

# 深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资 资基金 2017 年半年度报告

2017 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。本半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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 2017 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 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 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                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 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 | 14        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 14        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 39        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 39        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 41        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 45        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 45        |
| 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 45        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 45        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 45        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 45        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 45        |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 46        |

|                                    |           |
|------------------------------------|-----------|
| <b>§8 基金份额持有人信息</b>                | <b>48</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构              | 48        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人                   | 48        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况           | 49        |
| 8.4 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的情况  | 49        |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b>                | <b>50</b> |
| <b>§10 重大事件揭示</b>                  | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                   | 51        |
| 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   | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼        | 51        |
| 10.4 基金投资策略的改变                     | 51        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况              | 51        |
| 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      | 51        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况             | 51        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b>          | <b>52</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 | 52        |
| <b>§12 备查文件目录</b>                  | <b>54</b> |
| 12.1 备查文件目录                        | 54        |
| 12.2 存放地点                          | 54        |
| 12.3 查阅方式                          | 54        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 深 F60ETF                |
| 场内简称         | 深 F60                   |
| 基金主代码        | 159916                  |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                  |
| 基金合同生效日      | 2011 年 9 月 8 日          |
| 基金管理人        | 建信基金管理有限责任公司            |
| 基金托管人        | 中国民生银行股份有限公司            |
| 报告期末基金份额总额   | 33,566,039.00 份         |
| 基金合同存续期      | 不定期                     |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                 |
| 上市日期         | 2011 年 10 月 24 日        |

### 2.2 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最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。                                                    |
| 投资策略   | 本基金主要采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构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票及其权重的变动进行相应调整。                  |
| 业绩比较基准 | 深证基本面 60 指数收益率                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。 |

### 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              | 中国民生银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吴曙明                       | 罗菲菲                   |
|         | 联系电话 | 010-66228888              | 010-58560666          |
|         | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn      | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-81-95533 010-66228000 | 95568                 |
| 传真      |      | 010-66228001              | 010-58560798          |
| 注册地址    |      | 北京市西城区金融大街 7 号            | 北京市西城区复兴门内大街          |

|       |                                 |                     |
|-------|---------------------------------|---------------------|
|       | 英蓝国际金融中心 16 层                   | 2 号                 |
| 办公地址  | 北京市西城区金融大街 7 号<br>英蓝国际金融中心 16 层 | 北京市西城区复兴门内大街<br>2 号 |
| 邮政编码  | 100033                          | 100031              |
| 法定代表人 | 许会斌                             | 洪崎                  |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                                           |
|----------------------|-----------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》                                    |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所                                            |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址                             |
|--------|----------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 中国北京西城区金融大街 27 号投<br>资广场 22-23 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 7,784,964.71                           |
| 本期利润          | 23,022,170.45                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.6305                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | 21.81%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 24.20%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配利润      | 47,947,237.46                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 1.4284                                 |
| 期末基金资产净值      | 109,555,299.60                         |
| 期末基金份额净值      | 3.2639                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )                |
| 基金份额累计净值增长率   | 77.83%                                 |

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（不含公允价值变动损益）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损益。

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、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）。

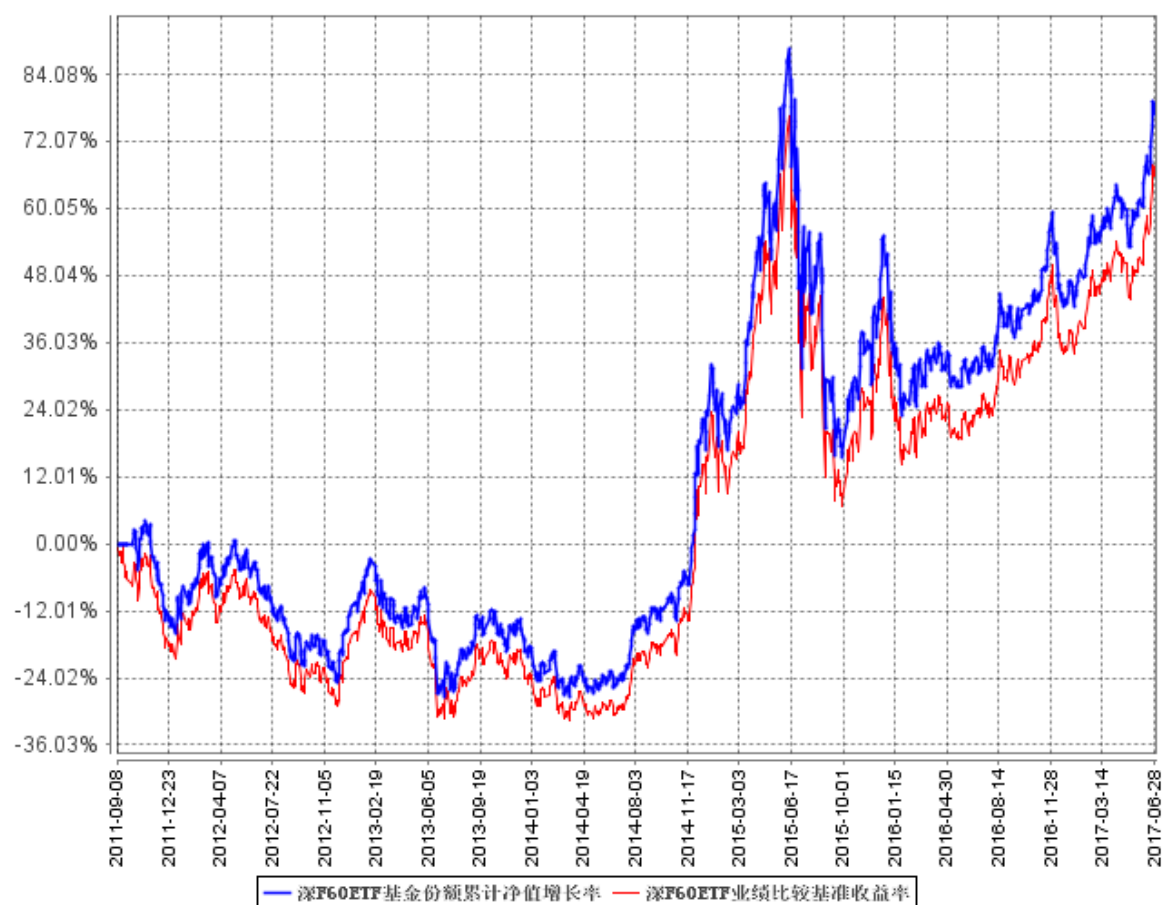
## 3.2 基金净值表现

### 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

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去一个月          | 9.95%        | 1.01%               | 9.99%              | 1.04%                 | -0.04% | -0.03% |
| 过去三个月          | 12.72%       | 0.95%               | 12.28%             | 0.96%                 | 0.44%  | -0.01% |
| 过去六个月          | 24.20%       | 0.88%               | 23.73%             | 0.89%                 | 0.47%  | -0.01% |
| 过去一年           | 33.50%       | 0.95%               | 34.83%             | 0.96%                 | -1.33% | -0.01% |
| 过去三年           | 134.06%      | 1.78%               | 135.15%            | 1.80%                 | -1.09% | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 77.83%       | 1.58%               | 66.49%             | 1.61%                 | 11.34% | -0.03% |

### 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

深F60ETF基金份额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



本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。



## §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的 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、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部，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、南京五个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。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“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2017 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、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、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、建信全球资源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、建信安心保本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、建信安心回报两年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、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、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、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、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、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期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、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号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、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、建信丰裕定增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、建信恒丰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、建信鑫悦回报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，共计 87 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 3,439.09 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 |        |                       |
| 路龙凯 | 本基金 | 2016 年 4 月      | -    | 7      | 硕士。2008 年 8 月至 2011 年 |

|  |           |      |  |  |                                                                                                                                                                                                                                |
|--|-----------|------|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 的基金<br>经理 | 11 日 |  |  | 11 月在中国人民健康保险股份有限公司从事保险精算工作，历任主办、主管；2011 年 11 月至 2012 年 4 月在中诚信国际信用评级有限公司工作，任结构融资分析师；2012 年 5 月至 2015 年 4 月在泰达宏利基金管理有限责任公司工作，历任初级研究员、研究员、投资经理；2015 年 4 月加入建信基金管理公司金融工程及指数投资部，任基金经理助理，2016 年 4 月 11 日起任深证基本面 60ETF 及其联接基金的基金经理。 |
|--|-----------|------|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》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 1 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 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

在报告期间，本基金一直保持高仓位运作。本基金管理人根据基金合同规定，采取了对指数的被动复制策略，将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

在报告期内，本基金跟踪误差的主要来源有以下几个方面：

由于指数成分股调整导致基金持仓与指数权重较大偏离。指数成分股调整后，非指数成分股长期停牌，导致基金持仓组合无法及时作出相应调整。同时基金遇到的大额赎回、指数成分股分红对跟踪误差有一定影响。

本基金管理人在量化分析基础上，采取了适当的组合调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 24.2%，波动率 0.88%，业绩比较基准收益率 23.73%，波动率 0.89%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2017 年上半年，A 股市场在经历了金融去杠杆、A 股加入 MSCI、欧洲诸国大选、外围资本市场走势向好的情况下，出现了一波结构性机会。在大消费、银行及非银行等股票的带动下，成长白马股表现较好，受此影响，本基金的表现也较好。展望 2017 年下半年，预计经济仍将在底部徘徊，党的十九大会议、中央经济工作会议和国企改革进一步推进等事件将有可能给市场带来阶段性影响，指数将维持震荡向上格局。

本基金管理人将根据基金合同，以量化分析研究为基础，克服各种因素的不利影响，不断优化和改进量化模型，将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

#### 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[2008]38 号文《关于进一步规范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。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及内控合规总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、内控合规人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，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。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，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）。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值价格，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）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

本报告期内本基金未实施利润分配,符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

### §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,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,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基金托管人应尽的义务。

#### 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,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内,本基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 1,346,463.11                   | 1,355,057.86                     |
| 结算备付金           |            | 24,995.16                      | 2,740.11                         |
| 存出保证金           |            | 2,234.95                       | 3,546.05                         |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 108,518,862.75                 | 95,220,555.15                    |
| 其中：股票投资         |            | 108,518,862.75                 | 95,220,555.15                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 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         |            | 111,345.34                     | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 334.14                         | 343.93                           |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 110,004,235.45                 | 96,582,243.10                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 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           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 45,695.46                      | 42,312.45                        |
| 应付托管费           |            | 9,139.10                       | 8,462.47                         |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 40,872.73                      | 35,171.48                        |

|               |          |                |               |
|---------------|----------|----------------|---------------|
| 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  | 353,228.56     | 404,519.65    |
| 负债合计          |          | 448,935.85     | 490,466.05    |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 61,608,062.14  | 67,114,347.42 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 47,947,237.46  | 28,977,429.63 |
| 所有者权益合计       |          | 109,555,299.60 | 96,091,777.05 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 110,004,235.45 | 96,582,243.10 |

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.2639 元，基金份额总额 33,566,039.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 23,710,525.44                            | -9,715,977.14                                 |
| 1.利息收入                |            | 6,078.50                                 | 10,321.42                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 6,078.50                                 | 10,321.42                                     |
| 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            |            | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 8,466,179.20                             | -2,773,673.56                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 7,463,806.25                             | -3,463,260.82                                 |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 1,002,372.95                             | 689,587.26                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 15,237,205.74                            | -6,948,828.00                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 1,062.00                                 | -3,797.00                                     |



|                            |            |               |                |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| 列)                         |            |               |                |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 688,354.99    | 610,931.05     |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 260,944.03    | 214,100.65     |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 52,188.90     | 42,820.14      |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -             | -              |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 66,895.79     | 45,126.62      |
| 5. 利息支出                    |            | -             | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | -              |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 308,326.27    | 308,883.64     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 23,022,170.45 | -10,326,908.19 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 23,022,170.45 | -10,326,908.19 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                        | 67,114,347.42                         | 28,977,429.63  | 96,091,777.05  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 23,022,170.45  | 23,022,170.45  |
| 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）      | -5,506,285.28                         | -4,052,362.62  | -9,558,647.90  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 10,094,856.35                         | 7,357,501.35   | 17,452,357.70  |
| 2. 基金赎回款                               | -15,601,141.63                        | -11,409,863.97 | -27,011,005.60 |
| 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）                        | 61,608,062.14                         | 47,947,237.46  | 109,555,299.60 |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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<br>(基金净值)                    | 62,525,776.34                              | 31,169,322.22  | 93,695,098.56  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | -10,326,908.19 | -10,326,908.19 |
| 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)      | 2,753,142.64                               | 833,917.93     | 3,587,060.57   |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 7,341,713.69                               | 2,304,690.60   | 9,646,404.29   |
| 2. 基金赎回款                               | -4,588,571.05                              | -1,470,772.67  | -6,059,343.72  |
| 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<br>(基金净值)                    | 65,278,918.98                              | 21,676,331.96  | 86,955,250.94  |

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:

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>孙志晨</u> | <u>吴曙明</u> | <u>丁颖</u> |
| 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

深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金(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[2011]第 1092 号《关于核准深证基本面 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》和《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 389,202,212.00 元(含募集股票市值),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(2011)第 340 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《深证基本面

60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 389,232,036.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 29,824.00 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，基金管理人建信基金管理有限责任公司确定 2011 年 10 月 12 日为本基金的基金份额折算日。当日深证基本面 60 指数收盘值为 3,728.224 点，基金资产净值为 395,318,115.60 元，折算前基金份额总额为 389,232,036.00 份，折算前基金份额净值为 1.0156 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.54483643，折算后基金份额总额为 212,066,039.00 份，折算后基金份额净值为 1.8641 元。建信基金管理有限责任公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2011 年 10 月 13 日进行了变更登记。经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2011]第 317 号文审核同意，本基金于 2011 年 10 月 24 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数深证基本面 60 指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益；主要投资范围为标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为深证基本面 60 指数。

本基金的基金管理人建信管理有限责任公司以本基金为目标 ETF，募集成立了建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“建信深证基本面 60ETF 联接”）。建信深证基本面 60ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,346,463.11           |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计：            | 1,346,463.11           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 90,538,018.21          | 108,518,862.75 | 17,980,844.54 |
| 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            | —                      | —              | —             |
| 其他            | —                      | —              | —             |

|    |               |                |               |
|----|---------------|----------------|---------------|
| 合计 | 90,538,018.21 | 108,518,862.75 | 17,980,844.54 |
|----|---------------|----------------|---------------|

股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 320.43                 |
| 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  | 12.71                  |
| 应收债券利息     | —                      |
| 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 | —                      |
| 其他         | 1.00                   |
| 合计         | 334.14                 |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 40,872.73              |
| 银行间市场应付交易费用 | —                      |
| 合计          | 40,872.73              |

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | —                      |
| 预提费用        | 352,790.92             |
| 可退替代款       | 437.64                 |
| 合计          | 353,228.56             |

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 36,566,039.00                         | 67,114,347.42  |
| 本期申购          | 5,500,000.00                          | 10,094,856.35  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -8,500,000.00                         | -15,601,141.63 |
| - 基金拆分/份额折算前  | —                                     | —              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | —                                     | —              |
| 本期申购          | —                                     | —              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | —                                     | —              |
| 本期末           | 33,566,039.00                         | 61,608,062.14  |

## 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           | 51,769,105.68  | -22,791,676.05 | 28,977,429.63  |
| 本期利润           | 7,784,964.71   | 15,237,205.74  | 23,022,170.45  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,309,847.92  | 257,485.30     | -4,052,362.62  |
| 其中：基金申购款       | 8,607,833.63   | -1,250,332.28  | 7,357,501.35   |
| 基金赎回款          | -12,917,681.55 | 1,507,817.58   | -11,409,863.97 |
| 本期已分配利润        | —              | —              | —              |
| 本期末            | 55,244,222.47  | -7,296,985.01  | 47,947,237.46  |

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 5,917.48                              |
| 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 | 140.98                                |
| 其他        | 20.04                                 |
| 合计        | 6,078.50                              |

**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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 3,153,905.32                          |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 4,309,900.93                          |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                                     |
| 合计               | 7,463,806.25                          |

**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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 22,125,955.77                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 18,972,050.45                         |
| 买卖股票差价收入   | 3,153,905.32                          |

**6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 27,011,005.60                         |
| 减：现金支付赎回款总额 | 892,702.60                            |
| 减：赎回股票成本总额  | 21,808,402.07                         |



|        |              |
|--------|--------------|
| 赎回差价收入 | 4,309,900.93 |
|--------|--------------|

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金无申购差价收入。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资-赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资-申购差价收入。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期未投资贵金属。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未投资贵金属。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未投资贵金属。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期末投资衍生工具。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,002,372.95                          |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     |
| 合计          | 1,002,372.95                          |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 15,237,205.74                         |
| ——股票投资     | 15,237,205.74                         |
| ——债券投资     | -                                     |
| ——资产支持证券投资 | -                                     |
| ——贵金属投资    | -                                     |
| ——其他       | -                                     |
| 2. 衍生工具    | -                                     |
| ——权证投资     | -                                     |
| 3. 其他      | -                                     |
| 合计         | 15,237,205.74                         |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                     |
| 替代损益收入  | 1,062.00                              |
| 合计      | 1,062.00                              |

替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 66,895.79                             |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 66,895.79                             |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 29,752.78                             |
| 信息披露费   | 148,765.71                            |
| 上市费     | 29,752.78                             |
| 指数使用费   | 100,000.00                            |
| 银行划款手续费 | 55.00                                 |
| 合计      | 308,326.27                            |

指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，本期按前一日基金资产净值的

0.10%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币 50,000.00 元。

### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人

购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## 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            |
| 中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）                              | 基金托管人            |
| 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         |
| 美国信安金融服务公司                                          | 基金管理人的股东         |
| 中国华电集团资本控股有限公司                                      | 基金管理人的股东         |
| 建信资本管理有限责任公司                                        | 基金管理人的子公司        |
| 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（“建信深证基本面 60ETF 联接基金”） | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

**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**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

**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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月<br>30 日 |
|-----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 260,944.03                               | 214,100.65                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | —                                        | —                                             |

支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月<br>30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 52,188.90                                | 42,820.14                                     |

支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 X 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称                      | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |                              | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |                              |
|----------------------------|------------------------|------------------------------|--------------------------|------------------------------|
|                            | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金<br>份额<br>占基金总份<br>额的比例 |
| 建信深证基本<br>面 60ETF 联接<br>基金 | 32,500,000.00          | 96.82%                       | 35,500,000.00            | 97.08%                       |

#### 6.4.10.5 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<br>名称 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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    |
| 中国民生银行    | 1,346,463.11                          | 5,917.48 | 2,469,812.54                               | 10,030.06 |

本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |                 |        |       |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|-----------------|-----------------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 可流通日            | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 002882               | 金龙羽  | 2017 年 6 月 15 日 | 2017 年 7 月 17 日 | 新发未上市  | 6.20  | 6.20   | 2,966    | 18,389.20 | 18,389.20 | -  |
| 300670               | 大烨智能 | 2017 年 6 月 26 日 | 2017 年 7 月 3 日  | 新发未上市  | 10.93 | 10.93  | 1,259    | 13,760.87 | 13,760.87 | -  |
| 300672               | 国科微  | 2017 年 6 月 30 日 | 2017 年 7 月 12 日 | 新发未上市  | 8.48  | 8.48   | 1,257    | 10,659.36 | 10,659.36 | -  |

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期   | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期   | 复牌开盘单价 | 数量（股）   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|--------|------|--------|--------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 000100 | TCL  | 2017 年 | 重大事  | 3.43   | 2017 年 | 3.72   | 656,440 | 2,211,461.49 | 2,251,589.20 | -  |

|        | 集团   | 4 月 21 日        | 项      |      | 7 月 26 日        |      |         |            |              |   |
|--------|------|-----------------|--------|------|-----------------|------|---------|------------|--------------|---|
| 000656 | 金科股份 | 2017 年 5 月 5 日  | 重大资产重组 | 6.54 | 2017 年 7 月 5 日  | 5.92 | 241,500 | 982,572.66 | 1,579,410.00 | - |
| 002128 | 露天煤业 | 2017 年 3 月 17 日 | 重大资产重组 | 8.70 | 2017 年 8 月 14 日 | 6.57 | 56,989  | 484,006.73 | 495,804.30   | - |

本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后经交易所批准复牌。

### 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

至本报告期末，本基金银行间市场无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易，故未存在作为抵押的债券。

### 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、央行票据和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 按长期信用评级列示的债券投资**

无

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无

#### 6.4.13.4 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<br>2017 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                     | 1,346,463.11 | -     | -     | -              | 1,346,463.11   |
| 结算备付金                    | 24,995.16    | -     | -     | -              | 24,995.16      |
| 存出保证金                    | 2,234.95     | -     | -     | -              | 2,234.95       |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 108,518,862.75 | 108,518,862.75 |
| 应收证券清算款                  | -            | -     | -     | 111,345.34     | 111,345.34     |
| 应收利息                     | -            | -     | -     | 334.14         | 334.14         |
| 资产总计                     | 1,373,693.22 | 0.00  | 0.00  | 108,630,542.23 | 110,004,235.45 |
| 负债                       |              |       |       |                |                |
| 应付证券清算款                  | -            | -     | -     | 437.64         | 437.64         |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 45,695.46      | 45,695.46      |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 9,139.10       | 9,139.10       |
| 应付交易费用                   | -            | -     | -     | 40,872.73      | 40,872.73      |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 352,790.92     | 352,790.92     |
| 负债总计                     | 0.00         | 0.00  | 0.00  | 448,935.85     | 448,935.85     |
| 利率敏感度缺口                  | 1,373,693.22 | 0.00  | 0.00  | 108,181,606.38 | 109,555,299.60 |
| 上年度末<br>2016 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                     | 1,355,057.86 | -     | -     | -              | 1,355,057.86   |

|           |              |      |      |               |               |
|-----------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 结算备付金     | 2,740.11     | -    | -    | -             | 2,740.11      |
| 存出保证金     | 3,546.05     | -    | -    | -             | 3,546.05      |
| 交易性金融资产   | -            | -    | -    | 95,220,555.15 | 95,220,555.15 |
| 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      | -            | -    | -    | 343.93        | 343.93        |
| 应收股利      | -            | -    | -    | -             | -             |
| 应收申购款     | -            | -    | -    | -             | -             |
| 其他资产      | -            | -    | -    | -             | -             |
| 资产总计      | 1,361,344.02 | 0.00 | 0.00 | 95,220,899.08 | 96,582,243.10 |
| 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     | -            | -    | -    | -             | -             |
| 应付管理人报酬   | -            | -    | -    | 42,312.45     | 42,312.45     |
| 应付托管费     | -            | -    | -    | 8,462.47      | 8,462.47      |
| 应付销售服务费   | -            | -    | -    | -             | -             |
| 应付交易费用    | -            | -    | -    | 35,171.48     | 35,171.48     |
| 应交税费      | -            | -    | -    | -             | -             |
| 应付利息      | -            | -    | -    | -             | -             |
| 应付利润      | -            | -    | -    | -             | -             |
| 其他负债      | -            | -    | -    | 404,519.65    | 404,519.65    |
| 负债总计      | 0.00         | 0.00 | 0.00 | 490,466.05    | 490,466.05    |
| 利率敏感度缺口   | 1,361,344.02 | 0.00 | 0.00 | 94,730,433.03 | 96,091,777.05 |

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 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。

本基金采用完全复制法，跟踪深证基本面 60 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。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<br>2017 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2016 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  | 108,518,862.75         | 99.05         | 95,220,555.15            | 99.09         |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —             | —                        | —             |
| 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            | 108,518,862.75         | 99.05         | 95,220,555.15            | 99.09         |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 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（2017 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2016 年 12 月 31 日） |
|    |           |                             |                        |

|  |             |               |               |
|--|-------------|---------------|---------------|
|  | 业绩比较基准上升 5% | 5,370,685.96  | 4,694,800.93  |
|  | 业绩比较基准下降 5% | -5,370,685.96 | -4,694,800.93 |

#### 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

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 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 104,149,249.82 元，属于第二层次的余额为 4,369,612.93 元，无属于第三层次的余额(2016 年 6 月 30 日：第一层次 60,995,227.18 元，第二层次 23,961,912.87 元，无第三层次)。

##### (ii) 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，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 6 月 30 日：同)。

##### (d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

## (2) 基金申购款

于 2017 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 17,452,357.70 元(2016 年上半年：9,646,404.29 元)，其中包括以股票支付的申购款 16,919,353.00 元(2016 年上半年：7,387,545.00 元)和以现金支付的申购款 533,004.70 元(2016 年上半年：2,258,859.29 元)。

## (3) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## §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              | 108,518,862.75 | 98.65         |
|    | 其中：股票             | 108,518,862.75 | 98.65         |
| 2  | 固定收益投资            | —              | —             |
|    | 其中：债券             | —              | —             |
|    | 资产支持证券            | —              | —             |
| 3  | 贵金属投资             | —              | —             |
| 4  | 金融衍生品投资           | —              | —             |
| 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  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,371,458.27   | 1.25          |
| 7  | 其他各项资产            | 113,914.43     | 0.10          |
| 8  | 合计                | 110,004,235.45 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,196,796.80  | 2.01          |
| B  | 采矿业              | 1,473,160.33  | 1.34          |
| C  | 制造业              | 63,797,708.28 | 58.23         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,285,477.84  | 1.17          |
| E  | 建筑业              | 1,139,280.00  | 1.04          |
| F  | 批发和零售业           | 3,460,248.50  | 3.16          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —             | —             |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —             | —             |
| J  | 金融业              | 14,954,118.16 | 13.65         |
| K  | 房地产业             | 17,483,453.97 | 15.96         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 508,788.00     | 0.46  |
| M | 科学研究和技术服务业    | —              | —     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,681,217.14   | 1.53  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | —              | —     |
| P | 教育            | —              | —     |
| Q | 卫生和社会工作       | —              | —     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | —              | —     |
| S | 综合            | —              | —     |
|   | 合计            | 107,980,249.02 | 98.56 |

1、合计项不含可退替代款估值增值。

2、以上行业分类以 2017 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —          | —            |
| B  | 采掘业              | 495,804.30 | 0.45         |
| C  | 制造业              | 42,809.43  | 0.04         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —          | —            |
| E  | 建筑业              | —          | —            |
| F  | 批发和零售业           | —          | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —          | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —          | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —          | —            |
| J  | 金融业              | —          | —            |
| K  | 房地产业             | —          | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —          | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —          | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —          | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —          | —            |
| P  | 教育               | —          | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —          | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —          | —            |
| S  | 综合               | —          | —            |
|    | 合计               | 538,613.73 | 0.49         |



以上行业分类以 2017 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 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股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 000651 | 格力电器   | 304,662 | 12,542,934.54 | 11.45        |
| 2  | 000002 | 万 科 A  | 468,203 | 11,691,028.91 | 10.67        |
| 3  | 000333 | 美的集团   | 191,006 | 8,220,898.24  | 7.50         |
| 4  | 000001 | 平安银行   | 653,949 | 6,140,581.11  | 5.61         |
| 5  | 000858 | 五 粮 液  | 68,891  | 3,834,473.06  | 3.50         |
| 6  | 000338 | 潍柴动力   | 219,686 | 2,899,855.20  | 2.65         |
| 7  | 000725 | 京东方 A  | 677,399 | 2,817,979.84  | 2.57         |
| 8  | 000776 | 广发证券   | 154,288 | 2,661,468.00  | 2.43         |
| 9  | 000100 | TCL 集团 | 656,440 | 2,251,589.20  | 2.06         |
| 10 | 002142 | 宁波银行   | 114,664 | 2,213,015.20  | 2.02         |
| 11 | 300498 | 温氏股份   | 93,720  | 2,196,796.80  | 2.01         |
| 12 | 000063 | 中兴通讯   | 86,363  | 2,050,257.62  | 1.87         |
| 13 | 002304 | 洋河股份   | 23,167  | 2,011,127.27  | 1.84         |
| 14 | 000157 | 中联重科   | 438,402 | 1,968,424.98  | 1.80         |
| 15 | 000895 | 双汇发展   | 81,499  | 1,935,601.25  | 1.77         |
| 16 | 002024 | 苏宁云商   | 171,450 | 1,928,812.50  | 1.76         |
| 17 | 000625 | 长安汽车   | 128,758 | 1,856,690.36  | 1.69         |
| 18 | 000069 | 华侨城 A  | 167,119 | 1,681,217.14  | 1.53         |
| 19 | 000568 | 泸州老窖   | 33,060  | 1,672,174.80  | 1.53         |
| 20 | 000876 | 新 希 望  | 197,470 | 1,623,203.40  | 1.48         |
| 21 | 000656 | 金科股份   | 241,500 | 1,579,410.00  | 1.44         |
| 22 | 000709 | 河钢股份   | 373,737 | 1,565,958.03  | 1.43         |
| 23 | 000630 | 铜陵有色   | 540,675 | 1,535,517.00  | 1.40         |
| 24 | 002415 | 海康威视   | 46,461  | 1,500,690.30  | 1.37         |
| 25 | 001979 | 招商蛇口   | 69,335  | 1,480,995.60  | 1.35         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 26 | 000825 | 太钢不锈 | 298,136 | 1,296,891.60 | 1.18 |
| 27 | 002736 | 国信证券 | 96,061  | 1,272,808.25 | 1.16 |
| 28 | 000783 | 长江证券 | 122,594 | 1,160,965.18 | 1.06 |
| 29 | 002202 | 金风科技 | 72,501  | 1,121,590.47 | 1.02 |
| 30 | 000066 | 中国长城 | 121,967 | 1,098,922.67 | 1.00 |
| 31 | 000778 | 新兴铸管 | 163,007 | 1,092,146.90 | 1.00 |
| 32 | 000039 | 中集集团 | 55,869  | 1,007,318.07 | 0.92 |
| 33 | 000402 | 金融街  | 85,490  | 1,001,942.80 | 0.91 |
| 34 | 000983 | 西山煤电 | 112,168 | 983,713.36   | 0.90 |
| 35 | 000423 | 东阿阿胶 | 13,600  | 977,704.00   | 0.89 |
| 36 | 000425 | 徐工机械 | 251,127 | 941,726.25   | 0.86 |
| 37 | 000538 | 云南白药 | 9,963   | 935,027.55   | 0.85 |
| 38 | 000878 | 云南铜业 | 68,873  | 908,434.87   | 0.83 |
| 39 | 000166 | 申万宏源 | 161,371 | 903,677.60   | 0.82 |
| 40 | 000540 | 中天金融 | 127,200 | 884,040.00   | 0.81 |
| 41 | 002146 | 荣盛发展 | 85,718  | 846,036.66   | 0.77 |
| 42 | 000898 | 鞍钢股份 | 144,600 | 818,436.00   | 0.75 |
| 43 | 002081 | 金螳螂  | 69,200  | 759,816.00   | 0.69 |
| 44 | 000059 | 华锦股份 | 75,200  | 752,752.00   | 0.69 |
| 45 | 000543 | 皖能电力 | 127,048 | 740,689.84   | 0.68 |
| 46 | 000792 | 盐湖股份 | 66,439  | 694,287.55   | 0.63 |
| 47 | 000963 | 华东医药 | 12,600  | 626,220.00   | 0.57 |
| 48 | 002594 | 比亚迪  | 12,405  | 619,629.75   | 0.57 |
| 49 | 000728 | 国元证券 | 49,231  | 601,602.82   | 0.55 |
| 50 | 000600 | 建投能源 | 44,400  | 544,788.00   | 0.50 |
| 51 | 000937 | 冀中能源 | 86,970  | 532,256.40   | 0.49 |
| 52 | 000415 | 渤海金控 | 75,600  | 508,788.00   | 0.46 |
| 53 | 002419 | 天虹股份 | 33,200  | 477,416.00   | 0.44 |
| 54 | 000626 | 远大控股 | 23,000  | 427,800.00   | 0.39 |
| 55 | 000703 | 恒逸石化 | 28,457  | 405,227.68   | 0.37 |
| 56 | 000961 | 中南建设 | 58,200  | 379,464.00   | 0.35 |
| 57 | 000959 | 首钢股份 | 54,000  | 377,460.00   | 0.34 |
| 58 | 300433 | 蓝思科技 | 7,560   | 219,920.40   | 0.20 |
| 59 | 000761 | 本钢板材 | 29,600  | 154,808.00   | 0.14 |
| 60 | 000617 | 中油资本 | 2,900   | 45,240.00    | 0.04 |

**7.3.2 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股票投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1  | 002128 | 露天煤业 | 56,989 | 495,804.30 | 0.45         |
| 2  | 002882 | 金龙羽  | 2,966  | 18,389.20  | 0.02         |
| 3  | 300670 | 大烨智能 | 1,259  | 13,760.87  | 0.01         |
| 4  | 300672 | 国科微  | 1,257  | 10,659.36  | 0.01         |

**7.4 报告期内股票投资组合的重大变动****7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|--------------|----------------|
| 1  | 000002 | 万 科 A | 4,341,558.00 | 4.52           |
| 2  | 300498 | 温氏股份  | 2,360,640.80 | 2.46           |
| 3  | 000001 | 平安银行  | 1,512,158.00 | 1.57           |
| 4  | 000066 | 中国长城  | 1,393,742.09 | 1.45           |
| 5  | 000059 | 华锦股份  | 872,242.00   | 0.91           |
| 6  | 000543 | 皖能电力  | 831,974.19   | 0.87           |
| 7  | 000776 | 广发证券  | 746,473.25   | 0.78           |
| 8  | 000625 | 长安汽车  | 739,921.00   | 0.77           |
| 9  | 000963 | 华东医药  | 707,610.87   | 0.74           |
| 10 | 002736 | 国信证券  | 662,129.00   | 0.69           |
| 11 | 000415 | 渤海金控  | 562,942.00   | 0.59           |
| 12 | 002419 | 天虹股份  | 504,992.00   | 0.53           |
| 13 | 000626 | 远大控股  | 484,074.00   | 0.50           |
| 14 | 000959 | 首钢股份  | 483,609.00   | 0.50           |
| 15 | 000761 | 本钢板材  | 480,931.00   | 0.50           |
| 16 | 000617 | 中油资本  | 477,070.00   | 0.50           |
| 17 | 000876 | 新 希 望 | 452,989.00   | 0.47           |
| 18 | 000895 | 双汇发展  | 412,115.59   | 0.43           |
| 19 | 000166 | 申万宏源  | 385,771.00   | 0.40           |

|    |        |     |            |      |
|----|--------|-----|------------|------|
| 20 | 002594 | 比亚迪 | 366,382.00 | 0.38 |
|----|--------|-----|------------|------|

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|--------------|----------------|
| 1  | 000651 | 格力电器  | 3,596,355.00 | 3.74           |
| 2  | 000568 | 泸州老窖  | 1,602,868.00 | 1.67           |
| 3  | 000858 | 五 粮 液 | 1,448,746.00 | 1.51           |
| 4  | 000333 | 美的集团  | 1,410,767.00 | 1.47           |
| 5  | 000027 | 深圳能源  | 1,158,971.04 | 1.21           |
| 6  | 000725 | 京东方 A | 902,866.00   | 0.94           |
| 7  | 000338 | 潍柴动力  | 897,333.00   | 0.93           |
| 8  | 000709 | 河钢股份  | 877,410.00   | 0.91           |
| 9  | 000778 | 新兴铸管  | 786,266.00   | 0.82           |
| 10 | 000066 | 中国长城  | 763,662.00   | 0.79           |
| 11 | 000063 | 中兴通讯  | 560,817.60   | 0.58           |
| 12 | 000539 | 粤电力 A | 509,657.04   | 0.53           |
| 13 | 000550 | 江铃汽车  | 499,411.10   | 0.52           |
| 14 | 000729 | 燕京啤酒  | 489,208.72   | 0.51           |
| 15 | 000157 | 中联重科  | 456,715.00   | 0.48           |
| 16 | 000800 | 一汽轿车  | 429,398.20   | 0.45           |
| 17 | 000617 | 中油资本  | 429,256.00   | 0.45           |
| 18 | 000883 | 湖北能源  | 422,322.20   | 0.44           |
| 19 | 002269 | 美邦服饰  | 415,335.15   | 0.43           |
| 20 | 000046 | 泛海控股  | 407,979.40   | 0.42           |

上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 21,922,201.38 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 22,125,955.77 |

买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## **7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

## **7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

## **7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

## **7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## **7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

## **7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

### **7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

## **7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

### **7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，广发证券股份有限公司（000776）于 2016 年 11 月 28 日发布公告称 11 月 26 日收到中国证监会行政处罚决定书：2015 年 1 月 16 日，中国证监会公开通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，受到责令限期改正的行政监管措施。2015 年 8 月 24 日，收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（鄂证调查字 2015023 号）。因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。

2015 年 9 月 12 日，因在接入恒生 HOMES 系统期间未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，因此受到中国证监会责令整改，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款等处罚。宁波银行股份有限公司(002142)于 2016 年 7 月 7 日发布公告：宁波银行深圳分行原员工违规办理票据业务，共涉及 3 笔，金额合计人民币 32 亿元。目前该 3 笔票据业务已结清，银行没有损失，公安机关已立案侦查。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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   | 2,234.95   |
| 2  | 应收证券清算款 | 111,345.34 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 334.14     |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 5 | 应收申购款 | —          |
| 6 | 其他应收款 | —          |
| 7 | 待摊费用  | —          |
| 8 | 其他    | —          |
| 9 | 合计    | 113,914.43 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|--------|--------------|----------------------|----------|
| 1  | 000100 | TCL 集团 | 2,251,589.20 | 2.06                 | 重大事项停牌   |

本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|----------------------|----------|
| 1  | 002128 | 露天煤业 | 495,804.30  | 0.45                 | 重大资产重组停牌 |
| 2  | 002882 | 金龙羽  | 18,389.20   | 0.02                 | 新股未上市    |
| 3  | 300670 | 大烨智能 | 13,760.87   | 0.01                 | 新股未上市    |
| 4  | 300672 | 国科微  | 10,659.36   | 0.01                 | 新股未上市    |

本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股

票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### **7.12.6 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

#### 8.1.1 本基金的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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额            | 占总份<br>额比例 |
| 222          | 151, 198. 37  | 32, 537, 003. 00 | 96. 93%    | 1, 029, 036. 00 | 3. 07%     |

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

| 项目                            | 持有份额（份）          | 占总份额比例  |
|-------------------------------|------------------|---------|
| 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 | 32, 500, 000. 00 | 96. 82% |

机构投资者包括建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称            | 持有份额（份）     | 占上市总份额<br>比例 |
|----|------------------|-------------|--------------|
| 1  | 杨沁蕾              | 97, 100. 00 | 0. 29%       |
| 2  | 郑元岳              | 81, 189. 00 | 0. 24%       |
| 3  | 杨祥红              | 76, 978. 00 | 0. 23%       |
| 4  | 熊梅               | 65, 600. 00 | 0. 20%       |
| 5  | 俞琦               | 54, 490. 00 | 0. 16%       |
| 6  | 王欣欣              | 54, 488. 00 | 0. 16%       |
| 7  | 潘万宝              | 50, 000. 00 | 0. 15%       |
| 8  | 上海勤远投资管理中心（有限合伙） | 37, 000. 00 | 0. 11%       |

|    |                                     |               |        |
|----|-------------------------------------|---------------|--------|
|    | 一麦田 2 号私募投资基金                       |               |        |
| 9  | 冷文广                                 | 32,200.00     | 0.10%  |
| 10 | 胡明                                  | 27,242.00     | 0.08%  |
| 11 | 中国民生银行一建信深证基本面<br>60 交易型开放式指数证券投资基金 | 32,500,000.00 | 96.82% |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 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的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                |
|-------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2011 年 9 月 8 日）基金份额总额 | 389,232,036.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 36,566,039.00  |
| 本报告期基金总申购份额                   | 5,500,000.00   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 8,500,000.00   |
| 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                  | 33,566,039.00  |

## §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

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，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、证券业协会、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，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

### 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<br>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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 光大证券 | 2          | 43,890,297.12 | 100.00%              | 40,872.73 | 100.00%        | -  |
| 招商证券 | 1          | -             | -                    | -         | -              | -  |

1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股、个债等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人。能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期内无新增或剔除交易单元。

**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**

本基金本报告期内未使用租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

**§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<br>号 | 持有基金份额比<br>例达到或者超过<br>20%的时间区间 | 期初<br>份额      | 申购<br>份额     | 赎回<br>份额     | 持有份额          | 份额<br>占比 |
|------------------------------------------|--------|--------------------------------|---------------|--------------|--------------|---------------|----------|
| 建信深证基本面<br>60 交易型开放式指<br>数证券投资基金联<br>接基金 | 1      | 1 月 1 日至 6 月<br>30 日           | 35,500,000.00 | 4,500,000.00 | 8,500,000.00 | 31,500,000.00 | 93.84    |

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《深证基本面 60 交易型开放式指数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处。

### 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

2017 年 8 月 26 日