

# 富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

## 二〇一九年第 4 季度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 01 月 17 日

## § 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 1 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国中证 1000 指数增强 (LOF)
场内简称	富国 1000
基金主代码	161039
交易代码	161039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 05 月 31 日
报告期末基金份额总额 (单位: 份)	63, 323, 227. 96
投资目标	本基金为增强型股票指数基金, 在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上, 通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制, 力争实现超越目标指数的投资收益, 谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”, 在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股, 力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。</p> <p>本基金主要策略为复制目标指数, 投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础, 利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差, 避免大幅偏离目标指数, 另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。</p> <p>富国研发的定量投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验, 利用多因子 alpha 模型预测股票超额回报, 在有效控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率 (税后) ×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金, 其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单

位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年10月01日-2019年12月31日）
1. 本期已实现收益	3,186,481.12
2. 本期利润	7,171,779.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1005
4. 期末基金资产净值	75,675,679.90
5. 期末基金份额净值	1.1951

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.31%	0.92%	6.09%	0.96%	3.22%	-0.04%

注：过去三个月指2019年10月1日-2019年12月31日。

##### 3.2.2 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2019年12月31日。

2、本基金于2018年5月31日成立，建仓期6个月，从2018年5月31日起至2018年11月29日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金基金经理	2018-05-31	—	10	硕士，自2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014年4月至2014年11月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理助理，2014年11

					月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 5 月至 2019 年 11 月任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金(已于 2019 年 5 月 10 日变更为富国中证银行指数型证券投资基金) 的基金经理, 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理, 2017 年 7 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 7 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 1 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理; 兼任量化投资副总监。具有基金从业资格。
徐幼华	本基金基金经理	2018-05-31	—	14	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

					<p>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月至2017年12月任富国中证工业4.0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, 2015年6月至2017年11月任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, 2017年3月起任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理, 2017年4月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理, 2018年5月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理, 2018年7月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理, 2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理; 兼任量化投资部副总经理。具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求



相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### **4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析**

3 季度初，伴随着中美贸易谈判传出乐观消息，节后市场整体震荡反弹。10 月中旬起，尽管陆续公布的金融数据超出市场预期，但由于 CPI 高企，滞胀风险加大，投资者对货币政策进一步宽松产生担忧，市场出现明显回调。11 月，由于央行陆续下调 MLF 利率、逆回购利率、LPR 利率，超出市场预期，部分缓解了投资者收紧货币政策的担忧，同时伴随着 MSCI 进一步上调 A 股纳入因子的比重，北上资金持续大幅流入，A 股有所反弹。进入 12 月，由于 11 月制造业 PMI 数据回升明显，改善的时点和幅度均超预期，表明经济正逐步复苏。12 月中旬，中美宣布达成第一阶段贸易协议，尽管具体协议内容及签订时间仍未明确，但短期进一步恶化的概率大幅降低，市场风险偏好大幅提升。总体来看，2019 年 4 季度上证综指上涨 4.99%，沪深 300 上涨 7.39%，创业板指上涨 10.48%。其中，中证 1000 指数 2019 年 4 季度上涨 6.4%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理，积极获取超额收益率。

#### **4.5 报告期内基金的业绩表现**

本报告期，本基金份额净值增长率为 9.31%，同期业绩比较基准收益率为 6.09%

#### **4.6 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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	71,779,597.27	92.88
	其中：股票	71,779,597.27	92.88
2	固定收益投资	52,000.00	0.07
	其中：债券	52,000.00	0.07
	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	5,112,434.58	6.62
7	其他资产	336,727.83	0.44
8	合计	77,280,759.68	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	6,994,702.55	9.24
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	360,525.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	1,617,369.00	2.14
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,134,649.17	2.82
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	165,150.00	0.22
S	综合	—	—
	合计	11,272,395.72	14.90

### 5.2.2 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	704,666.50	0.93
B	采矿业	1,877,615.00	2.48
C	制造业	40,032,691.85	52.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,033,884.20	2.69
E	建筑业	540,631.00	0.71
F	批发和零售业	1,942,303.00	2.57
G	交通运输、仓储和邮政业	84,105.00	0.11
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,263,383.00	6.96
J	金融业	512,750.00	0.68
K	房地产业	1,861,843.00	2.46
L	租赁和商务服务业	762,770.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	772,208.00	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,617,514.00	2.14
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	344,925.00	0.46
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,839,055.00	2.43
S	综合	316,857.00	0.42
	合计	60,507,201.55	79.96

### 5.3 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

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600720	祁连山	86,000	1,079,300.00	1.43

2	600667	太极实业	119,800	971,578.00	1.28
3	601677	明泰铝业	83,400	961,602.00	1.27
4	600063	皖维高新	240,700	943,544.00	1.25
5	603313	梦百合	44,660	942,772.60	1.25
6	601163	三角轮胎	60,900	931,770.00	1.23
7	600308	华泰股份	199,100	913,869.00	1.21
8	603508	思维列控	15,400	911,372.00	1.20
9	600261	阳光照明	186,300	884,925.00	1.17
10	603368	柳药股份	25,900	871,276.00	1.15

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

#### 票投资明细

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	688111	金山办公	14,659	1,885,587.17	2.49
2	600031	三一重工	47,700	813,285.00	1.07
3	603986	兆易创新	3,800	778,582.00	1.03
4	601233	桐昆股份	51,700	774,983.00	1.02
5	600026	中远海能	117,100	747,098.00	0.99

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	52,000.00	0.07
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	52,000.00	0.07

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113558	日月转债	500	50,000.00	0.07
2	113030	东风转债	20	2,000.00	0.00

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	44,648.54
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,119.20
5	应收申购款	290,960.09
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	336,727.83

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	---------	--------	----------

			公允价值(元)	值比例 (%)	
1	688111	金山办公	1,885,587.17	2.49	科创板限售

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	74,551,280.95
报告期期间基金总申购份额	9,331,812.05
减：报告期期间基金总赎回份额	20,559,865.04
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	63,323,227.96

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	—
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	—
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	—

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）的文件
- 2、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 9.2 存放地点

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

### 9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。  
咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址：  
<http://www.fullgoal.com.cn>。

富国基金管理有限公司  
2020 年 01 月 17 日