上证社会责任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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年一月二十一日

§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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	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(ETF)
基金合同生效日	2010年5月28日
报告期末基金份额总额	454,581,114.00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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,340,427.33
2.本期利润	59,791,010.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.1314
4.期末基金资产净值	401,952,438.77
5.期末基金份额净值	0.884

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。

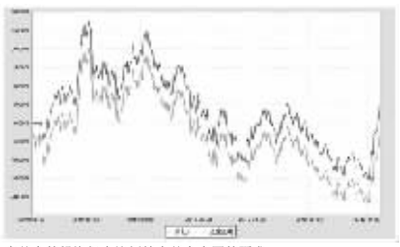
3.2 基金净值表现

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	17.40%	1.40%	17.77%	1.40%	-0.37%	0.00%

3.2.2自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

上证社会责任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历史走势对比图
（2010年5月28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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天先生	本基金基金经理	2012-3-21	-	4	曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资；2011年9月加入我公司，担任基金经理助理。2012年3月21日起任上证社会责任ETF及联接基金基金经理。

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，严格遵守了《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指数证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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基金净值保留位数有限造成的舍入误差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。权重结构上的差异源自部分股票由于舍入取整等原因，申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比有所变化。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。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值增长率17.40%，波动率 1.40%，业绩比较基准收益率17.77%，波动率1.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在四季度初期，指数延续三季度的颓势继续下跌，但到12月份，在银行股等权重股的带领下，指数走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。预计一季度初期，指数在市场情绪的推动下仍会维持震荡向上的走势。

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 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	400,294,367.83	99.41
	其中：股票	400,294,367.83	99.41
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,387,863.34	0.59
6	其他各项资产	454.24	0.00
7	合计	402,682,685.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	36,995,679.89	9.20
C	制造业	69,568,640.26	17.31
C0	食品、饮料	2,279,685.36	0.57
C1	纺织、服装、皮毛	2,093,579.00	0.52
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,676,010.44	1.16
C5	电子	3,725,346.97	0.93
C6	金属、非金属	8,085,834.26	2.01
C7	机械、设备、仪表	32,533,917.35	8.09
C8	医药、生物制品	16,174,266.88	4.02
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,415,678.48	0.60
E	建筑业	25,784,474.29	6.41
F	交通运输、仓储业	4,371,082.03	1.09
G	信息技术业	13,220,984.52	3.29
H	批发和零售贸易	11,500,074.85	2.86
I	金融、保险业	211,064,453.51	52.51
J	房地产业	23,465,186.28	5.84
K	社会服务业	1,908,113.72	0.47
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	400,294,367.83	99.59

注：以上行业分类以2012年12月31日的证监会行业分类标准为依据。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	600016	民生银行	4,478,283	35,199,304.38	8.76
2	600036	招商银行	2,451,793	33,712,153.75	8.39
3	601318	中国平安	664,239	30,083,384.31	7.48
4	601166	兴业银行	1,497,113	24,986,815.97	6.22
5	601328	交通银行	4,669,427	23,066,969.38	5.74
6	600000	浦发银行	2,219,184	22,014,305.28	5.48
7	600030	中信证券	1,365,454	18,242,465.44	4.54
8	601088	中国神华	653,917	16,576,795.95	4.12
9	601601	中国太保	623,260	14,023,350.00	3.49
10	601668	中国建筑	2,973,913	11,598,260.70	2.89

5.3.2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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	454.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	454.24

5.8.4 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。

5.8.5报告期末前十名（前五名）股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1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不存在流通受限的情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	455,581,114.00
本报告期基金总申购份额	3,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	454,581,114.00

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准上证社会责任交易型指数证券投资基金募集设立的文件；

2、《上证社会责任交易型指数证券投资基金基金合同》；

3、《上证社会责任交易型指数证券投资基金招募说明书》；

4、《上证社会责任交易型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。

7.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3 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
二〇一三年一月二十一日

建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年一月二十一日

§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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	建信责任
基金主代码	530010
交易代码	530010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月28日
报告期末基金份额总额	410,150,883.25份
投资目标	通过将绝大部分基金财产投资于上证社会责任ETF，密切跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为上证社会责任ETF的联接基金，主要通过投资于上证社会责任ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证社会责任ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×上证社会责任指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率
风险收益特征	本基金为上证社会责任ETF的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及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

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510090
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年5月28日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年8月9日
基金管理人名称	建信基金管理有限责任公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品概况

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。

§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

投资目标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-193,091.01
2.本期利润	58,726,371.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.1426
4.期末基金资产净值	415,450,678.26
5.期末基金份额净值	1.013

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。

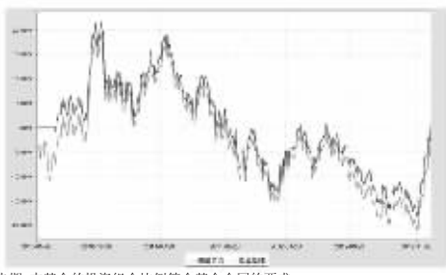
3.2 基金净值表现

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	16.44%	1.32%	16.85%	1.33%	-0.41%	-0.01%

3.2.2自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

建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2010年5月28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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天先生	本基金基金经理	2012-3-21	-	4	曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资；2011年9月加入我公司，担任基金经理助理。2012年3月21日起任上证社会责任ETF及联接基金基金经理。

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《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金绝大部分资产投资于上证社会责任ETF，因此基金的跟踪误差和偏离度主要取决于责任ETF的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动也会对本基金的跟踪误差和偏离度造成一定影响。在报告期内，基金跟踪误差和日均偏离度均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率16.44%，波动率1.32%，业绩比较基准收益率16.85%，波动率1.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在四季度初期，指数延续三季度的颓势继续下跌，但到12月份，在银行股等权重股的带领下，指数走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。预计一季度初期，指数在市场情绪的推动下仍会维持震荡向上的走势。

本基金管理人将根据基金合同规定，继续将不低于90%的基金资产投资于责任ETF，同时适当对所直接持有的股票组合进行优化，以控制跟踪误差及偏离度。

§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	4,724,786.25	1.13
	其中：股票	4,724,786.25	1.13
2	基金投资	388,518,000.00	92.95
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	22,026,100.18	5.27
7	其他各项资产	2,698,905.52	0.65
8	合计	417,967,791.95	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式指数基金	建信基金管理有限责任公司	388,518,000.00	93.52

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	434,776.95	0.10
C	制造业	822,574.75	0.20
C0	食品、饮料	26,811.66	0.01
C1	纺织、服装、皮毛	24,584.80	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	55,329.48	0.01
C5	电子	43,819.14	0.01
C6	金属、非金属	95,498.67	0.02
C7	机械、设备、仪表	383,308.54	0.09
C8	医药、生物制品	193,222.46	0.05
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	28,315.72	0.01
E	建筑业	302,995.31	0.07
F	交通运输、仓储业	51,375.12	0.01
G	信息技术业	170,653.30	0.04
H	批发和零售贸易	135,664.45	0.03
I	金融、保险业	2,480,376.43	0.60
J	房地产业	275,612.61	0.07
K	社会服务业	22,441.61	0.01
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	4,724,786.25	1.14

注：以上行业分类以2012年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

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

代码	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	600016	民生银行	52,627	413,648.22	0.10
2	600036	招商银行	28,813	396,178.75	0.10
3	601318	中国平安	7,806	353,533.74	0.09
4	601166	兴业银行	17,592	293,610.48	0.07
5	601328	交通银行	54,877	271,092.38	0.07
6	600000	浦发银行	26,079	258,703.68	0.06
7	600030	中信证券	16,048	214,401.28	0.05
8	601088	中国神华	7,685	194,814.75	0.05
9	601601	中国太保	7,324	164,790.00	0.04
10	601668	中国建筑	34,953	136,316.70	0.03

5.5 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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 投资组合报告附注

5.9.1 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,250,251.21
3	应收股利	-
4	应收利息	4,750.88
5	应收申购款	443,903.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,698,905.52

5.9.4 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。

5.9.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	413,896,009.39
本报告期基金总申购份额	18,935,903.26
减：本报告期基金总赎回份额	22,681,029.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	410,150,883.25

注：上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金设立的文件；

2、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》；

3、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金招募说明书》；

4、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金托管协议》；

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。

7.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3 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
二〇一三年一月二十一日

金元惠理宝石动力混合型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人：金元惠理基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年一月二十一日

§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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元惠理宝石动力混合
基金主代码	620001
交易代码	620001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月15日
报告期末基金份额总额	466,486,239.29份
投资目标	本基金主要投资具有稳健基础的中国优质企业，追求本基金资产的稳定收益与长期资本增值。
投资策略	在不同的市场阶段，本基金将分别从宏观经济情景、各类资产收益风险预期等方面进行深入分析，在股票与债券资产之间进行策略性资产配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化基金资产组合。本基金股票投资策略由采用自上而下的资产配置计划与自下而上的选股计划组成。资产配置计划贯穿国内外宏观经济分析和行业优选策略，即首先根据国家政策、国内外经济形势以及各产业的生命周期，对各行业投资价值进行优先排序，确定各行业的投资比重。选股计划采用金元惠理股票评级体系，对优选行业内的上市公司进行综合评级，精选出最有投资价值的股票。本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。
业绩比较基准	中信标普300指数×50%+中信国债指数×50%。
风险收益特征	本基金为一只稳健增长型的混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场型基金，属于中等预期收益、中等预期风险的证券投资基金品种。
基金管理人	金元惠理基金管理有限公司
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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-11,199,534.13
2.本期利润	308,437.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0007
4.期末基金资产净值	367,298,075.27
5.期末基金份额净值	0.7874

注：①上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；

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）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收益。

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	0.14%	0.60%	5.20%	0.62%	-5.06%	-0.02%

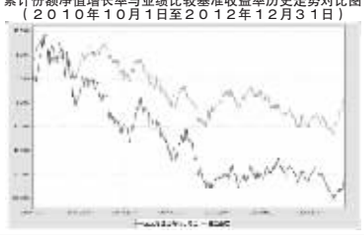
注：①上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

②本基金业绩比较基准为：中信标普300指数＊50% ＋ 中信国债指数＊50%；

③本基金从2010年10月1日起正式转型为混合型证券投资基金。

3.2.2自基金转型以来基金份额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

金元惠理宝石动力混合型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2010年10月1日至2012年12月31日）



注：①本基金合同生效日为2007年8月15日，基金的建仓期系自2007年8月15日起至2008年3月14日，在建仓期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定；

②本基金从2010年10月1日起正式转型为混合型证券投资基金；

③本基金转型后业绩比较基准为：中信标普300指数＊50% ＋ 中信国债指数＊50%；

④本基金投资组合中，股票资产占基金资产的比例为40%~60%，债券资产占基金资产的比例为35%~55%，权证不超过基金资产净值的3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。

§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		
侯斌	本基金基金经理	2011-12-22	-	10	金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理核心动力股票型证券投资基金和金元惠理宝石动力混合型证券投资基金基金经理，上海财经大学经济学学士。曾任光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2010年6月加入本公司，历任高级行业研究员，金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理和金元惠理核心动力股票型证券投资基金基金经理助理。10年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。
谷伟	本基金基金经理	2012-2-14	-	4	金元惠理宝石动力混合型证券投资基金基金经理、金元惠理丰利债券型证券投资基金和金元惠理保本混合型证券投资基金基金经理，上海交通大学管理学博士。曾任浙江红蜻蜓集团有限公司董事长秘书，德勤咨询（上海）有限公司高级咨询顾问，泰信基金管理有限公司基金经理助理。2011年12月加入本公司。4年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则、基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、股票备选库管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等，重视交易执行环节的公平交易措施，启用投资交易系统中的公平交易模块，以确保公平对待各投资组合。在报告期内，本管理人对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《异常交易监控与报告制度》。本报告期，根据制度的规定，对交易进行了监控，未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年四季度，上证综指涨8.77%，沪深300指数涨10.02%，主要原因是因为四季度陆续公布的经济数据显示经济已经探底回升，而且全球各大经济体都处于流动性充沛的状态，促使风险资产价格回升。

在本报告期，本基金主要