

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 2018 年第 3 季度报告

2018 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：2018 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 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 2018 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	170,603,780.69 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	
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目 卖目标 ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪 调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基	
业绩比较基准	95%×深证基本面 60 指数收益率+5%×商业银行活	
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 本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的 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	
下属分级基金的基金简称	建信深证基本面 60ETF 联接	建信深证基本面 60ETF
下属分级基金的交易代码	530015	006363
报告期末下属分级基金的份额总额	170,595,320.04 份	8,460.65 份

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（2018年7月1日—2018年9月30日）	
	建信深证基本面 60ETF 联接 A	建信深证基本面 60ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	-656,718.00	-1.33
2. 本期利润	-9,919,670.98	128.85
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0596	0.0729
4. 期末基金资产净值	286,508,665.47	14,205.11
5. 期末基金份额净值	1.6795	1.6790

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

建信深证基本面 60ETF 联接 A

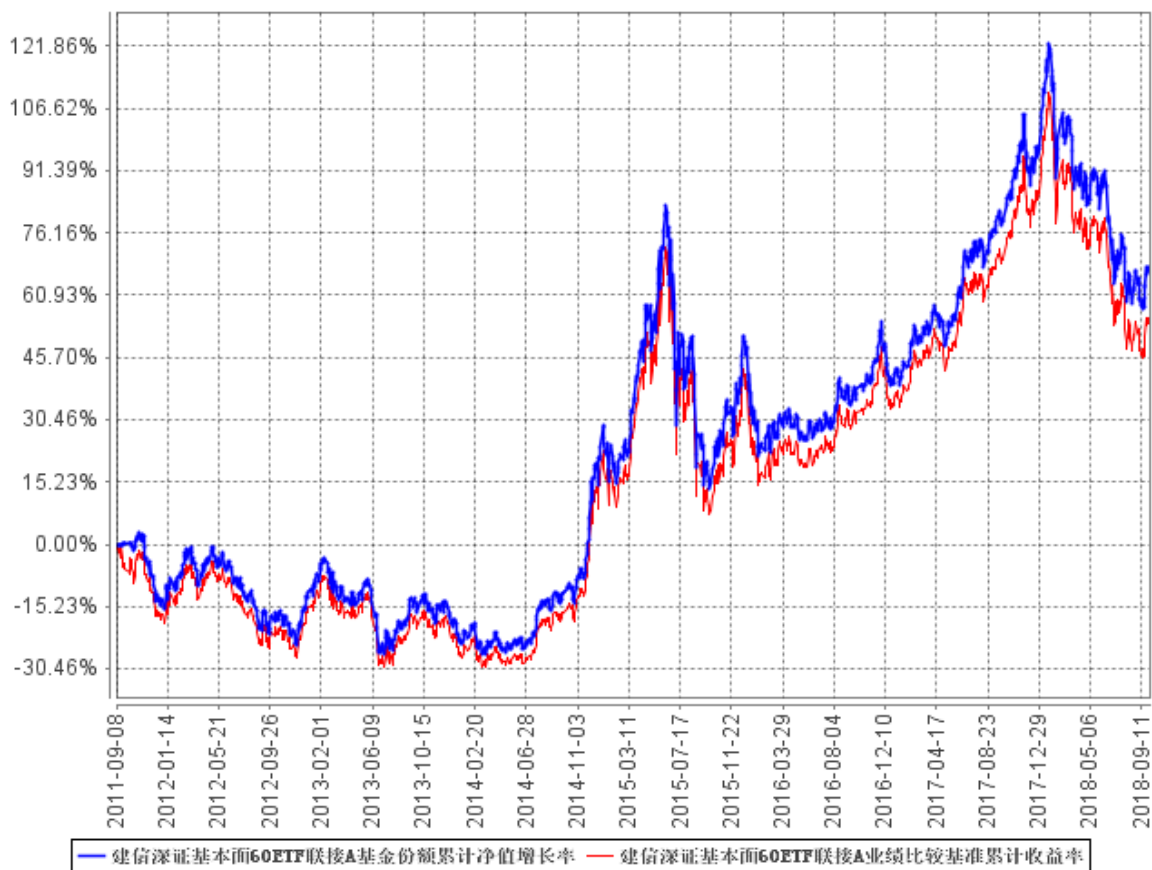
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.63%	1.38%	-4.98%	1.40%	1.35%	-0.02%

建信深证基本面 60ETF 联接 C

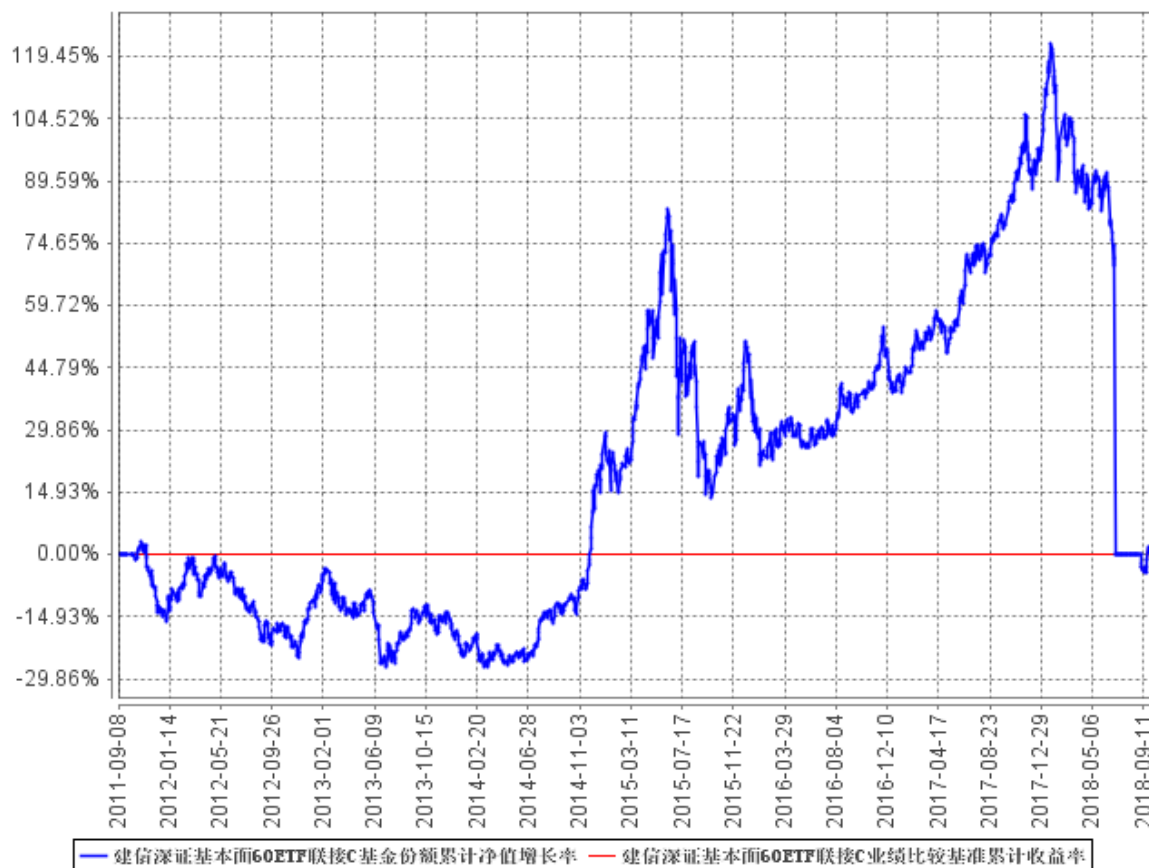
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.73%	1.22%	1.79%	1.23%	-0.06%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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A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



建信深证基本面60ETF联接C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



1. 本基金于 2018 年 9 月 4 日起新增 C 类份额，并于当日发售。
2. 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	-	5	薛玲女士，金融工程及指数投资部总经理助理，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 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；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，历任基金经理助理、基金经理，2018 年 5 月起兼任部门总经理助理，2016 年 7 月 4 日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2017 年 5 月 27 日至 2018 年 4 月 25 日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；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的基金经理；2017 年 9 月 28 日起任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2017 年 12 月 20 日起任建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 22 日起任建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 5 日起任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	---

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

本报告期深 60ETF 联接 A 净值增长率-3.63%，波动率 1.38%，业绩比较基准收益率-4.98%，波动率 1.4%；深 60ETF 联接 C 净值增长率 1.73%，波动率 1.22%，业绩比较基准收益率 1.79%，波动率 1.23%。

§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	6,316,535.12	2.19
	其中：股票	6,316,535.12	2.19
2	基金投资	263,146,200.00	91.37
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	18,034,611.21	6.26
8	其他资产	512,925.28	0.18
9	合计	288,010,271.61	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	222,912.00	0.08
B	采矿业	68,672.00	0.02
C	制造业	3,621,645.98	1.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,484.00	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	173,216.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	27,412.00	0.01
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	1,088,519.84	0.38
K	房地产业	927,812.50	0.32
L	租赁和商务服务业	84,860.80	0.03
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	6,316,535.12	2.20

以上行业分类以 2018 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	000651	格力电器	17,600	707,520.00	0.25
2	000002	万科 A	20,835	506,290.50	0.18
3	000001	平安银行	42,800	472,940.00	0.17

4	000333	美的集团	9,084	382,163.88	0.13
5	300498	温氏股份	9,600	222,912.00	0.08
6	000100	TCL 集团	78,000	219,180.00	0.08
7	000338	潍柴动力	24,400	208,620.00	0.07
8	000858	五粮液	2,800	190,260.00	0.07
9	000725	京东方 A	57,200	180,180.00	0.06
10	000776	广发证券	12,800	177,280.00	0.06

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	263,146,200.00	91.84

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，平安银行股份有限公司（000001）因贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现，贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票被大连银监局罚款 40 万元。因贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资、贷后管理失职，流动资金贷款被挪用被天津银监局罚款 50 万元。本公司通过网络报道知悉上述处罚。

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	36,173.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,939.13
5	应收申购款	472,813.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	512,925.28

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处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	382,163.88	0.13	重大资产重组

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

项目	建信深证基本面 60ETF 联接 A	建信深证基本面 60ETF 联接 C
报告期期初基金份额总额	161,424,182.36	-
报告期期间基金总申购份额	28,300,448.38	8,460.65
减:报告期期间基金总赎回份额	19,129,310.70	-
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	170,595,320.04	8,460.65

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 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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

2018 年 10 月 26 日