

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年3月26日

重要提示

基金管理人、基金托管人及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法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2019年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告自2018年1月1日起至2019年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

2.1 基金基本情况

基金简称	上证ETF
缩写简称	上证ETF
基金代码	510000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年6月28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
报告期末基金份额总额	63,561,114,009份
基金合同存续期	不定期
基金上市交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年8月25日

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,实现与标的指数相同-相近的投资收益。
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及其权重构建投资组合,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	上证社会责任指数。
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为被动型基金,具有和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	基金托管人
建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	姓名
张明	张明
联系电话	010-66166288
电子邮箱	010-66166288
客户服务电话	400-81-98883
网址	010-66166200

2.2 基金业绩表现

本基金年度净值变动的管理人互联网地址: <http://www.ccbfund.cn>

基金年度报告备置地点: 基金管理人及基金托管人的住所

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

项目	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	7,711,564.70	8,822,414.29	-2,613,478.71
本期利润	-17,406,534.83	27,527,367.98	-6,486,772.00
加权平均基金份额本期利润	-0.2749	0.3679	-0.0701
本期基金份额净值增长率	-16.67%	20.54%	-4.76%
1. 本期基金份额净值增长率	0.0661	0.0302	0.4600
2. 本期基金份额净值增长率	88.164,462.76	116,717,771.73	104,508,428.00
3. 本期基金份额净值增长率	1.3944	1.6774	1.3900

1. 本基金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. 所述基金份额净值增长率不包括持有人认购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配的利润金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配的利润金额为期末未分配利润(已实现部分)扣减未实现部分。

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	7,711,564.70	8,822,414.29	-2,613,478.71
本期利润	-17,406,534.83	27,527,367.98	-6,486,772.00
加权平均基金份额本期利润	-0.2749	0.3679	-0.0701
本期基金份额净值增长率	-16.67%	20.54%	-4.76%
1. 本期基金份额净值增长率	0.0661	0.0302	0.4600
2. 本期基金份额净值增长率	88.164,462.76	116,717,771.73	104,508,428.00
3. 本期基金份额净值增长率	1.3944	1.6774	1.3900

1. 本基金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. 所述基金份额净值增长率不包括持有人认购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配的利润金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配的利润金额为期末未分配利润(已实现部分)扣减未实现部分。

3.2 基金业绩表现

本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

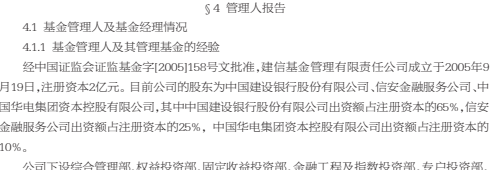
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-12.12%	1.59%	-12.14%	1.59%	0.02%	0.00%
过去六个月	-63.75%	15.28%	-63.33%	15.33%	1.76%	-0.01%
过去一年	-16.67%	1.36%	-20.69%	1.37%	3.01%	-0.01%
过去三年	1.77%	1.17%	-7.21%	1.18%	9.48%	-0.01%
过去五年	71.31%	1.55%	51.86%	1.57%	19.68%	-0.02%
自基金合同生效之日起至今	65.36%	1.49%	33.22%	1.51%	33.13%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效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



本报告期末,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金托管人

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

信息披露

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

基金管理人

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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