

# 建信富时 100 指数型证券投资基金（QDII） 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 30 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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	44
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	45

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 .....	45
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	52
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	53
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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
7.11 投资组合报告附注 .....	54
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	56
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信富时 100 指数型证券投资基金 (QDII)	
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	103,368,146.46 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	73,970,717.26 份	29,397,429.20 份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 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
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
		许俊
		010-66594319
		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

项目		境外投资顾问	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

## 2.5 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	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
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

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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
-------------------	-------------------------------------

	建信富时 100 指数 (QDII) A	建信富时 100 指数 (QDII) C
本期已实现收益	1, 275, 839. 51	468, 655. 33
本期利润	6, 249, 292. 71	2, 557, 431. 47
加权平均基金份额本期利润	0. 0814	0. 0832
本期加权平均净值利润率	9. 98%	10. 22%
本期基金份额净值增长率	10. 76%	10. 57%
3. 1. 2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-11, 818, 001. 73	-4, 734, 009. 64
期末可供分配基金份额利润	-0. 1598	-0. 1610
期末基金资产净值	62, 152, 715. 53	24, 663, 419. 56
期末基金份额净值	0. 8402	0. 8390
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-7. 47%	-7. 40%

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

### 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	-0.87%	0.71%	-1.10%	0.73%	0.23%	-0.02%
过去三个月	4.14%	0.73%	3.60%	0.71%	0.54%	0.02%
过去六个月	10.76%	0.88%	9.09%	0.86%	1.67%	0.02%
过去一年	13.68%	1.10%	16.22%	1.08%	-2.54%	0.02%
自基金合同生效起至今	-7.47%	1.49%	-8.37%	1.61%	0.90%	-0.12%

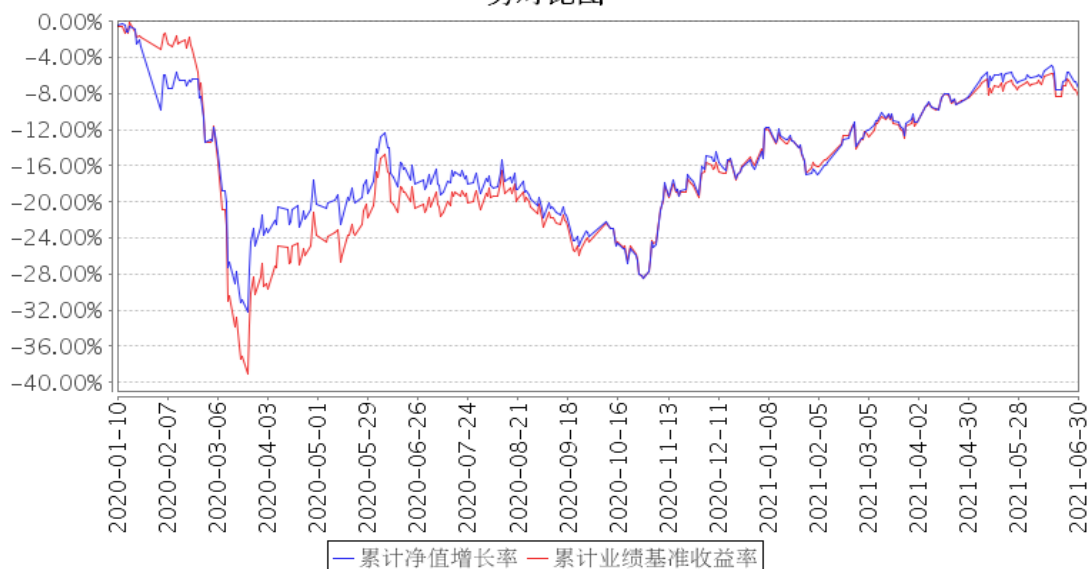
建信富时 100 指数 (QDII) C

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	-0.90%	0.71%	-1.10%	0.73%	0.20%	-0.02%
过去三个月	4.04%	0.73%	3.60%	0.71%	0.44%	0.02%
过去六个月	10.57%	0.88%	9.09%	0.86%	1.48%	0.02%
过去一年	13.26%	1.10%	16.22%	1.08%	-2.96%	0.02%
自基金合同生效起至今	-7.40%	1.50%	-7.89%	1.62%	0.49%	-0.12%

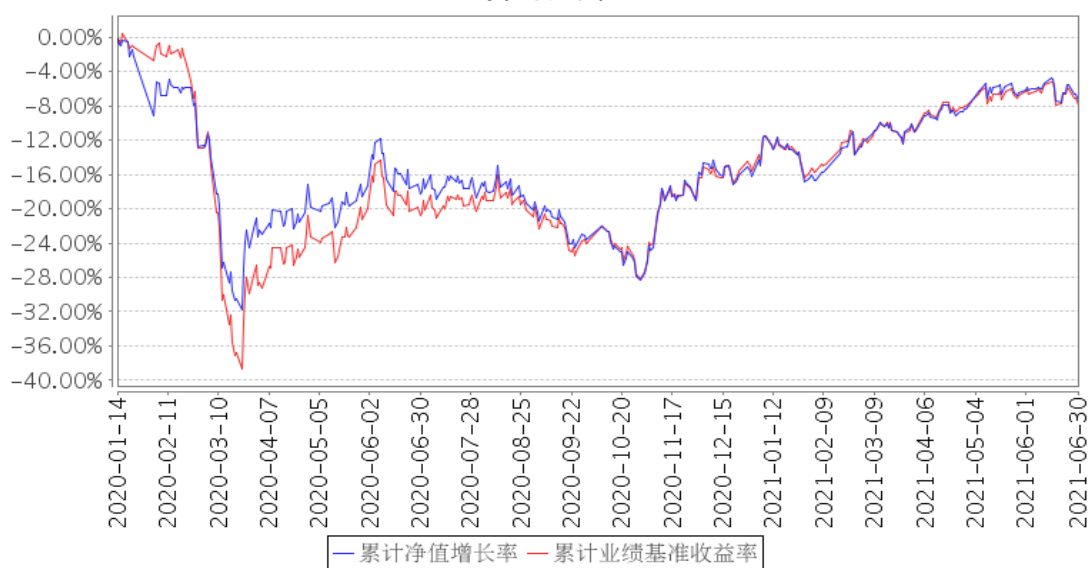


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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。

### 3.3 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、国际投资与业务发展部、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、证券公司客户部、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 2021 年 6 月 30 日，公司旗下有建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信利率债债券型证券投资基金基金、建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金、建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信恒久价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信环保产业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、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放

式指数证券投资基金联接基金、建信短债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、建信稳定得利债券型证券投资基金、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、建信多因子量化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、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、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、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数证券投资基金 (LOF)、建信优势动力混合型证券投资基金 (LOF)、建信周盈安心理财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、建信裕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、建信现金增利货币市场基金、建信睿享纯债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、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、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、建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人 (MOM) 证券投资基金、建信智能生活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)、建信安心回报 6 个月定期开放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、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、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、建信收益增强债券型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信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、建信中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、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发起式联接基金、建信臻选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、建信恒安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、建信高端医疗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、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金、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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信利率债策略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、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、建信高端装备股票型证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金(QDII)、建信新兴市场优选混合型证券投资基金(QDII)、建信富时 100 指数型证券投资基金(QDII)、建信中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、建信泓利一年持有期债券型证券投资基金、建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、建信裕丰利率债三个月定期开放债券型证券投资基金共计 135 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 5785.77 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

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	-	16 年	李博涵先生，国际投资与业务发展部总经理，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 日至 2021 年 8 月 9 日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。
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	2021 年 2 月 8 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。

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证券从业的含义遵从行业协会《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

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法

规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》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。

#### 4.3.2 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为富时 100 指数，基金业绩比较基准为：人民币计价的富时 100 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后收益率 $\times$ 5%。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，较好控制了基金年化跟踪误差和日均跟踪偏离度。报告期内，基金总规模较为稳定，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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 10.76%，波动率 0.88%，本报告期本基金 C 净值增长率 10.57%，波动率 0.88%；业绩比较基准收益率 9.09%，波动率 0.86%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年初以来，虽然屡遭新冠疫情反复的冲击，英国经济持续复苏。英国央行 5 月大幅上调经济增长预测，2021 年和 2022 年英国 GDP 预计将分别增长 7.25%和 5.75%。英国制造业 6 月 PMI 已经达到 63.90，服务业 PMI 达到 62.40，均为近年新高。货币政策上，英国央行维持 0.10%基准利率不变，并且维持 8,750 亿英镑资产购买规模和 200 亿英镑企业债购买规模不变。通胀方面，英国央行预计消费者价格指数(CPI)将在今年年底前暂时突破 2.5%，主要受大宗商品价格上涨的推动，但通胀将在明年回到 2%左右。随着通胀压力增大和经济前景改善，分析师预计英国央行加息时间将不早于 2023 年。富时 100 指数成份股中有很多跨国大型公司，且主要分布于金融、消费、周期等传统行业，企业利润多数来自海外，受益于全球宽松政策刺激下的经济复苏，企业利润将大幅改善。英国脱欧后，政治上的不确定消除，有利于海外资金继续投资英国市场。英镑与全球主要货币的汇率一直处于多年的振荡区间中，预计未来英镑仍将延续振荡和相对稳定的格局，汇率风险不大。相比处于历史高位的其它全球主要股指，富时 100 指数的总体估值处于历史中枢水平以下，在全球股市中有很大的估值优势，投资者可以积极配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

#### 4.8 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

无。

## § 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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信富时 100 指数型证券投资基金（QDII）



报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,891,593.40	5,989,487.33
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	81,439,511.57	79,844,643.44
其中：股票投资		81,377,943.84	79,788,083.35
基金投资		61,567.73	56,560.09
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	252.41	334.58
应收股利		290,775.86	378,819.04
应收申购款		434,456.36	857,028.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	116,010.76
资产总计		89,056,589.60	87,186,323.59
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,035,349.52	1,591,357.91
应付管理人报酬		58,711.46	59,413.32
应付托管费		18,347.33	18,566.67
应付销售服务费		8,239.20	9,273.48
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	119,807.00	301,971.95
负债合计		2,240,454.51	1,980,583.33
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	6.4.7.9	103,368,146.46	112,305,224.71
未分配利润	6.4.7.10	-16,552,011.37	-27,099,484.45
所有者权益合计		86,816,135.09	85,205,740.26
负债和所有者权益总计		89,056,589.60	87,186,323.59

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 103,368,146.46 份，其中建信富时 100 指数（QDII）A 基金份额总额 73,970,717.26 份，基金份额净值 0.8402 元；建信富时 100 指数（QDII）C 基金份额总额 29,397,429.20 份，基金份额净值 0.8390 元。

## 6.2 利润表

会计主体：建信富时 100 指数型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		9,537,171.07	-2,546,521.90
1. 利息收入		6,674.67	5,833.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,674.67	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）		2,472,757.10	1,938,769.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	479,174.81	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	1,993,582.29	650,629.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,062,229.34	-4,275,903.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-51,133.21	-264,245.92
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	46,643.17	49,025.54

减：二、费用		730,446.89	785,463.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	347,071.48	151,756.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	108,459.83	47,423.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	49,581.48	16,836.39
4. 交易费用	6.4.7.20	37,431.80	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	187,902.30	217,886.46
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		8,806,724.18	-3,331,985.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		8,806,724.18	-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(QDII)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	112,305,224.71	-27,099,484.45	85,205,740.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	8,806,724.18	8,806,724.18
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)	-8,937,078.25	1,740,748.90	-7,196,329.35
其中：1. 基金申购款	68,637,513.87	-12,992,400.91	55,645,112.96
2. 基金赎回款	-77,574,592.12	14,733,149.81	-62,841,442.31
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)	103,368,146.46	-16,552,011.37	86,816,135.09
项目	上年度可比期间 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(QDII)(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(QDII)”，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(QDII)份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2020 年 1 月 10 日起《建信富时 100 指数型证券投资基金(QDII)基金合同》《建信富时 100 指数型证券投资基金(QDII)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。本基金为契约型开放式，存续期限不定，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.)。

本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。在每一份额类别内，本基金根据申购、赎回所使用货币的不同，再分为人民币份额和美元现汇份额。

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(QDII)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。本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

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列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 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 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，以产生的利息及利息性质

的收入为销售额。

(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 2021年6月30日
活期存款	6,891,593.40
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	6,891,593.40

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	73,358,981.46	81,377,943.84	8,018,962.38
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	51,993.92	61,567.73	9,573.81
其他	-	-	-
合计	73,410,975.38	81,439,511.57	8,028,536.19

## 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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	252.41
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	252.41

## 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 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,873.72
应付证券出借违约金	-
预提费用	109,466.77
应付指数使用费用	6,466.51
合计	119,807.00

## 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	78,663,362.38	78,663,362.38
本期申购	44,618,200.69	44,618,200.69
本期赎回 (以“-”号填列)	-49,310,845.81	-49,310,845.81
-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	73,970,717.26	73,970,717.26

建信富时 100 指数 (QDII) C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	33,641,862.33	33,641,862.33
本期申购	24,019,313.18	24,019,313.18
本期赎回 (以“-”号填列)	-28,263,746.31	-28,263,746.31
-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	29,397,429.20	29,397,429.20

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。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信富时 100 指数 (QDII) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,505,431.39	-14,481,124.18	-18,986,555.57
本期利润	1,275,839.51	4,973,453.20	6,249,292.71
本期基金份额 交易产生的变 动数	218,805.17	700,455.96	919,261.13
其中：基金申 购款	-2,149,475.17	-6,316,577.82	-8,466,052.99
基金赎 回款	2,368,280.34	7,017,033.78	9,385,314.12
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-3,010,786.71	-8,807,215.02	-11,818,001.73

## 建信富时 100 指数 (QDII) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,895,653.06	-6,217,275.82	-8,112,928.88
本期利润	468,655.33	2,088,776.14	2,557,431.47
本期基金份额 交易产生的变 动数	212,927.09	608,560.68	821,487.77
其中：基金申 购款	-1,166,090.84	-3,360,257.08	-4,526,347.92
基金赎 回款	1,379,017.93	3,968,817.76	5,347,835.69
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-1,214,070.64	-3,519,939.00	-4,734,009.64

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,643.53
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	31.14
合计	6,674.67

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	479,174.81
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	479,174.81

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	13,303,205.25
减：卖出股票成本总额	12,824,030.44
买卖股票差价收入	479,174.81

##### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,992,342.95
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,239.34
合计	1,993,582.29

## 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,062,229.34
股票投资	7,057,221.70
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	5,007.64
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	7,062,229.34

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	46,643.17
合计	46,643.17

## 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

交易所市场交易费用	37,431.80
银行间市场交易费用	-
合计	37,431.80

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,036.89
指数使用费	119,398.64
合计	187,902.30

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	347,071.48	151,756.42
其中：支付销售机构的客户维护费	115,424.71	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 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	108,459.83	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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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) A	建信富时 100 指数 (QDII) C	合计
建信基金	-	145.75	145.75
中国建设银行	-	4,782.30	4,782.30
合计	-	4,928.05	4,928.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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) A	建信富时 100 指数 (QDII) C	合计



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：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
		建信富时 100 指数 (QDII) A
基金合同生效日 (2020 年 1 月 10 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	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	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.96%	-
项目	上年度可比期间 2020年1月10日(基金合同生效日)至2020年6月30日	上年度可比期间 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
布朗兄弟哈里曼银行	2,883,405.15	-	4,626,673.71	-
中国银行	4,008,188.25	6,643.53	4,995,535.20	5,785.19

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(2021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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,891,593.40	-	-	-	6,891,593.40
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	81,439,511.57	81,439,511.57
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	-	-	-	252.41	252.41
应收股利	-	-	-	290,775.86	290,775.86
应收申购款	-	-	-	434,456.36	434,456.36
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,891,593.40	-	-	82,164,996.20	89,056,589.60
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	-	-	-	2,035,349.52	2,035,349.52
应付管理人报酬	-	-	-	58,711.46	58,711.46
应付托管费	-	-	-	18,347.33	18,347.33
应付销售服务费	-	-	-	8,239.20	8,239.20
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	119,807.00	119,807.00
负债总计	-	-	-	2,240,454.51	2,240,454.51
利率敏感度缺口	6,891,593.40	-	-	79,924,541.69	86,816,135.09
上年度末 2020 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	5,989,487.33	-	-	-	5,989,487.33
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	79,844,643.44	79,844,643.44
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	-	-	-	334.58	334.58
应收股利	-	-	-	378,819.04	378,819.04
应收申购款	-	-	-	857,028.44	857,028.44
其他资产	-	-	-	116,010.76	116,010.76
资产总计	5,989,487.33	-	-	81,196,836.26	87,186,323.59
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	-	-	-	1,591,357.91	1,591,357.91
应付管理人报酬	-	-	-	59,413.32	59,413.32
应付托管费	-	-	-	18,566.67	18,566.67
应付销售服务费	-	-	-	9,273.48	9,273.48
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	301,971.95	301,971.95
负债总计	-	-	-	1,980,583.33	1,980,583.33
利率敏感度缺口	5,989,487.33	-	-	79,216,252.93	85,205,740.26

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

项目	本期末 2021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	5,100,081 .50	-	730.75	5,100,812.25
交易性金融资 产	-	-	81,439,511.57	81,439,511.57
应收股利	58,109.96	-	232,665.90	290,775.86
应收利息	1.74	-	-	1.74
资产合计	5,158,193 .20	-	81,672,908.22	86,831,101.42
以外币计价的 负债				
应付赎回款	62,892.17	-	-	62,892.17
其他负债	237.02	-	-	237.02
负债合计	63,129.19	-	-	63,129.19
资产负债表外 汇风险敞口净 额	5,095,064 .01	-	81,672,908.22	86,767,972.23



项目	上年度末 2020 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	4,267,245 .71	-	-	4,267,245.71
交易性金融资产	-	-	79,844,643.44	79,844,643.44
应收股利	45,394.58	-	333,424.46	378,819.04
应收利息	13.18	-	-	13.18
资产合计	4,312,653 .47	-	80,178,067.90	84,490,721.37
以外币计价的负债				
应付赎回款	658.17	-	-	658.17
其他负债	2.48	-	-	2.48
负债合计	660.65	-	-	660.65
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	4,311,992 .82	-	80,178,067.90	84,490,060.72

#### 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）		上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	本期末（2021 年 6 月 30 日）		
分析	所有外币相对人民币贬值 5%	-4,339,079.55	-4,224,503.04
	所有外币相对人民币升值 5%	4,339,079.55	4,224,503.04

### 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 2021年6月30日		上年度末 2020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	81,377,943.84	93.74	79,788,083.35	93.64
交易性金融资产—基金投资	61,567.73	0.07	56,560.09	0.07
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	81,439,511.57	93.81	79,844,643.44	93.71

## 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	4,351,349.82	-
	业绩比较基准下降 5%	-4,351,349.82	-

## 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 2021 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 81,439,511.57 元，无属于第二层次和第三层次的余额（2020 年 06 月 30 日：第一层次 64,220,339.14 元，无第二层次或第三层次）。

## 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。

#### 6.4.14.3 其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	81,377,943.84	91.38
	其中：普通股	81,377,943.84	91.38
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	61,567.73	0.07
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	6,891,593.40	7.74
8	其他各项资产	725,484.63	0.81
9	合计	89,056,589.60	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	81,377,943.84	93.74
合计	81,377,943.84	93.74

### 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(%)
房地产	-	-
信息技术	-	-
必需消费品	20,425,637.96	23.53
金融	13,712,571.63	15.79
医疗保健	11,328,366.99	13.05
材料	10,884,306.59	12.54
能源	10,707,809.37	12.33
工业	7,714,643.06	8.89
公用事业	2,937,278.18	3.38
电信服务	1,991,248.86	2.29
非必需消费品	1,661,153.22	1.91
合计	81,363,015.86	93.72

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

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	-	-
必需消费品	-	-
非必需消费品	-	-
能源	14,927.98	0.02
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	14,927.98	0.02

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

#### 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
----	----------	----------	------	--------	----------	-------	------	-----------

				场 地 区 )			(%)	
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	8,980	6,971,596.33	8.03
2	UNILEVER PLC	联合利华公 共有限公司	GB00B10RZP78	英国 伦敦证 券交易 所	英国	17,992	6,805,456.10	7.84
3	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	GB0005405286	英国 伦敦证 券交易 所	英国	139,361	5,199,669.40	5.99
4	DIAGEO PLC	帝亚吉欧	GB0002374006	英国 伦敦证 券交易 所	英国	15,996	4,949,930.37	5.70
5	GLAXOSMITHKLI NE PLC	葛兰素史克 公司	GB0009252882	英国 伦敦证 券	英国	34,330	4,356,770.66	5.02

				交易所				
6	RIO TINTO PLC	力拓公司	GB0007188757	英国伦敦证券交易所	英国	7,678	4,083,928.89	4.70
7	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	英美烟草	GB0002875804	英国伦敦证券交易所	英国	15,700	3,930,463.60	4.53
8	BP PLC	BP 公司	GB0007980591	英国伦敦证券交易所	英国	138,655	3,905,100.22	4.50
9	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	GB00B03MLX29	英国伦敦证券交易所	英国	28,064	3,630,313.78	4.18
10	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	荷兰皇家壳牌	GB00B03MM408	英国伦敦证券交易所	英国	25,362	3,172,395.37	3.65

				交易所				
1 1 1	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	利洁时	GB00B24CGK77	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	4,867	2,783,708.73	3.21
1 2	BHP GROUP PLC	必和必拓集 团公司	GB00BH0P3Z91	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	14,454	2,752,667.46	3.17
1 3	RELX PLC	励讯集团	GB00B2B0DG97	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	13,219	2,268,086.81	2.61
1 4	PRUDENTIAL PLC	保诚	GB0007099541	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	17,853	2,192,431.19	2.53
1 5	ANGLO AMERICAN PLC	英美公司	GB00B1XZS820	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	8,394	2,155,832.91	2.48



				交易所				
1 6	LLOYDS BANKING GROUP PLC	劳埃德银行 集团	GB0008706128	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	484,361	2,021,990.61	2.33
1 7	VODAFONE GROUP PLC	沃达丰	GB00BH4HKS39	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	183,542	1,991,248.86	2.29
1 8	NATIONAL GRID PLC	英国国家电 网	GB00BDR05C01	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	24,088	1,983,134.36	2.28
1 9	GLENCORE PLC	嘉能可	JE00B4T3BW64	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	68,378	1,891,877.33	2.18
2 0	BARCLAYS PLC	巴克莱	GB0031348658	英国 伦敦 证券	英国	118,700	1,816,090.91	2.09

				交易所				
2 1	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	12,207	1,661,153.22	1.91
2 2	EXPERIAN PLC	益博睿有限 公司	GB00B19NLV48	英国 伦敦证 券交易 所	英国	6,271	1,562,082.65	1.80
2 3	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	伦敦证券交 易所	GB00B0SWJX34	英国 伦敦证 券交易 所	英国	2,164	1,542,061.42	1.78
2 4	ASHTEAD GROUP PLC	Ashtead 集 团公共有限 公司	GB0000536739	英国 伦敦证 券交易 所	英国	3,074	1,474,275.77	1.70
2 5	FERGUSON PLC	Ferguson PLC	JE00BJVNSS43	英国 伦敦证 券	英国	1,539	1,382,900.00	1.59

				交易所				
2 6	TESCO PLC	特易购	GB00BLGZ9862	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	52,902	1,054,546.33	1.21
2 7	BAE SYSTEMS PLC	英国宇航系 统	GB0002634946	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	22,011	1,027,297.83	1.18
2 8	SSE PLC	苏格兰和南 部能源	GB0007908733	英国 伦敦 证券 交易 所	英国	7,112	954,143.82	1.10
2 9	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	40,827	940,328.10	1.08
3 0	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	6,476	901,532.83	1.04

				交易所				
--	--	--	--	-----	--	--	--	--

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

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	THUNGELA RESOURCES LTD	THUNGELA RESOURCES LTD	ZAE000296554	英国 伦敦 证 券 交 易 所	英国	839	14,927.98	0.02

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

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	占期初基金资产净 值比例 (%)
1	UNILEVER PLC	GB00B10RZP78	3,869,524.95	4.54
2	FERGUSON PLC	JE00BJVNSS43	1,211,302.39	1.42
3	ASHTREAD GROUP PLC	GB0000536739	1,050,663.82	1.23
4	SSE PLC	GB0007908733	976,922.38	1.15
5	ANGLO AMERICAN PLC	GB00B1XZS820	177,643.05	0.21
6	COMPASS GROUP PLC	GB00BD6K4575	70,612.64	0.08

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净
----	-----------	------	----------	----------

				值比例(%)
1	SMITH & NEPHEW PLC	GB0009223206	945,029.60	1.11
2	AVIVA PLC	GB0002162385	920,660.63	1.08
3	ASTRAZENECA PLC	GB0009895292	896,128.71	1.05
4	STANDARD CHARTERED PLC	GB0004082847	851,813.10	1.00
5	HSBC HOLDINGS PLC	GB0005405286	706,399.97	0.83
6	DIAGEO PLC	GB0002374006	699,949.69	0.82
7	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	GB00B03MLX29	696,454.69	0.82
8	RIO TINTO PLC	GB0007188757	618,920.15	0.73
9	GLAXOSMITHKLINE PLC	GB0009252882	596,654.79	0.70
10	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	GB0002875804	575,494.92	0.68
11	BP PLC	GB0007980591	556,571.49	0.65
12	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	GB00B03MM408	482,916.91	0.57
13	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GB00B24CGK77	407,496.18	0.48
14	BHP GROUP PLC	GB00BH0P3Z91	403,129.56	0.47
15	GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	388,200.78	0.46
16	UNILEVER PLC	GB00B10RZP78	384,664.69	0.45
17	RELX PLC	GB00B2B0DG97	342,353.51	0.40
18	PRUDENTIAL PLC	GB0007099541	317,015.51	0.37
19	VODAFONE GROUP PLC	GB00BH4HKS39	313,330.89	0.37
20	NATIONAL GRID PLC	GB00BDR05C01	256,784.54	0.30

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	7,356,669.23
卖出收入(成交)总额	13,303,205.25

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	BlackRock Inc	61,567.73	0.07

## 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	290,775.86
4	应收利息	252.41
5	应收申购款	434,456.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	725,484.63
---	----	------------

#### 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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(QDII)A	5,137	14,399.59	17,677,320.86	23.90	56,293,396.40	76.10
建信富时100指数(QDII)C	2,762	10,643.53	3,164,474.25	10.76	26,232,954.95	89.24
合计	7,899	13,086.23	20,841,795.11	20.16	82,526,351.35	79.84

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	79,861.62	0.11
	建信富时 100 指数 (QDII) C	13,836.50	0.05
	合计	93,698.12	0.09

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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信富时 100 指数 (QDII) A	建信富时 100 指数 (QDII) C
基金合同生效日 (2020 年 1 月 10 日) 基金份额总额	24,966,059.47	-
本报告期期初基金份额总额	78,663,362.38	33,641,862.33
本报告期基金总申购份额	44,618,200.69	24,019,313.18
减：本报告期基金总赎回份额	49,310,845.81	28,263,746.31
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	73,970,717.26	29,397,429.20

## § 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

### 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	
JP MORGAN-ASIA	-	14,748,232.24	71.40%	4,425.17	71.39%	-
MAQUARIE -EURO PROGRAMS	-	5,907,650.95	28.60%	1,773.14	28.61%	-
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA	-	-	-	-	-	-

CONVERGEX -ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-
EXANE BNP PARIBAS - ALGO	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-
ISI GROUP-PROGRAM	-	-	-	-	-	-
ITG-ASIA	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO., INC.-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE_ASIA ALOGRITHMS	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY -ASIA	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN_ASIA	-	-	-	-	-	-
SBSHASIAPR_E-CITIGROUP-ASIA PROGRA M	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM	-	-	-	-	-	-
VIRTU AMERICAS LIC	-	-	-	-	-	-

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，最大限度地调动整体资源，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、本报告期内新增的服务券商 MAQUARIE -EURO PROGRAMS，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
JP MORGAN-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
MAQUARIE -EURO PROGRAMS	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
CONVERGEX -ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
EXANE BNP PARIBAS - ALGO	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
ISI GROUP-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO., INC.-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE_ASIA ALOGRITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY -ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN_ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SBSHASIAPR_E-CITIGROUP-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
VIRTU AMERICAS LIC	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信基金管理有限责任公司关于增加宜信普泽（北京）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	2021-06-03
2	建信富时 100 指数型证券投资基金（QDII）基金经理变更公告	指定报刊和/或公司网站	2021-02-09
3	关于新增华鑫证券为旗下开放式基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-01-20
4	关于增加深圳市前海排排网基金销售有限责任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	2021-01-15
5	关于增加华金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-01-12

## § 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

无。

### 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

2021 年 8 月 30 日