	135,865	8,529,604.70	1.16
25	002202	金风科技	795,258	8,445,639.96	1.15
26	002236	大华股份	422,200	8,338,450.00	1.13
27	601615	明阳智能	463,800	7,828,944.00	1.06
28	300751	迈为股份	40,112	6,794,170.56	0.92
29	002008	大族激光	245,400	6,429,480.00	0.87
30	002439	启明星辰	194,400	5,785,344.00	0.78
31	300604	长川科技	121,676	5,778,393.24	0.78
32	300136	信维通信	281,907	5,660,692.56	0.77
33	300567	精测电子	56,750	5,399,762.50	0.73
34	300024	机器人	314,800	5,247,716.00	0.71
35	603290	斯达半导	24,200	5,207,840.00	0.71
36	688017	绿的谐波	28,762	4,670,948.80	0.63
37	002747	埃斯顿	152,300	4,264,400.00	0.58
38	688516	奥特维	22,599	4,257,651.60	0.58
39	603160	汇顶科技	80,205	3,709,481.25	0.50
40	600416	湘电股份	193,400	3,692,006.00	0.50
41	600038	中直股份	85,863	3,419,064.66	0.46

42	688188	柏楚电子	16,436	3,099,172.16	0.42
43	300166	东方国信	268,900	3,022,436.00	0.41
44	688083	中望软件	20,580	2,981,836.20	0.40
45	688333	铂力特	27,931	2,953,423.94	0.40
46	300083	创世纪	390,800	2,856,748.00	0.39
47	002334	英威腾	219,700	2,798,978.00	0.38
48	002690	美亚光电	102,920	2,650,190.00	0.36
49	300747	锐科激光	86,200	2,627,376.00	0.36
50	300776	帝尔激光	39,840	2,585,616.00	0.35
51	600967	内蒙一机	248,600	2,510,860.00	0.34
52	300457	赢合科技	130,300	2,301,098.00	0.31
53	002698	博实股份	129,800	2,270,202.00	0.31
54	688518	联赢激光	78,800	2,195,368.00	0.30
55	301029	怡合达	48,025	2,145,757.00	0.29
56	688006	杭可科技	67,796	2,065,744.12	0.28
57	688559	海目星	41,300	1,941,513.00	0.26
58	300048	合康新能	323,600	1,935,128.00	0.26
59	688686	奥普特	10,752	1,768,488.96	0.24
60	603859	能科科技	34,000	1,738,420.00	0.24
61	603666	亿嘉和	36,424	1,644,543.60	0.22
62	601882	海天精工	45,600	1,518,480.00	0.21
63	603283	赛腾股份	32,600	1,450,700.00	0.20
64	300353	东土科技	108,200	1,407,682.00	0.19
65	688305	科德数控	13,100	1,313,406.00	0.18
66	002979	雷赛智能	54,030	1,283,752.80	0.17
67	603583	捷昌驱动	55,900	1,204,086.00	0.16
68	300607	拓斯达	74,500	1,119,735.00	0.15
69	300278	华昌达	248,700	1,111,689.00	0.15
70	603416	信捷电气	24,600	1,016,226.00	0.14
71	002957	科瑞技术	46,400	940,528.00	0.13
72	300802	矩子科技	38,000	914,660.00	0.12
73	603025	大豪科技	64,800	800,928.00	0.11
74	688697	纽威数控	28,600	738,738.00	0.10
75	688330	宏力达	20,443	717,140.44	0.10
76	300809	华辰装备	28,080	627,868.80	0.09
77	301328	维峰电子	9,810	558,581.40	0.08
78	688320	禾川科技	11,400	549,708.00	0.07
79	688162	巨一科技	11,500	477,020.00	0.06
80	301195	北路智控	9,900	460,944.00	0.06

**7.3.2 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所有股票投资  
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	688506	百利天恒	15,622	1,115,098.36	0.15
2	301486	致尚科技	4,426	255,203.16	0.03
3	688539	高华科技	5,334	231,975.66	0.03
4	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
5	002559	亚威股份	15,000	133,200.00	0.02
6	002184	海得控制	6,600	108,240.00	0.01
7	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
8	002380	科远智慧	3,800	88,540.00	0.01
9	301312	智立方	800	84,928.00	0.01
10	603011	合锻智能	10,300	81,370.00	0.01
11	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
12	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
13	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
14	688249	晶合集成	3,801	68,646.06	0.01
15	688558	国盛智科	1,500	53,640.00	0.01
16	688472	阿特斯	2,873	48,955.92	0.01
17	301112	信邦智能	1,300	47,593.00	0.01
18	688361	中科飞测-U	701	45,333.67	0.01
19	301358	湖南裕能	1,008	43,233.12	0.01
20	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
21	688531	日联科技	254	34,536.38	0.00
22	301260	格力博	1,262	29,821.06	0.00
23	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
24	688146	中船特气	661	25,203.93	0.00
25	301246	宏源药业	807	24,782.97	0.00
26	688484	南芯科技	673	24,705.83	0.00
27	688352	颀中科技	1,988	23,995.16	0.00
28	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
29	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
30	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
31	001287	中电港	1,056	22,197.12	0.00
32	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
33	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
34	301322	绿通科技	357	19,006.68	0.00
35	688570	天玛智控	734	18,592.22	0.00
36	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
37	688581	安杰思	153	18,058.59	0.00
38	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00

39	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
40	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
41	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
42	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
43	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
44	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
45	688623	二元科技	170	14,754.30	0.00
46	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
47	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
48	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
49	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
50	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
51	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
52	301345	涛涛车业	262	12,219.68	0.00
53	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
54	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
55	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
56	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
57	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
58	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
59	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
60	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
61	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
62	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
63	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
64	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
65	601065	江盐集团	740	8,761.60	0.00
66	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
67	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
68	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
69	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
70	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
71	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
72	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
73	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
74	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
75	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
76	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
77	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	隆基绿能	12,674,399.80	1.86
2	002236	大华股份	8,066,404.00	1.18
3	300124	汇川技术	4,851,679.50	0.71
4	300024	机器人	4,540,518.00	0.67
5	002475	立讯精密	2,810,677.00	0.41
6	300747	锐科激光	2,320,494.00	0.34
7	002698	博实股份	1,932,963.00	0.28
8	002415	海康威视	1,785,491.00	0.26
9	300353	东土科技	1,288,121.00	0.19
10	002559	亚威股份	1,146,987.00	0.17
11	603501	韦尔股份	995,480.65	0.15
12	000725	京东方 A	805,130.00	0.12
13	300750	宁德时代	802,565.00	0.12
14	688249	晶合集成	754,819.02	0.11
15	301328	维峰电子	652,912.15	0.10
16	301029	怡合达	621,067.60	0.09
17	688006	杭可科技	558,753.60	0.08
18	688162	巨一科技	526,255.77	0.08
19	600745	闻泰科技	515,923.00	0.08
20	688017	绿的谐波	506,139.42	0.07

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 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	002415	海康威视	4,929,050.00	0.72
2	000063	中兴通讯	4,379,790.00	0.64
3	000725	京东方 A	3,712,942.00	0.54
4	600703	三安光电	3,075,616.00	0.45
5	002371	北方华创	3,032,537.91	0.44
6	601138	工业富联	2,870,482.00	0.42
7	000333	美的集团	2,785,889.00	0.41
8	603986	兆易创新	2,674,328.00	0.39
9	002049	紫光国微	2,291,984.00	0.34
10	603019	中科曙光	2,212,702.00	0.32



11	000977	浪潮信息	1,844,238.00	0.27
12	688777	中控技术	1,818,704.32	0.27
13	600760	中航沈飞	1,699,248.00	0.25
14	600588	用友网络	1,649,310.00	0.24
15	300316	晶盛机电	1,645,132.00	0.24
16	300450	先导智能	1,384,774.00	0.20
17	002202	金风科技	1,241,831.00	0.18
18	600845	宝信软件	1,053,076.80	0.15
19	002184	海得控制	988,816.00	0.14
20	601615	明阳智能	979,420.00	0.14

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	67,346,245.11
卖出股票收入（成交）总额	83,227,098.76

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。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 声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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，富士康工业互联网股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国台湾地区经济部的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。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。

### 7.12.2 声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。

### 7.12.3 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	8,431.48
2	应收清算款	123,846.64
3	应收股利	11,709.00
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,241,220.72
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	应计出借证券利息	27,452.06
9	其他	—

10	合计	1,412,659.90
----	----	--------------

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000063	中兴通讯	14,117,400.00	1.91	转融通流通受限
2	002371	北方华创	3,525,915.00	0.48	转融通流通受限
3	601138	工业富联	1,789,200.00	0.24	转融通流通受限
4	000333	美的集团	1,178,400.00	0.16	转融通流通受限

##### 7.12.5.2 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	688506	百利天恒	1,115,098.36	0.15	新股限售
2	301486	致尚科技	255,203.16	0.03	新股认购
3	688539	高华科技	231,975.66	0.03	新股限售
4	301395	仁信新材	124,755.68	0.02	新股认购
4	301395	仁信新材	13,873.60	0.00	新股限售

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 A	31,907	23,432.68	749,099.22	0.10	746,917,300.30	99.90
富国中证工业 4.0 指数 C	852	5,685.38	819.00	0.02	4,843,128.07	99.98
合计	32,759	22,971.10	749,918.22	0.10	751,760,428.37	99.90

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证工业 4.0 指数 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	徐青	451,756.00	2.74
2	董文	447,242.00	2.72
3	陆宝勤	366,804.00	2.23
4	董芳	316,208.00	1.92
5	谢雅	316,205.00	1.92
6	范志田	256,834.00	1.56
7	福建力禾电子科技有限公司	225,876.00	1.37
8	邱绍青	202,083.00	1.23
9	陈秀莲	190,962.00	1.16
10	杜秀珍	180,705.00	1.10

### 8.3 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(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国中证工业 4.0 指数 A	7,233.35	0.0010
	富国中证工业 4.0 指数 C	10,973.21	0.2265
	合计	18,206.56	0.0024

### 8.4 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 A	0
	富国中证工业 4.0 指数 C	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 A	0
	富国中证工业 4.0 指数 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证工业 4.0 指数 A	富国中证工业 4.0 指数 C
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	768,058,473.78	2,819,669.37
本报告期基金总申购份额	26,873,219.68	11,790,681.93
减：本报告期基金总赎回份额	47,265,293.94	9,766,404.23
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	747,666,399.52	4,843,947.07

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		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 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	20,139,492.26	14.56	14,526.87	15.00	—
诚通证券	2	—	—	—	—	—
川财证券	2	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—

广发证券	2	18,049,190.34	13.05	13,018.65	13.45	—
国都证券	2	2,001,773.74	1.45	1,443.85	1.49	—
国海证券	1	2,231,215.68	1.61	1,609.43	1.66	—
国泰君安	2	585,470.10	0.42	422.29	0.44	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	1	34,448,161.57	24.90	24,848.64	25.66	—
华宝证券	1	48,902.00	0.04	35.28	0.04	—
华创证券	1	6,544,185.71	4.73	4,720.03	4.87	—
瑞银证券	2	79,979.52	0.06	57.68	0.06	—
上海证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	4	49,903,908.60	36.07	35,995.50	37.18	—
西部证券	2	78,390.00	0.06	56.54	0.06	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
中泰证券	3	4,242,149.80	3.07	90.27	0.09	—

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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 (%)
长江证券	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
川财证券	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国都证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国元证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华宝证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—



---

瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	502,716.30	100.00	—	—	—	—
西部证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年02月02日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年03月25日

---

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

## § 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
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	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	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） 公司地址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。