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

2016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
二〇一六年一月

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5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收回其原本投资。

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和产品特性，充分考虑自身风险承受能力，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需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回报偏离的风险、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管理实施过程中产生的基金管理风险，等等。本基金属股票基金，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，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。

投资有风险，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的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2015年11月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日（财务数据未经审计）。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：2005年9月19日

法定代表人：许会斌

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[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下：

股东名称	股权比例
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者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，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权和对总裁等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，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、高级管理人员尽职情况。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

许会斌先生，董事长。自2011年3月起至现在，出任中国建设银行批发业务总监；自2006年5月至2011年3月任中国建设银行河南省分行行长；自1994年5月至2006年5月历任中国建设银行筹资储蓄部副主任，零售业务部副总经理，个人银行部副总经理，营业部主要负责人、总经理，个人银行业务部总经理，个人银行业务委员会副主任，个人金融部总经理。许先生是高级经济师，并是国务院特殊津贴获得者，曾荣获中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章等奖项。1983年辽宁财经学院基建财务与信用专业大学本科毕业。2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

孙志晨先生，董事。1985年获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副处长，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。

曹伟先生，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。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、北京分行朝阳支行行长、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部总经理助理。

张维义先生，董事，现任信安国际北亚副总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院，获经济学学士学位，2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长，新加坡电信国际有限公司业务发展总监，信诚基金公司首席运营官和代总经理，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。

袁时奋先生，董事，现任信安国际有限公司大中华区首席营运官。1981年毕业于美国阿而比学院。历任香港汇丰银行投资银行部副经理，加拿大丰业银行资本市场部高级经理，香港铁路公司库务部助理司库，香港置地集团库务部司库，香港赛马会副集团司库，信安国际有限公司大中华区首席营运官。

殷红军先生，董事，现任中国华电融资租赁有限公司董事长兼总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数量经济学专业，获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理（主持工作）、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长、中国华电集团资本控股有限公司副总经理。

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年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员、正大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。

王建国先生，独立董事，曾任大新人寿保险有限公司首席行政员，中银保诚退休金信托管理有限公司董事，英国保诚保险有限公司首席行政员，美国国际保险集团亚太区资深副总裁，美国友邦保险(加拿大)有限公司总裁兼首席行政员等。1989年获Pacific Southern University 工商管理硕士学位。

伏军先生，独立董事，法学博士，现任对外经济贸易大学法学院教授，兼任中国法学会国际经济法学研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

2、监事会成员

王雪玲女士，监事会主席。毕业于清华大学经济管理学院高级工商管理人员工商管理专业，高级经济师。历任中国建设银行山东省分行计划处职员；中国建设银行新疆区分行计划处、信贷处、风险处和人力部等副处长、处长、行长助理、副行长；中国建设银行总行机构业务部副总经理。2015年10月起任公司监事会主席。

方蓉敏女士，监事，现任信安国际（亚洲）有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和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年获新加坡国立大学法学学士学位，拥有新加坡、英格兰和威尔斯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责任公司机构与风险管理部经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士，2009年获中央财经大学会计专业硕士。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经理助理、副经理，中国华电集团资本控股（华电财务公司）计划财务部经理，中国华电集团资本控股有限公司财务部经理，中国华电集团资本控股有限公司企业融资部经理。

吴灵玲女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司人力资源管理部总经理兼综合管理部总经理。1996年毕业于中国人民大学经济信息管理系，获得学士学位；2001年毕业于北京师范大学经济系，获得管理学硕士学位。历任中国建设银行总行人力资源部主任科员，高级经理助理，建信基金管理公司人力资源管理部总监助理，副总监，总监。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用专业，获得学士学位。曾任中国建设银行北京分行科技部科员、中国建设银行信息技术管理部主任科员、项目经理。2005年9月加入建信基金管理公司，历任基金运营部总监助理、副总监；信息技术部副总监、总监。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副总经理，英国特许公认会计师公会（ACCA）资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系，获学士学位；2010年毕业于香港中文大学，获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振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月至今任职于建信基金管理有限责任公司监察稽核部。

3、公司高管人员

孙志晨先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

张威威先生，副总裁。1997年毕业于大连理工大学，获学士学位；2003年毕业于大连理工大学，获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁省分行筹资处科员、主任科员；中国建设银行总行个人银行业务部主任科员、高级副经理；2005年9月加入建信基金管理公司，历任市场营销部副总监（主持工作）、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任建信基金管理副总裁。

曲寅军先生，副总裁。1996年毕业于中国人民大学，获学士学位；1999年毕业于中国人民大学，获硕士学位。曾任中国建设银行总行审计部科员、副主任科员；团委主任科员；重组改制办公室高级副经理；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、投资管理部副总监、专户投资部总监和公司首席战略官。2013年8月至今，任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理，并于2015年8月6日起任建信基金管理公司副总裁。

4、督察长

吴曙明先生，督察长。1992年毕业于中南工业大学管理系，获学士学位；1999年毕业于财政部财政科学研究所，获经济学硕士学位。1992年7月至1996年8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总行，先后在营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，曾任科员、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，担任董事会秘书兼综合管理部总监。2015年8月6日起任建信基金管理公司督察长。

5、本基金基金经理

叶乐天先生，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日起任建信中证500指数增强型证券投资基金基金经理；2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

梁洪昀先生：2010年5月28日至2012年5月28日。

叶乐天先生：2012年3月21日至今。

6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总裁。

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。

钟敬棣先生，固定收益投资部首席固定收益投资官。

李菁，固定收益投资部总经理

姚锦女士，权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师。

顾中汉先生，权益投资部副总经理。

许杰先生，权益投资部基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

（二）主要人员情况

截至2015年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工205人，平均年龄30岁，95%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、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，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最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、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2015年9月，中国工商银行共托管证券投资基金496只。自2003 年以来，本行连续十一年获得香港《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》等境内外权威财经媒体评选的49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：万建华

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

（2）中信证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

客服电话：95558

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：薛峰

客服电话：10108998

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：宫少林

客户服务热线：95565、4008888111

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155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

客服电话：0871-3577888

网址：www.hongtastock.com

（6）长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

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：王开国

客户服务电话：400-8888-001，（021）962503

网址：www.htsec.com

（9）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：胡运钊

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：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

（11）中泰证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

网址： www.qlzq.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：矫正中

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：王春峰

客户服务电话： 4006515988

网址：www.bhzq.com

（14）广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路183号大都会广场43楼

法定代表人：林治海

客户服务电话：020-95575

网址：www.gf.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：0591-96326

网址：www.gfhfzq.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

法定代表人：兰荣

客户服务电话： 4008888123

网址：www.xyzq.com.cn

（18）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

客服热线：4008866338

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：牛冠兴

客户服务电话：0755－82825555

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：凤良志

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：顾伟国

客户服务电话：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（23）中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

法定代表人：杨宝林

客服电话：0532-96577

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：吴万善

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

注册地址： 新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国家大厦20楼2005室

法定代表人：许建平

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：郁忠民

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：周晖

客户服务电话：0731-4403340

网址：www.cfzq.com

（28）东海证券有限责任公司

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：朱科敏

客服热线：4008888588

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与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层

法定代表人：龙增来

开放式基金咨询电话：4006008008

网址： www.cjis.cn

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及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：金颖

办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23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

联系人：徐建军

电话：010－66575888

传真：010－65232181

经办律师：徐建军、刘焕志

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址： 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人：杨绍信

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：薛竞、陈熹

四、基金的名称

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

股票型基金

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。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、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制的情形除外。

八、基金的投资策略

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。基金投资于标的指数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资产投资组合，但在特殊情况下，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（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标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、股票资产组合日常管理

（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：根据复制标的指数成份股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，确定合理的建仓策略；

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，以实现基金最优组合结构。

（3）标的指数成份股票定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，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，并据以确定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周期内，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样本股票的调整，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，结合基金的现金头寸管理，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、面临重大不利的司法诉讼或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替，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代替，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"及"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、行业构成比例偏差、个股比例偏差和个股构成差异。本基金通过设定上述指标的最大允许值，对投资行为予以约束，以控制基金相对于比较基准的偏差。

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，以达到控制跟踪偏差的目的。

在具体的修正过程中，本基金将采用定量化分析模型，每日计算总体累积偏差指标，计算区间从组合修正日开始累积。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，缩减跟踪偏差。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，而是取得与指数涨跌基本一致的收益。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。

2、其他金融工具投资策略

基于流动性管理的需要，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，债券投资的目的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是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，或用作杆杠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超过基金资产净值的10%。

九、基金的业绩比较标准

本基金的标的指数为：上证社会责任指数。

本基金的业绩比较基准为：本基金标的指数。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告

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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日，本报告中的财务资料未经审计。

11.1 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	118,096,394.02	98.53
	其中：股票	118,096,394.02	98.53
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金融投资	–	–
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	1,738,128.99	1.45
7	其他各项资产	19,663.27	0.02
8	合 计	119,854,186.28	100.00

11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.2.1 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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	274,253.84	0.23
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	–	–
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	274,253.84	0.23

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。

11.2.2 指数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	–	–
B	采矿业	2,909,368.42	2.45
C	制造业	21,878,302.29	18.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,082,252.48	1.75
E	建筑业	13,888,130.65	11.68
F	批发和零售业	3,835,367.12	3.23
G	交通运输、仓储和邮政业	617,942.53	0.52
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,484,886.84	3.77
J	金融业	60,170,866.75	50.60
K	房地产业	7,480,120.40	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：以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

11.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

11.3.1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	600036	招商银行	767,830	13,644,339.10	11.47
2	600016	民生银行	1,375,012	11,618,851.40	9.77
3	600000	浦发银行	520,716	8,659,507.08	7.28
4	601166	兴业银行	531,875	7,744,100.00	6.51
5	601328	交通银行	913,153	5,551,970.24	4.67
6	600030	中信证券	366,185	4,972,792.30	4.18
7	601668	中国建筑	697,864	4,033,653.92	3.39
8	601601	中国太保	146,225	3,244,732.75	2.73
9	601390	中国中铁	260,216	2,846,763.04	2.39
10	600104	上汽集团	153,868	2,584,982.40	2.17

11.3.2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	600879	航天电子	17,227	274,253.84	0.23

11.4 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。

11.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

11.7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投资。

11.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（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。

11.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（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。

（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。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

11.11 投资组合报告附注

11.11.1 本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，中信证券股份有限公司（600030）于2015年1月19日发布公告：2015 年 1 月 16 日收市后，中国证监会在例行的新闻发布会上，通报证券公司融资融券业务检查情况，提及本公司等 3 家证券公司由于存在为到期融资融券合约展期的问题，对本公司等 3 家证券公司采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。2015 年 1 月 16 日约 17 时，本公司通过网络报道知悉上述处罚。

11.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

11.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,188.58
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	350.52
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	15,124.17
8	其他	–
9	合 计	19,663.27

11.11.4 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。

11.11.5报告期末前十名（前五名）股票中存在流通受限情况的说明

11.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2015年9月30日。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2010年5月28日至2010年12月31日	12.14%	1.40%	5.92%	1.57%	6.22%	-0.17%
2011年1月1日至2011年12月31日	-18.30%	1.34%	-18.82%	1.35%	0.52%	-0.01%
2012年1月1日至2012年12月31日	15.10%	1.28%	13.42%	1.29%	1.68%	-0.01%
2013年1月1日至2013年12月31日	-8.03%	1.58%	-10.04%	1.59%	2.01%	-0.01%
2014年1月1日至2014年12月31日	64.70%	1.34%	61.54%	1.35%	3.16%	-0.01%
2015年1月1日至2015年9月30日	-10.81%	2.74%	-11.75%	2.76%	0.94%	-0.02%
自基金合同生效之日2010年5月28日至2015年9月30日	42.47%	1.65%	25.07%	1.67%	17.40%	-0.02%

十三、基金的费用概揽

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金上市费及年费；

6、基金收益分配中发生的费用；

7、基金份额持有人大会费用；

8、基金的证券交易费用；

9、基金的银行汇划费用；

10、标的指数许可使用费；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.5\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.1\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述（一）"基金费用的种类"中第3－11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

2、与基金销售有关的费用

申购、赎回的对价及费用

（1） 申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

（2）申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。申购赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

（3）投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

十四、对招募说明书更新部分的说明

1、更新了"三、基金管理人"的 相关信息；

2、更新了"四、基金托管人"的"基本情况"及"基金托管业务经营情况"；

3、更新了"五、相关服务机构"中的信息；

4、更新了"十一、基金的投资"的投资组合报告的内容，并经基金托管人复核；

5、更新了"十二、基金的业绩"，并经基金托管人复核；

6、更新了"二十四、其他应披露事项"，添加了报告期间涉及本基金和基金管理人的相关临时公告。

上述内容仅为本招募说明书（更新）摘要，投资人欲查询本更新招募说明书正文，可登陆基金管理人网站www.ccbfund.cn。

建信基金管理有限责任公司
二〇一六年一月十九日

建信双息红利债券型证券投资基金分红公告

公告送出日期：2016年1月21日

1.公告基本信息

基金名称		建信双息红利债券型证券投资基金	
基金简称		建信双息红利债券	
基金主代码		530017	
基金合同生效日		2011年12月13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		中信银行股份有限公司	
公告依据		《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》、《建信双息红利债券型证券投资基金招募说明书》以及相关法律法规	
收益分配基准日		2016年1月8日	
有关年度分红次数的说明		本次分红为本基金第十一次分红，2016年度的第一次分红	
下属分级基金的基金简称		建信双息红利A	建信双息红利C
下属分级基金的交易代码		530017	531017
截止基准日下属分级基金的相关指标	基准日下属分级基金份额净值（单位：人民币元）	1.278	1.227
	基准日下属分级基金可供分配利润（单位：人民币元）	668,088,710.97	160,577,657.05
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额（单位：人民币元）	200,426,613.29	48,173,297.12
本次下属分级基金分红方案（单位：元/10份基金份额）		0.46	0.41

注：（1）本基金于2014年9月1日新增C类份额，原有基金份额全部转换为A类份额。A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费。由于不同基金份额类别的成立时间不同，C类份额成立时间较短，因此不同基金份额类别对应的可分配收益有所不同。本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。

（2）根据基金合同的规定，本基金A、C类份额均符合基金分红条件，故进行分红，A类份额分红方案为0.46元每10份基金份额，C类份额分红方案为0.41元每10份基金份额。

（3）根据基金合同的规定，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的30%。若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配。

（4）本基金的分红方式有现金分红和红利再投资两种；若投资者不选择，默认分红方式为现金分红。

（5）基金份额持有人可对A类和C类基金份额分别选择不同的分红方式。如果采用红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按权益登记日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额。同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则以投资人最后一次选择的分红方式为准。

2.与分红相关的其他信息

权益登记日	2016年1月25日
除息日	2016年1月25日
现金红利发放日	2016年1月26日
分红对象	权益登记日登记在册的本基金全体份额持有人。
红利再投资相关事项的说明	选择红利再投资方式的投资者其红利再投资的份额将于2016年1月26日直接计入其基金账户，2016年1月27日起可以查询、赎回。
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局的相关规定，基金向投资者分配的基金收益，暂免征收所得税。
费用相关事项的说明	本基金本次分红免收分红手续费；选择红利再投资方式的投资者其红利所转换的基金份额免收申购费用。

3.其他需要提示的事项

（1） 权益登记日申请申购的基金份额不享有本次分红权益，权益登记日申请赎回的基金份额享有本次分红权益。

（2）对于未选择具体分红方式的投资者，本基金默认的分红方式为现金方式。

（3） 投资者可以在基金开放日的交易时间内到销售网点修改分红方式，本次分红确认的方式将按照投资者在权益登记日之前(不含该日)最后一次选择的分红方式为准。请投资者到销售网点或通过本基金管理人客户服务中心确认分红方式是否正确，如不正确或希望修改分红方式的，请在上述规定时间前到销售网点办理变更手续。

（4） 本基金份额持有人及希望了解本基金其他有关信息的投资者，可以登录本基金管理人网站（www.ccbfund.cn）或拨打客户服务电话（400-81-95533免长途通话费、010-66228000）咨询相关事宜。

（5） 权益登记日和红利发放日注册登记人不接受投资者基金转托管、非交易过户等业务的申请。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来业绩。敬请广大投资者注意投资风险，理性投资。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司
2016年1月21日