

# 深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金

## [2015] 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:2016年1月21日

**§ 1 重要提示**  
基金管理人、基金托管人及基金份额持有人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法律责任。  
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据基金合同规定，于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等信息，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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称	深证基本面60ETF
场内简称	深证60
基金代码	161006
交易代码	161006
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月1日
报告期末基金资产总额	214,006,020.00元
报告期末基金份额总额	93,101,425.14份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪误差最小化，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法，即尽可能地复制标的指数的构成、权重和变化，同时根据标的指数成份股的流动性情况，对流动性差的股票进行适当的调整，以降低跟踪误差。
业绩比较基准	深证基本面60指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，具有较高的风险收益特征，较股票型基金的风险收益特征，属股票型基金中风险较高，较股票型基金的收益特征。
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

注：本基金未设置赎回费。

### § 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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期营业收入	3,030,647.52
2.本期利润	21,156,462.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0317
4.期末基金资产净值	93,096,098.56
5.期末基金份额净值	2.7004

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公允价值变动损益。  
2.所列基金绩效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。

### § 3.1 主要财务指标份额百分比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(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	20.40%	1.00%	26.09%	1.08%	-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	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
1	万科A 600,000份 16,879,700.29 18.01
2	格力电器 204,062份 6,602,400.75 7.04
3	美的集团 139,504份 4,079,521.38 4.09
4	五粮液 146,291份 3,990,818.40 4.26
5	平安银行 206,441份 3,578,307.09 3.62
6	海康威视 600,008份 3,442,427.20 2.01
7	苏银云海 173,450份 2,329,020.60 2.49
8	广发证券 10,288份 2,145,101.60 2.29
9	中航黑豹 399,302份 2,136,267.70 2.28
10	海通证券 217,398份 2,099,948.00 2.24

3.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	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
1	平安银行 600,000份 16,879,700.29 18.01
2	招商银行 204,062份 6,602,400.75 7.04
3	美的集团 139,504份 4,079,521.38 4.09
4	五粮液 146,291份 3,990,818.40 4.26
5	平安银行 206,441份 3,578,307.09 3.62

3.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	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
1	无
2	无
3	无
4	无
5	无

3.2.5 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存出保证金明细

序号	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存出保证金明细
1	无
2	无
3	无
4	无
5	无

3.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名应收证券清算款明细

序号	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应收证券清算款明细
1	无
2	无
3	无
4	无
5	无

3.2.7 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其他应收款明细

序号	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其他应收款明细
1	无
2	无
3	无
4	无
5	无

3.2.8 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买入返售金融资产明细

序号	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买入返售金融资产明细
1	无
2	无
3	无
4	无
5	无

3.2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名应收票据明细

序号	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应收票据明细
1	无
2	无
3	无
4	无
5	无

3.2.10 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应收账款明细

序号	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应收账款明细
1	无
2	无
3	无
4	无
5	无

3.2.11 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存货明细

序号	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存货明细
1	无
2	无
3	无
4	无
5	无

3.2.12 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短期投资明细

序号	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短期投资明细
1	无
2	无
3	无
4	无
5	无

3.2.13 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其他投资明细