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招募说明书（更新）摘要

2015年第1号

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
二〇一五年一月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2010年3月26日证监许可[2010]378号文核准募集。本基金的基金合同于2010年5月28日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为上证社会责任ETF的联接基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合基金、债券型基金和货币市场基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为2014年11月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年9月30日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

设立日期：2005年9月19日

法定代表人：杨文升

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字［2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下：

股东名称	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
美国信安金融服务公司	25%
中国华电集团资本控股有限公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由6名监事组成，其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营管理由总经理负责。公司根据经营运作需要设置综合管理部、投资管理部、海外投资部、专户投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部十五个职能部门，以及深圳、成都、北京、上海四家分公司。在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。此外，公司还设有投资决策委员会和风险管理委员会。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

杨文升先生，董事长。现任中国建设银行副行长。1993年毕业于清华大学技术经济专业，获硕士学位。历任中国建设银行吉林省分行副处长、处长、分行行长助理、副行长，中国建设银行大连市分行行长，中国建设银行辽宁省分行行长。2014年6月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

孙志晨先生，董事。1985年获东北财经大学经济学学士学位，2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长，中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。

曹伟先生，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

欧阳伯权先生，董事，现任美国信安金融集团总裁 — 亚洲。1977年获加拿大滑铁卢大学城市设计及环境规划系学士学位。历任加拿大安泰保险公司管理级培训员、团体核保总监，美国友邦保险公司亚洲区团体保险部副总裁，信安国际有限公司亚洲区行政总裁。

袁时奋先生，董事，现任信安国际有限公司大中华区首席营运官。1981年毕业于美国阿而比学院。历任香港汇丰银行投资银行部副经理，加拿大丰业银行资本市场部高级经理，香港铁路公司库务部助理司库，香港置地集团库务部司库，香港赛马会副集团司库，信安国际有限公司大中华区首席营运官。

殷红军先生，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司副总经理。１９９８年毕业于首都经济贸易大学数量经济学专业，获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理（主持工作）、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长。

顾建国先生，独立董事，现任中国信达资产管理股份有限公司副总裁。1984年获浙江工业大学管理工程学学士学位，1991年获浙江大学经济系宏观经济专业硕士学位，1994年获财政部财科所研究生部财务学博士学位。历任中国建设银行信托投资公司总裁助理兼财会部经理、中国建设银行会计部副总经理、香港华建国际集团公司总经理。

王建国先生，独立董事，曾任大新人寿保险有限公司首席行政员，中银保诚退休金信托管理有限公司董事，英国保诚保险有限公司首席行政员，美国国际保险集团亚太区资深副总裁，美国友邦保险(加拿大)有限公司总裁兼首席行政员等。1989年获Pacific Southern University 工商管理硕士学位。

伏军先生，独立董事，法学博士，现任对外经济贸易大学法学院教授，兼任中国法学会国际经济法学研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

2、监事会成员

张涛女士，监事会主席，高级经济师。现任中共中国建设银行委员会第一巡视组组长。1999年毕业于东北财经大学投资经济管理专业。历任中国建设银行辽宁省分行储蓄处副处长、处长，中国建设银行辽宁省分行营业部总经理，中国建设银行辽宁省抚顺市分行行长、党委（组）书记，中国建设银行辽宁省分行副行长、党委委员，中国建设银行新疆区分行行长、党委书记，中国建设银行高级研修院副院长。

方蓉敏女士，监事，现任信安国际（亚洲）有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。方女士1990年获新加坡国立大学法学学士学位，拥有新加坡、英格兰和威尔斯以及香港地区律师从业资格。

唐湘晖女士，监事，现任中国华电集团资本控股有限公司政治工作部（纪检监察部）主任。1993年获北京物资学院会计学学士，2007年获得清华-麦考瑞大学应用金融硕士。历任中电联电力财会与经济发展研究中心，原电力工业部经济调节司，国家电力公司财务与资产管理部，中国华电集团公司财务与资产管理部，中国华电集团公司结算中心，中国华电集团公司金融管理部副处长，中国华电集团资本控股（财务）公司监审部经理。

翟峰先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。1988年获得安徽省安庆师范学院文学学士学位，1990年获得上海复旦大学国际经济法专业法学学士学位。历任中国日报评论部记者，秘鲁首钢铁矿股份有限公司内部审计部副主任，中国信达信托投资有限公司（原名为中国建设银行信托投资公司）证券发行部副总经理，宏源证券股份有限公司投资银行总部副总经理，上海永嘉投资管理有限公司执行董事、副总经理。

吴洁女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司风险管理部总监。1992年毕业于南开大学金融系，1995年毕业于中国人民银行金融研究所研究生部。历任中国建设银行国际业务部外汇资金处主任科员、中国建设银行资金部交易风险管理处副处长、中国建设银行资金部交易风险管理处、综合处高级副经理（主持工作）。

吴灵玲女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司人力资源管理部总监。1996年毕业于中国人民大学经济信息管理系，获得学士学位；2001年毕业于北京师范大学经济系，获得管理学硕士学位。历任中国建设银行总行人力资源部主任科员，高级经理助理，建信基金管理公司人力资源管理部总监助理，副总监，总监。

3、公司高管人员

孙志晨先生，总经理（简历请参见董事会成员）。

何斌先生，副总经理。1992年获东北财经大学计划统计系学士学位。先后就职于北京市财政局、北京京都会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部、国泰基金管理公司副总经理、建信基金管理公司督察长。

王新艳女士，副总经理。特许金融分析师（CFA），硕士。1998年10月加入长盛基金管理公司，历任研究员、基金经理助理，2002年11月2日至2004年5月22日担任长盛成长价值股票型证券投资基金的基金经理。2004年6月加入景顺长城基金管理公司，历任基金经理、投资副总监、投资总监等职，于2005年3月16日至2009年3月16日任景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）的基金经理，于2007年6月18日至2009年3月16日任景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2009年3月加入本公司，任总经理助理，2010年5月起任副总经理。2009年12月17日至2011年2月1日任建信恒久价值股票型证券投资基金的基金经理；2010年4月27日至2013年12月20日任建信核心精选股票型证券投资基金的基金经理；2010年11月16日至2011年12月20日任建信内生动力股票型证券投资基金的基金经理。

4、督察长

路彩营女士，督察长。1979年毕业于河北大学经济系计划统计专业。历任中国建设银行副主任科员、主任科员、副处长、处长，华夏证券部门副总经理，宝盈基金管理公司首席顾问（公司副总经理级），建信基金管理公司监事长。

5、本基金基金经理

叶乐天先生，硕士。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交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

梁洪昀先生：2010年5月28日至2012年5月28日。

叶乐天先生：2012年3月21日至今。

6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总经理。

王新艳女士，副总经理。

梁洪昀先生，投资管理部总监。

万志勇先生，投资管理部副总监。

钟敬棣先生，投资管理部副总监。

姚锦女士，研究部首席策略分析师。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545,827元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至2014年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工170人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2014年6月，中国工商银行共托管证券投资基金380只。自2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的41项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。

（1）直销柜台

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：杨文升

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

（2）网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址：www.ccbfund.cn。

2.代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安兴融中心)

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

（2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（3）中国农业银行

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：薛峰

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（4）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

（5）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

网址：www.95559.com.cn

（6）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555

传真：0755-83195049

网址：www.cmbchina.com

（7）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

公司网站：www.cmbc.com.cn

（8）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

（9）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

（10）中信证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

客服电话：95558

网址：www.citics.com

（11）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

客服电话：10108998

网址：www.ebscn.com

（12）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

客户服务热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

（13）中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路11号万凯商务楼A座

法定代表人：刘军

客服电话：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

（14）长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

客服电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

（15）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

客户服务电话：400-8888-001，(021)962503

网址：www.htsec.com

（16）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：4008-888-999

公司网址：www.95579.com

（17）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

（18）齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（19）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：0431-96688、0431-85096733

网址：www.nesc.cn

（20）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：杜庆平

客户服务电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

（21）广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路183号大都会广场43楼

法定代表人：孙树明

客户服务电话：020-95575

网址：www.gf.com.cn

（22）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

法定代表人：黄金琳

客服热线：0591-96326

网址：www.gfhfzq.com.cn

（23）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（24）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268

法定代表人：兰荣

客户服务电话：4008888123

网址：www.xyzq.com.cn

（25）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

客服热线：4008866338

网址：stock.pingan.com

（26）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：龙增来

开放式基金咨询电话：4006008008

网址：www.china-invs.cn

（27）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心20层

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：0755－82825555

网址：www.axzq.com.cn

（28）国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

客户服务热线：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

（29）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

法定代表人：陈有安

客户服务电话：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（30）中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

法定代表人：杨宝林

客服电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

（31）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户咨询电话：025-84579897

网址：www.htsc.com.cn

（32）宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：冯戎

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（33）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

客服电话：021-962518

网址：www.962518.com

（34）财富证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路2段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人：周晖

客户服务电话：0731-4403340

网址：www.cfzq.com

（35）东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼

法定代表人：朱科敏

客服热线：4008888588

网址：www.longone.com.cn

（36）申银万国证券股份有限公司

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

客服电话：95523或4008895523

网址：www.sywg.com

（37）浙商证券股份有限公司

办公地址：杭州杭大路1号黄龙世纪广场A6/7

法定代表人：吴承根

客服电话：0571-967777

网址：http://www.stocke.com.cn

（38）天源证券经纪有限公司

注册地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼

法定代表人：林小明

客服电话：0755-33331188

网址：www.tyzq.com.cn

（39）广州证券有限责任公司

注册地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20层

法定代表人：刘东

客服电话：020-88836999

网址：www.gzs.com.cn

（40）红塔证券有限责任公司概况

住所：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

客服电话：0871-3577930

网址：http://www.hongtastock.com/

（41）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（42）深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006788887

网址：www.zlfund.cn，www.jmmw.com

（43）杭州数米基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000766123

网址：www.fund123.cn

（44）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

（45）上海天天基金销售有限公司概况

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

法定代表人：其实

客户服务电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

（46）和讯信息科技有限公司概况

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

客户服务电话：4009200022

网址：http://fund.licaike.com

（47）浙江同花顺基金销售有限公司概况

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：400-877-3772

网址：www.5ifund.com

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：杨文升

联系人：郑文广

电话：010-66228888

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010－66575888

传真：010－65232181

经办律师：徐建军、刘焕志

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人：杨绍信

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：薛竞、陈熹

四、基金的名称

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。

五、基金的类型

ETF联接基金。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

本基金以上证社会责任ETF、上证社会责任指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于上证社会责任ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；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%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

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。

本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：在正常情况下，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略

本基金主要投资于上证社会责任ETF、上证社会责任指数成份股和备选成份股，采取自上而下的资产配置策略，保留现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，然后主要通过一级市场将剩余的大部分资产投资于上证社会责任ETF并使该投资比例不低于基金资产净值的90%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

2、目标ETF投资策略

（1）基金组合的构建原则

本基金对基金的投资仅限于指定的目标ETF，现时目标ETF仅指上证社会责任ETF。

（2）基金组合的构建方法

本基金可以以成份股实物形式在一级市场申购及赎回上证社会责任ETF基金份额；本基金可在二级市场上买卖上证社会责任ETF基金份额，本基金在二级市场上买卖上证社会责任ETF基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

本基金作为上证社会责任ETF的联接基金，主要通过成份股实物形式从一级市场申购ETF份额来构建ETF投资组合。不足一级市场最小申购赎回单位资产净值的部分可以从二级市场买入ETF份额或者投资于上证社会责任指数的成份股和备选成份股等。本基金在二级市场的ETF份额投资将不以套利为目的，作为被动投资的开放式基金，套利不符合本基金的投资特点和运作目的。

（3）基金组合的调整

本基金为ETF联接基金，基金所构建的ETF投资组合将根据目标ETF的变动而发生相应变化。本基金将根据法律法规中的投资比例限制、申购和赎回情况、现金头寸，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3、成份股投资策略

（1）股票组合的构建原则

成份股组合的构建主要是基金经理根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，以抽样复制法构建组合。

（2）股票组合的构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化进行上证社会责任指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用抽样复制基准指数的方法，在综合考虑个股的市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证社会责任指数的相关性等因素的基础上，采用重点抽样方法，选择上证社会责任指数的成份股构建股票投资组合。考虑到个股权重集中度的因素，本基金主要投资于上证社会责任指数的前5大成份股，按照其在社会责任指数的原有比例分配权重后构成抽样组合。

（3）股票组合的调整

1）定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的上证社会责任指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

2）不定期调整

基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

对个别成份股，若其存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大不利的司法诉讼、或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替。

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购。

4、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性和有效利用基金资产。

通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、短期金融工具等产品的比例。并灵活地采用收益率曲线方法、市场和品种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合。力求这些有效的固定收益类证券组合，在一定的风险度下能提供最大的预期收益，或者在确定收益率上承担最小的风险。

5、其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。本基金的基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得用于投机交易目的。

6、跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金跟踪误差的来源包括：留存现金及债券部分、成份股和备选成份股的投资、基金每日现金流入或流出的建仓或变现策略、股息的再投资策略等。基金管理人将通过对上述因素的有效管理，追求跟踪误差最小化。本基金每日跟踪基金组合与业绩比较基准表现的偏离度，每月末定期分析基金组合与业绩比较基准表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

九、投资业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：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。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

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。

本投资组合报告所载数据截至2014年9月30日，本报告中的财务资料未经审计。

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	5,056,811.77	1.92
	其中：股票	5,056,811.77	1.92
2	基金投资	241,062,500.00	91.44
3	固定收益投资	6,556,960.20	2.49
	其中：债券	6,556,960.20	2.49
	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	10,578,504.08	4.01
8	其他各项资产	371,988.23	0.14
9	合 计	263,626,764.28	100.00

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	241,062,500.00	92.88

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	采矿业	396,679.38	0.15
C	制造业	1,541,669.25	0.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	134,752.62	0.05
E	建筑业	464,276.22	0.18
F	批发和零售业	95,547.81	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	42,810.20	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	523,698.22	0.20
J	金融业	1,672,360.13	0.64
K	房地产业	170,830.22	0.07
L	租赁和商务服务业	14,187.72	0.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合 计	5,056,811.77	1.95

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。

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

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	600685	广船国际	22,855	577,545.85	0.22
2	600845	宝信软件	13,428	409,419.72	0.16
3	601318	中国平安	8,144	336,672.96	0.13
4	600036	招商银行	28,083	291,782.37	0.11
5	600016	民生银行	46,123	287,807.52	0.11
6	600497	驰宏锌锗	25,522	265,173.58	0.10
7	600068	葛洲坝	53,277	254,131.29	0.10
8	601222	林洋电子	7,670	205,479.30	0.08
9	601166	兴业银行	19,453	198,809.66	0.08
10	600000	浦发银行	19,043	185,669.25	0.07

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,556,960.20	2.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	6,556,960.20	2.53

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019322	13国债22	65,380	6,556,960.20	2.53

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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

9、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。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

12、投资组合报告附注

12.1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。

12.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,286.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	243,678.42
5	应收申购款	101,023.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合 计	371,988.23

12.4 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。

12.5 报告期末前十名股票中存