

## 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

2018年年度报告摘要

基金管理人:建信基金管理有限责任公司  
基金托管人:中国国际金融股份有限公司  
送出日期:2019年3月26日

## § 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月22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。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年5月16日起至2018年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称		建信MSCI联接
基金代码	000629	612100
基金运作方式	契约型开放式	契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2018年5月16日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国国际金融股份有限公司	不定期
报告期末基金份额总额	99,238,506.64份	
基金合同存续期间的基金简称	建信MSCI联接A	建信MSCI联接C
下属分级基金的基金代码	000629	000630
报告期末下属分级基金的份额总额	88,507,159.26份	13,731,437.38份

## 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称		建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	612100	
基金运作方式	契约型开放式	契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2018年4月19日	
基金的上市交易场所	上海证券交易所	
上市日期	2018年6月1日	
基金管理人名称	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人名称	中国国际金融股份有限公司	

## 2.2 基金产品说明

投资目标		通过主要投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
本基金为契约型开放式基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的权重比例进行投资组合,并根据成份股的调整而进行相应调整,以确保本基金尽可能地跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。	本基金主要投资于目标ETF,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF,本基金不参与目标ETF的投资操作。	
业绩比较基准	MSCI中国A股国际通交易型开放式指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为被动型指数基金,其投资目标是紧密地跟踪标的指数,其风险与预期风险调整后的收益水平相当。MSCI中国A股国际通指数,其风险与预期风险调整后的收益水平相当。本基金为被动型指数基金,风险与市场上基金、股票型基金与债券型基金的市场表现,属于风险收益特征的市场组合的风险收益特征相当。	

## 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标		紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
本基金为契约型开放式基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的权重比例进行投资组合,并根据成份股的调整而进行相应调整,以确保本基金尽可能地跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。	本基金主要投资于目标ETF,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF,本基金不参与目标ETF的投资操作。	
业绩比较基准	MSCI中国A股国际通交易型开放式指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为被动型指数基金,其投资目标是紧密地跟踪标的指数,其风险与预期风险调整后的收益水平相当。MSCI中国A股国际通指数,其风险与预期风险调整后的收益水平相当。本基金为被动型指数基金,风险与市场上基金、股票型基金与债券型基金的市场表现,属于风险收益特征的市场组合的风险收益特征相当。	

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露负责人	姓名:吴国明 联系电话:010-60228898 电子邮箱:ximip@jxfund.com.cn	姓名:张智 联系电话:010-6006166-1563 电子邮箱:zhangz@cmcb.com
客户服务电话	400-01-00323 010-60229900	400-01-00323 010-60229900
传真	010-60229973	010-60229973

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.crbfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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		2018年5月16日(基金合同生效日) -2018年12月31日	2017年	2016年
本期已实现收益		-390,100.83	-90,131.51	-
本期利润		-8,006,650.81	-1,263,717.99	-
期末基金资产净值		-0.0952	-0.0966	-
期末基金份额净值		-0.93%	-0.97%	-
3.1.2期末数据和指标	2018年末		2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0933	-0.0967	-	-
期末基金资产净值	77,526,978.40	12,416,878.07	-	-
期末基金份额净值	0.0907	0.0943	-	-

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金基金合同于2018年5月16日生效,截至报告期末未满一年。

## 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MSCI联接C

阶段	份额净值增长 率(%)	份额净值 增长率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	-8.6%	1.14%	-10.84%	1.55%	2.08%	-0.41%
过去六个月	-8.4%	0.96%	-12.32%	1.42%	3.98%	-0.46%
自基金合同生效起至今	-9.3%	0.85%	-22.09%	1.35%	12.76%	-0.50%

本基金的业绩比较基准为:MSCI中国A股国际通指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

3.2.2 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

阶段	份额净值 增长(%)	份额净值 增长(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	-8.6%	1.14%	-10.84%	1.55%	2.08%	-0.41%
过去六个月	-8.4%	0.96%	-12.32%	1.42%	3.98%	-0.46%
自基金合同生效起至今	-9.3%	0.85%	-22.09%	1.35%	12.76%	-0.50%

本基金的业绩比较基准为:MSCI中国A股国际通指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

3.2.3 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长(%)	份额净值 增长(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	-8.6%	1.14%	-10.84%	1.55%	2.08%	-0.41%
过去六个月	-8.4%	0.96%	-12.32%	1.42%	3.98%	-0.46%
自基金合同生效起至今	-9.3%	0.85%	-22.09%	1.35%	12.76%	-0.50%

本基金的业绩比较基准为:MSCI中国A股国际通指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

3.2.4 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

阶段	份额净值 增长(%)	份额净值 增长(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	-					