

建信富时 100 指数型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 23 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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|--------------|---|---------------------|
| 基金简称 | 建信富时 100 指数(QDII) | |
| 基金主代码 | 539003 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 1 月 10 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 113,858,865.31 份 | |
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。 | |
| 投资策略 | 本基金以实现对标的指数的有效跟踪为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。 本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.45%，基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 5%。 | |
| 业绩比较基准 | 人民币计价的富时 100 指数收益率*95% (Financial Times Stock Exchange 100 Index) +活期存款利率(税后)*5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 建信富时 100 指数(QDII) A | 建信富时 100 指数(QDII) C |
| 下属分级基金的交易代码 | 539003 | 008706 |
| 报告期末下属分级基金的份 | 73,426,023.07 份 | 40,432,842.24 份 |

| | | |
|---------|--|--|
| 额总额 | | |
| 境外投资顾问 | 英文名称: Principal Global Investors, LLC. | |
| | 中文名称: 信安环球投资有限公司 | |
| 境外资产托管人 | 英文名称: Brown Brothers Harriman & Co. | |
| | 中文名称: 布朗兄弟哈里曼银行 | |

§ 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 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日) | |
|-----------------|--------------------------------------|----------------------|
| | 建信富时 100 指数 (QDII) A | 建信富时 100 指数 (QDII) C |
| 1. 本期已实现收益 | 204,556.64 | 71,772.45 |
| 2. 本期利润 | -3,399,890.19 | -1,854,839.80 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0506 | -0.0531 |
| 4. 期末基金资产净值 | 50,755,302.42 | 27,986,333.87 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.6912 | 0.6922 |

注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入 (不含公允价值变动损益) 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损益。

2、所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, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

建信富时 100 指数 (QDII) A

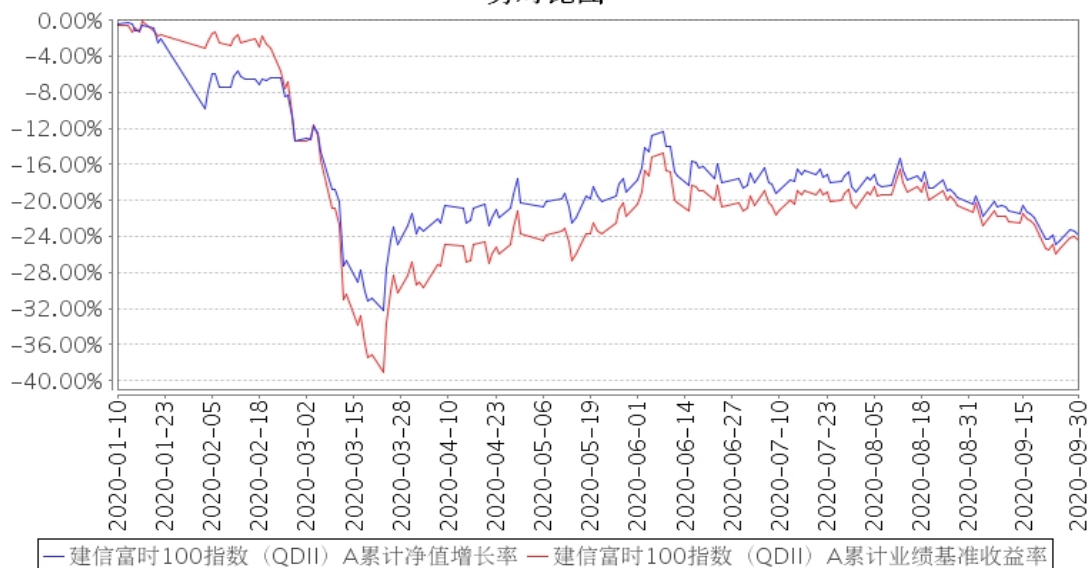
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -6.48% | 1.16% | -4.20% | 1.20% | -2.28% | -0.04% |
| 过去六个月 | -2.99% | 1.42% | 3.31% | 1.54% | -6.30% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -23.88% | 1.81% | -24.47% | 2.04% | 0.59% | -0.23% |

建信富时 100 指数 (QDII) C

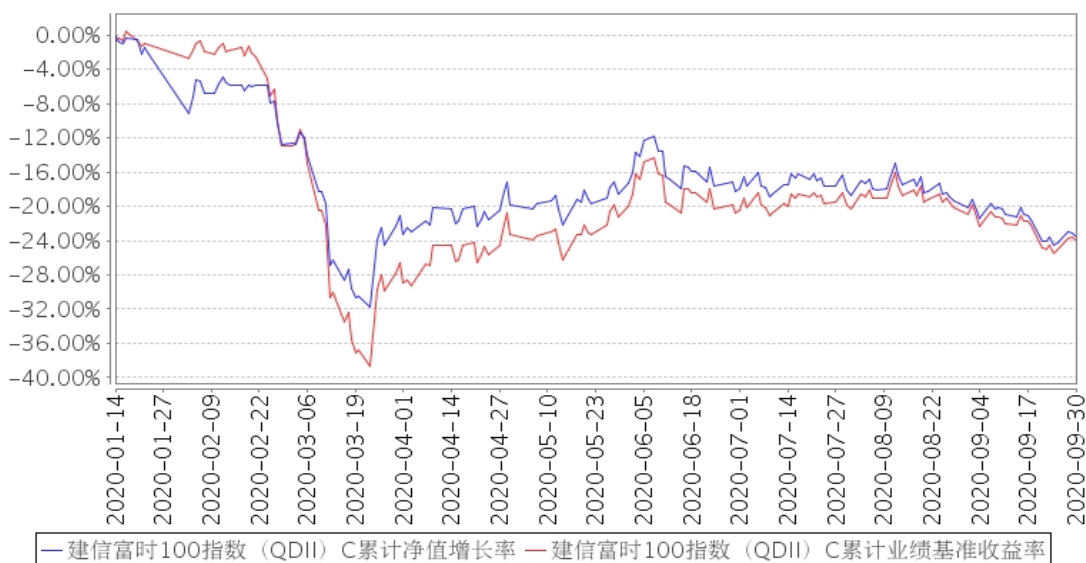
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -6.56% | 1.16% | -4.20% | 1.20% | -2.36% | -0.04% |
| 过去六个月 | -3.19% | 1.42% | 3.31% | 1.54% | -6.50% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -23.60% | 1.82% | -24.08% | 2.05% | 0.48% | -0.23% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

建信富时100指数 (QDII) A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信富时100指数 (QDII) C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§ 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 | | |
| 李博涵 | 海外投资部总经理，本基金的基金经理 | 2020年1月10日 | - | 15年 | 李博涵先生，海外投资部总经理，硕士，加拿大籍华人。曾就职于美国联邦快递北京分公司、美国联合航空公司北京分公司和美国万事达卡国际组织北京分公司。2005年2月起加入加拿大蒙特利尔银行，任全球资本市场投资助理；2006年8月起加入加拿大帝国商业银行，任全球资本市场投资顾问；2008年8月加入我公司海外投资部，历任高级研究员兼基金经理助理、基金经理，2018年5月起兼任部门副总经理，2020年5月起兼任部门总经理。2013年8月5日起任建信全球资源混合型证券投资基金的基金经理，该基金自2020年1月10日起转型为建信富时100指数型证券投资基金（QDII），李博涵继续担任该基金的基金经理；2017年11月13日起任建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金的基金经理；2018年12月13日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信富时 100 指数型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价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的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内，根据基金合同规定，采取了对指数的被动复制策略，年化跟踪误差和日均跟踪偏离度都较为稳定。

报告期内，产品规模持续上升，基金的申赎金额也逐步增加。同时，英镑兑人民币汇率出现较大波动，本基金管理人根据市场情况，对策略方案进行优化和调整，以尽可能降低申赎行为和汇率波动对产品业绩和跟踪误差产生的负面影响。

本报告期本基金 A 净值增长率-6.48%，波动率 1.16%，本报告期本基金 C 净值增长率-6.56%，波动率 1.16%；业绩比较基准收益率-4.20%，波动率 1.20%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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（人民币元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 66,015,445.48 | 82.00 |
| | 其中：普通股 | 66,015,445.48 | 82.00 |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 7,313,161.17 | 9.08 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,424,600.09 | 7.98 |
| 8 | 其他资产 | 753,146.78 | 0.94 |
| 9 | 合计 | 80,506,353.52 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家（地区） | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 英国 | 66,015,445.48 | 83.84 |
| 合计 | 66,015,445.48 | 83.84 |

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|--------------|--------------|
| 材料 | 7,840,970.33 | 9.96 |

| | | |
|--------|---------------|-------|
| 必需消费品 | 16,813,199.81 | 21.35 |
| 非必需消费品 | 1,168,127.42 | 1.48 |
| 能源 | 7,699,468.58 | 9.78 |
| 金融 | 11,660,652.64 | 14.81 |
| 医疗保健 | 12,387,545.70 | 15.73 |
| 工业 | 4,763,684.89 | 6.05 |
| 房地产 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | 1,731,074.22 | 2.20 |
| 公用事业 | 1,950,721.89 | 2.48 |
| 合计 | 66,015,445.48 | 83.84 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

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前十名股票及存托凭证投资明细

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及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------------------|------------|--------------|-----------|----------|---------|--------------|--------------|
| 1 | ASTRAZENECA PLC | 阿斯利康公共有限公司 | GB0009895292 | 英国伦敦证券交易所 | 英国 | 9,436 | 6,988,666.67 | 8.88 |
| 2 | GLAXOSMITHKLINE PLC | 葛兰素史克公司 | GB0009252882 | 英国伦敦证券交易所 | 英国 | 35,879 | 4,562,438.37 | 5.79 |
| 3 | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 英美烟草 | GB0002875804 | 英国伦敦证券交易所 | 英国 | 16,500 | 4,013,544.44 | 5.10 |
| 4 | DIAGEO PLC | 帝亚吉欧 | GB0002374006 | 英国伦敦证券交易所 | 英国 | 17,017 | 3,949,289.19 | 5.02 |
| 5 | HSBC HOLDINGS PLC | 汇丰控股 | GB0005405286 | 英国伦敦证券交易所 | 英国 | 145,211 | 3,834,218.88 | 4.87 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------------------|------------|------------------|-----------------------|----|-------------|--------------|------|
| 6 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 利洁时 | GB00B2 4CGK77 | 英国伦 敦证 券交 易所 | 英国 | 5,101 | 3,377,280.89 | 4.29 |
| 7 | UNILEVER PLC | 联合利华 | GB00B1 0RZP78 | 英国伦 敦证 券交 易所 | 英国 | 7,983 | 3,339,031.46 | 4.24 |
| 8 | RIO TINTO PLC | 力拓公司 | GB0007 188757 | 英国伦 敦证 券交 易所 | 英国 | 8,127 | 3,313,497.60 | 4.21 |
| 9 | BP PLC | BP 公司 | GB0007 980591 | 英国伦 敦证 券交 易所 | 英国 | 146,5 23 | 2,889,776.52 | 3.67 |
| 10 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 荷兰皇家 壳牌 | GB00B0 3MLX29 | 英国伦 敦证 券交 易所 | 英国 | 30,77 1 | 2,597,548.45 | 3.30 |

注：所有证券代码采用 ISIN 码。

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及存托凭证投资明细

无。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资 明细

无。

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十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------------------------|--------|----------|------------------|--------------|--------------|
| 1 | ISHARES CORE FTSE 100 | ETF 基金 | 交易型开放式指数 | BlackRock Inc | 7,313,161.17 | 9.29 |

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（人民币元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 178,498.77 |
| 4 | 应收利息 | 427.46 |
| 5 | 应收申购款 | 574,220.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 753,146.78 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 建信富时 100 指数 (QDII) A | 建信富时 100 指数 (QDII) C |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 62,803,306.80 | 35,117,083.02 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 29,015,847.91 | 26,043,125.66 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 18,393,131.64 | 20,727,366.44 |
| 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 | 73,426,023.07 | 40,432,842.24 |

注：上述总申购份额含转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 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**

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录**9.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准建信富时 100 指数型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信富时 100 指数型证券投资基金基金合同》；

- 3、《建信富时 100 指数型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信富时 100 指数型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2020 年 10 月 27 日