

# 建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 联接
基金主代码	008827
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 10 月 16 日
报告期末基金份额总额	177,494,701.88 份
投资目标	通过主要投资于目标 ETF，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	<p>本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。</p> <p>(一) 资产配置策略</p> <p>为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF，其余资产可投资于标的指数的成份期货合约和备选成份期货合约、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、地方政府债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，其目的是为了使本基金在保障日常申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.50%，年跟踪误差不超过 6%。如因指数编制规则调整或其他因素导</p>

	致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。	
业绩比较基准	易盛郑商所能源化工指数 A 收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%	
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数所表征的市场组合相似的风险收益特征，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 联接 A	建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	008827	008828
报告期末下属分级基金的份额总额	59,995,769.88 份	117,498,932.00 份

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159981
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 13 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 17 日
基金管理人名称	建信基金管理有限责任公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

### 2.1.2 目标基金产品说明

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，日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。
投资策略	本基金主要采用指数复制策略及替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金主要采用指数复制策略，即按照成份期货合约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期货合约及其权重的变化进行相应调整。本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为易盛郑商所能源化工指数 A 收益率。
风险收益特征	本基金属于商品期货型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式指数基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 联接 A	建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	7,649,263.95	13,361,045.85
2. 本期利润	13,063,137.40	40,104,242.40
3. 加权平均基金份额本 期利润	0.3473	0.4247
4. 期末基金资产净值	95,620,900.13	186,541,139.16
5. 期末基金份额净值	1.5938	1.5876

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。

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 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

建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 联接 A

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	28.41%	1.26%	34.30%	1.35%	-5.89%	-0.09%
过去六个月	36.49%	1.31%	52.87%	1.34%	-16.38%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	59.38%	1.10%	91.46%	1.15%	-32.08%	-0.05%

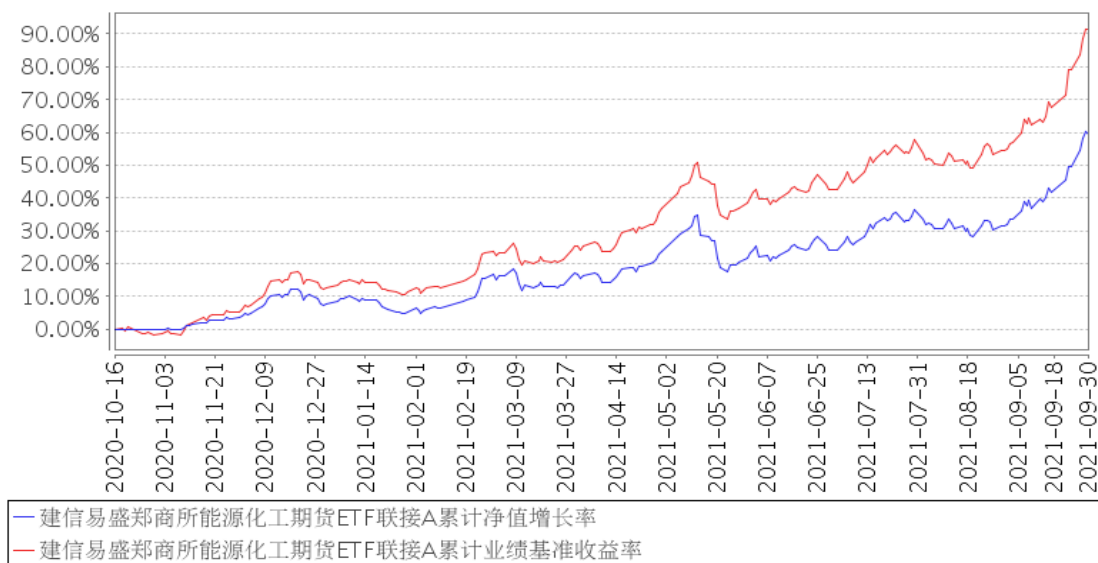
建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 联接 C

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	28.28%	1.26%	34.30%	1.35%	-6.02%	-0.09%
过去六个月	36.20%	1.31%	52.87%	1.34%	-16.67%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	58.76%	1.10%	91.46%	1.15%	-32.70%	-0.05%

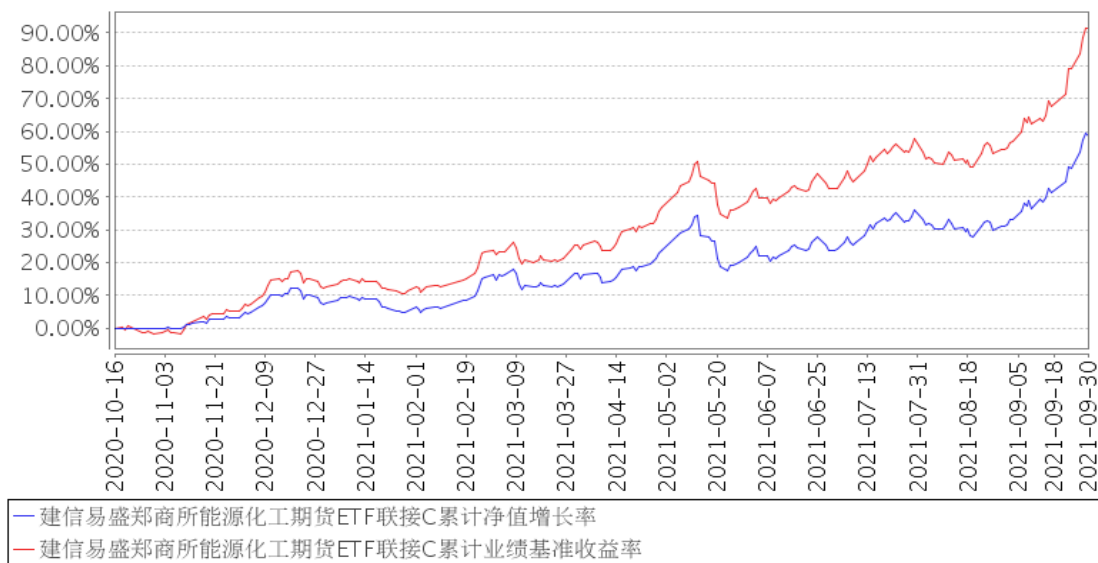
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

## 率变动的比较

建信易盛郑商所能源化工期货ETF联接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



建信易盛郑商所能源化工期货ETF联接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：本基金基金合同于2020年10月16日生效，截至报告期末未满一年。本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
朱金钰	金融工程及指数投资部副总经理，本基金的基金经理	2020 年 10 月 16 日	-	10 年	朱金钰先生，金融工程及指数投资部副总经理，博士。2008 年 7 月至 2010 年 10 月在 Mapleridge Capital 公司担任量化策略师；2011 年 6 月至 2014 年 11 月在中信证券股份有限公司担任投资经理；2014 年 11 月加入我公司，历任资产配置与量化投资部投资经理、部门总经理助理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理、基金经理。2019 年 12 月 13 日起任建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 8 月 5 日起任建信上海金交易型开放式证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理；2020 年 10 月 16 日起任建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 发起式联接基金的基金经理；2021 年 2 月 8 日起任建信富时 100 指数型证券投资基金（QDII）的基金经理；2021 年 9 月 22 日起任建信纳斯达克 100 指数型证券投资基金（QDII）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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，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《建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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

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。

#### 4.3.2 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。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为易盛郑商所能源化工指数 A，基金业绩比较基准为：易盛郑商所能源化工指数 A 收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%。报告期内，管理人严格遵守基金合同约定，保持目标 ETF 份额不低于基金资产净值的 90%。本基金主要通过申购赎回的方式投资于目标 ETF，同时通过部分持有指数成份期货合约的方式，紧密跟踪标的指数即易盛郑商所能源化工指数 A 的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。报告期内，部分交易日基金出现了较大比例的申赎，单日大比例的申赎会对持仓结构造成一定影响，从而放大基金的跟踪偏离度和跟踪误差。管理人通过对组合的适当调整，尽力降低了这些不利影响。2021 年 3 季度，需求回暖、供给约束的背景下，能源化工商品价格维持强势。就动力煤而言，电厂库存处于低位，虽然国内保供增产政策不断出台，但增量释放不明显，进口煤价维持高位，供需偏紧的局面难以扭转；若今年冬季出现大范围长时间寒潮天气，全年全社会用电量增速可能超预期；加之动力煤期货盘面贴水幅度较大，存在基差修复的需要。甲醇港口和内地市场均较为强势，成本抬升及供应受限对其价格形成支撑。受此影响，易盛郑商所能源化工指数 A 延续反弹态势，连续创出新高，其中动力煤、甲醇涨幅居前。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 28.41%，波动率 1.26%，本报告期本基金 C 净值增长率 28.28%，波动率 1.26%；业绩比较基准收益率 34.30%，波动率 1.35%。

#### 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	224,194,269.74	49.26
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	40,000,000.00	8.79
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	132,227,064.87	29.05
8	其他资产	58,717,131.76	12.90
9	合计	455,138,466.37	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 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

无。

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

## 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

无。

## 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

无。



## 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

无。

## 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	建信基金管理有限责任公司	224,194,269.74	79.46

## 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

## 5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

## 5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

## 5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.12 投资组合报告附注

## 5.12.1

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。

## 5.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

## 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,900,319.05
2	应收证券清算款	3,071,860.20
3	应收股利	-
4	应收利息	19,314.26
5	应收申购款	45,725,638.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,717,131.76

## 5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 5.12.6 报告期末本基金投资的商品期货交易情况说明

### 5.12.6.1 报告期末本基金投资的商品期货持仓和损益明细

	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值（元）	公允价值变动 (元)	风险说明
FG201	玻璃 201	116.00	5,229,280.00	-193,219.94	-
MA201	甲醇 201	319.00	11,432,960.00	1,223,049.91	-
TA201	精对苯二甲酸 201	406.00	10,300,220.00	131,780.93	-
ZC201	动力煤 201	174.00	23,142,000.00	2,780,481.20	-
公允价值变动总额合计（元）					3,942,092.10
商品期货投资本期收益（元）					8,100,177.90

商品期货投资本期公允价值变动（元）	3,942,092.10
-------------------	--------------

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示，单位为手。

#### 5.12.6.2 本基金投资商品期货的投资政策

本基金主要采用指数复制策略，即按照成份期货合约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期货合约及其权重的变化进行相应调整。

#### 5.12.7 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	建信易盛郑商所能源化工 期货 ETF 联接 A	建信易盛郑商所能源化工 期货 ETF 联接 C
报告期期初基金份额总额	41,338,041.95	58,002,572.50
报告期期间基金总申购份额	38,556,118.55	607,338,732.56
减：报告期期间基金总赎回份额	19,898,390.62	547,842,373.06
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	59,995,769.88	117,498,932.00

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

### § 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	18,669,152.07
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	18,669,152.07
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	10.52

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	18,669,152.07	10.52	10,000,000.00	5.63	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	18,669,152.07	10.52	10,000,000.00	5.63	3年

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

## 9.1 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	2021年07月28日-2021年07月29日, 2021年08月19日-2021年08月23日, 2021年09月13日-2021年09月15日	18,669,152.07	-	-	18,669,152.07	10.52

注：本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金设立的文件；
- 2、《建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；
- 3、《建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》；
- 4、《建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；
- 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。

### 10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 10.3 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  
2021 年 10 月 26 日