

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 年中期报告

2020 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。本中期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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人（转型后）	7
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人（转型前）	7
2.5 信息披露方式	8
2.6 其他相关资料（转型后）	8
2.6 其他相关资料（转型前）	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）	8
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）	9
3.2 基金净值表现（转型后）	10
3.2 基金净值表现（转型前）	11
3.3 其他指标	12
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
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	17
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	17
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 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	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	20
6.1 资产负债表	20
6.2 利润表	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	22

6.4 报表附注.....	23
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	48
6.1 资产负债表.....	48
6.2 利润表.....	50
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	51
6.4 报表附注.....	52
§7 投资组合报告（转型后）	74
7.1 期末基金资产组合情况.....	74
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	75
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	75
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	75
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	78
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	80
7.7 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.....	80
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	80
7.9 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.....	80
7.10 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.....	80
7.11 投资组合报告附注.....	80
§7 投资组合报告（转型前）	81
7.1 期末基金资产组合情况.....	81
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	82
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	82
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	82
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	85
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	85
7.7 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.....	85
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	85
7.9 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.....	85
7.10 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.....	86
7.11 投资组合报告附注.....	86
§8 基金份额持有人信息（转型后）	87
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	87
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	87
8.3 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情况.....	88
§8 基金份额持有人信息（转型前）	88
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	88
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	88
8.3 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情况.....	88
§9 开放式基金份额变动（转型后）	88
§9 开放式基金份额变动（转型前）	89
§10 重大事件揭示	89

10.1 基金份额持有人大会决议.....	89
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.....	89
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	89
10.4 基金投资策略的改变.....	89
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	89
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.....	89
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	90
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	92
10.8 其他重大事件(转型后).....	99
10.8 其他重大事件(转型前).....	99
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	100
11.1 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	100
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	100
§ 12 备查文件目录	100
12.1 备查文件目录.....	100
12.2 存放地点.....	100
12.3 查阅方式.....	101

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	建信富时 100 指数型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	97,920,389.82 份	
基金合同存续期	不定期	
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额总额	62,803,306.80 份	35,117,083.02 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	建信全球资源混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	24,966,059.47 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明（转型后）

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。
--------	---

2.2 基金产品说明（转型前）

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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	许俊
	联系电话	010-66228888	010-66594319
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95566
传真		010-66228001	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街1号
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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		孙志晨	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人（转型后）

项目		境外资产托管人
名称	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York
办公地址		140 Broadway New York
邮政编码		NY10005

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人（转型前）

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Principal Global Investors, LLC.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	信安环球投资有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York
邮政编码		IA 50392-0490	NY10005

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.6 其他相关资料（转型后）

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

2.6 其他相关资料（转型前）

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16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(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月10日(基金合同生效日)-2020年6月30日)	
	建信富时 100 指数 A	建信富时 100 指数 (QDII) C
本期已实现收益	997,200.14	-53,281.48
本期利润	-3,486,853.47	154,868.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0843	0.0127

本期加权平均净值利润率	-11.18%	1.72%
本期基金份额净值增长率	-18.60%	-18.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-16,383,533.48	-9,101,625.99
期末可供分配基金份额利润	-0.2609	-0.2592
期末基金资产净值	46,419,773.32	26,015,457.03
期末基金份额净值	0.7391	0.7408
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-18.60%	-18.23%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、汇兑损益、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、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，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）。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 1 月 9 日)
本期已实现收益	-15,956.04
本期利润	-234,893.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0093
本期加权平均净值利润率	-1.02%
本期基金份额净值增长率	-1.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 1 月 9 日)
期末可供分配利润	-2,690,575.22
期末可供分配基金份额利润	-0.1078

期末基金资产净值	22,671,402.87
期末基金份额净值	0.908
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年1月9日)
基金份额累计净值增长率	-6.32%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、汇兑损益、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、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，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）。

3.2 基金净值表现（转型后）

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
过去一个月	0.50%	1.79%	0.69%	1.91%	-0.19%	-0.12%
过去三个月	3.73%	1.69%	7.85%	1.88%	-4.12%	-0.19%
自基金合同生效起至今	-18.60%	2.12%	-21.16%	2.41%	2.56%	-0.29%

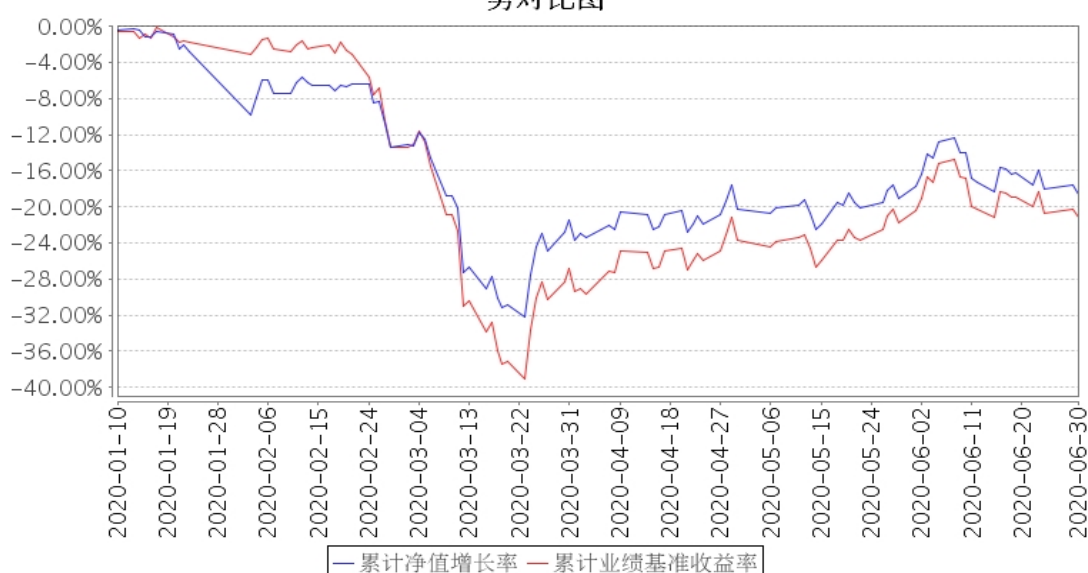
建信富时 100 指数 (QDII) C

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
过去一个月	0.46%	1.79%	0.69%	1.91%	-0.23%	-0.12%
过去三个月	3.61%	1.69%	7.85%	1.88%	-4.24%	-0.19%

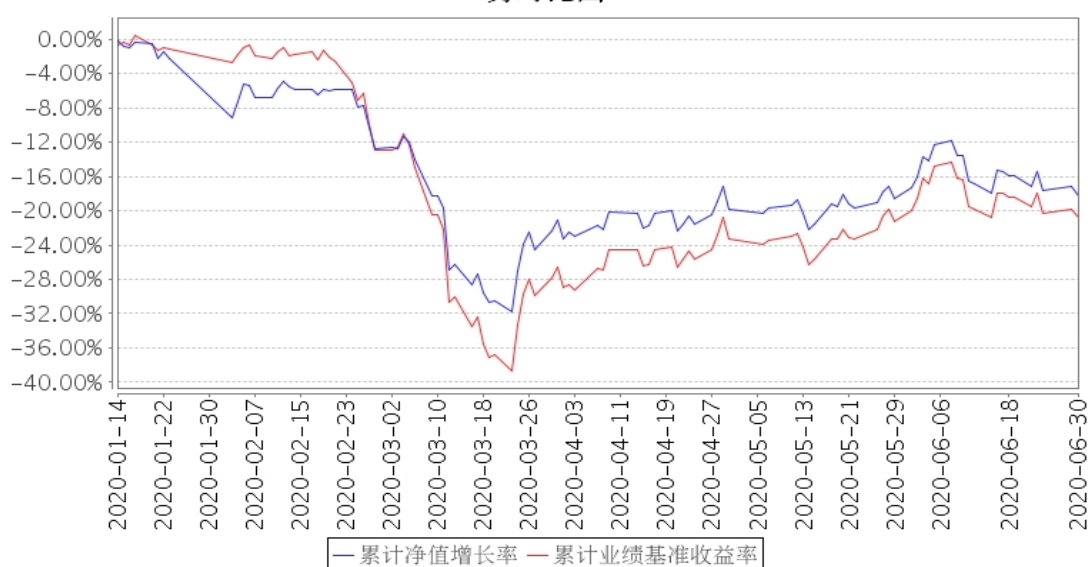
自基金合同生效起 至今	-18.23%	2.14%	-20.75%	2.43%	2.52%	-0.29%
----------------	---------	-------	---------	-------	-------	--------

3.2.2 自基金转型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。

3.2 基金净值表现（转型前）

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 值增长	份额净值 增长率标	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准差	①—③	②—④
----	-------------	--------------	----------------	------------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去六个月	-1.09%	0.59%	-1.09%	0.43%	0.00%	0.16%
过去一年	1.91%	0.82%	2.48%	0.78%	-0.57%	0.04%
过去三年	13.64%	0.88%	18.98%	0.80%	-5.34%	0.08%
自基金合同生效起至今	-6.32%	1.00%	42.50%	0.96%	-48.82%	0.04%

注：过去六个月：2020 年 1 月 1 日-2020 年 1 月 9 日；

过去一年：2019 年 7 月 1 日-2020 年 1 月 9 日；

过去三年：2017 年 7 月 1 日-2020 年 1 月 9 日。

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



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 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 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、基础设施投资部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部、内控合规部和审计部，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、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（香港）有限公司。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“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家资产管理行业的领跑者”。

截至 2020 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、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、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、建信富时 100 指数型证券投资基金、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、建信灵活配置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 6 个月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、建信短债债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、建信睿怡纯债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（LOF）、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 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及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、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、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、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 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、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、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、建信优享稳健养老目标一年持有期

混合型基金中基金（FOF）、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、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、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金，建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金共计 126 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4939.77 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（转型后）

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		
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。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
李博涵	海外投资部总经理，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。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

4.1.3 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（转型后）

无。

4.1.3 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（转型前）

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 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》、《公开募集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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.4.2 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 2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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，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。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金转型后 A 净值增长率-18.60%，波动率 2.12%，业绩比较基准收益率-21.16%，

波动率 2.41%；本报告期本基金转型后 C 净值增长率-18.23%，波动率 2.14%，业绩比较基准收益率-20.75%，波动率 2.43%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球货币政策和流动性预计仍将维持宽松。美联储、欧央行等主要央行依然努力向外界传达维持低利率环境的信号。财政政策方面，各主要经济体也传达出积极信号，美国第二轮财政刺激方案正在密集磋商，欧盟达成 7500 亿欧元共担债券的刺激方案推动欧元大涨。

基本面方面，英国制造业 PMI 已经从 4 月最低的 32.6 恢复到 53.3，服务业 PMI 从 4 月最低 13.4 达到 56.6 的近期新高。领先指标反映后续企业信心和基本面恢复预期良好。

汇率方面，随着欧洲疫情恢复好于美国，英镑与欧元相对美元近期均有所升值。但总体来看，英镑与全球主要货币的汇率一直处于多年的振荡区间中，预计汇率后续仍将延续振荡和相对稳定的格局。

随着全球经济逐步在疫情中恢复，在全球大类资产中，股票依然是最佳的配置资产。低利率环境和逐步恢复的基本面都有利于风险资产继续表现。受益于货币政策和财政政策刺激，市场流动性充裕，叠加基本面恢复良好，伦敦市场后续预计仍然会有较好的表现。

4.7 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、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及本基金基金合同中关于收益分配相关条款的规定，本基金本报告期末达到利润分配条件，未进行利润分配。

4.9 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

本报告期内，自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 4 月 24 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 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对建信富时 100 指数型证券投资基金（以下称“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、基金合同和托管协议的规定，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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：建信富时 100 指数型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	9,622,208.91
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	64,220,339.14
其中：股票投资		58,953,355.78
基金投资		5,266,983.36
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		-
应收利息	6.4.7.5	487.11
应收股利		220,223.77
应收申购款		1,793,325.32
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		75,856,584.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负 债：		
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		-
应付赎回款		3,051,205.36
应付管理人报酬		45,847.52
应付托管费		14,327.33
应付销售服务费		7,632.33
应付交易费用	6.4.7.7	-
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	302,341.36
负债合计		3,421,353.90
所有者权益：		

实收基金	6.4.7.9	97,920,389.82
未分配利润	6.4.7.10	-25,485,159.47
所有者权益合计		72,435,230.35
负债和所有者权益总计		75,856,584.25

注：1、报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 97,920,389.82 份，其中建信富时 100 指数 A 基金份额总额 62,803,306.80 份，基金份额净值 0.7391 元；建信富时 100 指数 C 基金份额总额 35,117,083.02 份，基金份额净值 0.7408 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：建信富时 100 指数型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同 生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-2,546,521.90
1. 利息收入		5,833.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,833.08
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,938,769.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	757,757.50
基金投资收益	6.4.7.13	530,381.98
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	650,629.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-4,275,903.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-264,245.92
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	49,025.54
减：二、费用		785,463.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	151,756.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	47,423.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	16,836.39

4. 交易费用	6. 4. 7. 20	351,560.14
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. 21	217,886.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,331,985.10
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,331,985.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信富时 100 指数型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 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）	24,966,059.47	-2,294,656.60	22,671,402.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-3,331,985.10	-3,331,985.10
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）	72,954,330.35	-19,858,517.77	53,095,812.58
其中：1. 基金申购款	113,346,450.26	-30,253,610.27	83,092,839.99
2. 基金赎回款	-40,392,119.91	10,395,092.50	-29,997,027.41
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）	97,920,389.82	-25,485,159.47	72,435,230.35

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

吴灵玲

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

建信富时 100 指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原建信全球资源混合型证券投资基金转型而来。根据原建信全球资源混合型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《关于建信全球资源混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，转型日为 2020 年 1 月 10 日，基金名称相应变更为“建信富时 100 指数型证券投资基金”，建信全球资源混合型证券投资基金份额转换为建信富时 100 指数型证券投资基金。转型后，基金的托管人、登记机构不变。自 2020 年 1 月 10 日起《建信富时 100 指数型证券投资基金基金合同》、《建信富时 100 指数型证券投资基金托管协议》生效，原《建信全球资源混合型证券投资基金基金合同》、《建信全球资源混合型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）。本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。A 类基金份额在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用；C 类基金份额在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信富时 100 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括英国证券市场中的富时 100 指数成份股、备选成份股；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证；经中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品；银行存款、短期政府债券等以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%；其中投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金资产的 80%；投资于跟踪标的指数的公募基金的比例不高于基金资产净值的 20%；本基金持有的现金或者到

期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为人民币计价的富时 100 指数收益率*95%（Financial Times Stock Exchange 100 Index）+活期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 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 6 月 30 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 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、基金投资、债券投资和衍生工具等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、基金投资、债券投资和衍生工具等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。

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股票交易所在地适用的预缴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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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和托管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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或

地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	9,622,208.91
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	9,622,208.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	60,466,081.87	58,953,355.78	-1,512,726.09
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	5,143,192.07	5,266,983.36	123,791.29
其他	—	—	—
合计	65,609,273.94	64,220,339.14	-1,388,934.80

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	487.11
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	—
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	—
应收出借证券利息	—
其他	—
合计	487.11

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	10,753.47
应付证券出借违约金	—

预提费用	223,914.74
应付指数使用费用	67,673.15
合计	302,341.36

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信富时 100 指数 (QDII) A

项目	本期 2020 年 1 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	24,966,059.47	24,966,059.47
2020 年 1 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2020 年 1 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2020 年 1 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2020 年 1 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	62,167,631.18	62,167,631.18
本期赎回 (以“-”号填列)	-24,330,383.85	-24,330,383.85
本期末	62,803,306.80	62,803,306.80

建信富时 100 指数 (QDII) C

项目	本期 2020 年 1 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	-	-

2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	51,178,819.08	51,178,819.08
本期赎回(以“-”号填列)	-16,061,736.06	-16,061,736.06
本期末	35,117,083.02	35,117,083.02

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信富时 100 指数 A			
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	-2,690,575.22	395,918.62	-2,294,656.60
本期利润	997,200.14	-4,484,053.61	-3,486,853.47
本期基金份额 交易产生的变动数	-2,393,239.90	-8,208,783.51	-10,602,023.41
其中：基金申 购款	-3,978,902.98	-12,762,640.23	-16,741,543.21
基金赎 回款	1,585,663.08	4,553,856.72	6,139,519.80
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-4,086,614.98	-12,296,918.50	-16,383,533.48
建信富时 100 指数 C			
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	-53,281.48	208,149.85	154,868.37
本期基金份额	-2,149,649.92	-7,106,844.44	-9,256,494.36

交易产生的变动数			
其中：基金申购款	-3,133,083.24	-10,378,983.82	-13,512,067.06
基金赎回款	983,433.32	3,272,139.38	4,255,572.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,202,931.40	-6,898,694.59	-9,101,625.99

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,785.19
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	47.89
合计	5,833.08

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 2020年1月10日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	757,757.50
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	757,757.50

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 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	20,820,958.17
减：卖出股票成本总额	20,063,200.67
买卖股票差价收入	757,757.50

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	2,938,587.62
减：卖出/赎回基金成本总额	2,408,205.64
基金投资收益	530,381.98

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	609,597.92
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	41,031.76
合计	650,629.68

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,275,903.76
股票投资	-3,988,318.88
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	-287,584.88
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	-4,275,903.76

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	49,025.54
合计	49,025.54

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	351,560.14
银行间市场交易费用	-
合计	351,560.14

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	21,270.35
信息披露费	47,267.06
证券出借违约金	-
银行划款手续费	21,732.95
指数使用费	126,070.41
其他	1,545.69
合计	217,886.46

6.4.7.22 分部报告

无。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行（“布朗兄弟哈里曼银行”）	境外资产托管人
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、基金销售机构
中国华电集团资本控股有限公司	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
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：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

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

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
	2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	151,756.42
其中：支付销售机构的客户维护费	41,745.18

注：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的 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	47,423.79

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信富时 100 指数(QDII)	建信富时 100 指数(QDII)	合计
	A	C	

中国建设银行	—	901.74	901.74
建信基金	—	460.95	460.95
—	—	—	—
合计	—	1,362.69	1,362.69

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费的计算公式为：
$$\text{销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
	建信富时 100 指数（QDII）A	建信富时 100 指数（QDII）C
基金合同生效日（2020 年 1 月 10 日）持有的基金份额	17,454,372.30	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—

减: 报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	17,454,372.30	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.79%	—

注: 分级持有份额占总份额比例的计算中, 对下属分级基金, 比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,995,535.20	5,785.19
布朗兄弟哈里曼银行	4,626,673.71	—

注: 本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管, 按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末 (2020 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。基金管理人对于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的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2020 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	9,622,208.91	0.00			9,622,208.91
结算备付金					0.00
存出保证金					0.00
交易性金融资产				64,220,339.14	64,220,339.14
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					0.00
应收利息				487.11	487.11
应收股利				220,223.77	220,223.77
应收申购款				1,793,325.32	1,793,325.32
其他资产					0.00
资产总计	9,622,208.91	0.00	0.00	66,234,375.34	75,856,584.25
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				0.00	0.00
应付赎回款				3,051,205.36	3,051,205.36
应付管理人报酬				45,847.52	45,847.52
应付托管费				14,327.33	14,327.33
应付销售服务费				7,632.33	7,632.33
应付交易费用					0.00
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				302,341.36	302,341.36
负债总计	0.00	0.00	0.00	3,421,353.90	3,421,353.90
利率敏感度缺口	9,622,208.91	0.00	0.00	62,813,021.44	72,435,230.35

注：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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	4,791,887.44	-	-	4,791,887.44
交易性金融资产	-	-	64,220,339.14	64,220,339.14
应收股利	72,352.06	-	147,871.71	220,223.77
应收利息	11.26	-	-	11.26
资产合计	4,864,250.76	-	64,368,210.85	69,232,461.61
以外币计价的负债				
其他负债	65,776.34	-	-	65,776.34
负债合计	65,776.34	-	-	65,776.34
资产负债表外汇风险敞口净额	4,798,474.42	-	64,368,210.85	69,166,685.27

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020 年 6 月 30 日）
	所有外币相对人民币贬值 5%	-3,458,684.04
	所有外币相对人民币升值 5%	3,458,684.04

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的股票，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。

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%；其中投资标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金资产的 80%；投资于跟踪标的指数的公募基金的比例不高于基金资产净值的 20%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，及时可靠地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 2020 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	58,953,355.78	81.39
交易性金融资产—基金投资	5,266,983.36	7.27
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	64,220,339.14	88.66

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金转型后不满一年，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

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 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，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 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人民币 64,220,339.14 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

6.4.14.1.2.2 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可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2 承诺事项

无。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：建信全球资源混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 1 月 9 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 1 月 9 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	1,572,705.99	2,521,467.86
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	21,018,855.74	21,237,793.23
其中: 股票投资		18,838,928.12	19,080,433.44
基金投资		2,179,927.62	2,157,359.79
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	246.27	106.67
应收股利		45,889.01	43,496.80
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	694,970.00	-
资产总计		23,332,667.01	23,802,864.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 1 月 9 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债:			
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		-	-
应付赎回款		371,914.29	181,168.91
应付管理人报酬		10,172.45	36,955.20
应付托管费		1,977.98	7,185.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	277,199.42	298,229.47
负债合计		661,264.14	523,539.32
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	24,966,059.47	25,371,623.48
未分配利润	6.4.7.10	-2,294,656.60	-2,092,298.24

所有者权益合计		22,671,402.87	23,279,325.24
负债和所有者权益总计		23,332,667.01	23,802,864.56

注：1、报告截止日 2020 年 01 月 09 日，基金份额总额 24,966,059.47 份，基金份额净值 0.908 元。

2、本财务报告的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日（基金合同失效前日）止期间。

6.2 利润表

会计主体：建信全球资源混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-219,107.57	3,371,409.57
1. 利息收入		139.64	6,032.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	139.64	6,032.65
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,970.81	845,357.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	260,723.62
基金投资收益	6.4.7.13	-	29,666.89
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.5	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	6,970.81	554,966.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-218,937.49	2,498,130.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-7,559.22	17,830.06
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	278.69	4,058.61
减：二、费用		15,785.96	458,842.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,172.45	234,134.73

2. 托管费	6.4.10.2.2	1,977.98	45,526.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	-	2,586.35
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	6.4.7.21	3,635.53	176,595.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-234,893.53	2,912,566.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-234,893.53	2,912,566.88

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信全球资源混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 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）	25,371,623.48	-2,092,298.24	23,279,325.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-234,893.53	-234,893.53
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）	-405,564.01	32,535.17	-373,028.84
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-405,564.01	32,535.17	-373,028.84
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	24,966,059.47	-2,294,656.60	22,671,402.87

权益(基金净值)			
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	31,232,079.78	-6,369,254.50	24,862,825.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	2,912,566.88	2,912,566.88
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)	-2,624,023.98	347,103.14	-2,276,920.84
其中：1. 基金申购款	1,499,896.62	-219,822.83	1,280,073.79
2. 基金赎回款	-4,123,920.60	566,925.97	-3,556,994.63
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)	28,608,055.80	-3,109,584.48	25,498,471.32

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

吴灵玲

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

建信全球资源混合型证券投资基金(原名为建信全球资源股票型证券投资基金,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[2012]322号《关于核准建信全球资源股票型证券投资基金募集的批复》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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《建信全球资源股票型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 498,213,122.75 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 211 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信全球资源股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 498,237,044.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 23,921.75 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,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行香港分行(JP Morgan ChaseBank, National Association, HongKong Branch),境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal GlobalInvestors, LLC.)。根据建信基金于 2012 年 10 月 17 日发布的公告及中国银行股份有限公司托管及投资者服务部《关于变更建信全球资源混合型基金境外托管人的函》(中银托(函)[2012]81 号),中国银行股份有限公司决定自 2012 年 10 月 15 日起将本基金的境外托管人由摩根大通银行香港分行(JP Morgan ChaseBank, National Association, HongKong Branch)变更为德意志银行新加坡分行(Deutsche Bank AG, Singapore Branch)。根据建信基金于 2018 年 8 月 14 日发布的公告及中国银行股份有限公司托管业务部《关于变更建信全球资源混合型基金境外托管人的函》(中银托(函)[2018]213 号),中国银行股份有限公司决定自 2018 年 8 月 10 日起将本基金的境外托管人由德意志银行新加坡分行(Deutsche Bank AG, Singapore Branch)变更为中国银行(香港)有限公司。根据建信基金管理有限责任公司于 2019 年 3 月 16 日发布的公告及中国银行股份有限公司托管业务部《关于变更建信全球资源混合型基金境外托管人的函》(中银托(函)[2019]54 号),中国银行股份有限公司决定自 2019 年 3 月 13 日起将本基金的境外托管人由中国银行(香港)有限公司变更为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman& Co.)。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,建信全球资源股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为建信全球资源混合型证券投资基金。

根据《关于建信全球资源混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金于 2020 年 1 月 10 日转型,基金名称变更为“建信富时 100 指数型证券投资基金”。

《建信富时 100 指数型证券投资基金基金合同》、《建信富时 100 指数型证券投资基金托管协议》自 2020 年 1 月 10 日起生效,原《建信全球资源混合型证券投资基金基金合同》、《建信全球资源混合型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信全球资源混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具,包括股票和其他权益类证券、现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。其中,股票及其他权益类证券包括普通股、优先股、存托凭证、公募股票型基金等;现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工

具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具，中长期政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币市场基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券，以及中国证监会认可的金融衍生产品等。本基金为混合型基金，投资于股票的比例不低于基金资产的 60%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，股票资产中投资于资源类相关行业的比例不低于 80%。本基金的业绩比较基准为 $50\% \times \text{MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Energy Net Total Return Index)} + 50\% \times \text{MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Material Net Total Return Index)}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

根据《关于建信全球资源混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2020 年 1 月 10 日转型为建信富时 100 指数型证券投资基金，存续期不定，因此本基金本期财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2020 年 1 月 9 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日（基金合同失效前日）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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 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 2020 年 1 月 9 日
活期存款	1,572,705.99
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	1,572,705.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 1 月 9 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,363,335.33	18,838,928.12	2,475,592.79
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	1,768,551.45	2,179,927.62	411,376.17
其他	-	-	-
合计	18,131,886.78	21,018,855.74	2,886,968.96

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 2020 年 1 月 9 日
应收活期存款利息	246.27
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	—
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	—
应收出借证券利息	—
其他	—
合计	246.27

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 1 月 9 日
其他应收款	694,970.00
待摊费用	—
合计	694,970.00

6.4.7.7 应付交易费用

无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 1 月 9 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	835.86
应付证券出借违约金	—
预提费用	276,363.56
合计	277,199.42

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,371,623.48	25,371,623.48
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	-405,564.01	-405,564.01
- 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	24,966,059.47	24,966,059.47

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
上年度末	-2,718,129.60	625,831.36	-2,092,298.20
本期利润	-15,956.04	-218,937.49	-234,893.53
本期基金份额交易产生的变动数	43,510.42	-10,975.25	32,535.17
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	43,510.42	-10,975.25	32,535.17
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-2,690,575.22	395,918.62	-2,294,656.60

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日	
活期存款利息收入		139.64
定期存款利息收入		—
其他存款利息收入		—
结算备付金利息收入		—
其他		—
合计		139.64

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

无。

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日
股票投资产生的股利收益	6,970.81
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	6,970.81

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日
1. 交易性金融资产	-218,937.49
股票投资	-241,505.32
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	22,567.83

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	-218,937.49

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日
基金赎回费收入	278.69
合计	278.69

6.4.7.20 交易费用

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日
审计费用	1,106.55
信息披露费	2,458.98
证券出借违约金	-
银行划款手续费	70.00
合计	3,635.53

6.4.7.22 分部报告

无。

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、注册登记机构、基金销售机构
信安环球投资有限公司	境外投资顾问
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行（“布朗兄弟哈里曼银行”）	境外资产托管人
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、基金销售机构
中国华电集团资本控股有限公司	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
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：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

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,172.45	234,134.73
其中：支付销售机构的客户维护费	913.40	29,845.52

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 1.80%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的管理人报酬，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 = 估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 $\times$ 1.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,977.98	45,526.13

注：支付基金托管人中国银行的托管费按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 0.35%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的托管费，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 $\times$ 0.35% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2012 年 6 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	17,454,372.30	17,454,372.30
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	17,454,372.30	17,454,372.30
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	69.91%	61.01%

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 9 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	737,176.99	139.64	218,553.15	6,032.65
布朗兄弟哈里曼银行	835,529.00	-	4,682,529.03	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2020 年 1 月 9 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。基金管理人会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的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的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 2020 年 1 月 9 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,572,705.99	0.00			1,572,705.99
结算备付金					0.00
存出保证金					0.00
交易性金融资产				21,018,855.74	21,018,855.74
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				0.00	0.00
应收利息				246.27	246.27
应收股利				45,889.01	45,889.01
应收申购款					0.00
其他资产				694,970.00	694,970.00
资产总计	1,572,705.99	0.00	0.00	21,759,961.02	23,332,667.01
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				0.00	0.00
应付赎回款				371,914.29	371,914.29
应付管理人报酬				10,172.45	10,172.45
应付托管费				1,977.98	1,977.98
应付销售服务费					0.00
应付交易费用				0.00	0.00
应交税费					0.00
应付利息					0.00
应付利润					0.00
其他负债				277,199.42	277,199.42
负债总计	0.00	0.00	0.00	661,264.14	661,264.14
利率敏感度缺口	1,572,705.99	0.00	0.00	21,098,696.88	22,671,402.87
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,521,467.86	-	-	-	2,521,467.86
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	21,237,793.23	21,237,793.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	106.67	106.67
应收股利	-	-	-	43,496.80	43,496.80
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,521,467.86	-	-	21,281,396.70	23,802,864.56
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	181,168.91	181,168.91
应付管理人报酬	-	-	-	36,955.20	36,955.20
应付托管费	-	-	-	7,185.74	7,185.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-
------	---	---	---	---

项目	本期末 2020 年 1 月 9 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	836,331.13	-	-	836,331.13
交易性金融资产	18,533,370.90	2,485,484.84	-	21,018,855.74
应收股利	45,889.01	-	-	45,889.01
应收利息	11.68	-	-	11.68
其它资产	694,970.00	-	-	694,970.00
资产合计	20,110,572.72	2,485,484.84	-	22,596,057.56
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
其他负债	-	-	298,229.47	298,229.47
负债总计	-	-	523,539.32	523,539.32
利率敏感度缺口	2,521,467.86	-	20,757,857.38	23,279,325.24

注：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（上年末：同）。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

资产负债表外 汇风险敞口净 额	20,110,57 2.72	2,485,484.84	-	22,596,057.56
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	2,230,341 .71	-	-	2,230,341.71
交易性金融资 产	18,752,21 8.71	2,485,574.52	-	21,237,793.23
应收股利	43,496.80	-	-	43,496.80
应收利息	10.74	-	-	10.74
资产合计	21,026,06 7.96	2,485,574.52	-	23,511,642.48
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	21,026,06 7.96	2,485,574.52	-	23,511,642.48

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 1 月 9 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对人民 币贬值 5%	-1,129,802.88	-1,175,582.12
	所有外币相对人民 币升值 5%	1,129,802.88	1,175,582.12

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的股票，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。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 60%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，股票资产中投资于资源类相关行业的比例不低于 80%。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，及时可靠地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 2020 年 1 月 9 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	18,838,928.12	83.10	19,080,433.44	81.96
交易性金融资产—基金投资	2,179,927.62	9.62	2,157,359.79	9.27
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	21,018,855.74	92.71	21,237,793.23	91.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 1 月 9 日）	上年度末（2019 年 12 月）

			31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	1,055,354.29	1,093,277.17
	业绩比较基准下降 5%	-1,055,354.29	-1,093,277.17

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

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 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，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 1 月 9 日（基金合同失效前日），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人民币 21,018,855.74 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（于 2019 年 6 月 30 日，属于第一层次的余额为人民币 20,190,366.82 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元）。

6.4.14.1.2.2 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可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2 承诺事项

无。

§ 7 投资组合报告（转型后）

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	58,953,355.78	77.72
	其中：普通股	58,953,355.78	77.72
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	5,266,983.36	6.94
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	9,622,208.91	12.68
8	其他各项资产	2,014,036.20	2.66
9	合计	75,856,584.25	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
英国	58,953,355.78	81.39
合计	58,953,355.78	81.39

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
材料	6,419,496.31	8.86
必需消费品	14,082,089.65	19.44

非必需消费品	910,801.90	1.26
能源	8,435,096.59	11.65
金融	10,943,156.87	15.11
医疗保健	10,600,192.06	14.63
工业	4,004,003.09	5.53
电信服务	1,780,844.28	2.46
公用事业	1,777,675.03	2.45
合计	58,953,355.78	81.39

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

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	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	7,773.00	5,704,135.40	7.87
2	GLAXOSMITHKLINE PLC	葛兰素史克公司	GB0009252882	英国伦敦证券交易所	英国	29,557.00	4,215,415.49	5.82
3	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	GB0005405286	英国伦敦证券交易所	英国	119,626.00	3,946,786.97	5.45
4	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	英美烟草	GB0002875804	英国伦敦证券交易所	英国	13,592.00	3,677,159.94	5.08
5	DIAGEO PLC	帝亚吉欧	GB0002374006	英国伦敦证券交易所	英国	14,018.00	3,275,679.08	4.52
6	BP PLC	BP 公司	GB0007980591	英国伦敦证券交易所	英国	120,707.00	3,231,403.22	4.46
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	25,349.00	2,843,000.06	3.92

8	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	利洁时	GB00B24CGK77	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	4,202.00	2,721,442.98	3.76
9	RIO TINTO PLC	力拓公司	GB0007188757	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	6,694.00	2,653,622.47	3.66
10	UNILEVER PLC	联合利华	GB00B10RZP78	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	6,575.00	2,495,292.19	3.44
11	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	荷兰皇家壳 牌	GB00B03MM408	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	22,132.00	2,360,693.31	3.26
12	RELX PLC	励讯集团	GB00B2B0DG97	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	11,522.00	1,877,616.82	2.59
13	BHP GROUP PLC	必和必拓集 团公司	GB00BH0P3Z91	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	12,520.00	1,805,021.34	2.49
14	VODAFONE GROUP PLC	沃达丰	GB00BH4HKS39	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	158,588.00	1,780,844.28	2.46
15	NATIONAL GRID PLC	英国国家电 网	GB00BDR05C01	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	20,622.00	1,777,675.03	2.45
16	PRUDENTIAL PLC	保诚	GB0007099541	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	15,406.00	1,635,885.56	2.26
17	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	伦敦证券交 易所	GB00B0SWJX34	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	1,864.00	1,357,643.56	1.87
18	EXPERIAN PLC	益博睿有限 公司	GB00B19NLV48	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	5,401.00	1,326,803.91	1.83
19	TESCO PLC	特易购	GB0008847096	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	58,066.00	1,154,209.64	1.59
20	LLOYDS BANKING GROUP PLC	劳埃德银行 集团	GB0008706128	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	415,334.00	1,128,343.74	1.56
21	BARCLAYS PLC	巴克莱	GB0031348658	英国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	102,240.00	1,019,436.74	1.41
22	ANGLO	英美公司	GB00B1XZS820	英国 伦 敦	英国	6,150.00	1,001,878.01	1.38

	AMERICAN PLC			证 券 交 易 所				
23	GLENCORE PLC	嘉能可	JE00B4T3BW64	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	64,271.00	958,974.49	1.32
24	COMPASS GROUP PLC	金巴斯集团 公共有限公 司	GB00BD6K4575	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	9,399.00	910,801.90	1.26
25	BAE SYSTEMS PLC	英国宇航系 统	GB0002634946	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	18,981.00	799,582.36	1.10
26	IMPERIAL BRANDS PLC	帝国品牌公 共有限公司	GB0004544929	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	5,656.00	758,305.82	1.05
27	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	法通集团公 共有限公司	GB0005603997	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	35,369.00	680,857.12	0.94
28	SMITH & NEPHEW PLC	施乐辉	GB0009223206	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	5,188.00	680,641.17	0.94
29	STANDARD CHARTERED PLC	渣打集团	GB0004082847	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	16,173.00	620,268.07	0.86
30	AVIVA PLC	英杰华保险	GB0002162385	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	23,233.00	553,935.11	0.76

注：所有证券代码采用 ISIN 码。

7.4.2 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权益投资明细

无。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净 值比例(%)
1	ASTRAZENECA PLC	GB0009895292	5,653,194.23	7.80
2	HSBC HOLDINGS PLC	GB0005405286	5,130,809.58	7.08
3	GLAXOSMITHKLINE PLC	GB0009252882	4,465,620.68	6.16
4	BP PLC	GB0007980591	3,912,179.59	5.40
5	BRITISH AMERICAN	GB0002875804	3,848,368.68	5.31

	TOBACCO PLC			
6	DIAGEO PLC	GB0002374006	3,630,509.70	5.01
7	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	GB00B03MLX29	3,524,386.08	4.87
8	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	GB00B03MM408	3,014,417.19	4.16
9	UNILEVER PLC	GB00B10RZP78	2,607,290.37	3.60
10	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GB00B24CGK77	2,514,553.76	3.47
11	RIO TINTO PLC	GB0007188757	2,447,453.86	3.38
12	RELX PLC	GB00B2BODG97	1,996,549.15	2.76
13	VODAFONE GROUP PLC	GB00BH4HKS39	1,873,128.19	2.59
14	NATIONAL GRID PLC	GB00BDR05C01	1,850,702.71	2.55
15	PRUDENTIAL PLC	GB0007099541	1,673,686.90	2.31
16	BHP GROUP PLC	GB00BHOP3Z91	1,653,573.82	2.28
17	LLOYDS BANKING GROUP PLC	GB0008706128	1,461,876.51	2.02
18	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	GB00B0SWJX34	1,358,841.13	1.88
19	TESCO PLC	GB0008847096	1,290,047.86	1.78
20	EXPERIAN PLC	GB00B19NLV48	1,259,979.80	1.74

注：1、买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	ASIA CEMENT CHINA HOLDINGS	KYG0539C1069	1,148,975.57	1.59
2	EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	1,045,981.16	1.44
3	CHEVRON CORP	US1667641005	734,633.38	1.01
4	FORTESCUE METALS-SPON ADR	US34959A2069	712,424.92	0.98
5	MARATHON PETROLEUM CORP	US56585A1025	674,619.28	0.93
6	BP PLC-SPONS ADR	US0556221044	663,996.68	0.92
7	TOTAL SA-SPON ADR	US89151E1091	655,432.16	0.90
8	LUKOIL PJSC-SPON ADR	US69343P1057	626,410.58	0.86
9	ANGLO AMERICAN PLC-SPONS ADR	US03485P3001	617,887.29	0.85

10	RIO TINTO PLC-SPON ADR	US7672041008	614,401.51	0.85
11	BASF SE-SPON ADR	US0552625057	559,500.88	0.77
12	ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-B	US7802591070	522,773.64	0.72
13	LYONDELLBASELL INDU-CL A	NL0009434992	509,678.64	0.70
14	VALERO ENERGY CORP	US91913Y1001	475,757.77	0.66
15	ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-A	US7802592060	459,829.93	0.63
16	PACKAGING CORP OF AMERICA	US6951561090	451,096.64	0.62
17	VALE SA-SP ADR	US91912E1055	432,723.57	0.60
18	PPG INDUSTRIES INC	US6935061076	397,880.59	0.55
19	CANADIAN NATURAL RESOURCES	CA1363851017	373,581.43	0.52
20	ASTRAZENECA PLC	GB0009895292	366,148.32	0.51

注：1、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	64,165,947.21
卖出收入（成交）总额	20,820,958.17

注：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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 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。

7.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	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	5,266,983.36	7.27

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.11.3 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	应收证券清算款	—
3	应收股利	220,223.77
4	应收利息	487.11
5	应收申购款	1,793,325.32
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,014,036.20

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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。

§ 7 投资组合报告（转型前）

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	18,838,928.12	80.74
	其中：普通股	10,814,123.01	46.35
	存托凭证	8,024,805.11	34.39
	优先股	—	—
	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	其他各项资产	741,105.28	3.18
9	合计	23,332,667.01	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	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

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	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)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

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	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	5.30
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	卢克石油公	US69343P1057	美国证券	美国	877	638,256.56	2.82

	ADR	司		交易所				
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
11	BASF SE-SPON ADR	巴斯夫欧洲 公司	US0552625057	美国证券 交易所	美国	4,819	615,724.79	2.72
12	LYONDELLBASELL INDU-CL A	利安德巴塞 尔工业公司	NL0009434992	纽约证券 交易所	美国	890	560,196.55	2.47
13	ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-A	荷兰皇家壳 牌	US7802592060	纽约证券 交易所	美国	1,312	544,162.62	2.40
14	VALERO ENERGY CORP	Valero 能 源	US91913Y1001	纽约证券 交易所	美国	816	539,761.52	2.38
15	RIO TINTO PLC-SPON ADR	力拓公司	US7672041008	纽约证券 交易所	美国	1,225	496,245.07	2.19
16	PACKAGING CORP OF AMERICA	美国包装公 司	US6951561090	纽约证券 交易所	美国	653	476,642.33	2.10
17	VALE SA-SP ADR	淡水河谷公 司	US91912E1055	纽约证券 交易所	美国	5,107	461,042.61	2.03
18	PHILLIPS 66	Phillips 66	US7185461040	纽约证券 交易所	美国	587	430,874.03	1.90
19	PPG INDUSTRIES INC	PPG 工业	US6935061076	纽约证券 交易所	美国	479	428,297.08	1.89
20	CANADIAN NATURAL RESOURCES	加拿大自然 资源有限公 司	CA1363851017	纽约证券 交易所	美国	1,748	390,196.19	1.72
21	CELANESE CORP	塞拉尼斯公 司	US1508701034	纽约证券 交易所	美国	452	370,229.42	1.63
22	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	CNE1000004Q8	香港联合 交易所	中国 香港	58,000	370,053.49	1.63
23	REPSOL SA-SPONSORED ADR	雷普索尔股 份公司	US76026T2050	美国证券 交易所	美国	3,038	335,488.57	1.48
24	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	CNE1000002Q2	香港联合 交易所	中国 香港	78,000	332,469.10	1.47
25	WOODSIDE PETROLEUM-SP ADR	伍德赛德石 油有限公司	US9802283088	美国证券 交易所	美国	1,950	330,395.69	1.46
26	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	US26875P1012	纽约证券 交易所	美国	532	326,281.47	1.44
27	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	US20825C1045	纽约证券 交易所	美国	685	314,529.18	1.39
28	NIPPON STEEL CORP-SPON ADR	新日本制铁 株式会社	US65461T1016	美国证券 交易所	美国	3,008	313,779.51	1.38
29	TECK RESOURCES LTD-CLS B	加拿大泰克 资源有限公	CA8787422044	纽约证券 交易所	美国	2,849	308,677.25	1.36

		司						
30	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	CNE1000002N9	香港联合交易所	中国香港	38,000	305,607.78	1.35
31	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	CNE1000002R0	香港联合交易所	中国香港	20,500	299,692.21	1.32
32	NUCOR CORP	纽柯公司	US6703461052	纽约证券交易所	美国	757	281,459.38	1.24
33	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	US4601461035	纽约证券交易所	美国	888	272,217.53	1.20
34	VEDANTA LTD-ADR	韦丹塔有限公司	US92242Y1001	纽约证券交易所	美国	4,149	256,336.97	1.13
35	NEWCREST MINING LTD-SPON ADR	纽克雷斯特矿业有限公司	US6511911082	美国证券交易所	美国	1,546	227,670.37	1.00
36	EASTMAN CHEMICAL CO	伊士曼化工	US2774321002	纽约证券交易所	美国	418	218,947.94	0.97
37	ARCELORMITTAL-NY REGISTERED	安赛乐米塔尔	US03938L2034	纽约证券交易所	美国	1,867	218,500.51	0.96
38	WESTROCK CO	Westrock 公司	US96145D1054	纽约证券交易所	美国	656	194,076.77	0.86
39	MURPHY OIL CORP	墨菲石油公司	US6267171022	纽约证券交易所	美国	982	186,857.70	0.82
40	POSCO- SPON ADR	浦项制铁公司	US6934831099	纽约证券交易所	美国	519	183,663.06	0.81
41	METHANEX CORP	梅赛尼斯公司	CA59151K1084	纳斯达克证券交易所	美国	686	181,736.88	0.80
42	TECHNIPFMC PLC	TechnipFMC 公共有限公司	GB00BDSFG982	纽约证券交易所	美国	910	131,860.13	0.58
43	ALCOA CORP	美铝公司	US0138721065	纽约证券交易所	美国	447	61,540.08	0.27

注：所有证券代码采用 ISIN 码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

无。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

无。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

无。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 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。

7.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	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

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.11.3 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	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

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.11.6 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（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
建信富时 100 指数	5,744	10,933.72	17,454,372.30	27.79	45,348,934.50	72.21

(QDII)A						
建信富时 100 指数 (QDII)C	3,422	10,262.15	1,735,293.53	4.94	33,381,789.49	95.06
合计	9,166	10,683.00	19,189,665.83	19.60	78,730,723.99	80.40

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信富时 100 指数（QDII）A	286,671.79	0.46
	建信富时 100 指数（QDII）C	31,074.65	0.09
	合计	317,746.44	0.32

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 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（%）
1,291	19,338.54	17,454,372.30	69.91	7,511,687.17	30.09

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	49.02	0.00

8.3 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情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持

有本基金。

§ 9 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	62,167,631.18	51,178,819.08
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	24,330,383.85	16,061,736.06
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	62,803,306.80	35,117,083.02

注：申购含红利再投、转换入份额及金融，赎回含转换出份额及金额。

§ 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2012 年 6 月 26 日） 基金份额总额	498,237,044.50
本报告期期初基金份额总额	25,371,623.48
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	405,564.01
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	24,966,059.47

注：申购含红利再投、转换入份额及金融，赎回含转换出份额及金额。

§ 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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），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、基金业协会、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。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)**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	
MORGAN STANLEY -ASIA	-	7,672,099.52	9.03%	2,996.77	8.49%	-
JEFFERIES & CO., INC. -ALGORITHMS	-	-	-	950.96	2.69%	-
GOLDMAN SACH-ASIA	-	9,863,805.10	11.61%	3,760.53	10.66%	-

PROGRAM						
VIRTU AMERICAS LIC	-	3,557,512.46	4.19%	3,994.70	11.32%	-
MACQUARIE_ASIA ALGORITHMS	-	265,445.62	0.31%	79.63	0.23%	-
JP MORGAN-ASIA	-	12,275,435.83	14.45%	3,869.52	10.97%	-
SBSHASIAPR_E-CITIGROUP-ASIA PROGRAM	-	11,989,163.30	14.11%	3,743.45	10.61%	-
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA	-	3,381,350.88	3.98%	1,014.34	2.87%	-
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM	-	401,796.57	0.47%	361.66	1.02%	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM	-	2,659,594.62	3.13%	2,111.98	5.98%	-
CONVERGEX -ALGORITHMS	-	8,687,060.53	10.22%	2,606.43	7.39%	-
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM	-	2,827,096.55	3.33%	2,604.56	7.38%	-
SANFORD BERNSTEIN_ASIA	-	-	-	1,009.03	2.86%	-
ISI GROUP-PROGRAM	-	11,411,394.17	13.43%	2,850.69	8.08%	-
RBC CAPITAL MARKETS	-	2,598,804.44	3.06%	779.69	2.21%	-
EXANE BNP PARIBAS - ALGO	-	-	-	339.23	0.96%	-
ITG-ASIA	-	7,386,932.30	8.69%	2,215.57	6.28%	-

注：1、本基金管理人制定了服务券商的选择标准，具体如下：

- (1) 交易执行能力：能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等；
- (2) 研究支持服务：能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务，包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等；
- (3) 财务实力：净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列，或具有明显的安全边际；
- (4) 后台便利性和可靠性：交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

(5) 组织框架和业务构成: 具有战略规划和定位, 能够积极推动多边业务合作, 最大限度地调调整体资源, 为基金投资赢取机会;

(6) 其他有利于基金份额持有人利益的商业合作考虑。

海外投资部在根据以上标准进行评估后, 列出券商名单报海外投资决策委员会最终确定。

2、券商的服务评价

(1) 海外投资部每半年组织“服务总结”及评分。

(2) 若券商提供的研究报告及其他信息服务不符合要求, 经海外投资决策委员会批准, 公司将提前终止租用其交易席位。

3、本报告期内新增的服务券商 MORGAN STANLEY -ASIA、JEFFERIES & CO., INC.-ALGORITHMS、GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM、VIRTU AMERICAS LIC、MACQUARIE_ASIA ALOGRITHMS、JP MORGAN-ASIA、SBSHASIAPR_E-CITIGROUP-ASIA PROGRAM、BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA、CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM、UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM、CONVERGEX -ALGORITHMS、MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM、SANFORD BERNSTEIN_ASIA、ISI GROUP-PROGRAM、RBC CAPITAL MARKETS、EXANE BNP PARIBAS - ALGO、ITG-ASIA, 本报告期无剔除的服务券商。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
MORGAN STANLEY -ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO., INC.-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	1,056,677.75	14.84%
GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	684,077.29	9.61%
VIRTU AMERICAS LIC	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE_ASIA ALOGRITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
JP MORGAN-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-

SBSHASIAPR_E-CITIGROUP-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	310,775.15	4.36%
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM	-	-	-	-	-	-	1,334,368.59	18.74%
CONVERGEX -ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	1,482,936.45	20.83%
SANFORD BERNSTEIN-ASIA	-	-	-	-	-	-	1,121,143.28	15.74%
ISI GROUP-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS	-	-	-	-	-	-	-	-
EXANE BNP PARIBAS - ALGO	-	-	-	-	-	-	1,130,778.46	15.88%
ITG-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

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	
INSTINET CORP, ASIA-PROGRAM	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-
MAQUARIE-ASIA PROGRAMS	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM	-	-	-	-	-	-
SANFORD	-	-	-	-	-	-

BERNSTEIN-ASIA						
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA	-	-	-	-	-	-
BLOOMBERG TRADEBOOK-ASIA CREDIT	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC	-	-	-	-	-	-
CIMB-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP-ASIA ALGO	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP-PROGRAM	-	-	-	-	-	-
CONVERGEX-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC-ASIA	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE -ASIA	-	-	-	-	-	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
FIDELITY-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
FOX RIVER(SUNGARD)	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN	-	-	-	-	-	-

SACHS&CO., INC						
HOWARD WEIL LABOUISSIE FRIEDRICHS INC	—	—	—	—	—	—
HSBC INC	—	—	—	—	—	—
HSBC INC-ASIA	—	—	—	—	—	—
ING BANK	—	—	—	—	—	—
INSTINET CORP, ASIA	—	—	—	—	—	—
ISI GROUP -PROGRAM	—	—	—	—	—	—
ITG-ASIA	—	—	—	—	—	—
ITG-CSA	—	—	—	—	—	—
JEFFERIES & CO, INC-ASIA	—	—	—	—	—	—
JEFFERIES & CO., INC	—	—	—	—	—	—
JP MORGAN -ASIA PROGRAMS	—	—	—	—	—	—
JP MORGAN SECURITIES, INC	—	—	—	—	—	—
KNIGHT SECURITIES	—	—	—	—	—	—
LIQUIDNET	—	—	—	—	—	—
Longbow Securities, LLC	—	—	—	—	—	—
MACQUARIE CAPITAL	—	—	—	—	—	—
MACQUARIE CAPITAL-PROGRAM	—	—	—	—	—	—
MACQUARIE-ASIA ALGORITHMS	—	—	—	—	—	—
MERRILL LYNCH	—	—	—	—	—	—

MIZUHO	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
NOMURA-PROGRAMS	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
STEPHENS, INC.	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS -PROGRAM	-	-	-	-	-	-
UBS ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-
WELLS FARGO SECURITIES ,LLC	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人制定了服务券商的选择标准，具体如下：

- （1）交易执行能力：能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等；
- （2）研究支持服务：能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务，包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等；
- （3）财务实力：净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列，或具有明显的安全边际；
- （4）后台便利性和可靠性：交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；
- （5）组织框架和业务构成：具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调调整体资源，为基金投资赢取机会；
- （6）其他有利于基金份额持有人利益的商业合作考虑。

海外投资部在根据以上标准进行评估后并结合海外投资顾问提供的建议，列出券商名单报海

外投资决策委员会最终确定。

2、券商的服务评价

(1) 海外投资部每半年组织“服务总结”及评分。

(2) 若券商提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，经海外投资决策委员会批准，公司将提前终止租用其交易席位。

3、本报告期内无新增的服务券商，本报告期无剔除的服务券商。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比例
INSTINET CORP, ASIA-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
MAQUARIE-ASIA PROGRAMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
BLOOMBERG TRADEBOOK-ASIA CREDIT	-	-	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD	-	-	-	-	-	-	-	-

AND CO., INC								
CIMB-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP-ASIA ALGO	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
CONVERGEX-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE -ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDELITY-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
FOX RIVER (SUNGARD)	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS&CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
HOWARD WEIL LABOUISSSE FRIEDRICHS INC	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC INC	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-
INSTINET CORP, ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
ISI GROUP -PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-CSA	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO, INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
JP MORGAN -ASIA PROGRAMS	-	-	-	-	-	-	-	-
JP MORGAN SECURITIES, INC	-	-	-	-	-	-	-	-
KNIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-	-	-
Longbow SECURITIES, LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-

MACQUARIE CAPITAL-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE-ASIA ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA-PROGRAMS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
STEPHENS, INC.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS -PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-	-
WELLS FARGO SECURITIES, LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于建信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分证券投资基金基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-11
2	建信基金管理有限责任公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-10
3	建信基金管理有限责任公司关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-30
4	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加渤海银行基金申购、定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-26
5	建信基金管理有限责任公司更正公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-30
6	关于新增安信证券股份有限公司等两	指定报刊和/或公司网站	2020-04-25

	家机构为旗下部分开放式基金销售机构的公告		
7	建信基金管理有限责任公司更正公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-14
8	建信基金管理有限责任公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-08
9	建信富时 100 指数型证券投资基金开放日常申购（赎回、定期定额投资）业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-01-10

10.8 其他重大事件（转型前）

无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 06 月 09 日	17,454,372.30	—	—	17,454,372.30	17.83

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

12.3 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 8 月 28 日