建信纳斯达克100指数型证券投资基金（QDII）
2026年第3季度报告

2026年9月30日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信纳斯达克100指数（QDII）
基金主代码	539001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年9月22日
报告期末基金份额总额	1,965,376,910.87份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

	在正常市场情况下，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%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。		
业绩比较基准	经汇率调整的纳斯达克100指数收益率*95% +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。本基金投资于境外证券，需承担汇率风险以及境外市场的风险。		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	建信纳斯达克100指数（QDII）A	建信纳斯达克100指数（QDII）C	建信纳斯达克100指数（QDII）D
下属分级基金的交易代码	539001	012752	023422
报告期末下属分级基金的份额总额	1,239,955,702.37份	691,781,302.32份	33,639,906.18份
境外资产托管人	英文名称：Brown Brothers Harriman & Co.		
	中文名称：布朗兄弟哈里曼银行		

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026年7月1日-2026年9月30日）		
	建信纳斯达克100指数（QDII）A	建信纳斯达克100指数（QDII）C	建信纳斯达克100指数（QDII）D
1.本期已实现收	-4,098,022.39	-3,646,889.12	-165,922.92

益			
2.本期利润	49,977,913.11	17,714,987.78	1,480,009.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0501	0.0317	0.0568
4.期末基金资产净值	4,374,353,271.19	2,360,824,872.38	115,346,292.42
5.期末基金份额净值	3.5278	3.4127	3.4289

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信纳斯达克100指数（QDII）A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.52%	1.13%	-0.62%	1.17%	0.10%	-0.04%
过去六个月	23.01%	1.30%	23.39%	1.33%	-0.38%	-0.03%
过去一年	14.79%	1.21%	16.02%	1.24%	-1.23%	-0.03%
过去三年	88.18%	1.28%	88.19%	1.27%	-0.01%	0.01%
过去五年	108.44%	1.40%	108.35%	1.40%	0.09%	0.00%
自基金合同生效起至今	107.51%	1.40%	104.88%	1.41%	2.63%	-0.01%

建信纳斯达克100指数（QDII）C

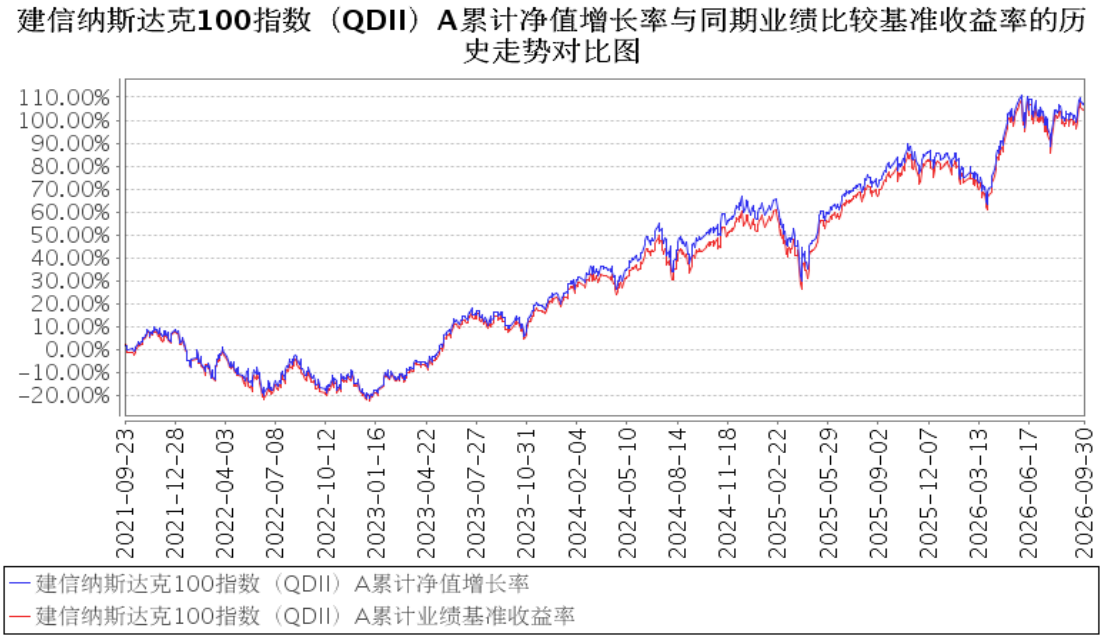
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.60%	1.13%	-0.62%	1.17%	0.02%	-0.04%
过去六个月	22.83%	1.30%	23.39%	1.33%	-0.56%	-0.03%
过去一年	14.45%	1.21%	16.02%	1.24%	-1.57%	-0.03%
过去三年	86.47%	1.28%	88.19%	1.27%	-1.72%	0.01%
自基金合同生效起至今	97.37%	1.40%	103.76%	1.41%	-6.39%	-0.01%

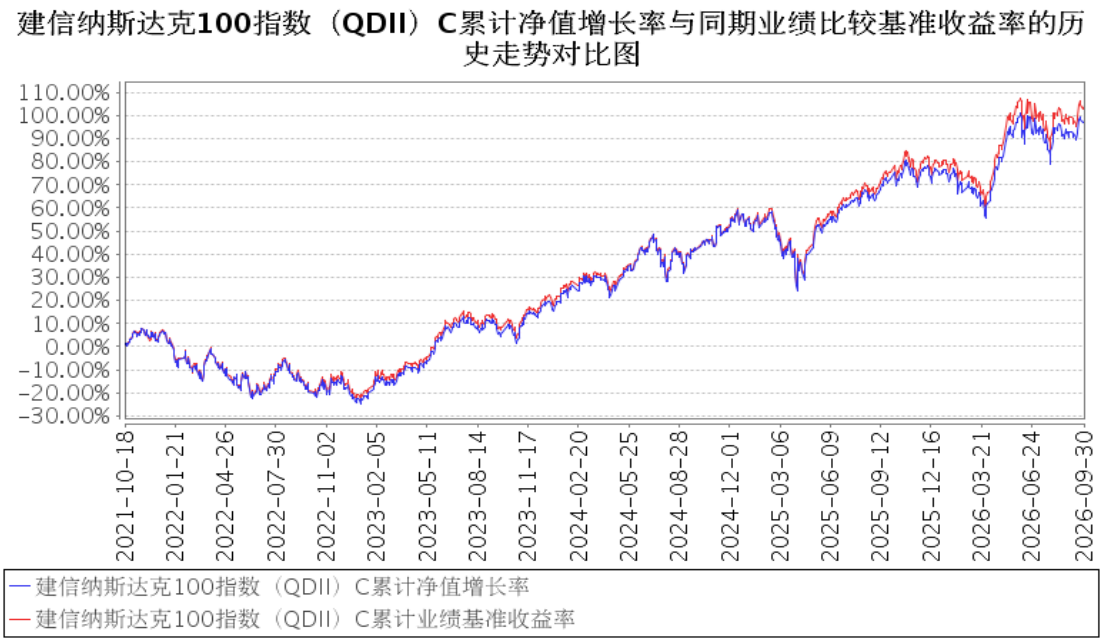
建信纳斯达克100指数（QDII）D

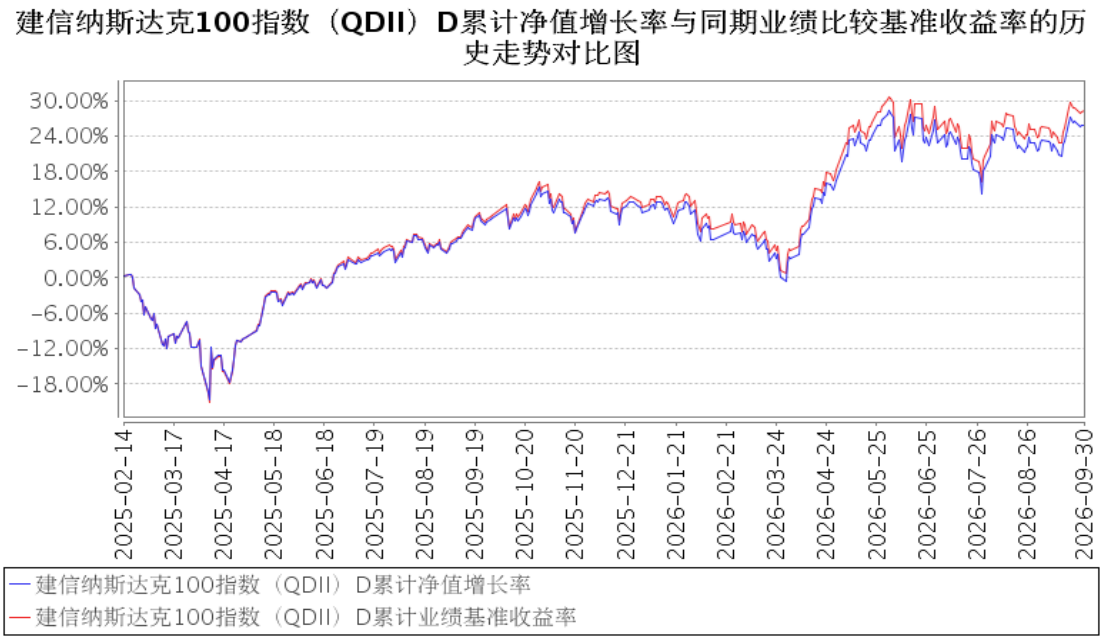
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④

				④		
过去三个月	-0.60%	1.13%	-0.62%	1.17%	0.02%	-0.04%
过去六个月	22.83%	1.30%	23.39%	1.33%	-0.56%	-0.03%
过去一年	14.45%	1.21%	16.02%	1.24%	-1.57%	-0.03%
自基金合同生效起至今	25.93%	1.36%	28.23%	1.39%	-2.30%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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







注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李博涵	国际投资与业务发展部副总经理，本基金的基金经理	2021 年 9 月 22 日	2026 年 7 月 28 日	21	李博涵先生，国际投资与业务发展部副总经理，硕士，加拿大籍华人。曾就职于美国联邦快递北京分公司、美国联合航空公司北京分公司、美国万事达卡国际组织北京分公司。曾任加拿大蒙特利尔银行全球资本市场投资助理、加拿大帝国商业银行全球资本市场投资顾问。2008 年 8 月加入建信基金，历任海外投资部高级研究员兼基金经理助理、基金经理、副总经理、总经理等职务。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，该基金于 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），李博涵自 2020 年 1 月 10 日至 2026 年 7 月 28 日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的基金经理，该基金于 2021 年 9 月 22 日起转型为建信纳斯达克 100 指数型证券投资基金（QDII），李博涵自 2021 年 9 月 22 日至 2026 年 7 月 28 日担任该基金的基金经理；2017 年

					11月13日起任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	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2021年9月22日	-	15	朱金钰先生，数量投资部副总经理，博士。2008年7月至2010年10月任Mapleridge Capital公司量化策略师；2011年6月至2014年11月任中信证券股份有限公司投资经理。2014年11月加入建信基金管理有限责任公司，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。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联接基金的基金经理；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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2021年2月8日起任建信富时100指数型证券投资基金（QDII）的基金经理；2021年9月22日起任建信纳斯达克100指数型证券投资基金（QDII）的基金经理。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
朱金钰	公募基金	6	20,420,752,642.13	2019年12月13日
	私募资产管理计划	1	9,610,844.05	2025年5月21日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	20,430,363,486.18	-

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信纳斯达克100指数型证券投资基金（QDII）基金合同》的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

受中东地缘局势影响，2026 年三季度 10 年期美债收益率较二季度大幅上涨 85BP，收于 5.29%，美元指数上涨 0.28%至 101.47，纳斯达克 100 指数收于 30408.5，较二季度小幅上涨 0.44%。如果原油价格处于高位且持续时间足够长，全球将面临通胀上行以及货币政策不得不趋紧的环境，未来美国经济衰退的可能增大，美国市场投资者的风险偏好会受到不利影响，预计将给纳斯达克 100 指数带来压力。另一方面，随着新一代人工智能技术的突破并向应用端扩散，以纳斯达克 100 指数为代表的科技股或将迎来中长期慢牛行情。　　报告期内，管理人较好地控制了基金年化跟踪误差和日均跟踪偏离度。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。

本报告期本基金 A 净值增长率-0.52%，波动率 1.13%，业绩比较基准收益率-0.62%，波动率 1.17%。本报告期本基金 C 净值增长率-0.60%，波动率 1.13%，业绩比较基准收益率-0.62%，波动率 1.17%。本报告期本基金 D 净值增长率-0.60%，波动率 1.13%，业绩比较基准收益率-0.62%，波

动率1.17%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,076,990,733.11	88.24
	其中：普通股	5,987,182,920.50	86.94
	优先股	-	-
	存托凭证	89,807,812.61	1.30
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
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	757,242,777.30	11.00
8	其他资产	52,685,590.20	0.77
9	合计	6,886,919,100.61	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	6,076,990,733.11	88.71
合计	6,076,990,733.11	88.71

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
材料	57,811,206.35	0.84

必需消费品	346,120,115.27	5.05
非必需消费品	623,835,473.68	9.11
能源	27,967,552.73	0.41
金融	12,205,566.91	0.18
医疗保健	212,627,447.26	3.10
工业	178,717,319.63	2.61
房地产	-	-
信息技术	3,706,316,816.24	54.10
电信服务	847,738,928.28	12.37
公用事业	63,650,306.76	0.93
合计	6,076,990,733.11	88.71

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

5.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	NVIDIA Corp	英伟达公司	US67066G1040	纳斯达克证券交易所	美国	342,849	527,357,350.85	7.70
2	Apple Inc	苹果公司	US0378331005	纳斯达克证券交易所	美国	208,079	466,705,175.33	6.81
3	Microsoft Corp	微软公司	US5949181045	纳斯达克证券交易所	美国	105,241	363,547,961.25	5.31
4	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	US5951121038	纳斯达克证券交易所	美国	44,107	316,406,961.48	4.62
5	Advanced Micro Devices Inc	AMD公司	US0079031078	纳斯达克证券交易所	美国	63,777	262,778,126.62	3.84
6	Amazon.com Inc	亚马逊公司	US0231351067	纳斯达克证券交易所	美国	152,398	255,731,489.05	3.73

7	Meta Platforms Inc	Meta平台股份有限公司	US30303M1027	纳斯达克证券交易所	美国	41,953	204,905,156.84	2.99
8	Alphabet Inc	Alphabet股份有限公司	US02079K3059	纳斯达克证券交易所	美国	82,510	191,209,763.79	2.79
9	Alphabet Inc	Alphabet股份有限公司	US02079K1079	纳斯达克证券交易所	美国	77,296	177,387,979.72	2.59
10	Tesla Inc	特斯拉公司	US88160R1014	纳斯达克证券交易所	美国	70,773	169,124,881.45	2.47

注：所用证券代码采用ISIN码。

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

无。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	期股指货	NASDAQ 100 E-MINI Dec26	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益。本报告期末基金投资的期货持仓和损益明细为：NASDAQ 100 E-MINI Dec26 买入持仓35.00手，合约市值人民币144,731,405.78元，公允价值变动人民币4,191,825.21元。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	13,994,493.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,189,884.46
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,501,211.88
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	52,685,590.20

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信纳斯达克100	建信纳斯达克	建信纳斯达克

	指数（QDII）A	100指数（QDII）C	100指数(QDII)D
报告期期初基金份额总额	613,692,135.08	375,238,084.48	14,953,264.55
报告期期间基金总申购份额	685,065,074.42	378,194,982.45	22,470,384.90
减:报告期期间基金总赎回份额	58,801,507.13	61,651,764.61	3,783,743.27
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	1,239,955,702.37	691,781,302.32	33,639,906.18

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信纳斯达克100指数型证券投资基金（QDII）设立的文件；

2、《建信纳斯达克100指数型证券投资基金（QDII）基金合同》；

3、《建信纳斯达克100指数型证券投资基金（QDII）招募说明书》；

4、《建信纳斯达克100指数型证券投资基金（QDII）托管协议》；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2026年10月26日