

# 富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

## 二〇一六年第 4 季度报告

2016 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： 2017 年 01 月 21 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 2017 年 1 月 19 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 2016 年 10 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF)
场内简称	富国 500
基金主代码	161017
交易代码	前端交易代码: 161017 后端交易代码: 161021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 10 月 12 日
报告期末基金份额总额 (单位: 份)	230, 109, 510. 54
投资目标	本基金为增强型股票指数基金, 在力求对中证 500 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	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。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=95%×中证 500 指数收益率+1%(指年收益率, 评价时按期间折算)。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金, 属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种, 其预期风险与收益高于混合型基金、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 (2016 年 10 月 01 日- 2016 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	13, 139, 381. 44
2. 本期利润	960, 394. 09
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0044
4. 期末基金资产净值	469, 817, 227. 77
5. 期末基金份额净值	2. 042

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	0.39%	0.78%	-0.71%	0.79%	1.10%	-0.01%

注：过去三个月指 2016 年 10 月 1 日—2016 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 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2011 年 10 月 12 日成立，建仓期 6 个月，从 2011 年 10 月 12 日起

至 2012 年 4 月 11 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	本基金基金经理兼任量化投资副总监、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、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、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理	2014-11-19	—	7	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 月起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；兼任量化投资副总监。具有基金从业资格。
李笑薇	本基金基金经理兼任副总经理、富国沪深	2011-10-12	—	14	博士，曾任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

	300 增强证 券投资基金 基金经理				莱国际投资管理公司 (Barclays Global Investors), 大中华主动股 票投资总监、高级基金经 理及高级研究员; 2009 年 6 月 加入富国基金管理有限公司, 2011 年 1 月至 2012 年 5 月任 上证综指交易型开放式指数 证券投资基金、富国上证综 指交易型开放式指数证 券投资基金联接基金基金 经理, 2009 年 12 月至今任富 国沪深 300 增强证 券投资基金基金经理, 2011 年 10 月至今任富国中 证 500 指数增强型证 券投资基金 (LOF) 基金 经理; 兼任副 总经理; 具有中国基金从 业资格。
徐幼华	本基金基金 经理兼任量 化投资部副 总经理、富 国中证红利 指数增强型 证券投资基金、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、 富国中证医 药主题指 数增强型 证券投资基 金 (LOF) 基 金经理	2011-10-12	—	16	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, 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。具有基金从业资格。

注: 1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期, 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，富国基金管理有限公司作为富国中证 500 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 500 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、确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，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，监察稽核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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 2 次同日反向交易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**

回顾 4 季度，由于国庆期间各地陆续出台房地产限购政策，在资产荒的大背景下，市场预期房地产投资资金将回流股市，国庆节后 A 股迎来大幅反弹。其中，受益于财政刺激力度加大的 PPP 相关行业如建筑装饰、建筑材料等行业表现较好，同时受益于供给侧改革的煤炭等行业在期货价格的带动下持续上涨。进入 11 月，在安邦举牌中国建筑、前海人寿举牌格力电器等信息刺激下，资产荒逻辑得到进一步加强，低估值蓝筹股加速上涨，沪深 300 表现突出，全月上涨 6.05%。12 月以来，随着监管层加强对保险举牌行为的监管，前期推动大盘上涨的资产荒逻辑受到抑制，相关举牌概念股出现明显回调。同时，央行持续收紧资金引发债市去杠杆行情，国债期货出现跌停现象，国债利率及银行间回购利率均出现明显上升，由此也导致股市资金紧张，带动股市回调，进入休整期。总体来看，4 季度 A 股冲高回落，上证综指上涨 3.29%，沪深 300 上涨 1.75%，创业板指下跌 8.74%。其中，中证 500 指数 4 季度下跌 1.02%。

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 0.39%，同期业绩比较基准收益率为-0.71%

#### 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	435,860,904.84	92.30
	其中：股票	435,860,904.84	92.30
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	35,458,392.55	7.51
7	其他资产	881,232.86	0.19
8	合计	472,200,530.25	100.00

#### 5.2 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	5,217,620.80	1.11
B	采矿业	191,250.00	0.04
C	制造业	47,394,910.47	10.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	834,969.66	0.18
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	2,634,529.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	3,252,267.00	0.69

H	住宿和餐饮业	850,392.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,792,964.63	2.30
J	金融业	106,780.00	0.02
K	房地产业	4,577,144.00	0.97
L	租赁和商务服务业	1,028,840.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	169,947.00	0.04
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	593,408.00	0.13
S	综合	—	—
	合计	77,660,614.79	16.53

### 5.3 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	9,472,006.00	2.02
B	采矿业	14,038,568.00	2.99
C	制造业	220,980,566.51	47.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,941,916.48	1.05
E	建筑业	1,344,896.00	0.29
F	批发和零售业	19,370,766.68	4.12
G	交通运输、仓储和邮政业	5,996,505.00	1.28
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,762,496.10	6.76
J	金融业	2,296,042.10	0.49
K	房地产业	27,009,816.60	5.75
L	租赁和商务服务业	4,340,974.68	0.92
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	4,330,365.90	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	5,094,240.00	1.08
R	文化、体育和娱乐业	4,216,494.00	0.90
S	综合	3,004,636.00	0.64
	合计	358,200,290.05	76.24

#### 5.4 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

##### 5.4.1 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	002092	中泰化学	523,500	6,334,350.00	1.35
2	600522	中天科技	585,950	6,170,053.50	1.31
3	600967	北方创业	408,400	5,541,988.00	1.18
4	600409	三友化工	589,500	5,535,405.00	1.18
5	601717	郑煤机	782,800	5,503,084.00	1.17
6	000401	冀东水泥	462,200	5,500,180.00	1.17
7	300115	长盈精密	209,976	5,471,974.56	1.16
8	002572	索菲亚	99,927	5,412,046.32	1.15
9	002269	美邦服饰	1,070,800	5,364,708.00	1.14
10	601012	隆基股份	399,135	5,344,417.65	1.14

##### 5.4.2 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	601636	旗滨集团	1,122,400	4,354,912.00	0.93
2	600475	华光股份	208,900	4,167,555.00	0.89
3	300498	温氏股份	118,240	4,164,412.80	0.89
4	002624	完美世界	139,600	4,158,684.00	0.89
5	300267	尔康制药	294,425	3,842,246.25	0.82

#### 5.5 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。

#### 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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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。

## 5.8 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。

## 5.9 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.11.1 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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 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。

## 5.12 投资组合报告附注

### 5.12.1 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。

#### 5.12.2 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。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	94,092.25
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	7,473.67
5	应收申购款	779,666.94
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	881,232.86

#### 5.12.4 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。

#### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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。

##### 5.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

#### 5.12.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	210,953,260.50
报告期期间基金总申购份额	57,033,136.54
减：报告期期间基金总赎回份额	37,876,886.50
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	230,109,510.54

## §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	3,333.00
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	3,333.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的文件
- 2、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、富国中证 500 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 500 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

## **8.2 存放地点**

上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

## **8.3 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  
2017 年 01 月 21 日