

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  
2017 年第 3 季度报告

2017 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 25 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 20 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品情况

基金简称	建信深证基本面 60ETF 联接
基金主代码	530015
交易代码	530015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 8 日
报告期末基金份额总额	80,737,690.75 份
投资目标	本基金将绝大部分基金资产投资于目标 ETF，密切跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖目标 ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期标的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，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×深证基本面 60 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为深证基本面 60ETF 的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

	同时，本基金为指数型基金，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，属于证券投资基金中较高风险收益的品种。
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

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深F60ETF
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
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	中国民生银行股份有限公司

### 2.1.2 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。

## §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（2017年7月1日—2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	534,487.89

2. 本期利润	6,661,433.74
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0892
4. 期末基金资产净值	144,925,346.59
5. 期末基金份额净值	1.7950

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。

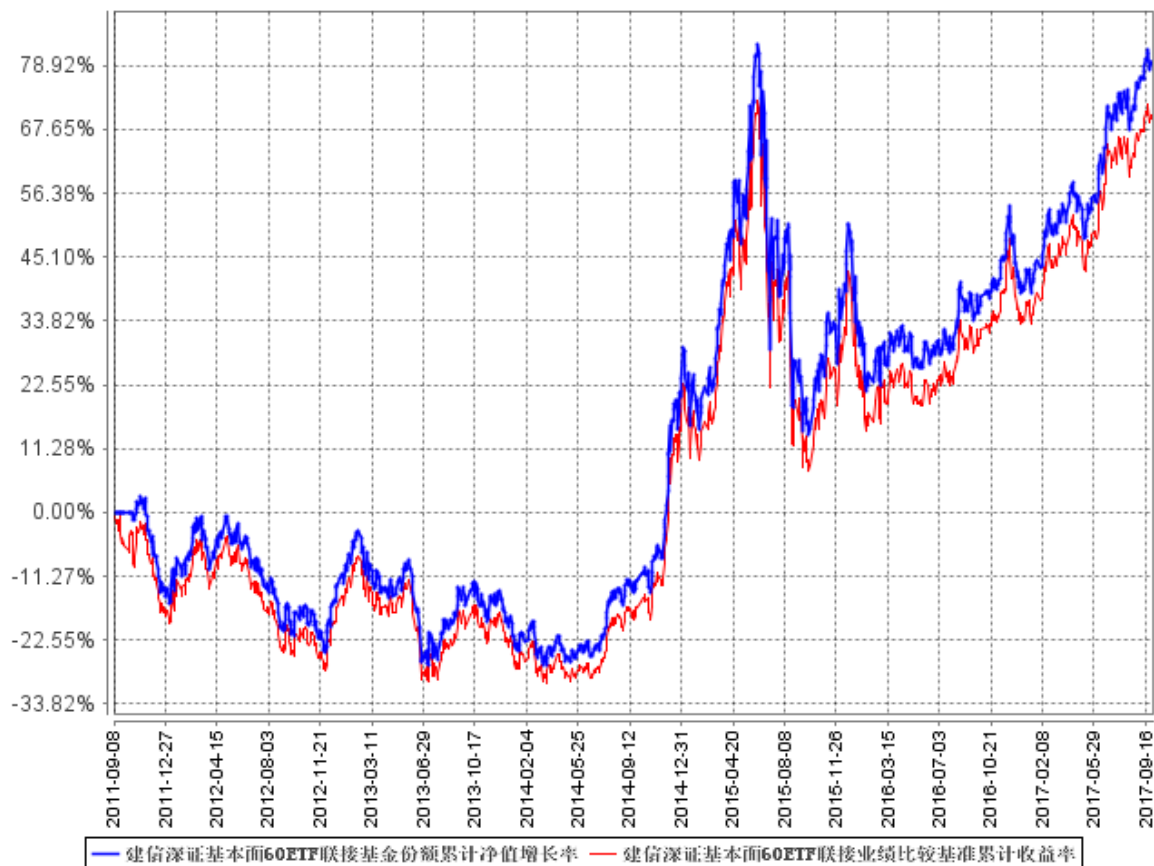
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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	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	5.24%	0.77%	3.76%	0.79%	1.48%	-0.02%

### 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

建信深证基本面60ETF联接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		
薛玲	本基金的基金经理	2017年9月28日	-	4	薛玲女士，博士。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院农电配电研究所工作，任项目经理；2010年1月至2013年

					<p>4 月在路通世纪公司亚洲数据收集部门工作，任高级软件工程师；</p> <p>2013 年 4 月至 2015 年 8 月在中国中投证券公司工作，历任研究员、投资经理；2015 年 9 月加入我公司金融工程及指数投资部，任基金经理助理，2016 年 7 月 4 日起任上证社会责任 ETF 及其联接基金的基金经理；2017 年 5 月 27 日起任建信鑫盛回报基金的基金经理；</p> <p>2017 年 9 月 13 日起任建信量化事件驱动股票型证券投资基金基金经理；2017 年 9 月 28 日起任深证基本面 60ETF 及其联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

## 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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《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基金合同》的规定。

## 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》、《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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金绝大部分资产投资于深证基本面 60ETF，因此基金的跟踪误差和偏离度主要取决于深证基本面 60ETF 的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动、持有的短期债券价格变动以及成份股的集中分红也会对本基金的跟踪误差和偏离度造成一定影响。在报告期内，基金跟踪误差和日均偏离度均被控制在基金合同约定的范围内。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 5.24%，波动率 0.77%，业绩比较基准收益率 3.76%，波动率 0.79%。

## §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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,444,192.00	2.35
	其中：股票	3,444,192.00	2.35
2	基金投资	132,682,550.00	90.38
3	固定收益投资	6,986,000.00	4.76
	其中：债券	6,986,000.00	4.76
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返	-	-

	售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	1,982,328.83	1.35
8	其他资产	1,708,928.82	1.16
9	合计	146,803,999.65	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	60,228.00	0.04
B	采矿业	52,838.00	0.04
C	制造业	2,047,116.00	1.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,192.00	0.03
E	建筑业	34,304.00	0.02
F	批发和零售业	119,498.00	0.08
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	524,078.00	0.36
K	房地产业	509,566.00	0.35
L	租赁和商务服务业	15,888.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	42,484.00	0.03
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	3,444,192.00	2.38

以上行业分类以 2017 年 9 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 5.2.2 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。



**5.3 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股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	14,600	383,250.00	0.26
2	000651	格力电器	9,400	356,260.00	0.25
3	000333	美的集团	6,000	265,140.00	0.18
4	000001	平安银行	20,200	224,422.00	0.15
5	000858	五粮液	2,200	126,016.00	0.09
6	000338	潍柴动力	13,600	101,864.00	0.07
7	000725	京东方 A	21,000	92,400.00	0.06
8	000776	广发证券	4,800	91,104.00	0.06
9	002304	洋河股份	800	81,200.00	0.06
10	000100	TCL 集团	21,400	76,184.00	0.05

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,986,000.00	4.82
	其中：政策性金融债	6,986,000.00	4.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,986,000.00	4.82

**5.5 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债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	108601	国开 1703	70,000	6,986,000.00	4.82

## 5.6 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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	深 F60	股票型	交易型开放式指数基金	建信基金管理有限责任公司	132,682,550.00	91.55

## 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.10.1 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投资股指期货。

### 5.10.2 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。

## 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

## 5.12 投资组合报告附注

### 5.12.1

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。

### 5.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	26,321.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	111,190.50
5	应收申购款	1,571,417.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,708,928.82
---	----	--------------

#### 5.12.4 报告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。

#### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 5.12.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	67,353,240.29
报告期期间基金总申购份额	32,883,961.51
减：报告期期间基金总赎回份额	19,499,511.05
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	80,737,690.75

上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 07 月 01 日-2017 年 09 月 27 日	15,982,850.52	0.00	0.00	15,982,850.52	19.80%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

注：本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

## §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深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件；
- 2、《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合同》；
- 3、《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招募说明书》；
- 4、《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

2017 年 10 月 25 日