

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

2018年第三季度报告

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 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

本基金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上证责任ETF的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动以及成份股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，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率为6.07%，波动率1.37%，业绩比较基准收益率为4.37%，波动率1.4%。

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	2,430,048.07	23.4
2	固定收益	4,310,095.97	41.6
3	基金投资	96,284,000.00	91.6
4	其他资产	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	6,006,094.00	5.76
9	其他资产	106,297,698.00	100.0
10	合计	110,778,936.04	100.0

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	30,700.00	0.03
C	制造业	546,170.89	0.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,729.00	0.02
E	建筑业	197,154.00	0.18
F	批发和零售业	76,593.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	44,693.16	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	97,632.40	0.09
J	金融业	1,266,207.69	1.20
K	房地产业	129,297.92	0.12
L	租赁和商务服务业	4,746.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	6,413.64	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、深埋其他服务业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	资产支持证券	-	-
R	债券投资	-	-
S	其他	-	-
合计		2,430,048.07	2.26

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金无港股通投资股票。

4.2 管理人对于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。本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》、《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》、《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》等风险管理制度。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 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

本基金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上证责任ETF的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动以及成份股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，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率为6.07%，波动率1.37%，业绩比较基准收益率为4.37%，波动率1.4%。

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	18,749,472.82	13.31
2	固定收益	18,749,472.82	13.31
3	基金投资	116,300,814.48	82.61
4	其他资产	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	4,407,770.69	3.17
9	其他资产	149,893,619.39	108.00
10	合计	149,893,619.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	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	11,718,571.62	11.80
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	-	-
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	6,558,500.00	6.56
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	1,510,400.00	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、深埋其他服务业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	资产支持证券	-	-
R	债券投资	-	-
S	其他	-	-
合计		18,749,472.82	18.33

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金无港股通投资股票。

4.2 管理人对于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。本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》、《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》、《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》等风险管理制度。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 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

本基金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上证责任ETF的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动以及成份股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，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率为6.07%，波动率1.37%，业绩比较基准收益率为4.37%，波动率1.4%。

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	61,486,389.84	61.75
2	固定收益	61,486,389.84	61.75
3	基金投资	10,000,000.00	9.85
4	其他资产	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	4,000,079.00	3.98
9	其他资产	62,141,829.89	61.1
10	合计	129,114,678.53	100.0

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,330,230.00	3.34
C	制造业	37,981,242.00	37.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,366,480.00	1.35
E	建筑业	2,498,271.30	2.49
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	2,226,524.99	2.24
J	金融业	22,678,877.67	22.72
K	房地产业	4,297,922.00	4.29
L	租赁和商务服务业	1,428,000.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	628,400.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	628,744.00	0.62
O	国防军工、深埋其他服务业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	资产支持证券	-	-
R	债券投资	-	-
S	其他	-	-
合计		61,486,389.84	60.99

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金无港股通投资股票。

4.2 管理人对于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。本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》、《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》、《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》等风险管理制度。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 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

本基金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上证责任ETF的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动以及成份股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，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率为6.07%，波动率1.37%，业绩比较基准收益率为4.37%，波动率1.4%。

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	42,046,389.84	41.75
2	固定收益	42,046,389.84	41.75
3	基金投资	10,000,000.00	9.85
4	其他资产	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	4,000,079.00	3.98
9	其他资产	62,141,829.89	61.1
10	合计	129,114,678.53	100.0

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,330,230.00	3.34
C	制造业	37,981,242.00	37.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,366,480.00	1.35
E	建筑业	2,498,271.30	2.49
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	2,226,524.99	2.24
J	金融业	22,678,877.67	22.72
K	房地产业	4,297,922.00	4.29
L	租赁和商务服务业	1,428,000.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	628,400.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	628,744.00	0.62
O	国防军工、深埋其他服务业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	资产支持证券	-	-
R	债券投资	-	-
S	其他	-	-
合计		42,046,389.84	40.99

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金无港股通投资股票。

4.2 管理人对于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。本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》、《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》、《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》等风险管理制度。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 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

本基金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上证责任ETF的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动以及成份股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，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率为6.07%，波动率1.37%，业绩比较基准收益率为4.37%，波动率1.4%。

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	42,046,389.84	41.75
2	固定收益	42,046,389.84	41.75
3	基金投资	10,000,000.00	9.85
4	其他资产	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	4,000,079.00	3.98
9	其他资产	62,141,829.89	61.1
10	合计	129,114,678.53	100.0

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,330,230.00	3.34
C	制造业	37,981,242.00	37.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,366,480.00	1.35
E	建筑业	2,498,271.30	2.49
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	2,226,524.99	2.24
J	金融业	22,678,877.67	22.72
K	房地产业	4,297,922.00	4.29
L	租赁和商务服务业	1,428,000.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	628,400.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	628,744.00	0.62
O	国防军工、深埋其他服务业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	资产支持证券	-	-
R	债券投资	-	-
S	其他	-	-
合计		42,046,389.84	40.99

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金无港股通投资股票。

4.2 管理人对于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。本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《