建信沪深300指数证券投资基金（LOF）

【2014】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:2014年10月24日

§1 重要提示

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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信沪深300指数(LOF)
场内简称	建信300
基金主代码	165309
交易代码	165309
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年11月5日
报告期末基金份额总额	2,178,175,972.41份
投资目标	本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合,复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300 指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-8,424,496.90
2.本期利润	244,637,055.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0904
4.期末基金资产净值	1,600,978,888.99
5.期末基金份额净值	0.735

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。

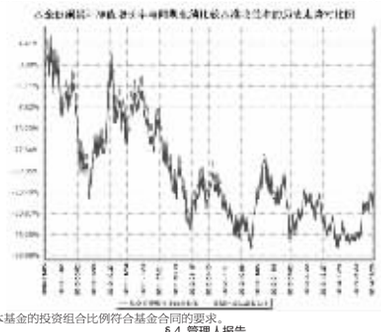
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.60%	0.85%	12.52%	0.85%	1.08%	0.00%

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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁洪昀	投资管理部总监、本基金的基金经理	2009年11月5日	-	11	特许金融分析师(CFA),2003年1月获清华大学经济学博士学位。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理;2010年5月28日至2012年5月28日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;2011年9月8日起任深证基本面60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;2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金基金经理。

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,本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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)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》等风险管控制度。公司使用的交易系统中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。

4.3.2 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

在报告期内,本基金根据基金合同规定,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了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自基金净值保留位数有限造成的舍入误差以及所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。权重结构上的差异源自部分股票由于舍入取整等原因,申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比有所变化。同时指数成份股的大比例分红在给基金带来超额收益的同时也很大程度上增加了基金的跟踪误差。本基金管理人在量化分析基础上,采取了适当的组合调整策略,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率12.04%,波动率0.94%,业绩比较基准收益率10.17%,波动率0.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年三季度,经济基本面较二季度略有好转,但经济增长仍然较弱,政府“稳增长”的意图更加明显。股票市场受系列改革措施和投资者乐观情绪推动,在整个三季度延续上涨走势,同时结构分化仍比较严重,小市值股票相对大市值股票的超额收益非常明显,体现了“蓝筹搭台,成长唱戏”的整体格局。展望四季度,大盘仍将维持震荡上行的走势,结构分化的局面还会持续。

本基金管理人将根据基金合同,以量化分析研究为基础,克服各种因素的不利影响,不断优化和改进量化模型,将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

§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	1,517,714,305.81	93.34
	其中:股票	1,517,714,305.81	93.34
2	固定收益投资	50,120,000.00	3.08
	其中:债券	50,120,000.00	3.08
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	41,745,625.68	2.57
7	其他资产	16,495,552.18	1.01
8	合计	1,626,075,483.67	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	6,067,507.20	0.38
B	采矿业	94,629,865.80	5.91
C	制造业	547,386,979.30	34.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,631,310.86	3.60
E	建筑业	52,507,852.20	3.28
F	批发和零售业	42,802,273.89	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	42,645,384.91	2.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,258,655.37	3.76
J	金融业	481,519,980.77	30.08
K	房地产业	66,947,590.94	4.18
L	租赁和商务服务业	15,121,345.10	0.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,293,070.10	0.89
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	12,950,215.74	0.81
S	综合	7,978,274.40	0.50
	合计	1,502,740,306.58	93.86

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。

5.2.2 报告期末积极投资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	180,564.00	0.01
B	采掘业	595,497.60	0.04
C	制造业	9,576,783.26	0.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,215,815.12	0.08
E	建筑业	232,848.00	0.01
F	批发和零售业	1,025,101.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	533,277.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	379,857.90	0.02
J	金融业	203,435.00	0.01
K	房地产业	367,232.20	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	91,597.15	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	176,220.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	92,043.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	303,728.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	14,973,999.23	0.94

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。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	1,262,996	52,212,254.64	3.26
2	600036	招商银行	4,730,311	49,147,931.29	3.07
3	600016	民生银行	7,785,319	48,580,390.56	3.03
4	601166	兴业银行	3,141,964	32,110,872.08	2.01
5	600000	浦发银行	2,954,127	28,802,738.25	1.80
6	600030	中信证券	2,077,945	27,678,227.40	1.73
7	601288	农业银行	10,032,279	24,980,374.71	1.56
8	000002	万 科A	2,554,419	23,449,566.42	1.46
9	600837	海通证券	2,135,014	22,033,344.48	1.38
10	600519	贵州茅台	120,526	19,540,880.38	1.22

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002437	誉衡药业	55,750	1,324,062.50	0.08
2	002206	海 利 得	87,200	721,144.00	0.05
3	600855	航天长峰	29,877	680,598.06	0.04
4	000501	鄂武商A	44,200	607,308.00	0.04
5	601001	大同煤业	80,910	595,497.60	0.04

5.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,120,000.00	3.13
	其中:政策性金融债	50,120,000.00	3.13
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	50,120,000.00	3.13

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

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	140204	14国开04	500,000	50,120,000.00	3.13

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明细

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	222,484.05
2	应收证券清算款	14,284,685.45
3	应收股利	-
4	应收利息	1,752,268.70
5	应收申购款	220,990.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.20
8	其他	-
9	合计	16,495,552.18

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,918,574,929.18
报告期期间基金总申购份额	12,206,089.88
减:报告期期间基金总赎回份额	752,605,046.65
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	2,178,175,972.41

注: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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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沪深300指数证券投资基金(LOF)设立的文件;

2、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)招募说明书》;

4、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)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
2014年10月24日

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

【2014】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:2014年10月24日

§1 重要提示

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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014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

基金简称	建信责任
基金主代码	530010
交易代码	530010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月28日
报告期末基金份额总额	258,729,481.04份
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。
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。
业绩比较基准	95%×上证社会责任指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率
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。同时,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
基金主代码	510090
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
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,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
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票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。
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。

§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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-6,159,907.97
2.本期利润	34,024,446.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.1081
4.期末基金资产净值	259,532,128.80
5.期末基金份额净值	1.003

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、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 本报告期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	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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.44%	0.89%	9.66%	0.90%	1.78%	-0.01%

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

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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天	本基金的基金经理	2012年3月21日	-	6	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日起任中证500指数增强基金经理。

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》等风险管控制度。公司使用的交易系统中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。

4.3.2 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本基金的跟踪误差和偏离度造成一定影响。在报告期内,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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率11.44%,波动率0.89%,业绩比较基准收益率9.66%,波动率0.9%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年三季度,经济基本面较二季度略有好转,但经济增长仍然较弱,政府“稳增长”的意图更加明显。股票市场受系列改革措施和投资者乐观情绪推动,在整个三季度延续上涨走势,同时结构分化仍比较严重,小市值股票相对大市值股票的超额收益非常明显,体现了“蓝筹搭台,成长唱戏”的整体格局。展望四季度,大盘仍将维持震荡上行的走势,结构分化的局面还会持续。

本基金管理人将根据基金合同,以量化分析研究为基础,克服各种因素的不利影响,不断优化和改进量化模型,将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

§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	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	其他资产	371,988.23	0.14
9	合计	263,626,764.28	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。

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	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

5.4 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

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

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

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明细

无。

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

无。

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

无。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	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

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

无。

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

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 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。

5.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.12.3 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

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.12.5 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	600685	广船国际	577,545.85	0.22	筹划重大资产重组
2	600845	宝信软件	409,419.72	0.16	筹划重大资产重组
3	600497	驰宏锌锗	265,173.58	0.10	筹划重大资产重组
4	601222	林洋电子	205,479.30	0.08	筹划重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	338,809,919.38
报告期期间基金总申购份额	7,239,327.68
减:报告期期间基金总赎回份额	87,319,766.02
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	258,729,481.04

注: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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	20,001,600.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	20,001,600.00
报告期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2014年9月25日	-20,001,600.00	-20,061,604.80	-
合计			-20,001,600.00	-20,061,604.80	

§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
2014年10月24日

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

【2014】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:2014年10月24日

§1 重要提示

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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	责任ETF
场内简称	责任ETF
基金主代码	510090
交易代码	510090
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	284,081,114.00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,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
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票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。