富国中证新能源汽车指数型证券投资基金

二 0 二一年第 1 季度报告

2021 年 03 月 31 日

基金管理人：　富国基金管理有限公司

基金托管人：　中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：　2021 年 04 月 22 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 20 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 3 月 31 日止。

§2　　基金产品概况

基金简称	富国中证新能源汽车指数
场内简称	新能源车
基金主代码	161028
交易代码	161028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 03 月 30 日
报告期末基金份额总额（单位：份）	8,366,917,341.71
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证新能源汽车指数。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，按照成份股在中证新能源汽车指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证新能源汽车指数的收益表现，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详见法律文件。
业绩比较基准	95%×中证新能源汽车指数收益率＋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。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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（2021 年 01 月 01 日-2021 年 03 月 31 日）
1.本期已实现收益	429,763,637.39
2.本期利润	-1,053,166,356.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1267

4.期末基金资产净值	7,826,085,143.70
5.期末基金份额净值	0.935

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	-11.88%	2.54%	-11.93%	2.60%	0.05%	-0.06%
过去六个月	28.11%	2.41%	30.66%	2.45%	-2.55%	-0.04%
过去一年	83.79%	2.17%	85.30%	2.21%	-1.51%	-0.04%
过去三年	52.56%	1.95%	54.39%	1.98%	-1.83%	-0.03%
过去五年	54.18%	1.76%	57.57%	1.79%	-3.39%	-0.03%
自基金合同生效起至今	38.82%	2.05%	67.38%	2.08%	-28.56%	-0.03%

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 2021 年 3 月 31 日。

2、本基金于 2015 年 3 月 30 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 3 月 30 日起至 2015 年 9 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		
牛志冬	本基金基金经理	2015-05-13	—	13.75	硕士，自 2007 年 7 月至 2010 年 8 月任华夏基金管理有限公司研究员；自 2010 年 8 月至 2012 年 4 月任富国基金管理有限公司基金经理助理；自 2012 年 4 月至 2015 年 3 月任富国基金管理有限公司投资经理；自 2015 年 5 月起任富国中证移动互联网指数

					型证券投资基金（原富国中证移动互联网指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、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，于2021年1月1日更名）基金经理，自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，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7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，2017年11月至2018年12月任富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018年11月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018年12月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任量化投资部量化投资副总监。具有基金从业资格。
张圣贤	本基金基金经理	2015-06-05	—	13.75	硕士，自2007年7月至2015年3月任上海申银万国证券研究所有限公司分析师；自2015年3月至2015年6月任富国基金管理有限公司基金经理助理；2015年6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，于

					2021 年 1 月 1 日更名)、富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，于 2021 年 1 月 1 日更名)、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，于 2021 年 1 月 1 日更名)基金经理;自 2015 年 8 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，于 2021 年 1 月 1 日更名)、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，于 2021 年 1 月 1 日更名）基金经理，2016 年 2 月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）基金经理，2017 年 7 月至 2020 年 12 月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,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，于 2021 年 1 月 1 日更名）基金经理，2020 年 4 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，2020 年 7 月起担任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理,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、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，2021 年 2 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任量化投资部量化投资总监助理。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遵规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证新能源汽车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》、《富国中证新能源汽车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 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

年初以来，在中欧投资协定达成、PMI 向好、货币政策不急转弯等多重利好因素的刺激下，市场风险偏好大幅提升。在美国新一轮财政刺激落地，国内公募基金发行火爆等消息的推动下，上证指数先后突破 3500、3600 点。1 月下旬，由于市场短期涨幅较大，同时伴随着月末银行间流动性紧张，市场迎来调整。2 月，随着流动性压力缓解，市场春节效应再现，A 股迎来反弹。春节期间，海外疫苗接种加速，全球疫情改善进一步，强化全球经济共振复苏的乐观预期，原油、铜等大宗商品大幅上涨，带动节后有色板块涨幅居前。随着美国经济复苏预期加强，美国 10 年期国债利率快速突破 1.5%，导致全球投资者对美联储货币政策提前收缩的担忧加大，使得全球股市均出现不同程度的下跌。其中，前期上涨幅度较大的消费、医药、科技等板块调整幅度较大。3 月中旬，尽管公布的经济数据显示国内经济向好，同时 2 月金融数据超预期，但投资者对后续国内货币政策边际收紧仍感到担忧，因此市场在阶段性反弹后再次回落。3 月下旬，随着上市公司年报、季报预告陆续披露，部分估值相对合理的公司开始企稳反弹。同时海外

疫情再度爆发，美国 10 年期国债利率升幅放缓，A 股快速杀估值阶段告一段落，前期调整较多的板块陆续迎来反弹。总体来看，2021 年 1 季度上证综指下跌 0.9%，沪深 300 下跌 3.13%，创业板指下跌 7%，中证 500 指数下跌 1.78%。

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。

4.5 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-11.88%，同期业绩比较基准收益率为-11.93%

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	7,337,905,322.11	92.98
	其中：股票	7,337,905,322.11	92.98
2	固定收益投资	10,173,144.02	0.13
	其中：债券	10,173,144.02	0.13
	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	525,793,115.02	6.66
7	其他资产	18,252,832.88	0.23
8	合计	7,892,124,414.03	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 438,141,611.00 元，占资产净值比例为 5.60%。

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	1,162,946.36	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.00
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	20,493.82	0.00
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	134,605.40	0.00
J	金融业	1,183,425.93	0.02
K	房地产业	10,200.30	0.00
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	19,857.82	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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,555,565.75	0.03

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	7,335,349,756.36	93.73
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	—	—

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	—	—
S	综合	—	—
	合计	7,335,349,756.36	93.73

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	002074	国轩高科	12,022,400	433,167,072.00	5.53
2	300750	宁德时代	1,337,629	430,943,934.93	5.51
3	300014	亿纬锂能	5,718,385	429,736,632.75	5.49
4	002460	赣锋锂业	4,382,637	413,107,363.62	5.28
5	300450	先导智能	5,204,328	411,089,868.72	5.25
6	002340	格林美	45,020,628	385,376,575.68	4.92
7	002812	恩捷股份	3,266,690	365,607,944.80	4.67
8	300124	汇川技术	4,129,136	353,082,419.36	4.51
9	002594	比亚迪	1,995,174	328,226,074.74	4.19
10	002709	天赐材料	3,855,025	314,608,590.25	4.02

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	601995	中金公司	24,951	1,183,425.93	0.02
2	688183	生益电子	18,394	245,559.90	0.00
3	688617	惠泰医疗	1,673	235,759.16	0.00
4	688079	美迪凯	10,622	129,800.84	0.00
5	300957	贝泰妮	853	107,827.73	0.00

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）	10,173,144.02	0.13
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	10,173,144.02	0.13

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	123094	星源转 2	93,383	10,173,144.02	0.13

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，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	1,740,234.43
2	应收证券清算款	1,158,086.49
3	应收股利	—
4	应收利息	397,484.28
5	应收申购款	14,909,613.61
6	其他应收款	—
7	待摊费用	47,414.07

8	其他	—
9	合计	18,252,832.88

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

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	002340	格林美	96,542,248.00	1.23	转融通流通受限
2	002460	赣锋锂业	80,516,892.00	1.03	转融通流通受限
3	002812	恩捷股份	57,750,720.00	0.74	转融通流通受限
4	002594	比亚迪	29,118,270.00	0.37	转融通流通受限
5	002074	国轩高科	13,824,711.00	0.18	转融通流通受限
6	002709	天赐材料	8,030,424.00	0.10	转融通流通受限
7	300014	亿纬锂能	7,499,970.00	0.10	转融通流通受限
8	300750	宁德时代	3,543,870.00	0.05	转融通流通受限
9	300450	先导智能	908,385.00	0.01	转融通流通受限

注：本基金本报告期末持有格林美（股票代码 002340）公允价值为 385,376,575.68 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 96,542,248.00 元，剩余部分为正常流通股票；赣锋锂业（股票代码 002460）公允价值为 413,107,363.62 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 80,516,892.00 元，剩余部分为正常流通股票；恩捷股份（股票代码 002812）公允价值为 365,607,944.80 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 57,750,720.00

元，剩余部分为正常流通股票；比亚迪（股票代码 002594）公允价值为 328,226,074.74 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 29,118,270.00 元，剩余部分为正常流通股票；国轩高科（股票代码 002074）公允价值为 433,167,072.00 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 13,824,711.00 元，剩余部分为正常流通股票；天赐材料（股票代码 002709）公允价值为 314,608,590.25 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 8,030,424.00 元，剩余部分为正常流通股票；亿纬锂能（股票代码 300014）公允价值为 429,736,632.75 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 7,499,970.00 元，剩余部分为正常流通股票；宁德时代（股票代码 300750）公允价值为 430,943,934.93 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 3,543,870.00 元，剩余部分为正常流通股票；先导智能（股票代码 300450）公允价值为 411,089,868.72 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 908,385.00 元，剩余部分为正常流通股票。

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	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601995	中金公司	1,183,425.93	0.02	新股限售
2	688183	生益电子	245,559.90	0.00	新股限售
3	688617	惠泰医疗	235,759.16	0.00	新股限售
4	688079	美迪凯	129,800.84	0.00	新股限售
5	300957	贝泰妮	107,827.73	0.00	新股限售

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	7,766,622,026.92
报告期期间基金总申购份额	6,696,963,995.66
减：报告期期间基金总赎回份额	6,096,668,680.87
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	8,366,917,341.71

§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。

8.2　影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自

2021 年 3 月 31 日起，对本基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订，增加《指数基金指引》规定的相关内容并在本基金投资范围中增加存托凭证。具体可参见基金管理人于 2021 年 3 月 30 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

§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新能源汽车指数分级证券投资基金的文件

2、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同

3、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金托管协议

4、富国中证新能源汽车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、富国中证新能源汽车指数型证券投资基金基金合同

7、富国中证新能源汽车指数型证券投资基金托管协议

8、富国中证新能源汽车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

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
2021 年 04 月 22 日