

## 深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金

## [2012]第四季度报告

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:2013年1月21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、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基金合同约定，于2013年1月17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，保证复核后的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2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 深证60ETF

基金主代码 159916

交易代码 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

报告期末基金份额总额 197,566,039份

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现与标的指数相一致的长期投资收益。

本基金主要采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的构成权重的构成及权重重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

深证基本面60指数量化收益率

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。

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -2,378,362.72

2.本期利润 23,353,388.19

3.加权平均基金份额本期利润 0.1163

4.期末基金份额净值 321,742,106.89

5.期末基金份额总额 1,628.5

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平均基金份额变动损益。

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(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 7.77% 1.31% 8.06% 1.32% -0.28% -0.01%

3.2.2.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

深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图(2011年9月8日至2012年12月31日)

注: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 任职日期 离任日期 说明

梁洪购 投资管理部执行总经理,本基金基金经理 2011-9-8 - 10 注册金融分析师(CFA),2003年1月获清华大学经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员、金融产品设计与评估部研究员,2005年8月加入建信基金管理有限公司,历任研究部总监助理、研究部总监、高级研究员、研究部总监助理,2009年11月1日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,2010年1月28日起任建信深证基本面60ETF及联接基金基金经理,2012年3月16日起任建信深证100指数基金的基金经理。

4.2.管理人对报告期内地本基金运作遵规守信的情况说明

本基金期内,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取利益,严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》,以及其他法律法规的规定,确保本基金

60交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定。

4.3.公平交易制度的执行情况及公平交易专项说明

4.3.1.公平交易制度的执行情况: 为公平对待投资人,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》、《证券投资基金公司内部控制制度指引》、《证券投资基金公司公平交易制度指引》、《基金公平交易行为评价方法》、《公平交易管理方法》、《公司公平交易制度》、《利益冲突管理办法》等风控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,通过公平交易模块在公平交易模块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.公平交易制度的公平交易情况: 为公平对待投资人,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》、《证券投资基金公司内部控制制度指引》、《证券投资基金公司公平交易制度指引》、《基金公平交易行为评价方法》、《公平交易管理方法》、《公司公平交易制度》、《利益冲突管理办法》等风控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,通过公平交易模块在公平交易模块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。

4.3.3.公平交易制度的公平交易专项说明: 本基金报告期内未发生公平交易行为。

4.4.报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1.报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期间,本基金一直保持较低仓位操作。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,将仓位调整差值和跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

报告期内,本基金误差主要来自基金经理所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。

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。

本基金管理人在对报告期内地本基金运作遵规守信的情况基础上,对本基金的组合进行了适当的组合调整,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.2.报告期内地本基金的业绩表现

本基金报告期内地本基金净值增长率为7.78%,波动率为1.31%,业绩比较基准收益率8.06%,波动率1.32%。

4.5.管理人对宏观经济的分析

4.5.1.宏观经济分析: 证券市场走势的简要展望

在四季度初期,指数整体呈现三季的弱势徘徊并跌入创新低,进入12月份,在银行股等权重股的带领下,指数显现出了一波明显的反弹行情,市场情绪也得到了一定程度的修复。预计一季度市场仍

有望保持比较积极的情绪。

本基金管理人将根据基金合同,以量化分析为基础,克服各种因素的不利影响,不断优化和改

进量化模型,将基金的跟踪误差与偏离度保持在较低水平。

在报告期间,本基金一直保持较低仓位操作。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,将仓位调整差值和跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

报告期内,本基金误差主要来自基金经理所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。

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。

本基金管理人在对报告期内地本基金运作遵规守信的情况基础上,对本基金的组合进行了适当的组合调整,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.3.报告期内地本基金的业绩表现

本基金报告期内地本基金净值增长率为7.78%,波动率为1.31%,业绩比较基准收益率8.06%,波动率1.32%。

4.5.管理人对宏观经济的分析

4.5.1.宏观经济分析: 证券市场走势的简要展望

在四季度初期,指数整体呈现三季的弱势徘徊并跌入创新低,进入12月份,在银行股等权重股的带领下,指数显现出了一波明显的反弹行情,市场情绪也得到了一定程度的修复。预计一季度市场

仍有望保持比较积极的情绪。

本基金管理人将根据基金合同,以量化分析为基础,克服各种因素的不利影响,不断优化和改

进量化模型,将基金的跟踪误差与偏离度保持在较低水平。

在报告期间,本基金一直保持较低仓位操作。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,将仓位调整差值和跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

报告期内,本基金误差主要来自基金经理所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。

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。

本基金管理人在对报告期内地本基金运作遵规守信的情况基础上,对本基金的组合进行了适当的组合调整,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.4.报告期内地本基金投资策略和运作分析

4.4.1.报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期间,本基金一直保持较低仓位操作。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,将仓位调整差值和跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

报告期内,本基金误差主要来自基金经理所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。

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。

本基金管理人在对报告期内地本基金运作遵规守信的情况基础上,对本基金的组合进行了适当的组合调整,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.5.管理人对报告期内地本基金的业绩表现

本基金报告期内地本基金净值增长率为7.78%,波动率为1.31%,业绩比较基准收益率8.06%,波动率1.32%。

4.5.管理人对宏观经济的分析

4.5.1.宏观经济分析: 证券市场走势的简要展望

在四季度初期,指数整体呈现三季的弱势徘徊并跌入创新低,进入12月份,在银行股等权重股的带领下,指数显现出了一波明显的反弹行情,市场情绪也得到了一定程度的修复。预计一季度市场

仍有望保持比较积极的情绪。

本基金管理人将根据基金合同,以量化分析为基础,克服各种因素的不利影响,不断优化和改

进量化模型,将基金的跟踪误差与偏离度保持在较低水平。

在报告期间,本基金一直保持较低仓位操作。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,将仓位调整差值和跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

报告期内,本基金误差主要来自基金经理所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。

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。

本基金管理人在对报告期内地本基金运作遵规守信的情况基础上,对本基金的组合进行了适当的组合调整,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.6.报告期内地本基金投资策略和运作分析

4.4.1.报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期间,本基金一直保持较低仓位操作。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,将仓位调整差值和跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

报告期内,本基金误差主要来自基金经理所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。

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。

本基金管理人在对报告期内地本基金运作遵规守信的情况基础上,对本基金的组合进行了适当的组合调整,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.7.管理人对报告期内地本基金的业绩表现

本基金报告期内地本基金净值增长率为7.78%,波动率为1.31%,业绩比较基准收益率8.06%,波动率1.32%。

4.5.管理人对宏观经济的分析

4.5.1.宏观经济分析: 证券市场走势的简要展望

在四季度初期,指数整体呈现三季的弱势徘徊并跌入创新低,进入12月份,在银行股等权重股的带领下,指数显现出了一波明显的反弹行情,市场情绪也得到了一定程度的修复。预计一季度市场

仍有望保持比较积极的情绪。

本基金管理人将根据基金合同,以量化分析为基础,克服各种因素的不利影响,不断优化和改

进量化模型,将基金的跟踪误差与偏离度保持在较低水平。

在报告期间,本基金一直保持较低仓位操作。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,将仓位调整差值和跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

报告期内,本基金误差主要来自基金经理所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。

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。

本基金管理人在对报告期内地本基金运作遵规守信的情况基础上,对本基金的组合进行了适当的组合调整,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.8.报告期内地本基金投资策略和运作分析

4.4.1.报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期间,本基金一直保持较低仓位操作。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,将仓位调整差值和跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

报告期内,本基金误差主要来自基金经理所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。

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。

本基金管理人在对报告期内地本基金运作遵规守信的情况基础上,对本基金的组合进行了适当的组合调整,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.9.管理人对报告期内地本基金的业绩表现

本基金报告期内地本基金净值增长率为7