

# 建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式 指数证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 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：中国国际金融股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本半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。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 4 月 19 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
7.6 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.....	54
7.7 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.....	54
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.9 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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	58
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>

11.1 备查文件目录.....	61
11.2 存放地点.....	61
11.3 查阅方式.....	61

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	建信 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	建信 MSCI
基金主代码	512180
基金运作方式	契约型开放式(ETF)
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,412,048,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 21 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，本基金的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数(英文：MSCI China A Inclusion RMB Index)。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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，属于高风险/高收益的开放式基金。

## 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		建信基金管理有限责任公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	张萱
	联系电话	010-66228888	010-65051166-1553
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	CICC_AC@cicc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	010-65051166-1553
传真		010-66228001	010-65059873
注册地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
邮政编码		100033	100004
法定代表人		孙志晨	毕明建（代）

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京西城区金融大街27号投资广场22-23层

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2018年4月19日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	1,089,931.78
本期利润	-118,956,548.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0686
本期加权平均净值利润率	-6.97%
本期基金份额净值增长率	-8.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-115,019,400.44
期末可供分配基金份额利润	-0.0815
期末基金资产净值	1,297,028,599.56
期末基金份额净值	0.9185
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-8.15%

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

4、本基金基金合同于2018年4月19日生效。

#### 3.2 基金净值表现

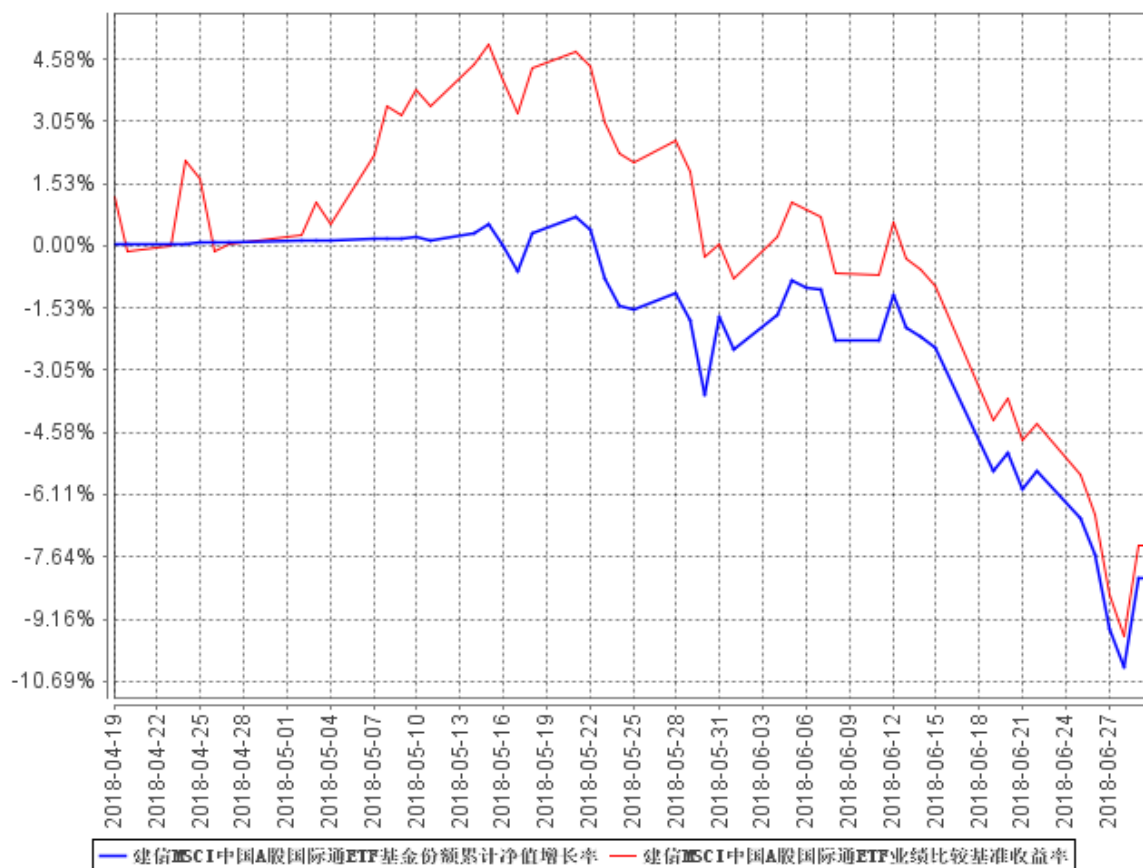
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-6.50%	1.19%	-7.38%	1.26%	0.88%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-8.15%	0.91%	-7.35%	1.12%	-0.80%	-0.21%



### 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

建信MSCI中国A股国际通ETF基金份额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



本基金基金合同于 2018 年 4 月 19 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2018 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、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、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基

金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF)、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金 (LOF)、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金 (FOF)、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信睿丰纯债定期开放债券

型发起式证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金，共计 101 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 6,342.88 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2018年5月16日	-	15	梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师（CFA），博士。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金的基金经理；2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理；2015年7月31日起任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2015年

				8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2018年2月6日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018年2月7日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年4月19日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018年5月16日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018年6月13日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	---

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人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% 的情况有 1 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金成立于 2 季度初期，并在 2 季度中期上市运作。在上市之前，管理人根据标的指数权重，逐渐建立起了股票仓位，以满足上市运作要求，同时，利用货币市场工具对暂时未投资于股票的资金进行了现金管理。上市后，基金保持较高仓位，以满足运作要求和跟踪误差控制要求。

在报告期内，基金仍处于建仓期，由于交易所冻结了较多的结算备付金等款项，基金距最终目标仓位仍小有差距。预计在三季度，随着被冻结资金数额的下降，基金将逐渐接近满仓运作。

在报告期内，基金标的指数的成分股进行了调整，管理人据此进行了组合调整。标的指数在编制时，某些技术环节与境内其他常见指数有明显区别，例如在调出部分成分股时，会采取先大幅调低其权重再作剔除的处理方式，这是导致本基金在上市之后，个别交易日出现较大偏离度的原因。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-8.15%，波动率 0.91%，业绩比较基准收益率-7.35%，波动率 1.12%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年下半年，国际贸易摩擦、化解债务压力与保持宏观经济稳健增长之间的平衡、资管新规细化与落实节奏等因素都将对资本市场的运行造成深刻影响。在经历了上半年的调整后，预计股票市场总体波动性趋于缓和，但需要关注可能存在的事件冲击对于市场造成的影响。

本管理人将根据基金合同，继续秉承被动复制策略，力争将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2017]13号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、风险管理部和资产核算部门负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）；对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

## §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

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行收益分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。



## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	45,956,901.75
结算备付金		26,625,762.27
存出保证金		2,090,530.35
交易性金融资产	6.4.7.2	1,228,747,981.14
其中：股票投资		1,228,747,981.14
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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		9,193.41
应收利息	6.4.7.5	32,938.02
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,303,463,306.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		3,367,889.15
应付赎回款		-
应付管理人报酬		579,988.50
应付托管费		115,997.69
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	2,100,313.64

应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	270,518.40
负债合计		6,434,707.38
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	1,412,048,000.00
未分配利润	6.4.7.10	-115,019,400.44
所有者权益合计		1,297,028,599.56
负债和所有者权益总计		1,303,463,306.94

1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9185 元，基金份额总额

1,412,048,000.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-114,100,879.20
1.利息收入		5,909,629.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,833,329.46
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		2,076,299.76
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		252,256.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-11,913,835.74
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	12,166,091.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-120,046,480.14

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-216,284.30
<b>减：二、费用</b>		4,855,669.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,698,029.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	339,605.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,546,200.29
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	6.4.7.20	271,833.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-118,956,548.36
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-118,956,548.36

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 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）	2,046,048,000.00	0.00	2,046,048,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-118,956,548.36	-118,956,548.36
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）	-634,000,000.00	3,937,147.92	-630,062,852.08
其中：1. 基金申购款	134,000,000.00	-5,601,779.79	128,398,220.21
2. 基金赎回款	-768,000,000.00	9,538,927.71	-758,461,072.29
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）	1,412,048,000.00	-115,019,400.44	1,297,028,599.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
张军红	吴曙明	丁颖
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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]503号《关于准予建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,046,048,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,046,048,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、权证、股指期货以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)。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;权证、股

指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 2 月 7 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下

由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **6.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。



#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所

得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	45,956,901.75
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	45,956,901.75

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,348,798,869.66	1,228,747,981.14	-120,050,888.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,348,798,869.66	1,228,747,981.14	-120,050,888.52

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

无。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	20,015.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	11,981.60
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	940.70
合计	32,938.02

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,100,313.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,100,313.64

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	100,248.95
应付指数使用费	170,269.45
合计	270,518.40

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,046,048,000.00	2,046,048,000.00
本期申购	134,000,000.00	134,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-768,000,000.00	-768,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,412,048,000.00	1,412,048,000.00

1、本基金自 2018 年 3 月 30 日至 2018 年 4 月 13 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,046,048,000.00 元。

2、根据《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 5 月 20 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务自 2018 年 5 月 21 日起开始办理。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,089,931.78	-120,046,480.14	-118,956,548.36
本期基金份额交易产生的变动数	-1,173,374.08	5,110,522.00	3,937,147.92
其中：基金申购款	183,683.38	-5,785,463.17	-5,601,779.79
基金赎回款	-1,357,057.46	10,895,985.17	9,538,927.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-83,442.30	-114,935,958.14	-115,019,400.44

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,387,115.97
定期存款利息收入	2,400,000.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	43,673.52
其他	2,539.97
合计	3,833,329.46

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年
----	--

	6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,057,809.80
股票投资收益——赎回差价收入	-7,856,025.94
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-11,913,835.74

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	242,841,769.08
减：卖出股票成本总额	246,899,578.88
买卖股票差价收入	-4,057,809.80

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	758,461,072.29
减：现金支付赎回款总额	232,667,617.29
减：赎回股票成本总额	533,649,480.94
赎回差价收入	-7,856,025.94

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,166,091.76



基金投资产生的股利收益	-
合计	12,166,091.76

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至 2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-120,046,480.14
——股票投资	-120,046,480.14
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-120,046,480.14

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至 2018年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	-216,284.30
合计	-216,284.30

替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至 2018年6月30日
交易所市场交易费用	2,546,200.29

银行间市场交易费用	-
合计	2,546,200.29

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	28,405.03
信息披露费	59,999.43
上市费	11,844.49
指数使用费	170,269.45
银行费用	1,314.95
合计	271,833.35

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司(“建信基金”)	基金管理人
中国国际金融股份有限公司(“中金公司”)	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东

建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司
--------------	-----------

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

关联方名称	本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月 30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中金公司	1,583,063,038.55	69.24%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

关联方名称	本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月 30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中金公司	926,500,000.00	26.61%

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
中金公司	1,459,560.97	69.49%	1,459,560.97	69.49%

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,698,029.60
其中：支付销售机构的客户维护费	184,679.20

支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	339,605.92	-

支付基金托管人中金公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

本基金本报告期在基金托管人中金公司无存款余额，同时也无相应存款利息收入。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

本期 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股)	总金额
中金公司	603587	地素时尚	网下新股 申购	2,442	67,203.84

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1**

无。

**6.4.12 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新发未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月	新发未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

			9 日							
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新发未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
002310	东方园林	2018 年 5 月 25 日	重大资产重组	15.03	-	-	229,200	4,401,812.16	3,444,876.00	-
601727	上海电气	2018 年 6 月 6 日	重大资产重组	6.34	2018 年 8 月 7 日	5.71	537,600	3,378,680.64	3,408,384.00	-
601118	海南橡胶	2018 年 5 月 24 日	重大资产重组	6.62	-	-	378,600	2,130,094.16	2,506,332.00	-
002602	世纪华通	2018 年 6 月 12 日	重大资产重组	32.50	-	-	69,000	2,406,168.88	2,242,500.00	-

本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程  
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督  
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和  
控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、  
内控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的  
督察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人  
出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基  
金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，  
违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券  
交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发  
行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计  
及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，  
则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。



本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动现金流量在很大程度上独立于市场利率变化，本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	45,956,901.75	0.00	-	-	45,956,901.75
结算备付金	26,625,762.27	-	-	-	26,625,762.27
存出保证金	2,090,530.35	-	-	-	2,090,530.35
交易性金融资产	-	-	-	1,228,747,981.14	1,228,747,981.14
衍生金融资产	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	9,193.41	9,193.41
应收利息	-	-	-	32,938.02	32,938.02
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	74,673,194.37	0.00	0.00	1,228,790,112.57	1,303,463,306.94
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	-	-	0.00
短期借款	-	-	-	-	0.00
交易性金融负债	-	-	-	-	0.00

衍生金融负债	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	3,367,889.15	3,367,889.15
应付赎回款	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	579,988.50	579,988.50
应付托管费	-	-	-	115,997.69	115,997.69
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	2,100,313.64	2,100,313.64
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	270,518.40	270,518.40
负债总计	0.00	0.00	0.00	6,434,707.38	6,434,707.38
利率敏感度缺口	74,673,194.37	0.00	0.00	1,222,355,405.19	1,297,028,599.56

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及

其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	1,228,752,389.52	94.74
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,228,752,389.52	94.74

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金成立不满一年，尚无足够经验数据。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (2) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (a) 各层次金融工具公允价值

于2018年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,217,057,858.99元，属于第二层次的余额为11,690,122.15元，无属于第三层次的余额。

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(4) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,228,747,981.14	94.27
	其中：股票	1,228,747,981.14	94.27
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	72,582,664.02	5.57
7	其他各项资产	2,132,661.78	0.16
8	合计	1,303,463,306.94	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	3,009,942.00	0.23
B	采矿业	43,970,938.00	3.39
C	制造业	497,763,584.24	38.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,768,167.68	3.30
E	建筑业	43,166,278.52	3.33
F	批发和零售业	33,027,531.38	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	36,532,235.21	2.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,490,149.05	1.89
J	金融业	396,888,686.48	30.60
K	房地产业	68,633,621.05	5.29

L	租赁和商务服务业	19,019,079.30	1.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,365,743.20	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,591,800.20	0.35
R	文化、体育和娱乐业	4,748,902.24	0.37
S	综合	1,557,100.00	0.12
	合计	1,222,533,758.55	94.26

1、合计项不含可退替代款的估值增值。

2、以上行业分类以 2018 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,506,332.00	0.19
B	采掘业	-	-
C	制造业	191,454.74	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	3,444,876.00	0.27
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	6,214,222.59	0.48

以上行业分类以 2018 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	67,602	49,448,158.92	3.81
2	601318	中国平安	811,790	47,554,658.20	3.67
3	600036	招商银行	1,489,383	39,379,286.52	3.04
4	002415	海康威视	676,960	25,135,524.80	1.94
5	000333	美的集团	473,801	24,741,888.22	1.91
6	601166	兴业银行	1,489,400	21,447,360.00	1.65
7	601398	工商银行	3,926,598	20,889,501.36	1.61
8	000858	五粮液	270,800	20,580,800.00	1.59
9	600276	恒瑞医药	270,779	20,514,217.04	1.58
10	600000	浦发银行	2,097,700	20,054,012.00	1.55
11	600104	上汽集团	541,530	18,948,134.70	1.46
12	002304	洋河股份	135,400	17,818,640.00	1.37
13	600900	长江电力	1,083,162	17,482,234.68	1.35
14	000002	万科A	677,106	16,656,807.60	1.28
15	601668	中国建筑	3,028,412	16,535,129.52	1.27
16	601328	交通银行	2,843,375	16,320,972.50	1.26
17	600016	民生银行	2,163,187	15,142,309.00	1.17
18	601601	中国太保	473,164	15,070,273.40	1.16
19	601288	农业银行	4,233,800	14,564,272.00	1.12
20	600887	伊利股份	473,888	13,221,475.20	1.02
21	601988	中国银行	3,582,000	12,931,020.00	1.00
22	600030	中信证券	737,000	12,212,090.00	0.94
23	600028	中国石化	1,828,100	11,864,369.00	0.91
24	601766	中国中车	1,489,400	11,468,380.00	0.88
25	000001	平安银行	1,218,500	11,076,165.00	0.85
26	600048	保利地产	880,100	10,737,220.00	0.83

27	601818	光大银行	2,889,600	10,575,936.00	0.82
28	600019	宝钢股份	1,354,000	10,547,660.00	0.81
29	603288	海天味业	135,400	9,970,856.00	0.77
30	000651	格力电器	203,100	9,576,165.00	0.74
31	002024	苏宁易购	677,000	9,532,160.00	0.73
32	601169	北京银行	1,557,092	9,389,264.76	0.72
33	600690	青岛海尔	473,200	9,113,832.00	0.70
34	600585	海螺水泥	270,800	9,066,384.00	0.70
35	001979	招商蛇口	473,897	9,027,737.85	0.70
36	601006	大秦铁路	1,081,600	8,879,936.00	0.68
37	601857	中国石油	1,150,900	8,873,439.00	0.68
38	601888	中国国旅	135,330	8,716,605.30	0.67
39	000725	京东方 A	2,437,100	8,627,334.00	0.67
40	002027	分众传媒	893,600	8,551,752.00	0.66
41	601229	上海银行	541,580	8,535,300.80	0.66
42	000568	泸州老窖	135,400	8,240,444.00	0.64
43	601211	国泰君安	541,600	7,983,184.00	0.62
44	600518	康美药业	338,000	7,733,440.00	0.60
45	600436	片仔癀	67,600	7,566,468.00	0.58
46	000538	云南白药	67,690	7,240,122.40	0.56
47	600015	华夏银行	947,800	7,061,110.00	0.54
48	601186	中国铁建	812,400	7,002,888.00	0.54
49	603799	华友钴业	67,510	6,580,199.70	0.51
50	000963	华东医药	135,334	6,529,865.50	0.50
51	002594	比亚迪	135,400	6,455,872.00	0.50
52	601688	华泰证券	406,200	6,080,814.00	0.47
53	000166	申万宏源	1,354,000	5,916,980.00	0.46
54	601336	新华保险	135,308	5,802,007.04	0.45
55	600837	海通证券	608,400	5,761,548.00	0.44
56	600196	复星医药	135,400	5,604,206.00	0.43
57	600999	招商证券	406,200	5,556,816.00	0.43
58	002142	宁波银行	338,423	5,512,910.67	0.43
59	000776	广发证券	406,200	5,390,274.00	0.42
60	000895	双汇发展	203,006	5,361,388.46	0.41
61	601985	中国核电	947,800	5,355,070.00	0.41
62	600340	华夏幸福	203,100	5,229,825.00	0.40
63	600919	江苏银行	812,341	5,207,105.81	0.40
64	600703	三安光电	269,920	5,187,862.40	0.40
65	601933	永辉超市	677,000	5,172,280.00	0.40



66	600332	白云山	135,400	5,151,970.00	0.40
67	600031	三一重工	541,600	4,858,152.00	0.37
68	600741	华域汽车	203,100	4,817,532.00	0.37
69	601009	南京银行	609,300	4,709,889.00	0.36
70	002044	美年健康	203,177	4,591,800.20	0.35
71	002236	大华股份	203,100	4,579,905.00	0.35
72	002475	立讯精密	203,058	4,576,927.32	0.35
73	601628	中国人寿	203,044	4,572,550.88	0.35
74	600029	南方航空	539,965	4,562,704.25	0.35
75	601939	建设银行	676,923	4,433,845.65	0.34
76	000069	华侨城 A	609,300	4,405,239.00	0.34
77	601899	紫金矿业	1,216,400	4,391,204.00	0.34
78	002422	科伦药业	135,400	4,346,340.00	0.34
79	002230	科大讯飞	135,350	4,340,674.50	0.33
80	601618	中国中冶	1,286,300	4,283,379.00	0.33
81	600010	宝钢股份	2,748,200	4,259,710.00	0.33
82	600809	山西汾酒	67,700	4,257,653.00	0.33
83	000938	紫光股份	67,667	4,235,954.20	0.33
84	601155	新城控股	135,300	4,190,241.00	0.32
85	601901	方正证券	606,600	4,058,154.00	0.31
86	600115	东方航空	607,500	4,021,650.00	0.31
87	601669	中国电建	744,700	3,991,592.00	0.31
88	600606	绿地控股	609,300	3,984,822.00	0.31
89	601225	陕西煤业	473,200	3,889,704.00	0.30
90	600009	上海机场	67,402	3,739,462.96	0.29
91	600958	东方证券	406,190	3,708,514.70	0.29
92	000423	东阿阿胶	67,700	3,642,937.00	0.28
93	002008	大族激光	67,700	3,600,963.00	0.28
94	600570	恒生电子	67,595	3,579,155.25	0.28
95	000338	潍柴动力	405,200	3,545,500.00	0.27
96	002466	天齐锂业	70,900	3,515,931.00	0.27
97	600535	天士力	135,400	3,496,028.00	0.27
98	600660	福耀玻璃	135,400	3,481,134.00	0.27
99	600383	金地集团	338,500	3,449,315.00	0.27
100	600886	国投电力	472,500	3,435,075.00	0.26
101	600271	航天信息	135,200	3,416,504.00	0.26
102	601727	上海电气	537,600	3,408,384.00	0.26
103	603993	洛阳钼业	541,600	3,406,664.00	0.26
104	601012	隆基股份	203,020	3,388,403.80	0.26

105	600516	方大炭素	135,325	3,299,223.50	0.25
106	002456	欧菲科技	203,096	3,275,938.48	0.25
107	600867	通化东宝	135,320	3,243,620.40	0.25
108	600547	山东黄金	135,400	3,238,768.00	0.25
109	601607	上海医药	135,400	3,236,060.00	0.25
110	000768	中航飞机	203,100	3,176,484.00	0.24
111	600705	中航资本	677,000	3,161,590.00	0.24
112	600023	浙能电力	677,000	3,154,820.00	0.24
113	600111	北方稀土	270,750	3,081,135.00	0.24
114	600637	东方明珠	202,785	3,053,942.10	0.24
115	601877	正泰电器	135,386	3,021,815.52	0.23
116	600893	航发动力	135,307	3,020,052.24	0.23
117	002714	牧原股份	67,700	3,009,942.00	0.23
118	600926	杭州银行	270,800	3,003,172.00	0.23
119	601788	光大证券	270,727	2,972,582.46	0.23
120	600600	青岛啤酒	67,700	2,967,291.00	0.23
121	002146	荣盛发展	338,500	2,955,105.00	0.23
122	600674	川投能源	338,500	2,951,720.00	0.23
123	600816	安信信托	406,200	2,940,888.00	0.23
124	603858	步长制药	67,600	2,892,604.00	0.22
125	600018	上港集团	473,800	2,823,848.00	0.22
126	601919	中远海控	541,600	2,664,672.00	0.21
127	002460	赣锋锂业	67,637	2,609,435.46	0.20
128	600066	宇通客车	135,400	2,598,326.00	0.20
129	002202	金风科技	203,071	2,566,817.44	0.20
130	601998	中信银行	405,583	2,518,670.43	0.19
131	002294	信立泰	67,675	2,515,479.75	0.19
132	601377	兴业证券	473,890	2,497,400.30	0.19
133	002736	国信证券	270,800	2,464,280.00	0.19
134	000413	东旭光电	406,200	2,461,572.00	0.19
135	600068	葛洲坝	338,500	2,440,585.00	0.19
136	000625	长安汽车	270,800	2,437,200.00	0.19
137	600352	浙江龙盛	202,500	2,419,875.00	0.19
138	601111	中国国航	270,400	2,403,856.00	0.19
139	600085	同仁堂	67,700	2,388,456.00	0.18
140	600027	华电国际	608,400	2,384,928.00	0.18
141	600297	广汇汽车	406,200	2,380,332.00	0.18
142	601021	春秋航空	67,700	2,371,531.00	0.18
143	000826	启迪桑德	135,340	2,365,743.20	0.18

144	600482	中国动力	135,400	2,362,730.00	0.18
145	600208	新湖中宝	609,300	2,327,526.00	0.18
146	601800	中国交建	203,100	2,313,309.00	0.18
147	600998	九州通	135,400	2,296,384.00	0.18
148	601117	中国化学	338,500	2,278,105.00	0.18
149	002602	世纪华通	69,000	2,242,500.00	0.17
150	000783	长江证券	406,200	2,205,666.00	0.17
151	000792	盐湖股份	203,100	2,197,542.00	0.17
152	000709	河钢股份	744,700	2,196,865.00	0.17
153	600977	中国电影	135,131	2,167,501.24	0.17
154	600011	华能国际	338,500	2,152,860.00	0.17
155	000876	新希望	338,500	2,146,090.00	0.17
156	600362	江西铜业	135,400	2,146,090.00	0.17
157	002624	完美世界	69,000	2,139,690.00	0.16
158	002493	荣盛石化	203,050	2,095,476.00	0.16
159	600487	亨通光电	94,900	2,092,545.00	0.16
160	600177	雅戈尔	270,788	2,085,067.60	0.16
161	002508	老板电器	67,698	2,072,912.76	0.16
162	002241	歌尔股份	203,000	2,068,570.00	0.16
163	600739	辽宁成大	135,400	2,055,372.00	0.16
164	002081	金螳螂	203,100	2,051,310.00	0.16
165	002673	西部证券	270,800	2,044,540.00	0.16
166	000728	国元证券	270,800	2,003,920.00	0.15
167	000425	徐工机械	471,700	2,000,008.00	0.15
168	601018	宁波港	473,900	1,995,119.00	0.15
169	601992	金隅集团	606,600	1,989,648.00	0.15
170	002153	石基信息	67,700	1,963,300.00	0.15
171	000656	金科股份	406,200	1,949,760.00	0.15
172	000157	中联重科	473,900	1,947,729.00	0.15
173	600688	上海石化	338,500	1,926,065.00	0.15
174	000050	深天马 A	135,400	1,925,388.00	0.15
175	000627	天茂集团	270,800	1,901,016.00	0.15
176	000999	华润三九	67,700	1,884,091.00	0.15
177	601699	潞安环能	203,100	1,880,706.00	0.15
178	600089	特变电工	270,775	1,876,470.75	0.14
179	600438	通威股份	270,800	1,868,520.00	0.14
180	002180	纳思达	67,658	1,857,888.68	0.14
181	600489	中金黄金	270,800	1,846,856.00	0.14
182	002797	第一创业	270,800	1,833,316.00	0.14

183	600153	建发股份	203,012	1,825,077.88	0.14
184	600583	海油工程	338,500	1,780,510.00	0.14
185	600372	中航电子	135,400	1,768,324.00	0.14
186	601198	东兴证券	135,400	1,765,616.00	0.14
187	600415	小商品城	406,200	1,750,722.00	0.13
188	002065	东华软件	203,100	1,746,660.00	0.13
189	601333	广深铁路	406,200	1,726,350.00	0.13
190	600398	海澜之家	135,400	1,724,996.00	0.13
191	601098	中南传媒	135,400	1,711,456.00	0.13
192	600642	申能股份	337,500	1,694,250.00	0.13
193	601997	贵阳银行	135,300	1,672,308.00	0.13
194	000630	铜陵有色	744,700	1,645,787.00	0.13
195	002555	三七互娱	135,400	1,645,110.00	0.13
196	000402	金融街	203,100	1,634,955.00	0.13
197	600804	鹏博士	135,400	1,624,800.00	0.13
198	002558	巨人网络	67,620	1,608,003.60	0.12
199	600895	张江高科	135,400	1,557,100.00	0.12
200	600909	华安证券	270,800	1,548,976.00	0.12
201	000983	西山煤电	203,100	1,525,281.00	0.12
202	601238	广汽集团	135,447	1,508,879.58	0.12
203	000898	鞍钢股份	270,800	1,508,356.00	0.12
204	002195	二三四五	352,320	1,507,929.60	0.12
205	000581	威孚高科	67,700	1,496,847.00	0.12
206	600808	马钢股份	405,000	1,453,950.00	0.11
207	600109	国金证券	203,100	1,444,041.00	0.11
208	600008	首创股份	338,500	1,428,470.00	0.11
209	002385	大北农	338,500	1,398,005.00	0.11
210	000883	湖北能源	338,500	1,391,235.00	0.11
211	601555	东吴证券	203,100	1,387,173.00	0.11
212	000559	万向钱潮	203,028	1,380,590.40	0.11
213	002500	山西证券	203,100	1,368,894.00	0.11
214	601866	中远海发	539,400	1,343,106.00	0.10
215	000027	深圳能源	270,750	1,337,505.00	0.10
216	000060	中金岭南	270,792	1,316,049.12	0.10
217	600118	中国卫星	67,700	1,293,070.00	0.10
218	000839	中信国安	270,800	1,280,884.00	0.10
219	601958	金钼股份	203,100	1,273,437.00	0.10
220	600061	国投资本	135,400	1,256,512.00	0.10
221	600820	隧道股份	203,100	1,200,321.00	0.09

222	002465	海格通信	135,400	1,087,262.00	0.08
223	601718	际华集团	268,800	1,080,576.00	0.08
224	601611	中国核建	135,400	1,069,660.00	0.08
225	000039	中集集团	67,700	899,056.00	0.07
226	600373	中文传媒	67,700	869,945.00	0.07

### 7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002310	东方园林	229,200	3,444,876.00	0.27
2	601118	海南橡胶	378,600	2,506,332.00	0.19
3	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
4	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
5	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
6	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
7	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	75,655,952.92	5.83
2	600519	贵州茅台	72,891,503.91	5.62
3	600036	招商银行	66,585,582.84	5.13
4	002415	海康威视	43,579,556.11	3.36
5	000333	美的集团	40,361,381.90	3.11
6	601166	兴业银行	35,640,940.60	2.75
7	601398	工商银行	34,602,682.88	2.67
8	600000	浦发银行	33,703,827.10	2.60
9	000858	五粮液	33,340,537.76	2.57

10	000002	万科 A	29,157,726.82	2.25
11	002304	洋河股份	28,065,306.00	2.16
12	600276	恒瑞医药	27,958,044.89	2.16
13	600104	上汽集团	27,715,851.06	2.14
14	601668	中国建筑	26,957,660.78	2.08
15	600900	长江电力	26,239,607.20	2.02
16	601328	交通银行	25,903,149.50	2.00
17	600016	民生银行	24,927,682.93	1.92
18	601766	中国中车	24,739,130.90	1.91
19	601601	中国太保	24,591,082.04	1.90
20	601288	农业银行	24,299,054.00	1.87

上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	15,492,094.25	1.19
2	000333	美的集团	14,434,582.00	1.11
3	000858	五粮液	12,129,125.00	0.94
4	002304	洋河股份	10,321,574.00	0.80
5	000002	万科 A	10,292,354.00	0.79
6	000001	平安银行	7,296,253.00	0.56
7	001979	招商蛇口	5,991,339.00	0.46
8	000725	京东方 A	5,768,064.00	0.44
9	002024	苏宁易购	5,550,742.36	0.43
10	000651	格力电器	5,496,937.00	0.42
11	000568	泸州老窖	5,135,085.00	0.40
12	002027	分众传媒	5,067,747.70	0.39
13	000538	云南白药	4,235,697.06	0.33
14	002044	美年健康	4,121,232.04	0.32
15	002594	比亚迪	4,033,396.00	0.31
16	002460	赣锋锂业	3,798,174.00	0.29
17	000166	申万宏源	3,640,820.00	0.28
18	000776	广发证券	3,438,628.00	0.27
19	002142	宁波银行	3,380,027.00	0.26

20	002411	必康股份	3,225,772.00	0.25
----	--------	------	--------------	------

上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,043,688,339.98
卖出股票收入（成交）总额	242,841,769.08

上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未披露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。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,090,530.35
2	应收证券清算款	9,193.41
3	应收股利	-
4	应收利息	32,938.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,132,661.78

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。



**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

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	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002310	东方园林	3,444,876.00	0.27	重大资产重组
2	601118	海南橡胶	2,506,332.00	0.19	重大资产重组
3	603693	江苏新能	48,456.00	0.00	新发未上市

**7.12.6 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
22,359	63,153.45	258,337,200.00	18.30%	1,153,710,800.00	81.70%

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
中国国际金融股份有限公司-建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	20,000,000.00	1.42%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国国际金融股份有限公司-建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	20,000,000.00	1.42%
2	国元证券（香港）有限公司-客户资金（交易所）	63,000,000.00	4.46%
3	中信证券股份有限公司	37,783,500.00	2.68%
4	永安国富资产管理有限公司-永安国富-永富 12 号私募基金	31,152,500.00	2.21%
5	中国东方国际资产管理有限公司-客户资产账户	29,986,000.00	2.12%
6	东北证券股份有限公司	20,000,000.00	1.42%
7	招商证券股份有限公司	14,490,500.00	1.03%
8	都邦财产保险股份有限公司-传统保险产品	12,040,000.00	0.85%
9	方正证券股份有限公司	11,316,800.00	0.80%
10	张波	10,201,800.00	0.72%

11	张德明	10,000,000.00	0.71%
----	-----	---------------	-------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月19日）基金份额总额	2,046,048,000.00
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	134,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	768,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,412,048,000.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经本基金管理人建信基金管理有限责任公司 2018 年第一次临时股东会和第五届董事会第一次会议审议通过，自 2018 年 4 月 18 日起，许会斌先生不再担任本公司董事长（法定代表人），由孙志晨先生担任本公司董事长（法定代表人）；孙志晨先生不再担任本公司总裁，由张军红先生担任本公司总裁。上述事项本公司已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案并于 2018 年 4 月 20 日公告。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	4	1,583,063,038.55	69.24%	1,459,560.97	69.49%	-
长江证券	1	703,122,460.67	30.76%	640,752.67	30.51%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

(3) 具备较强的研究能力, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究, 能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人, 能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后, 基金管理人确定券商, 与被选择的券商签订委托协议, 并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	926,500,000.00	26.61%	-	-
长江证券	-	-	2,554,900,000.00	73.39%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信基金管理有限责任公司关于旗下建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金投资重大关联方证券的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 6 月 12 日
2	关于新增长城证券为旗下开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 5 月 25 日
3	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	指定报刊和/或公司网站	2018 年 5 月 16 日
4	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 5 月 16 日
5	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合	指定报刊和/或公司网站	2018 年 4 月 20 日

	同生效公告		
6	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型 开放式指数证券投资基金基金份 额发售公告	指定报刊和/或公司 网站	2018 年 3 月 27 日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数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。

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 11.3 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

2018 年 8 月 25 日