

建信富时 100 指数型证券投资基金(原建信
全球资源混合型证券投资基金)
2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 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 4 月 21 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 4 月 17 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况（转型后）

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	43,640,171.88 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 A(人民币)	建信富时 100 指数 C(人民币)
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额总额	36,983,204.34 份	6,656,967.54 份
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	

§ 2 基金产品概况 (转型前)

基金简称	建信全球资源混合(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	2012年6月26日	
报告期末基金份额总额	24,966,059.47 份	
投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理, 优选资源类相关行业的股票进行投资, 在控制风险的同时, 追求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金在投资策略方面, 将采取自上而下的资产配置与自下而上的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合等多种方式进行投资组合的构建。	
业绩比较基准	50%×MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Energy Net Total Return Index) +50%×MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Material Net Total Return Index)。	
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金, 其预期收益及预期风险水平低于股票型基金, 高于债券型基金和货币市场基金, 属于中高收益/风险特征的基金。	
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	
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 (转型后)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2020年1月10日-2020年3月31日)	
	建信富时 100 指数 A	建信富时 100 指数 C
1. 本期已实现收益	1,157,592.96	6,703.11
2. 本期利润	-4,884,153.22	38,021.35
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1781	0.0239

4. 期末基金资产净值	26,349,951.32	4,760,048.50
5. 期末基金份额净值	0.7125	0.7150

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年1月1日-2020年1月9日）	
1. 本期已实现收益		-15,956.04
2. 本期利润		-234,893.53
3. 加权平均基金份额本期利润		-0.0093
4. 期末基金资产净值		22,671,402.87
5. 期末基金份额净值		0.908

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（转型后）

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 A(人民币)

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
自基金合同生效起至今	-21.53%	2.48%	-26.89%	2.85%	5.36%	-0.37%

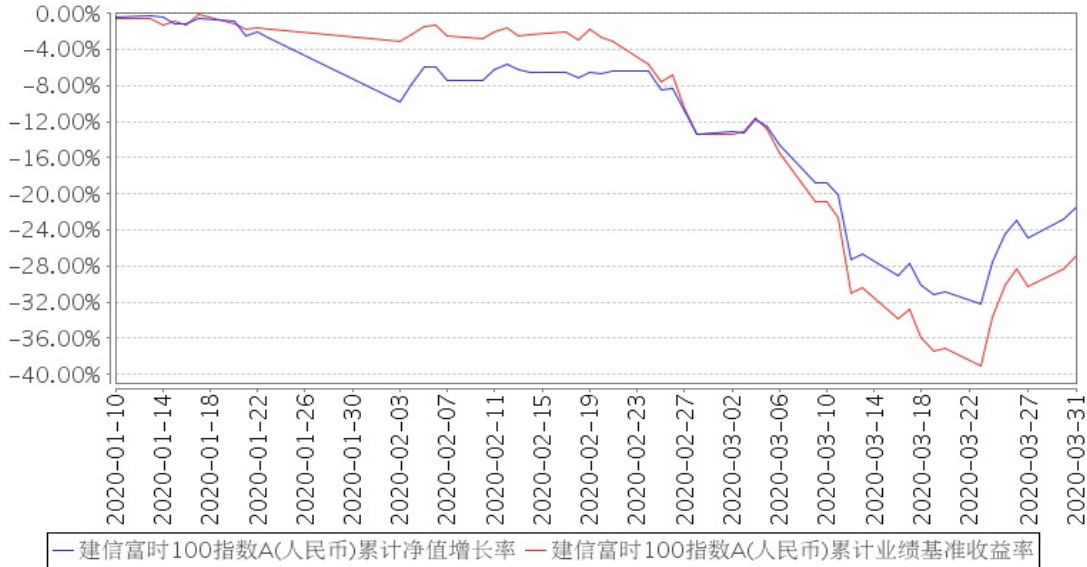
建信富时 100 指数 C(人民币)

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
自基金合同生效起至今	-21.08%	2.53%	-26.51%	2.90%	5.43%	-0.37%

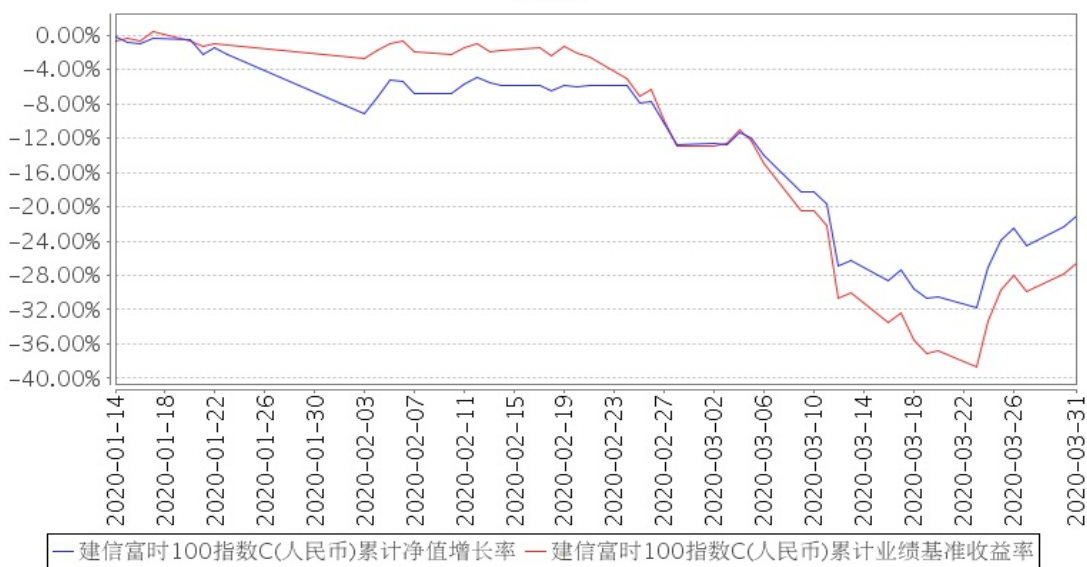
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金转型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A(人民币)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C(人民币)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：本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

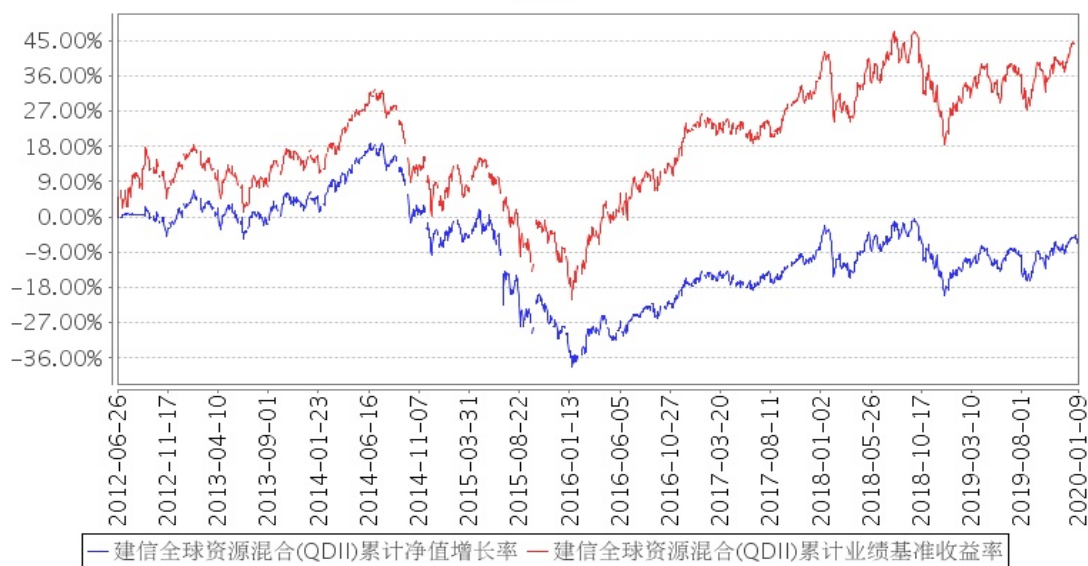
阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-1.09%	0.59%	-1.09%	0.43%	0.00%	0.16%

注:过去三个月:2020年1月1日至2020年1月9日。

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

建信全球资源混合(QDII)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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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	海外投资部副总经理, 本基金的基金经理	2020年1月10日	-	15年	李博涵先生, 海外投资部副总经理, 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; 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 基金经理 (或基金经理小组) 简介 (转型前)

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	海外投资部副总经理, 本基金的基金经理	2013 年 8 月 5 日	2020 年 1 月 9 日	15 年	李博涵先生, 海外投资部副总经理, 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; 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。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 (转型后)

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Aaron Siebel	投资组合经理	15	Aaron Siebel 是信安环球权益投资团队中的资深指数基金经理, 负责全球投资系统解决方案。专注于被动指数、指数增强、替代指数方案的实施、分析和组合构建支持。他也为团队和客户提供项目管理和

			沟通支持。Aaron 于 2005 年加入公司。Aaron 在爱荷华大学取得金融学学士学位，是 CFA 持证入及 CFA 协会会员。
--	--	--	--

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（转型前）

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Mohammed Zaidi	投资组合经理	16	Mohammed Zaidi 是信安环球股票的基金经理。他在新加坡办公，担任全球新兴市场股票策略的共同基金经理及新兴亚洲股票策略负责人。Mohammed 的职业生涯开始于 1997 年，在全球宏观对冲基金管理人 VZB Capital 担任新兴市场分析师及基金经理。他在 2001 年作为新兴市场股票分析师加入信安，专注于基础选股工作，并且是负责信安内部研发的全球研究平台（GRP）初始搭建的核心分析师之一。他专注于将 GRP 调整适用于新兴市场和亚洲股票。在 2006 年离开公司后，他曾经担任 Martin Currie 投资管理公司的新兴市场基金经理和分析师。在那之前服务于该团队的前任雇主 Scottish Widows 投资合伙公司。他持有麻省理工学院斯隆管理学院 MBA 学位，宾夕法尼亚大学沃顿学院经济学学士学位。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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。

4.4.2 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

在报告期内，本基金从全球资源基金转型为富时 100 指数基金。根据基金合同规定，采取了对指数的被动复制策略，在建仓期逐步完成了股票的配置，年化跟踪误差和日均跟踪偏离度都在初步降低。

报告期内，由于市场出现了剧烈波动，同时基金的申赎较多，基金易于产生跟踪误差。本基金管理人根据市场情况，对策略方案进行优化和调整，以尽可能降低这种不利影响。

本报告期本基金转型后 A 净值增长率-21.53%，波动率 2.48%，本报告期本基金转型后 C 净值增长率-21.08%，波动率 2.53%；本报告期本基金转型后 A 业绩比较基准收益率-26.22%，波动率 2.85%，本报告期本基金转型后 C 业绩比较基准收益率-25.87%，波动率 2.90%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 31 日，本基金基金资产净值低于五千万元超过连续 20 个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014 年 8 月 8 日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

§ 5 投资组合报告（转型后）

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	25,685,595.22	68.90
	其中：普通股	25,685,595.22	68.90
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	2,199,560.67	5.90
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	6,739,218.97	18.08
8	其他资产	2,654,059.35	7.12
9	合计	37,278,434.21	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	25,685,595.22	82.56
合计	25,685,595.22	82.56

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 (%)
必需消费品	5,948,024.64	19.12
金融	5,103,036.47	16.40
医疗保健	4,348,473.63	13.98
能源	4,321,245.16	13.89
材料	2,297,726.69	7.39
工业	1,686,662.81	5.42
公用事业	783,836.35	2.52

电信服务	719,707.20	2.31
非必需消费品	476,882.27	1.53
合计	25,685,595.22	82.56

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	3,563.00	2,252,172.13	7.24
2	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	GB0005405286	英国伦敦证券交易所	英国	54,839.00	2,182,095.23	7.01
3	GLAXOSMITHKLINE PLC	葛兰素史克公司	GB0009252882	英国伦敦证券交易所	英国	13,550.00	1,797,738.34	5.78
4	BP PLC	BP公司	GB0007980591	英国伦敦证券交易所	英国	55,329.00	1,668,218.47	5.36
5	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	英美烟草	GB0002875804	英国伦敦证券交易所	英国	6,230.00	1,505,667.17	4.84
6	DIAGEO PLC	帝亚吉欧	GB0002374006	英国伦敦证券交易所	英国	6,424.00	1,455,483.37	4.68
7	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	GB00B03MLX29	英国伦敦证券交易所	英国	11,621.00	1,444,491.96	4.64
8	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	GB00B03MLX29	英国伦敦证券交易所	英国	10,141.00	1,208,534.73	3.88

	TCH SHEL L PLC- B SHS	壳牌	3MM408	敦 证 券 交 易 所		6.00		
9	UNILEVER PLC	联合利华	GB00B1 0RZP78	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	3,014 .00	1,076,002.74	3.46
10	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	利洁时	GB00B2 4CGK77	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	1,926 .00	1,037,577.71	3.34

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

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	ETF 基金	交易型开 放式指数	BlackRock Inc	2,199,560.67	7.07

	100					
--	-----	--	--	--	--	--

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	169,456.77
4	应收利息	513.93
5	应收申购款	2,484,088.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,654,059.35

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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

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	18,838,928.12	80.74
	其中：普通股	10,814,123.01	46.35
	优先股	-	-
	存托凭证	8,024,805.11	34.39
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	2,179,927.62	9.34
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	1,572,705.99	6.74
8	其他资产	741,105.28	3.18
9	合计	23,332,667.01	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 (%)
美国	16,353,443.28	72.13
中国香港	2,485,484.84	10.96
合计	18,838,928.12	83.10

5.3 报告期末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	8,932,414.55	39.40
必需消费品	-	-
非必需消费品	-	-
能源	9,906,513.57	43.70
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
房地产	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-

公用事业	-	-
合计	18,838,928.12	83.10

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

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	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	US30231G1022	纽约证券交易所	美国	2,480	1,202,331.46	5.3
2	ASIA CEMENT CHINA HOLDINGS	亚洲水泥(中国)	KYG0539C1069	香港联合交易所	中国香港	115,000	1,177,662.26	5.19
3	CHEVRON CORP	雪佛龙	US1667641005	纽约证券交易所	美国	947	773,376.31	3.41
4	TOTAL SA-SPON ADR	道达尔	US89151E1091	纽约证券交易所	美国	1,918	744,853.83	3.29
5	BP PLC-SPONS ADR	碧辟公司	US0556221044	纽约证券交易所	美国	2,623	710,204.30	3.13
6	FORTESCUE METALS-SPON ADR	FMG 集团	US34959A2069	美国证券交易所	美国	6,828	688,536.52	3.04
7	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	US56585A1025	纽约证券交易所	美国	1,644	678,548.97	2.99
8	LUKOIL PJSC-SPON ADR	卢克石油公司	US69343P1057	美国证券交易所	美国	877	638,256.56	2.82
9	ANGLO AMERICAN PLC-SPONS ADR	英美公司	US03485P3001	美国证券交易所	美国	6,457	633,623.89	2.79
10	ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-B	荷兰皇家壳牌	US7802591070	纽约证券交易所	美国	1,483	626,320.24	2.76

注：所有证券代码采用 ISIN 码。

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

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 S&P 500 ETF	ETF 基金	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	2,051,864.18	9.05
2	ISHARES MSCI CHINA ETF	ETF 基金	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	44,073.33	0.19
3	ISHARES GLOBAL MATERIALS ETF	ETF 基金	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	43,650.72	0.19
4	ISHARES GLOBAL ENERGY ETF	ETF 基金	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	40,339.39	0.18

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	45,889.01
4	应收利息	246.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	694,970.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	741,105.28

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

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（转型后）

单位：份

项目	建信富时 100 指数 A	建信富时 100 指数 C
基金合同生效日(2020年1月10日)基金份额总额	24,966,059.47	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	15,169,896.38	7,976,158.25
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,152,751.51	1,319,190.71
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)	-	-
报告期期末基金份额总额	36,983,204.34	6,656,967.54

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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	25,371,623.48
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	405,564.01
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	24,966,059.47

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（转型后）

无。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020 年 01 月 01 日 -2020 年 03 月 31 日	17,454,372.30	-	-	17,454,372.30	40.00
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

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4月21日