

富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金

二〇一九年第 2 季度报告

2019 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

报告送出日期： 2019 年 07 月 18 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 7 月 16 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 4 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|                  |                                                                                                                                  |
|------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称             | 富国恒生中国企业 ETF                                                                                                                     |
| 场内简称             | 恒生中国                                                                                                                             |
| 基金主代码            | 159963                                                                                                                           |
| 交易代码             | 159963                                                                                                                           |
| 基金运作方式           | 契约型，交易型开放式                                                                                                                       |
| 基金合同生效日          | 2019年03月07日                                                                                                                      |
| 报告期末基金份额总额（单位：份） | 92,947,772.00                                                                                                                    |
| 投资目标             | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                                                                        |
| 投资策略             | 本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。                                                                                       |
| 业绩比较基准           | 经估值汇率调整的恒生中国企业指数收益率                                                                                                              |
| 风险收益特征           | 本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
| 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                                                                                                                     |

## § 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04月01日-2019年06月30日） |
|-----------------|------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 3,155,283.26                 |
| 2. 本期利润         | 3,879,777.04                 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0264                       |
| 4. 期末基金资产净值     | 91,859,724.76                |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9883                       |

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。

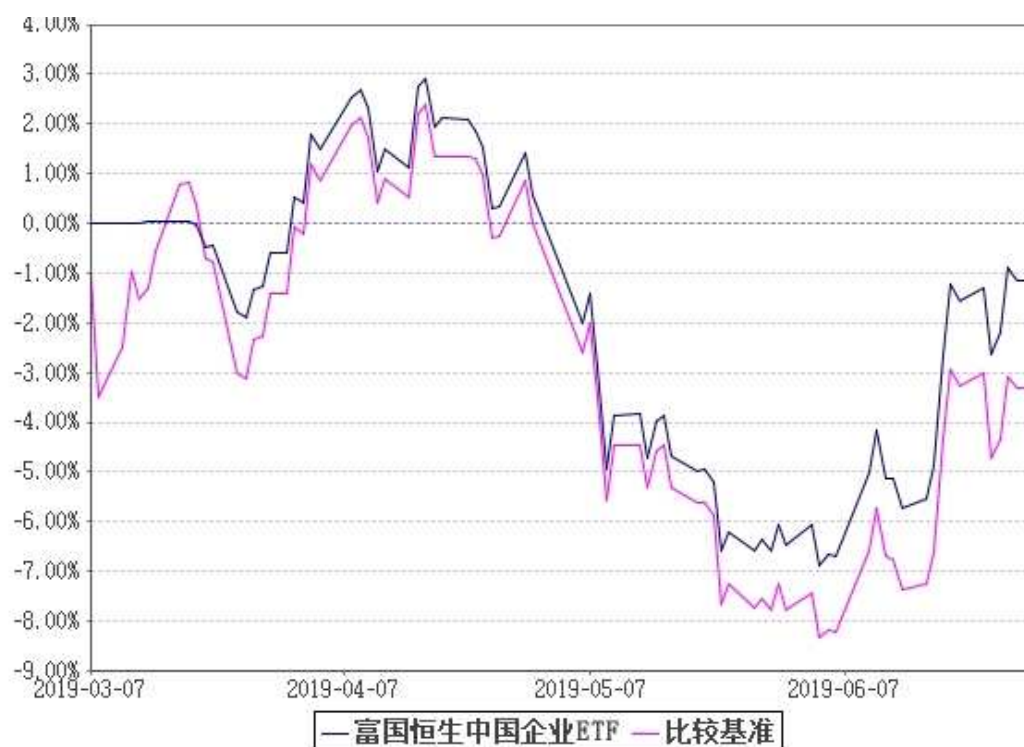
## 3.2 基金净值表现

### 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 | -0.57% | 0.93%     | -1.94%     | 0.98%         | 1.37% | -0.05% |

注：过去三个月指 2019 年 4 月 1 日—2019 年 6 月 30 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 6 月 30 日。

2、本基金于 2019 年 3 月 7 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 2019 年 3 月 7 日起至 2019 年 9 月 6 日，本期末建仓期还未结束。

## § 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 王保合 | 本基金基金经理 | 2019-03-07  | —    | 13     | 博士，曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理助理；2011 年 3 月起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，2013 年 9 月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理，2014 年 4 月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 4 月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 5 月起任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（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）基金经理，2017 年 9 月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 3 月起任富国中证 10 年期国债交易 |

|     |         |            |   |   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----|---------|------------|---|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |         |            |   |   | 型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任量化投资部总经理。具有基金从业资格。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 王乐乐 | 本基金基金经理 | 2019-03-07 | — | 9 | 博士，自2010年6月至2011年11月在上海证券有限责任公司任研究员；自2011年11月至2012年6月在华泰联合证券有限责任公司任研究员；自2012年7月至2015年5月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划团队负责人；自2015年5月加入富国基金管理有限公司，2015年8月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016年10月至2018年7月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017年10月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年11月起任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2018年11月起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月起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经理，2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年6月起任富国创业板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。 |

|    |         |            |   |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|----|---------|------------|---|----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 张峰 | 本基金基金经理 | 2019-03-07 | — | 18 | <p>硕士，曾任摩根史丹利研究部助理，里昂证券股票分析员，摩根大通执行董事，美林证券高级董事；自2009年7月至2011年4月任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人，2011年4月至2012年12月任富国全球债券证券投资基金基金经理，自2011年7月至2018年12月任富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）（原富国全球顶级消费品混合型证券投资基金）基金经理，自2012年9月起任富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金基金经理，自2015年6月至2018年7月任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年5月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理，自2018年7月起任富国沪港深业绩驱动混合型证券投资基金基金经理，2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任海外权益投资部总经理，2019年5月起任富国民裕进取沪港深成长精选混合型证券投资基金基金经理，2019年6月起任富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）基金经理。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，富国基金管理有限公司作为富国恒生中国企业交易型开放式指数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》、《富国恒生中国企业交易型开放式指数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**

由于 3 月末发布的 PMI 数据重新回到荣枯线上方，并创过去 5 个月新高，显著超预期。4 月上旬，投资者继续强化宽货币——宽信用——经济企稳的逻辑，对盈利触底企稳的乐观预期在市场持续演绎。进入 4 月中旬，尽管公布的 3 月经济数据明显超出市场预期，但随着央行推迟降准，同时政治局会议也强调货币政策以托底经济为主，不做大水漫灌，市场对货币进一步宽松的预期下降，市场开始迎来调整。5 月 6 日，由于美国表示从中国进口的 2000 亿美元商品仍可能将加征关税税率从 10%提升至 25%，全球资本市场迎来大幅调整。5 月中旬，美国将华为列入实体清单，进一步加大对中国的施压，市场持续走弱。6 月中下旬，随着中美两国领导人通电话决定双方再次展开接触，为 G20 见面做准备。同时美联储及欧央行也表态可能进一步宽松货币政策，以应对潜在的经济衰退风险，全球风险偏好进一步提升。另外，证监会公开征求上市公司重大资产重组管理办法修改意见，对资产重组管理进一步放松，未来有助于提升上市公司资产质量，市场大幅反弹。总体来看，2019 年 2 季度恒生指数下跌 1.75%，恒生国企指数下跌 4.37%。

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-0.57%，同期业绩比较基准收益率为-1.94%

#### 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              | 88,260,287.58 | 91.87        |
|    | 其中：股票             | 88,260,287.58 | 91.87        |
| 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      | 5,200,186.95  | 5.41         |
| 7  | 其他资产              | 2,611,135.44  | 2.72         |
| 8  | 合计                | 96,071,609.97 | 100.00       |

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 88,260,287.58 元，占资产净值比例为 96.08%。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

##### 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

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

##### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|-----------|--------------|
|------|-----------|--------------|

|          |               |       |
|----------|---------------|-------|
| 医疗保健     | 1,472,902.70  | 1.60  |
| 房地产      | 3,910,524.13  | 4.26  |
| 金融       | 44,627,840.90 | 48.58 |
| 能源       | 8,891,638.47  | 9.68  |
| 原材料      | 1,357,051.48  | 1.48  |
| 非日常生活消费品 | 3,001,716.60  | 3.27  |
| 日常消费品    | 1,349,684.33  | 1.47  |
| 通信服务     | 18,749,829.74 | 20.41 |
| 公用事业     | 2,331,055.02  | 2.54  |
| 工业       | 2,568,044.21  | 2.80  |
| 合计       | 88,260,287.58 | 96.08 |

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。2、以上行业分类的统计中已包含深港通投资的股票。

### 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  | 00939 | 建设银行     | 1,541,000 | 9,122,892.28 | 9.93         |
| 2  | 00700 | 腾讯控股     | 29,000    | 8,994,875.36 | 9.79         |
| 3  | 02318 | 中国平安     | 105,500   | 8,705,027.39 | 9.48         |
| 4  | 01398 | 工商银行     | 1,477,000 | 7,405,769.57 | 8.06         |
| 5  | 00941 | 中国移动     | 116,000   | 7,260,185.84 | 7.90         |
| 6  | 03988 | 中国银行     | 1,585,000 | 4,601,061.63 | 5.01         |
| 7  | 00883 | 中国海洋石油   | 346,000   | 4,066,281.13 | 4.43         |
| 8  | 03968 | 招商银行     | 74,000    | 2,535,444.02 | 2.76         |
| 9  | 02628 | 中国人寿     | 140,000   | 2,369,452.18 | 2.58         |
| 10 | 00386 | 中国石油化工股份 | 494,000   | 2,307,471.33 | 2.51         |

#### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 5.4 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。

#### 5.5 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

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

本基金股指期货投资主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，谨慎参与股指期货投资。

#### 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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“工商银行”的发行主体中国工商银行银行股份有限公司（以下简称“公司”）由于存在电话销售保险过程中欺骗投保人的行为，中国保险监督管理委员会北京监管局于 2018 年 11 月 19 日对公司处以罚款 30 万元的行政处罚，并责令改正违法行为（京保监罚〔2018〕28 号）。

工商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“中国人寿”的发行主体中国人寿保险股份有限公司（以下简称“公司”）由于存在未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告等违法违规事实，中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日作出对公司合计处以 70 万元罚款、对相关责任人共处以 6 万元罚款的行政处罚（银反洗罚决字〔2018〕5 号）。

中国人寿为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”）由于存在电话销售欺骗投保人等违法违规事实，深圳保监局于 2018 年 7 月 5 日作出对公司罚款 30 万元的行政处罚（深保监罚〔2018〕23 号）。

招商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

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 7 名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。

#### 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   | —            |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,274,099.38 |
| 3  | 应收股利    | 1,286,237.07 |
| 4  | 应收利息    | 1,069.23     |
| 5  | 应收申购款   | —            |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | 49,729.76    |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 2,611,135.44 |

#### 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

注：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

#### 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               | 433,947,772.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | —              |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 341,000,000.00 |
| 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               | 92,947,772.00  |

## § 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恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的文件
- 2、富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金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

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

### 9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本资产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  
2019年07月18日