富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF） 2018年年度报告摘要

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
送出日期：	2019年03月29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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年5月31日（基金合同生效日）起至2018年12月31日止。

1.2 §2 基金简介

2.1 基金基本情况

场内简称	富国1000
基金简称	富国中证1000指数增强（LOF）
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
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
报告期末基金份额总额	218,818,493.83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

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为跟强型股票指数基金，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标概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。 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，利用国际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。 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，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。
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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	贺婧
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686，4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816

注：公司已于2019年03月28日发布《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，裴长江先生自2019年03月27日起担任公司董事长。

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

注：信息披露报纸为截止至本报告期末信息。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2018年5月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日
本期已实现收益	-8,534,920.95
本期利润	-35,050,633.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1291
本期基金份额净值增长率	-15.46%
3.1.2期末数据和指标	2018年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.1546
期末基金资产净值	184,985,069.33
期末基金份额净值	0.8454

注：本基金于2018年5月31日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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 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	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
过去三个月	-11.58%	1.60%	-10.59%	1.80%	-0.99%	-0.20%
过去六个月	-15.75%	1.18%	-20.00%	1.54%	4.25%	-0.36%
自基金合同生效日起至今	-15.46%	1.09%	-27.62%	1.58%	12.16%	-0.49%

注：中证1000指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%

由于本基金投资标的指数为中证1000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中证1000指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmark）按下列公式计算：

benchmark =95%* [中证1000指数收益率t/ (中证1000指数收益率t-1)-1] +5%*银行人民币活期存款利率（税后）/360；

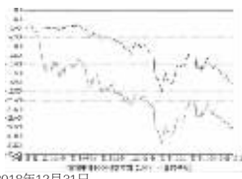
其中，t=1，2，3，···，T，T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmark t)]-1

其中，T=2，3，4，···；∏Tt=1(1+benchmark t)表示t日至T日的(1+benchmark t)数学连乘。

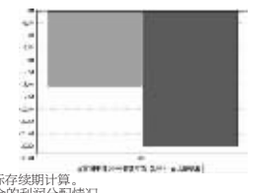
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2018年12月31日。

2、本基金于2018年5月31日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2018年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金2018年5月31日（基金合同生效日）至2018年12月31日未进行利润分配

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

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国际信托股份有限公司。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、ODII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全牌照业务牌照。

截至2018年12月31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、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、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等一百二十四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）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	-	9	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、富国中证500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月起任富国上证综合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4月至2018年12月任富国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月起任富国精选成长混合型证券投资基金、富国中证红利指数增强型证券投资基金（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；量化量化投资副总监。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量研究员，2008年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部量研究员、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月起任富国趋势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；量化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决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；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 管理人对投告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 管理人对投告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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风险列为限制行为，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，风险管理部现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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

4.3.3 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1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 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

2018年以来，A股市场内忧外患，全年震荡下跌。从外部影响来看，进入2月，市场对美联储货币政策加速收紧产生担忧，美股带动全球市场迎来一轮深幅调整。3月起，贸易摩擦阴霾笼罩全球资本市场。美国先后对500亿、2000亿美元的中国进口商品增加关税，市场对全球贸易担忧加剧，全球股指调整幅度加大。从内部影响来看，5月以来，金融去杠杆导致民企融资困难加剧，部分上市公司债券违约。进入9月，部分公司股权质押被迫平仓，导致A股出现严重的流动性风险。进入4季度，各方情况有所缓解。外部环境来看，美联储加息预期放缓，中美贸易摩擦迎来新的谈判窗口。内部环境来看，金融去杠杆暂告一段落，财政政策、货币政策放松将成为未来一段时间政策的主基调。4季度以来，市场恐慌情绪明显缓解。总体来看，2018年上证综指下跌24.59%，沪深300下跌25.31%，创业板指下跌28.65%。其中，中证1000指数2018年下跌36.87%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日，本基金份额净值为0.8454元；份额累计净值为0.8454元；本报告期，本基金份额净值增长率为-15.46%，同期业绩比较基准收益率为-27.62%

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2019年，经过2018年的大幅下跌后，目前A股市场总体估值处于历史较低水平，从全球横向来看，也具有较高的吸引力。总体来看，2019年中美贸易摩擦有望阶段性缓和，同时政府也将陆续释放更加宽松的财政及货币政策信号来对冲经济下滑带来的冲击，投资者恐慌情绪有望进一步缓解，市场结构性机会将明显增加。其中，有可能影响市场的重要因素包括中美双方贸易谈判进展、美联储加息进展、中国财政及货币政策刺激力度等。

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。

4.6 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，由基金管理人对外公布。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司2018年5月31日至2018年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末（2018年12月31日）
资 产：	
银行存款	25,016,739.28
结算备付金	175,728.09
存出保证金	66,630.28
交易性金融资产	160,481,336.81
其中：股票投资	160,481,336.81
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	5,383.22
应收股利	-
应收申购款	78,876.96
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	185,824,694.64
负债和所有者权益	本期末（2018年12月31日）
负 债：	
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	-
应付证券清算款	731.00
应付赎回款	372,607.80
应付管理人报酬	163,866.74
应付托管费	24,580.00
应付销售服务费	-
应付交易费用	86,453.68
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	191,386.09
负债合计	839,625.31
所有者权益：	
实收基金	218,818,493.83
未分配利润	-33,833,424.50
所有者权益合计	184,985,069.33
负债和所有者权益总计	185,824,694.64

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.8454元，基金份额总额218,818,493.83份。本基金合同生效日2018年05月31日。

7.2 利润表

会计主体：富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年05月31日至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期2018年5月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入	-32,562,104.55
1.利息收入	1,506,962.68
其中：存款利息收入	443,191.47
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	1,063,771.21
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-7,943,426.97
其中：股票投资收益	-8,277,803.28
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具投资收益	-
股利收益	334,376.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-26,515,712.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	390,072.49
减：二、费用	2,488,529.15
1. 管理人报酬	1,506,541.42
2. 托管费	225,981.14
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	371,741.87
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	384,264.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-35,050,633.70
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-35,050,633.70

注：本基金合同生效日为2018年5月31日，无上年度同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年05月31日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2018年5月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	512,114,043.76	-	512,114,043.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-35,050,633.70	-35,050,633.70
三、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）	-293,296,549.93	1,217,209.20	-292,078,340.73
其中：1.基金申购款	17,942,127.23	-1,160,739.04	16,781,388.19
2.基金赎回款	-311,237,677.16	2,377,948.24	-308,859,728.92
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	218,818,493.83	-33,833,424.50	184,985,069.33

注：本基金合同生效日为2018年5月31日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

陈 戈 林志松 徐慧

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）(以下简称“本基金”)，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（2018）30号《关于准予富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人自2018年5月3日到2018年5月25日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2018）验字第60467606_B16号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2018年5月31日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币512,011,341.26元，折合512,011,341.26份基金份额。募集资金在募集期间产生的利息为人民币102,702.50元，折合102,702.50份基金份额。以上收到的实收基金（本息）共计人民币512,114,043.76元，折合512,114,043.76份基金份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司。基金托管人为中国农业银行股份有限公司

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证1000指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、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（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、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80%，其中投资于中证1000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%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证1000指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%

7.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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，由基金管理人对外公布。

7.7 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。

7.8 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司2018年5月31日至2018年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末（2018年12月31日）
资 产：	
银行存款	25,016,739.28
结算备付金	175,728.09
存出保证金	66,630.28
交易性金融资产	160,481,336.81
其中：股票投资	160,481,336.81
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	5,383.22
应收股利	-
应收申购款	78,876.96
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	185,824,694.64
负债和所有者权益	本期末（2018年12月31日）
负 债：	
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	-
应付证券清算款	731.00
应付赎回款	372,607.80
应付管理人报酬	163,866.74
应付托管费	24,580.00
应付销售服务费	-
应付交易费用	86,453.68
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	191,386.09
负债合计	839,625.31
所有者权益：	
实收基金	218,818,493.83
未分配利润	-33,833,424.50
所有者权益合计	184,985,069.33
负债和所有者权益总计	185,824,694.64

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.8454元，基金份额总额218,818,493.83份。本基金合同生效日2018年05月31日。

7.2 利润表

会计主体：富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年05月31日至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期2018年5月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入	-32,562,104.55
1.利息收入	1,506,962.68
其中：存款利息收入	443,191.47
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	1,063,771.21
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-7,943,426.97
其中：股票投资收益	-8,277,803.28
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具投资收益	-
股利收益	334,376.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-26,515,712.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	390,072.49
减：二、费用	2,488,529.15
1. 管理人报酬	1,506,541.42
2. 托管费	225,981.14
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	371,741.87
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	384,264.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-35,050,633.70
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-35,050,633.70

注：本基金合同生效日为2018年5月31日，无上年度同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年05月31日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2018年5月31日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	512,114,043.76	-	512,114,043.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-35,050,633.70	-35,050,633.70
三、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）	-293,296,549.93	1,217,209.20	-292,078,340.73
其中：1.基金申购款	17,942,127.23	-1,160,739.04	16,781,388.19
2.基金赎回款	-311,237,677.16	2,377,948.24	-308,859,728.92
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	218,818,493.83	-33,833,424.50	184,985,069.33

注：本基金合同生效日为2018年5月31日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

陈 戈 林志松 徐慧

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）(以下简称“本基金”)，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（2018）30号《关于准予富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人自2018年5月3日到2018年5月25日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2018）验字第60467606_B16号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2018年5月31日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币512,011,341.26元，折合512,011,341.26份基金份额。募集资金在募集期间产生的利息为人民币102,702.50元，折合102,702.50份基金份额。以上收到的实收基金（本息）共计人民币512,114,043.76元，折合512,114,043.76份基金份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司。基金托管人为中国农业银行股份有限公司

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证1000指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、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（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、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80%，其中投资于中证1000指数成