

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:2014年10月24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2014年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚信运用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	深F60ETF
场内简称	深F60
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	120,566,039.00份

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 本基金主要采用完全复制策略,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 本基金主要投资于股票,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金,本基金为指数基金,具有和标的指数所代表的股票市场相近的风

险收益特征,属于证券投资基金中较高风险,较高预期收益的产品。

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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,830,078.86
2.本期利润	31,584,138.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.2362
4.期末基金资产净值	196,022,389.19
5.期末基金份额净值	1.6259

注:1.本期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

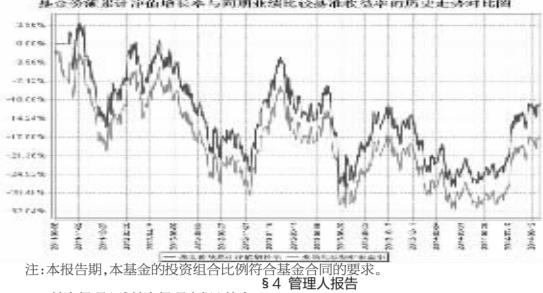
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	16.59%	0.97%	16.18%	0.98%	0.41%	-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

深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金

2014 第三季度报告



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(或基金经理助理)简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
黄晓娟	基金经理	2011年9月8日	-	11

说明:持有基金从业资格,具备基金从业经验,并经基金管理人考核合格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》,以及其他有关法律法规的规定及《深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人不存在不公平对待不同投资者的情形。

4.4 报告期内基金的投資策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的投資策略和业绩表现分析

在报告期间,本基金绝大部分资产投资于所处的交易所公开竞价日向反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的股票,本报告期未发现本基金存在异常交易行为。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现有投资组合参与的交易所公开竞价日向反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的股票,本报告期未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本报告期内,本基金不存在不公平对待不同投资者的情形。

4.6 管理人对基金持续经营能力的说明

本基金的持续经营能力,由基金合同和招募说明书规范。

4.7 管理人对本基金未来资产配置的说明

本基金的未来资产配置,将根据市场情况,在严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》的前提下,在

综合考虑各种因素的情况下,进行适当调整。

4.8 管理人对本基金的估值方法的说明

本基金的估值方法,由基金合同和招募说明书规范。

4.9 管理人对本基金的会计政策的说明

本基金的会计政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.10 管理人对本基金的审计报告的说明

本报告期内,本基金不存在审计报告。

4.11 管理人对报告期内基金费用的说明

4.12 管理人对其他重要事项的说明

本基金的其他重要事项,由基金合同和招募说明书规范。

4.13 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.14 管理人对本基金的会计政策的说明

本基金的会计政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.15 管理人对本基金的审计报告的说明

本报告期内,本基金不存在审计报告。

4.16 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.17 管理人对本基金的会计政策的说明

本基金的会计政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.18 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.19 管理人对本基金的会计政策的说明

本基金的会计政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.20 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.21 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.22 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.23 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.24 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.25 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.26 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.27 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.28 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.29 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.30 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.31 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.32 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.33 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.34 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.35 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.36 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.37 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.38 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.39 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.40 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.41 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.42 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.43 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.44 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.45 管理人对本基金的估值政策的说明

本基金的估值政策,由基金合同和招募说明书规范。

4.46 管理人对本基金的