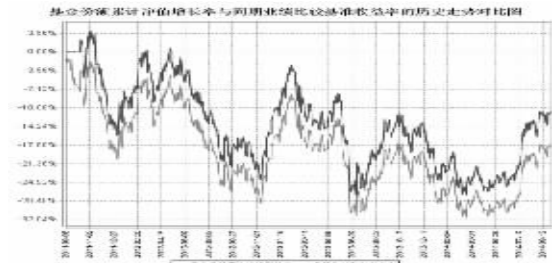


B018信息披露disclosure

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。

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏蔚	投资管理部总经理、本基金基金经理	2013年9月8日 -	11	魏蔚，曾任中国银河证券(CFA)，2003年1月毕业于复旦大学经济学院，2003年1月至2004年8月就职于大成基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理、股票研究部产品主管、机构理财部高级经理，2005年4月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究员、高级研究员、高级基金经理助理、基金经理助理、基金经理、权益管理部副总监，2008年11月起担任深证基本面60ETF的基金经理，2010年9月起担任深证基本面60ETF联接基金基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF的基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF联接基金基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF的基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF联接基金基金经理。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
 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，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《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《公平交易管理制度》、《异常交易管理制度》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理制度》等风险控制制度。公司使用的交易系统设置了公平交易模块，一旦出现不同基金间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，严禁直接或间接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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 本报告期内，本基金一直接近重仓运作，基金经理根据基金合同规定，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基金合同约定的范围之内。
 报告期内，本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。这种差异源自部分股票由于计入跟踪误差，导致跟踪误差中部分股票权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人通过量化分析基础上，采取了适当的权重调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
 本报告期内基金净值增长率为15.59%，波动率0.97%，业绩比较基准收益率为16.18%，波动率0.98%。
 4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 2014年三季度，经济形势有所好转，国企改革、沪港通临近等事件激发了投资者的乐观情绪，股票市场出现反弹，市场的结构分化也比较明显。展望四季度，随着宽松政策的延续，市场外部环境预计继续偏暖。

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。

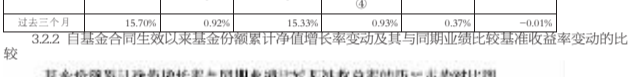
5.1 报告期末基金资产组合情况

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

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③	业绩比较基准收益标准差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



注：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏蔚	投资管理部总经理、本基金基金经理	2013年9月8日 -	11	魏蔚，曾任中国银河证券(CFA)，2003年1月毕业于复旦大学经济学院，2003年1月至2004年8月就职于大成基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理、股票研究部产品主管、机构理财部高级经理，2005年4月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究员、高级研究员、高级基金经理助理、基金经理助理、基金经理、权益管理部副总监，2008年11月起担任深证基本面60ETF的基金经理，2010年9月起担任深证基本面60ETF联接基金基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF的基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF联接基金基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF的基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF联接基金基金经理。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
 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，严格遵守了《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《公平交易管理制度》、《异常交易管理制度》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理制度》等风险控制制度。公司使用的交易系统设置了公平交易模块，一旦出现不同基金间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，严禁直接或间接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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 本报告期内，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基金合同约定的范围之内。
 报告期内，本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。这种差异源自部分股票由于计入跟踪误差，导致跟踪误差中部分股票权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人通过量化分析基础上，采取了适当的权重调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
 本报告期内基金净值增长率为15.59%，波动率0.97%，业绩比较基准收益率为16.18%，波动率0.98%。
 4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 2014年三季度，经济形势有所好转，国企改革、沪港通临近等事件激发了投资者的乐观情绪，股票市场出现反弹，市场的结构分化也比较明显。展望四季度，随着宽松政策的延续，市场外部环境预计继续偏暖。

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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

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

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③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.70%	0.92%	15.33%	0.93%	0.37%	-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



注：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
魏蔚	投资管理部总经理、本基金基金经理	2013年9月8日 -	11	魏蔚，曾任中国银河证券(CFA)，2003年1月毕业于复旦大学经济学院，2003年1月至2004年8月就职于大成基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理、股票研究部产品主管、机构理财部高级经理，2005年4月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究员、高级研究员、高级基金经理助理、基金经理助理、基金经理、权益管理部副总监，2008年11月起担任深证基本面60ETF的基金经理，2010年9月起担任深证基本面60ETF联接基金基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF的基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF联接基金基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF的基金经理，2013年9月8日起担任深证基本面60ETF联接基金基金经理。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
 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，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信双债增强债券型证券投资基金基金合同》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《公平交易管理制度》、《异常交易管理制度》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理制度》等风险控制制度。公司使用的交易系统设置了公平交易模块，一旦出现不同基金间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，严禁直接或间接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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 本报告期内，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基金合同约定的范围之内。
 报告期内，本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。这种差异源自部分股票由于计入跟踪误差，导致跟踪误差中部分股票权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人通过量化分析基础上，采取了适当的权重调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
 本报告期内基金净值增长率为15.59%，波动率0.97%，业绩比较基准收益率为16.18%，波动率0.98%。
 4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 2014年三季度，经济形势有所好转，国企改革、沪港通临近等事件激发了投资者的乐观情绪，股票市场出现反弹，市场的结构分化也比较明显。展望四季度，随着宽松政策的延续，市场外部环境预计继续偏暖。

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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

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

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③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.53%	0.08%	0.70%	0.07%	1.83%	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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	194,969,067.78	99.15
2	固定收益投资	194,969,067.78	99.15
3	其中：债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	1,637,079.00	0.85
10	其他资产	6,707.53	0.00
11	合计	196,616,854.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
 5.2.1 报告期末按股票行业分类的股票投资组合

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,110,777.42	5.67
C	制造业	119,667,530.04	61.85
D	电力、热力、燃气及生产供应业	4,548,194.82	2.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,399,592.96	3.26
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	23,082,495.35	11.76
K	房地产业	26,366,001.44	13.76
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	3,224,476.15	1.64
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	194,969,067.78	99.46

注：以上行业分类以2014年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。
 5.2.2 报告期末按股票行业分类的股票投资组合

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	2,113,358	69,406,626.44	9.90
2	000051	格力电器	371,909	10,313,036.57	5.26
3	000001	平安银行	804,310	8,155,705.40	4.16
4	000157	中联重科	1,473,314	7,204,305.46	3.68
5	000858	五粮液	353,000	6,519,910.00	3.53
6	000284	圣元环保	747,616	6,399,592.96	3.26
7	000333	友邦集团	294,732	5,862,319.48	2.99
8	000709	河北钢铁	2,495,330	5,680,352.40	2.90
9	000338	潍柴动力	272,916	5,534,736.48	2.82
10	000100	TCL 集团	1,566,147	3,380,596.90	2.71

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

5.3.1 报告期末按股票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	2,113,358	69,406,626.44	9.90
2	000051	格力电器	371,909	10,313,036.57	5.26
3	000001	平安银行	804,310	8,155,705.40	4.16
4	000157	中联重科	1,473,314	7,204,305.46	3.68
5	000858	五粮液	353,000	6,519,910.00	3.53
6	000284	圣元环保	747,616	6,399,592.96	3.26
7	000333	友邦集团	294,732	5,862,319.48	2.99
8	000709	河北钢铁	2,495,330	5,680,352.40	2.90
9	000338	潍柴动力	272,916	5,534,736.48	2.82
10	000100	TCL 集团	1,566,147	3,380,596.90	2.71

5.4 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

5.4.1 报告期末按股票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	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	428,532,210.21	2.06
2	固定收益投资	428,532,210.21	2.06
3	其中：债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	12,584,543.20	6.10
10	其他资产	54,208.87	0.03
11	合计	266,309,354.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
 5.2.1 报告期末按股票行业分类的股票投资组合

B	采矿业	242,419.30	0.12
C	制造业	2,610,293.87	1.28
D	电力、热力、燃气及生产供应业	59,528.56	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	139,476.64	0.07
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	503,423.04	0.25
K	房地产业	567,712.95	0.29
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	70,397.65	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	2,523,262.01	2.08

注：以上行业分类以2014年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

注：以上行业分类以2014年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。
 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	46,095	422,152.10	0.21
2	000061	格力电器	6,099	224,335.78	0.11
3	000001	平安银行	7,1564	176,096.96	0.09
4	000157	中联重科	32,165	157,286.85	0.08
5	000858	五粮液	7,714	142,477.58	0.07
6	000284	圣元环保	16,294	139,476.64	0.07
7	000333	友邦集团	6,417	127,634.13	0.06
8	000709	河北钢铁	54,433	124,107.64	0.06
9	000338	潍柴动力	5,935	126,361.80	0.06
10	000100	TCL 集团	42,891	115,805.70	0.06

5.4 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

5.4.1 报告期末按股票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

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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明
 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
 本报告期内，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基金合同约定的范围之内。
 报告期内，本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。这种差异源自部分股票由于计入跟踪误差，导致跟踪误差中部分股票权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人通过量化分析基础上，采取了适当的权重调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。
 4.4.2 报告期内基金的投资表现
 本报告期内基金净值增长率为15.59%，波动率0.97%，业绩比较基准收益率为16.18%，波动率0.98%。
 4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 2014年三季度，经济形势有所好转，国企改革、沪港通临近等事件激发了投资者的乐观情绪，股票市场出现反弹，市场的结构分化也比较明显。展望四季度，随着宽松政策的延续，市场外部环境预计继续偏暖。

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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

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

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③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.53%	0.08%	0.70%	0.07%	1.83%	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

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③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.53%	0.08%	0.70%	0.07%	1.83%	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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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