

建信内生动力混合型证券投资基金

2015 第三季度报告

基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当按照法律法规及中国证监会的有关规定，于2015年10月23日发布了本报告中的财务报表、净值表现和投资组合信息等内容，保证投资者及时、准确、完整地获取有关信息，并不得有虚假记载、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。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当按照法律法规及中国证监会的有关规定，于2015年10月23日发布了本报告中的财务报表、净值表现和投资组合信息等内容，保证投资者及时、准确、完整地获取有关信息，并不得有虚假记载、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。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当按照法律法规及中国证监会的有关规定，于2015年10月23日发布了本报告中的财务报表、净值表现和投资组合信息等内容，保证投资者及时、准确、完整地获取有关信息，并不得有虚假记载、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。

基金名称	建信内生动力组合
基金代码	530011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月16日
报告期末基金份额总额	383,741,112.80份
投资目标	在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采取主动、主动的资产配置策略，重点投资于消费性内生动力行业，投资性内生动力行业，消费性内生动力行业具有持续成长性/成长性的上市公司股票，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为：70%×沪深300指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。
风险等级	本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中收益/中风险特征的基金。
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

注：本基金自2015年9月30日起由混合型证券投资基金变更为混合型证券投资基金。

主要财务指标	报告期末 (2015年7月1日 - 2015年9月30日)	单位：人民币元
1.本期已实现收益	-159,228,099.56	
2.本期利润	-193,132,922.59	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4471	
4.期末基金资产净值	614,666,321.89	
5.期末基金份额净值	1.341	

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）扣除相关费用后的金额，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。

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	-24.41%	2.42%	-21.20%	25.1%	-3.21%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
万忠恩	权益投资部总经理、本基金的基金经理	2010年11月17日 - 2015年9月28日	14	硕士，曾就职于西安创信互融股权投资公司、北方证券有限公司、大成基金管理有限公司、鹏华基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、（前田田基金管理有限公司）、瑞华基金管理有限公司，2008年10月23日至2010年11月17日任建华先施基金基金经理，2010年11月17日至2010年10月19日任建华和主题基金基金经理，2010年10月19日至2013年10月16日任建华基金基金经理，2013年10月16日至2015年9月28日任建华基金基金经理，2015年9月28日至2015年9月28日任建华基金基金经理，2015年9月28日至2015年9月28日任建华基金基金经理。
吴兴伟	研究部总经理、本基金的基金经理	2014年11月26日 -	8	硕士，2004年6月至2007年6月任长城基金资产管理部研究员，2007年6月至2011年7月任招商基金资产管理部研究员，2011年7月至2014年11月任招商基金资产管理部研究员，2014年11月至2015年9月28日任招商基金资产管理部研究员，2015年9月28日至2015年9月28日任招商基金资产管理部研究员。

4.2 管理人对于报告期内本基金遵守法律法规情况的说明

本报告期内，本基金管理人不存在有损基金份额持有人利益的行为，基金管理人及基金经理均严格遵守基金合同中的各项承诺，严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定，恪尽职守，勤勉尽责，切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.3 公平交易制度的执行情况

7.1 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.3 公平交易制度的执行情况

4.3.4 公平交易制度的执行情况

4.3.5 公平交易制度的执行情况

4.3.6 公平交易制度的执行情况

4.3.7 公平交易制度的执行情况

4.3.8 公平交易制度的执行情况

4.3.9 公平交易制度的执行情况

4.3.10 公平交易制度的执行情况

4.3.11 公平交易制度的执行情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	376,496,832.14	63.67
2	其中：股票	376,496,832.14	63.67
3	固定收益投资	--	--
4	其中：债券	--	--
5	资产支持证券	--	--
6	贵金属投资	--	--
7	金融衍生品投资	--	--
8	其他资产	--	--
9	合计	376,496,832.14	63.67

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	14,640,000.00	2.84
B	采矿业	--	--
C	制造业	246,737,300.03	47.94
D	电力、热力、燃气及生产水和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	31,880,460.40	6.19
G	交通运输、仓储和邮政业	2,563,702.00	0.50
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,834,730.45	4.63
J	金融业	33,763,000.00	6.56
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	13,009,581.76	2.54
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	10,037,881.69	1.96

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

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27日

§1 重要提示
基金管理人的董事会及董事承诺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2016年10月28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预示其未来业绩表现。投资者有风险，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。
本基金的财务资料截止于2016年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南证红利
基金代码	510000
交易所代码	510000
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	99,581,114.00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，实现与标的指数长期一致的正长期投资收益。
投资策略	本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，跟踪标的指数的成份股的比例构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数的成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	上证社会综合指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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，具有与标的指数所代表的股票市场的类似的风险收益特征，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

主要财务指标	报告期(2016年07月1日至2016年09月30日)
1.本期已实现收益	9,039,488.31
2.本期利润	-37,764,694.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3749
4.期末基金资产净值	119,919,407.49
5.期末基金份额净值	1.1942

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.本基金净值表现不包括由个人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

§3.2 基金净值表现
3.2.1 报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

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	①-③	②-④
过去三个月	-24.00%	3.30%	-24.59%	3.32%	-0.02%

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对比

注：本报告期，本基金的业绩比较基准仍为符合基金合同约定的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金概况（或基金管理人）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
叶乐天	本基金的经理	2012年3月21日	7	硕士，曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任区域风险管理经理、量化分析经理、从事股指期货、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12月21日起任上证社会综合指数开放式股票证券投资基金及其联接基金的基金经理。2013年3月28日起任建信红利指数证券投资基金开放式股票基金基金经理。2014年1月27日起任上证50指数增强基金基金经理。2015年10月26日起任建信中证红利指数增强证券投资基金基金经理。

4.2 管理人及报告期内基金管理人遵守诚信情况的说明
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履行证券投资基金管理人的基本权利，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》和《上证社会综合指数开放式股票证券投资基金合同》的规定。

4.3 公平交易制度的执行情况
4.3.1 公平交易制度的执行情况
为公平对待投资人，保护投资人利益，避免产生不正当关联交易，利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金合同》等有关规定，制定了公平交易管理制度，并严格执行了公平交易管理制度。公平交易管理制度包括：公平交易制度的制定、公平交易制度的执行、公平交易制度的监督与评价、公平交易制度的改进与完善等。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金管理人严格执行了公平交易管理制度，未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内，本基金根据基金合同约定，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源于基金市值相对有现金的仓位以及所持证券组合与跟踪标的指数在构成上的差异。权益组合上的差异主要来自部分投资于含A股等境外资产，申购赎回资金在境外股票组合的收益与标的指数比例有所变化。同时跟踪误差较大的大部分原因在于本基金跟踪标的指数的同时也适度增加了基金的跟踪误差。本基金管理人在履行基金管理人职责时，采取了适当的跟踪误差管理，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组合报告
本报告期末基金份额净值-24.00%，波动率3.3%，业绩比较基准收益率-24.59%，波动率3.32%。

4.4.3 管理人及报告期内基金管理人遵守诚信情况的说明
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履行证券投资基金管理人的基本权利，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》和《上证社会综合指数开放式股票证券投资基金合同》的规定。

4.4.4 公平交易制度的执行情况
4.4.4.1 公平交易制度的执行情况
为公平对待投资人，保护投资人利益，避免产生不正当关联交易，利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金合同》等有关规定，制定了公平交易管理制度，并严格执行了公平交易管理制度。公平交易管理制度包括：公平交易制度的制定、公平交易制度的执行、公平交易制度的监督与评价、公平交易制度的改进与完善等。

4.4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金管理人严格执行了公平交易管理制度，未发现异常交易行为。

4.4.5 报告期内基金投资策略和运作分析
4.4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内，本基金根据基金合同约定，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。

4.4.5.2 报告期内基金的投资组合报告
本报告期末基金份额净值-24.00%，波动率3.3%，业绩比较基准收益率-24.59%，波动率3.32%。

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	2,909,368.42	2.45
C	制造业	21,876,202.49	18.40
D	电力、热力、燃气及生产供应业	2,082,252.48	1.76
E	建筑业	13,888,130.05	11.61
F	批发和零售业	3,836,367.12	3.23
G	交通运输、仓储和邮政业	617,942.53	0.52
H	信息传输业	-	-
I	住宿、餐饮业和住宿业	4,484,868.94	3.77
J	金融业	60,170,866.76	50.60
K	房地产业	7,480,120.00	6.29
L	租赁和商务服务业	474,902.70	0.40
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		117,822,140.18	99.08

注：以上行业分类采用中国证监会2015年12月1日起实施的《证券基金行业分类标准》。

§3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

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	-	-
C	制造业	274,263.84	0.23
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业		

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 重要提示

基金管理人、基金托管人和基金销售机构均不存在虚假记载、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约定，于2015年10月23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。

本报告中文财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金名称	信誉转债
基金代码	530010
交易代码	530010
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2010年5月20日
报告期末基金份额总额	90,984,727.93份
投资目标	通过持有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的跟踪基金，主要通过投资于上证社会责任ETF实现投资目标。当本基金申购赎回款流入、流出市场及上证社会责任ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的的跟踪误差可能带来影响时，或预期成份股发生调整或因成份股发生分红、增发、小股等事件时，基金管理人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% × 商业银行税后同期存款利率
风险收益特征	本基金为上证社会责任ETF的跟踪基金，风险与预期收益水平高于市场基准，将本基金与市场上其他基金相比，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的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
基金代码	530000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年5月20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 目标基金产品说明

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，实现与标的指数收益一致，谋求长期投资增值。
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构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数的成分股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型基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数所代表的股票市场的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	
主要财务指标	报告期：2015年7月1日 - 2015年9月30日
1.本期已实现收益	4,564,338.97
2.本期利润	-36,616,291.83
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3926
4.期末基金份额净值	122.07/242.78
5.期末基金份额净值	1.3609

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 本基金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

2015 第

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	-22.96%	3.06%	-23.39%	3.15%	0.43%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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。

§ 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	任本基金基金经理时间		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶天	本基金基金经理	2012年3月21日	-	7	硕士，曾就职于中国国际金融有限公司，后担任证券交易员、研究员、量化分析研究员、基金经理、量化分析研究员。2011年加入大成基金，担任基金经理。2012年3月21日起任大成基金上证社会责任交易型开放式证券投资基金及其联接基金的基金经理。2013年3月21日起任大成基金上证社会责任交易型开放式证券投资基金的基金经理。2014年11月27日起任大成基金上证社会责任交易型开放式证券投资基金的基金经理。2015年7月26日起任信誉转债制造指数增强型证券投资基金的基金经理。

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 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》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理人特定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，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块执行操作，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超过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该ETF的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动及因此造成的集中分红也会对基金的跟踪误差和偏离度造成一定影响。本报告期内，基金跟踪误差和日均偏离度均被控制在基金合同约定范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-22.96%，波动率3.08%，业绩比较基准收益率为-23.39%，波动率3.15%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

式指数证券投资基金联接基金

三 季 度 报 告

上列社会责任投资
附属于投资组合的
证券投资基金

股票型

交易型开放式证
券投资基金

建信基金管理有
限责任公司

115,837,400.00

94.28

三季度初期,股指延续二季度的涨势,快速下跌,而投资者的恐慌情绪蔓延则进一步放大了指数的跌幅。之后随着个股泡沫的不断挤出以及政府维稳行动的进行,指数开始企稳并在低位震荡,波动率仍维持较高水平。展望四季度,预计指数仍将维持震荡格局,个股分化会继续扩大,投资者对公司的基本面将更为关注。

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	520,119.76	0.42
其中:股票		520,119.76	0.42
2	基金投资	115,837,400.00	93.64
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	7,280,323.85	5.88
8	其他资产	73,516.24	0.06
9	合计	123,711,429.84	100.00

5.2 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	--	--
B	采矿业	--	--
C	制造业	2693,267.09	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,364.00	0.07
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	83,088.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	68,597.68	0.06
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	--	--
S	综合	--	--
	合计	520,119.76	0.42

注:以上行业分类以2015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	600879	航天电子	9,376	140,260.03	0.12
2	601877	正海磁材	6,547	134,017.00	0.11
3	600896	国统电力	9,600	84,364.00	0.07
4	600153	振发股份	4,800	83,088.00	0.07
5	600561	江中药业	6,742	68,597.68	0.06

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

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

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.2 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。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	58,321.54
2	应收证券清算款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	1,483.69
5	应收申购款	13,701.02
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	73,516.24

5.12.2 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。

5.12.3 报告期末前十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	601877	正海磁材	134,017.00	0.11	重大资产重组
2	600153	振发股份	83,088.00	0.07	重大资产重组

§ 6 开放式基金净值变动

单位:份

报告期末基金份额总额	92,401,090.19
报告期期间基金总申购份额	27,419,184.05
减:报告期期间基金总赎回份额	28,836,546.31
减:报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	--
报告期末基金份额总额	90,984,727.93

注:1、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 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

本基金本报告期未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 备查文件目录

8.1 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、报告期内基金基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,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
2015年10月27日