深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

2017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：2017年10月25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2017年10月20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2017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	39,566,039.00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。
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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月1日－2017年9月30日）
1.本期已实现收益	2,570,289.93
2.本期利润	6,867,019.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.1836
4.期末基金资产净值	136,353,582.40
5.期末基金份额净值	3.4462

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

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	5.59%	0.82%	3.95%	0.83%	1.64%	-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

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	-	4	薛玲女士，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月在路透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，任基金经理助理，2016年7月4日起任上证社会责任ETF及其联接基金的基金经理；2017年5月27日起任建信鑫盛回报基金的基金经理；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基金经理；2017年9月28日起任深证基本面60ETF及其联接基金的基金经理。
路龙凯	本基金的基金经理	2016年4月11日	2017年9月28日	7	路龙凯先生，硕士。2008年8月至2011年11月在中国人民健康保险股份有限公司从事保险精算工作，历任主办、主管；2011年11月至2012年4月在中诚信国际信用评级有限公司工作，任结构融资分析师；2012年5月至2015年4月在泰达宏利基金管理有限责任公司工作，历任初级研究员、研究员、投资经理；2015年4月加入建信基金管理公司金融工程及指数投资部，任基金经理助理，2016年4月11日至2017年9月28日任深证基本面60ETF及其联接基金的基金经理。

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，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《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

在报告期内，本基金跟踪误差主要来自于成分股的大比例分红以及所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。指数成份股的大比例分红在给基金带来超额收益的同时很大程度上增加了基金的跟踪误差。权重结构上的差异主要源自以下四个部分：第一，股票数量的舍入取整；第二，适当提高小权重股票便于提高基金可供申赎的篮子个数；第三，参与新股申购；第四，部分股票的停牌导致无法交易。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。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率5.59%，波动率0.82%，业绩比较基准收益率3.95%，波动率0.83%。

§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	135,689,487.94	99.08
	其中：股票	135,689,487.94	99.08
2	基金投资	-	-
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	1,259,488.22	0.92
8	其他资产	3,032.03	0.00
9	合计	136,952,008.19	100.00

股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资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	2,443,966.20	1.79
B	采矿业	2,109,584.88	1.55
C	制造业	80,270,724.26	58.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,472,741.34	1.08
E	建筑业	1,315,730.00	0.96
F	批发和零售业	4,589,640.00	3.37
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	20,486,287.74	15.02
K	房地产业	20,508,081.73	15.04
L	租赁和商务服务业	606,392.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,666,835.23	1.22
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	135,469,983.38	99.35

1.合计项不含可退替代款的估值增值。

2.以上行业分类以2017年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.2.2报告期末积极投资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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	175,635.07	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	12,776.05	0.01
S	综合	-	-
	合计	219,504.56	0.16

以上行业分类以2017年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.2.3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	000002	万科A	573,503	15,054,453.75	11.04
2	000651	格力电器	370,262	14,032,929.80	10.29
3	000333	美的集团	232,406	10,270,021.14	7.53
4	000001	平安银行	796,349	8,847,437.39	6.49
5	000858	五粮液	84,391	4,833,916.48	3.55
6	000338	潍柴动力	534,172	4,000,948.28	2.93
7	000725	京东方A	824,599	3,628,235.60	2.66
8	000776	广发证券	187,288	3,554,726.24	2.61
9	000100	TCL集团	844,740	3,007,274.40	2.21
10	000063	中兴通讯	104,863	2,967,622.90	2.18

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002901	大博医疗	1,834	49,206.22	0.04
2	300700	岱勒新材	833	43,440.95	0.03
3	002906	华阳集团	2,495	34,156.55	0.03
4	002893	华通热力	1,176	31,093.44	0.02
5	002902	铭普光磁	1,270	25,844.50	0.02

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报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

无。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

无。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券之一的五矿稀土因未及时披露重大事项，于2016年12月27日被山西证监局采取旁令改正的监管措施。

5.11.2本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,578.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	453.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,032.03

5.11.4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可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.7报告期末积极投资前五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	002906	华阳集团	34,156.55	0.03	新发未上市

5.11.8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

报告期期初基金份额总额	33,566,039.00
报告期期间基金总申购份额	6,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	500,000.00
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	39,566,039.00

§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

本基金本报告期发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
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	1	2017年07月01日-2017年08月21日，2017年08月23日-2017年09月28日，2017年09月30日-2017年09月30日	31,500,000.00	7,000,000.00	500,000.00		38,000,000.00	96.04%

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会批准深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

2.《深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金合同》；

3.《深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4.《深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

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。

9.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3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

2017年10月25日

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

2017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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2017年10月25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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月20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2017年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	责任ETF
场内简称	责任ETF
基金主代码	510090
交易代码	510090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年5月28日
报告期末基金份额总额	72,081,114.00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	上证社会责任指数
风险收益特征	本基金属于股票指数型基金，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	中国工商银行股份有限公司

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月1日－2017年9月30日）
1.本期已实现收益	3,308,791.74
2.本期利润	5,737,547.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0780
4.期末基金资产净值	112,212,864.60
5.期末基金份额净值	1.5568

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。

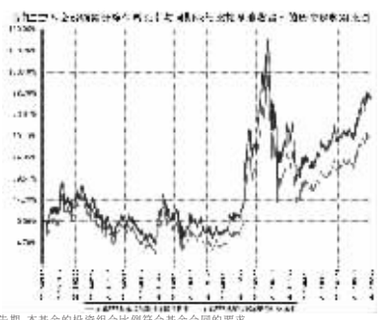
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	5.19%	0.72%	2.81%	0.73%	2.38%	-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



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	2016年7月4日	-	4	薛玲女士，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月在路透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，任基金经理助理，2016年7月4日起任上证社会责任ETF及其联接基金的基金经理；2017年5月27日起任建信鑫盛回报基金的基金经理；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基金经理；2017年9月28日起任深证基本面60ETF及其联接基金的基金经理。

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》、其他有关法律法规的规定和《上证社会责任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

在报告期内，本基金根据基金合同规定，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了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于成分股的大比例分红、所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。指数成份股的大比例分红在给基金带来超额收益的同时很大程度上增加了基金的跟踪误差。权重结构上的差异主要源自以下四个部分：第一，股票数量的舍入取整；第二，适当提高小权重股票便于提高基金可供申赎的篮子个数；第三，参与新股申购；第四，部分股票停牌导致无法交易。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。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率5.19%，波动率0.72%，业绩比较基准收益率2.81%，波动率0.73%。

§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	112,072,008.22	99.08
	其中：股票	112,072,008.22	99.08
2	基金投资	-	-
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	1,031,605.11	0.91
8	其他资产	4,040.46	0.00
9	合计	113,107,653.79	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资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	-	-
B	采矿业	1,652,569.30	1.47
C	制造业	22,282,183.34	19.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,198,708.63	1.07
E	建筑业	11,250,887.85	10.03
F	批发和零售业	3,386,140.52	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,511,179.91	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,087,743.76	2.75
J	金融业	60,183,821.06	53.63
K	房地产业	5,969,216.29	5.32
L	租赁和商务服务业	386,318.61	0.34
M	科学研究和技术服务业	223,799.94	0.20
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	378,252.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	111,510,821.21	99.37

以上行业分类以2017年9月30日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.2报告期末积极投资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	-	-
B	采掘业	31,179.19	0.03
C	制造业	326,541.59	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.10
R	文化、体育和娱乐业	18,740.85	0.02
S	综合	-	-
	合计	561,187.01	0.50

以上行业分类以2017年9月30日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.3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	601318	中国平安	335,700	18,181,512.00	16.20
2	600036	招商银行	316,330	8,082,231.50	7.20
3	601166	兴业银行	380,675	6,581,870.75	5.87
4	600016	民生银行	719,712	5,772,090.24	5.14
5	601328	交通银行	858,653	5,426,686.96	4.84
6	600000	浦发银行	351,369	4,522,119.03	4.03
7	601668	中国建筑	468,764	4,350,129.92	3.88
8	601601	中国太保	98,225	3,627,449.25	3.23
9	600104	上汽集团	109,568	3,307,857.92	2.95
10	600048	保利地产	222,271	2,311,618.40	2.06

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.10
2	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.07
3	603055	台华新材	2,658	62,489.58	0.06
4	603367	辰欣药业	3,049	51,192.71	0.05
5	603157	拉夏贝尔	2,150	38,119.50	0.03

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报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

无。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

无。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券之一均因未及时披露重大事项，于2016年12月27日被山西证监局采取旁令改正的监管措施。

5.11.2本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,824.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	216.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,040.46

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.7报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

5.11.8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

报告期期初基金份额总额	74,581,114.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	2,500,000.00
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	72,081,114.00

§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

无

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	2017年7月1日至2017年9月30日	70,584,520.51	29,256,143.94	0.00		99,840,664.45	28.67%
	2	2017年8月31日至2017年9月30日	8,106,296.46	75,797,013.57	0.00		83,903,310.03	24.10%

产品持有风险

本基金在报告期内，存在报告期同单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：

1）基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回，份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大额波动；

2）巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；

3）流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；

4）基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回日本基金出现连续六个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

5）基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

6）份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

8.2影响投资者决策的其他重要信息

1.本报告期内，经公司股东会审议通过，鸿请刘岩先生担任公司法定代表人职务，并同时免去凌雲华先生公司法定代表人职务，该事项已于2017年7月5日在证监会指定媒体披露；

2.本报告期内，经公司股东会审议通过，公司注册地址由"广东省珠海市香洲区吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼单元"变更为"广东省珠海市香洲区水湾路246号3栋2单元3D房"。该事项已于2017年7月20日在证监会指定媒体披露。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会批准金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2.《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

4.金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5.基金托管人业务资格批件和营业执照。

6.本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2存放地点

广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层

9.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：http://www.gtfund.com。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888或020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇一七年十月二十五日

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二