

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (更新)摘要

2019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
二〇一九年七月

【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6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;因基金份额净值及交易价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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,需充分了解本基金的风险收益特征及产品特性,充分考虑自身风险承受能力,对投资本基金的意见、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持份额享受基金的收益,但同时也要承担相应的投资风险。

投资本基金可能遇到的风险包括:标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险以及基金投资组合回报与标的指数的跟踪偏离的风险。基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金退市风险、投资者申购/赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险以及基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理人风险、基金业绩波动风险、风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为股票型基金,紧密跟踪标的指数,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。

投资者投资,投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金业绩并不构成新基金业绩表现的保证。本招募说明书所载内容截止日为2019年6月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(招募说明书未更新审计)。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:2006年9月19日
法定代表人:孙志晨
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[2006]168号文批准设立。公司的股权结构如下: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和对总裁等高级管理人员的监督和聘任权。

公司监事会成员,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、高级管理人员履职尽责情况。

(二)主要人员情况

1. 董事会成员
孙志晨先生,董事长,1986年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。2006年9月出任建信基金公司总裁,2018年4月起任建信基金公司董事长。

张军红先生,董事,现任建信基金公司总裁。毕业于国家行政学院行政管理专业,获博士学位。历任中国建设银行筹资部证券业务处科长,副主任科员、主任科员;零售业务部主任科员;个人银行业务部个人存款处副经理,高级理财经理,行长办公室秘书,高级副经理级秘书,秘书,高级经理,投资管理部总经理助理、副总经理,投资管理部总经理,资产管理部副总经理。2017年3月起任公司监事会主席,2018年4月起任建信基金公司总裁。

曹伟先生,董事,现任中国建设银行个人存款与投资管理部副总经理,1990年毕业于中文系硕士学历。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、北京分行顺义支行行长、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管理部总经理助理。

张维义先生,董事,现任信安亚洲区总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位。2012年获得香港科技大学暨大学EMBA工商管理硕士学位。历任新加坡公共服务委员会处长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,信银基金公司首席运营官和总经理,英国保诚集团(马来西亚)资产管理公司首席执行官,宏利金融全球副总裁,宏利资产管理公司(台湾)首席执行官和执行董事,信安北亚地区副总裁,总裁。

郑树明先生,董事,现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席运营官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理,新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长,爱德蒙顿希尔斯亚洲有限公司市场行销总监。

华薇女士,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学,获经济学博士学位。历任《长春晨报》新闻中心农村工作部记者,湖南卫视《视我非诚勿扰》财经节目组运营总监,输煤控股集团副总,锦辉精细化工有限公司总经理,吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理,理财中心总经理,财富管理总监兼理财中心总经理、副总经理,光大证券财富管理总经理(MD)。

李全先生,独立董事,现任新华资产管理股份有限公司董事总经理,1985年毕业于中国人民大学财政金融学院,1988年毕业于中国人民大学银行研究生班。历任中国人民银行总行信托投资公司职员、正国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理,博时基金管理有限公司副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理。

史亚萍女士,独立董事,现任嘉浩控股有限公司首席运营官。1994年毕业于对外经济贸易大学,获国际金融硕士学位;1996年毕业于耶鲁大学研究生院,获经济学硕士学位。先后在标准普尔国际评级公司、英国友邦民生银行、野村证券亚洲、惠理兄弟亚洲、中国投资有限公司、美国威灵顿资产管理、中金资本等多家金融机构担任管理职务。

邱峰之先生,独立董事,现任天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)首席合伙人。毕业于湖南大学高级工商管理专业,获EMBA学位,全国会计领军人才,中国注册会计师,注册资产评估师,高级会计师,澳洲注册会计师。1999年10月加入天职国际会计师事务所,现任首席合伙人。

2. 监事会成员

马美芹女士,监事会主席,高级经济师,1994年毕业于中央财经大学金融学院,获学士学位,2009年获长江商学院高级管理人员工商管理硕士学位。1994年加入建设银行,历任总行筹资部副部长,零售业务部,个人银行部副行长、处长,资深高级经理(技术二级),个人金融部副总经理,个人存款与投资部总经理。2018年6月起任建信基金公司监事会主席。

方敬敏女士,监事,现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团市场发展总监兼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年赴新加坡国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士,监事,高级会计师,现任中国华电集团资本控股有限公司机构与战略研究部总经理。1992年获东北财经大学工业会计专业学士学位,2009年获中央财经大学会计专业硕士学位。历任北京北奥有限公司,中进会计师事务所,中瑞华恒信会计师事务所,中国华电集团财务有限公司计划财务部总经理助理、副经理,中国华电集团资本(华电财务)公司计划财务部经理,中国华电集团财务有限公司财务部副经理,中国华电集团资本控股有限公司企业资源部副经理。

安晓先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司信息技术总监。1996年毕业于北京工业大学计算机应用系,获学士学位。1996年8月加入中国建设银行,历任北京分行信息技术部干部,信息技术管理部北京开发中心项目经理、处长,2006年11月加入建信基金管理公司,历任基金运营部总经理助理、基金运营部副经理、信息技术部执行总经理、信息技术部总经理、信息技术总监兼金融科技部总经理、信息技术总监。

尹冰女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源部总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业,获硕士学位。曾任安华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2006年8月加入建信基金管理公司,历任人力资源部专员、主管、部门总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司审计部总经理,英国特许公认会计师公会(ACCA)会员。1997年毕业于中国人民大学会计系,获学士学位;2010年:福州市于香港中文大学,获工商管理硕士学位。曾任地马威华恒会计师事务所高级审计师,华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月加入建信基金管理有限责任公司,历任监察稽核部监察稽核专员、稽核主管、资源稽核专员、内控合规部副经理、内控合规部副经理兼内控合规部审计部(二级部)总经理、审计部总经理。

3. 公司高级管理人员

张军红先生,总裁(简历请参见董事会成员)。
曲寅军先生,副总裁,硕士。1999年7月加入中国建设银行总行,历任审计部科员、副主任科员、团委主任科员,重组改制办公室主任高级副经理,行长办公室高级副经理;2005年9月起就职于建信基金管理公司,历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副经理、专户投资部总监和首席战略官;2013年8月至2015年7月,任我公司控股子公司建信基金管理有限责任公司董事、总经理。2015年8月6日至2019年3月13日任我公司副总裁,2015年8月至2017年11月30日任建信资本管理有限公司董事、总经理。2017年11月30日至2018年11月1日兼任建信资本管理有限公司董事长。2019年3月从我公司离任。

张威或先生,副总裁,硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行,从事个人零售业务,2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部,从事证券投资基金销售业务,任高级副经理;2006年9月加入建信基金管理公司,一直从事基金销售管理工作,历任市场营销部副总监(主持工作)、总监、公司首席市场营销等职务。2015年8月6日起任我公司副总裁。

吴朝晖先生,副总裁,硕士。1992年7月至1996年9月在湖南省物资贸易总公司工作;1999年7月加入中国建设银行,先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务,历任科员、副主任科员、主任科员,机构业务部高级副经理等职;2006年3月加入建信基金管理公司,担任董事会秘书,并兼任综合管理部副经理。2016年8月6日起任我公司督察长,2016年12月23日起任我公司副总裁。

吴灵玲女士,副总裁,硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作;2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部,历任副主任科员、业务经理、高级经理助理;2005年9月加入建信基金管理公司,任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

马勇先生,副总裁,硕士。1993年8月至1996年8月在江苏省机械设计研究院工作。1998年7月加入中国建设银行总行,历任副主任科员、主任科员、秘书、高级经理级秘书,高端客户部总经理助理,财富管理与私人银行部总经理助理、副总经理,建行黑龙江省分行副行长等职务。2018年3月30日加入建信基金管理有限责任公司,2018年11月13日起任副总裁;2018年11月1日起兼任我公司控股子公司建信资本管理有限公司董事长。

4. 督察长

吴朝晖先生,督察长(简历请参见公司高级管理人员)。

5. 基金经理

蒋玲女士,金融工程及指数投资部总经理助理,博士。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院电网电研研究所工作。任项目经理;2010年1月至2013年4月在路通世纪公司亚洲数据收集部工作。任高级软件工程师;2013年4月至2015年8月在中国中投证券公司工作,历任研究员、投资经理;2015年9月加入我公司金融工程及指数投资部,历任基金助理助理,基金经理,2016年5月起兼任部门总经理助理,2016年7月4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;2017年5月27日至2018年4月26日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年9月13日起任建信量化事件驱动股票型证券投资基金基金经理;2017年12月23日起任建信鑫源回报灵活配置混合型证券投资基金(ETF)及其联接基金的基金经理;2017年12月20日起任建信鑫源回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月22日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年3月5日起任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理;2018年10月25日起任建信上证50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;2018年12月13日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

历任基金经理

梁洪钧先生:2010年5月28日至2012年6月28日。
叶乐天先生:2012年3月21日至2016年7月20日。
薛玲女士:2016年7月4日至至今。
6. 投资决策委员会成员
张军红 总裁
郭伟峰 总裁特别助理
梁洪钧 金融工程及指数投资部 总经理
梁 翔 资产配置与量化投资部 总经理
叶乐天 金融工程及指数投资部 总经理助理
张 文 资产配置与量化投资部 总经理助理

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
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街56号
首次注册登记日期:1984年1月1日
注册资本:人民币34,332,123.46万元
法定代表人:陈四清
基金托管业务批准文号:中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号
联系人:郭明
电话:(010)66106799
(二)主要人员情况
截至2018年12月,中国工商银行资产托管部共有员工202人,平均年龄33岁,96%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、先进的运营系统和专业的服务团队,严格履行托管人职责,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丰富、成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、社保基金、社会保障基金、企业年金基金、QFII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券投资基金定向资产管理计划、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2018年12月,中国工商银行共托管证券投资基金923只。自2003年以来,本行连续十五年获得香港《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》等海内外权威财经媒体评选的64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.申购赎回代理券商(简称“一级交易商”)
(1)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:杨德红
客服电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com

(2)中证证券股份有限公司
地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中国证券大厦
法定代表人:张佑君
客服电话:95568
网址:www.citics.com
(3)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:魏建雄
客服电话:10109098
网址:www.ebscn.com
(4)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:霍达
客户服务热线:95565,4008881111
网址:www.newone.com.cn
(5)红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路156号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:李素明
客服电话:0871-3577888
网址:www.hongtastock.com
(6)华龙证券股份有限公司
住所:兰州市城关区东岗西路608号财富中心大厦14、16、17层
法定代表人:曹宏
客服电话:0755-82288968
网址:www.cc168.com.cn
(7)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:周杰
客户服务电话:400-8889-001,(021)962503
网址:www.htsec.com
(8)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:李新华
客户服务电话:4008-888-999
公司网址:www.95579.com
(10)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:400-888-1088
公司网址:www.csc108.com
(11)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经一路896号
法定代表人:李玮
客户服务热线:95538
网址:www.ztsc.com.cn
(12)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:李福春
客户服务电话:0431-96688,0431-85096733
网址:www.nesc.cn
(13)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:王峰
客户服务电话:4006159888
网址:www.bhzq.com
(14)广州证券股份有限公司
住所:广州市天河区珠江新城华利大厦4楼
法定代表人:孙树明
客户服务电话:020-96575
网址:www.gztc.com.cn
(15)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:0691-96326
网址:www.hfzq.com.cn
(16)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
(17)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
法定代表人:杨华辉
客户服务电话:4008881223
(18)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市益田路4069号平安国际交易广场8楼
法定代表人:何之江
客服热线:4008668338
网址:stock.pingan.com
(19)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
(20)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:王连志
客户服务电话:0755-82568555
网址:www.axzq.com.cn
(21)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:蔡咏
客户服务热线:400-8888-777
网址:www.gyzq.com.cn
(22)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:陈共炎
客户服务电话:4008-889-888
网址:www.chinastock.com.cn
(23)中信证券(山东)有限责任公司
住所:青岛市崂山区秦岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
法定代表人:姜晓燕
客服电话:0532-96677
网址:www.zxwt.com.cn
(24)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:周易
客户咨询电话:025-84579897
网址:www.htsc.com.cn
(25)申万宏源西部证券有限公司
地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:李琦
客服电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com
(26)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:李俊杰
客服电话:021-962518
网址:www.962518.com
(27)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:刘宛晨
客户服务电话:0731-4403340

网址:www.citq.com

(28)东海证券股份有限公司
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:赵俊
客服热线:4008888888
网址:www.longone.com.cn
(29)中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳福田区益田路与福中路口交汇处荣超商务中心A栋18-21层
法定代表人:高涛
开放式基金咨询电话:4006008008
网址:www.citics.com

2.二级市场交易代理券商
包括具有经纪业务资格和上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3.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:中国中投证券登记结算有限责任公司
住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:金麟
办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场4层
电话:010-58598839
传真:010-58598907

(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:王丽军
联系人:徐建丽
电话:010-65755888
传真:010-65232181
经办律师:徐建丽、刘焕志

(四)审计会计师事务所
普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展银银行大厦507单元01室
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
电话:021-2323 8888
执行事务合伙人:李丹

四、基金的名称
五、基金的类型

六、基金的投资目标
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。

本基金主要投资于标的指数成份股票,各成份股票、一级市场新股发债、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数的成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%,但因法律法规的规定而受限的情形除外。

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。基金投资于标的指数的成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。

本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票投资组合,但在特殊情况下,本基金可以包括其他证券或衍生品组合以替换,这些情况包括但不限于以下情形:(1)法律法规的限制;(2)标的指数的成份股票流动性严重不足;(3)标的指数的成份股票长期停牌;(4)其他合理原因导致本基金管理人对于标的指数的跟踪构成严重障碍等。

在正常情况下,本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差率不超过2%。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,基金管理人应采取积极措施跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(一)股票投资组合日常管理
1. 投资组合的建立
基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、确定建仓策略和组合调整。

(1)确定目标组合:根据复制标的指数的成份股票及其权重的方法确定目标组合;
(2)确定建仓策略:根据对成份股流动性、公司行为等因素的分析,制定合理的建仓策略;
(3)组合调整:根据目标组合,在合理时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

2. 投资组合日常管理
(1)根据标的指数构成及权重,结合基金当前持有的证券组合及其比例,制作下一交易日基金的申购赎回清单并公告;

(2)将基金持有的证券组合构成与标的指数进行比较,制定目标组合构成及权重,确定合理的交易策略;

(3)实施交易策略,以实现基金最优投资组合;

3. 标的指数的成份股票定期调整
跟踪标的指数的编制规则和公告调整,在指数成份股调整生效前,分析并确定组合调整策略,及时进行投资组合的优化调整,减少流动性冲击,尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

4. 成份股公司信息的日常跟踪与分析
跟踪标的指数的成份股公司信息(如:股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等)以及成份股公司其他重大信息,分析这些信息对指数的影响,并及时以调整基金的申购赎回清单以及基金的每日交易策略。

5. 标的指数成份股票临时调整
在标的指数成份股票调整期间,若出现成份股票临时调整的情形,本基金管理人将密切关注该本股票的调整,并及时制定相应的投资组合调整策略。

6. 申购赎回情况的跟踪与分析
跟踪基金申购和赎回信息,结合基金的现金流寸管理,分析其对组合的影响,制定交易策略以应对基金的申购赎回。

7. 替代投资
对个别成份股,若其存在投资受限、严重的流动性困难、财务风险较大、面临重大不利司法诉讼或存在充分合理的理由认为其被市场操纵等情形时,本基金可以不以投资该成份股,而用备选证券、现金类资产,或者选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其他股票来替代,即采用“替代投资策略”应对,采用替代投资策略的原则是使得本基金投资组合对标的指数的跟踪误差最小化,以利于本基金投资目标的实现。

8. 跟踪偏离度的监控与管理
基金经理每日跟踪基金组合与标的指数的表现的偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数的表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,现金控制情况,标的指数的成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等,并优化跟踪偏离度管理方案。

本基金选择“总体累积偏差”、“行业偏差”和“个股偏差”作为评估指标,评估投资组合与标的指数的跟踪误差,行业累积偏差、个股比例偏差和个股构成偏差。本基金通过设定上述指标的最大限度,对投资行为予以约束,以控制基金相对于目标指数的偏差。

本基金将“总体累积偏差”作为决定是否启动修正程序的监控指标,将“行业偏差”、“个股偏差”指标作为调整指标,以达到控制跟踪偏离度的目的。

在投资组合修正过程中,本基金将采用量化分析模型,每日计算总体累积偏差指标,计算区间从组合修正日开始起算。如该指标超过允许的最大值,则基金管理人将通过控制行业偏差、个股偏差等指标,调整组合品种,缩减跟踪误差。当总体累积偏差在允许的最大值以下时,原则上不调整组合。每修正一次组合,总体累积偏差指标将“归零”重新计算。

本基金的投资目标不是超越指数,而是取得与指数涨幅基本一致收益。因此,评判本基金的表现,主要是看基金收益与标的指数的收益的偏离度,偏离度越小,基金表现越好,而跟踪偏离度和跟踪误差是衡量基金收益与标的指数收益偏离度的重要指标。

(二)其他金融工具投资策略
基于流动性管理的考虑,本基金可以投资于期限在一年期以内的政府债券、央行票据和政策性金融债、债券投资组合的主要是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

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,以提高投资组合管理效率,管理基金投资组合风险并更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须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,不得应用于投机交易目的,或用于杠杆工具放大基金的投资。本基金投资于各种衍生工具的比例不得超过基金资产净值的10%。

九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:上证社会责任指数。
本基金业绩比较基准为:上证社会责任指数。

十、基金的风险收益特征
本基金属于股票基金,其风险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。

十一、基金投资组合报告
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,基金内容的真实性、准确性和完整性不承担个别及连带保证责任。

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2019年4月17日复核了本报告中与财务数据、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2019年3月31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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	103,364,770.02	99.11
	其中:股票	103,364,770.02	99.11
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--
4	衍生品投资	--	--
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	929,292.51	0.90
8	其他资产	908.54	0.00
9	合计	104,294,968.57	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,410,214.86	1.36
C	制造业	20,919,771.34	20.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	889,660.10	0.85
E	建筑业	6,729,063.47	6.39
F	批发和零售业	3,472,362.52	3.31
G	交通运输、仓储和邮政业	2,150,096.62	2.08
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	4,079,208.76	3.92
J	金融业	66,912,246.68	63.77
K	房地产业	6,184,135.58	5.96
L	租赁和商务服务业	267,100.14	0.25
M	科学研究和技术服务业	136,799.88	0.13
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	卫生和社公工作	220,284.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
	合计	103,296,798.33	99.34

注:以上行业分类以2019年3月31日的证监会行业分类标准为依据。