

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 第 四 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:2016年1月21日

1.1 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2016年1月19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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信ETF
场内简称	建信ETF
基金代码	510000
交易代码	510000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年5月29日
报告期末基金份额总额	89,081,114,00份

投资目标

本基金主要投资于上证社会责任指数成分股，力求在跟踪误差和跟踪误差最小化，实现与标的指数表现一致的长期收益回报。

投资策略

本基金将完全复制上证社会责任指数成分股的投资组合，并根据标的指数的成分股调整进行定期调整。

业绩比较基准

上证社会责任指数

风险收益特征

本基金为股票型基金，其基金资产的投资组合以追求超越上证社会责任指数基金为代表的股票市场的整体收益为目标，属于股票型基金中较高风险、较高收益的基金品种。

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

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益

1,476,363.24

2.本期利润

17,479,208.92

3.加权平均基金份额本期利润

0.1819

4.期末基金份额净值

122,051,416.00

5.期末基金份额净值

1.3701

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，计算费用后实际收益水平要低于所列示数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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 净值增长率为(%) ① 净值增长率标准差(%) ② 业绩比较基准收益率为(%) ③ 业绩比较基准收益率的标准差(%) ④ ①-③ ②-④

过去三个月 14.73% 1.56% 16.14% 1.58% -0.69% -0.02%

3.2.2 日均基金合同期间以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益

1,476,363.24

2.本期利润

17,479,208.92

3.加权平均基金份额本期利润

0.1819

4.期末基金份额净值

122,051,416.00

5.期末基金份额净值

1.3701

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，计算费用后实际收益水平要低于所列示数字。

3.3.1 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 净值增长率为(%) ① 净值增长率标准差(%) ② 业绩比较基准收益率为(%) ③ 业绩比较基准收益率的标准差(%) ④ ①-③ ②-④

过去三个月 14.73% 1.56% 16.14% 1.58% -0.69% -0.02%

3.3.2 日均基金合同期间以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.4 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益

3,294,806.40

2.本期利润

116,503,653.97

3.加权平均基金份额本期利润

0.4304

4.期末基金份额净值

416,361,948.68

5.期末基金份额净值

1.743

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，计算费用后实际收益水平要低于所列示数字。

3.3.3 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 净值增长率为(%) ① 净值增长率标准差(%) ② 业绩比较基准收益率为(%) ③ 业绩比较基准收益率的标准差(%) ④ ①-③ ②-④

过去三个月 30.17% 1.02% 20.29% 1.74% 9.26% 0.00%

3.3.4 日均基金合同期间以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.4 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益

23,294,806.40

2.本期利润

116,503,653.97

3.加权平均基金份额本期利润

0.4304

4.期末基金份额净值

416,361,948.68

5.期末基金份额净值

1.743

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，计算费用后实际收益水平要低于所列示数字。

3.3.5 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 净值增长率为(%) ① 净值增长率标准差(%) ② 业绩比较基准收益率为(%) ③ 业绩比较基准收益率的标准差(%) ④ ①-③ ②-④

过去三个月 30.17% 1.02% 20.29% 1.74% 9.26% 0.00%

3.3.6 日均基金合同期间以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.4 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益

23,294,806.40

2.本期利润

116,503,653.97

3.加权平均基金份额本期利润

0.4304

4.期末基金份额净值

416,361,948.68

5.期末基金份额净值

1.743

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，计算费用后实际收益水平要低于所列示数字。

3.3.7 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 净值增长率为(%) ① 净值增长率标准差(%) ② 业绩比较基准收益率为(%) ③ 业绩比较基准收益率的标准差(%) ④ ①-③ ②-④

过去三个月 30.17% 1.02% 20.29% 1.74% 9.26% 0.00%

3.3.8 日均基金合同期间以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.4 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益

23,294,806.40

2.本期利润

116,503,653.97

3.加权平均基金份额本期利润

0.4304

4.期末基金份额净值

416,361,948.68

5.期末基金份额净值

1.743

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，计算费用后实际收益水平要低于所列示数字。

3.3.9 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 净值增长率为(%) ① 净值增长率标准差(%) ② 业绩比较基准收益率为(%) ③ 业绩比较基准收益率的标准差(%) ④ ①-③ ②-④

过去三个月 30.17% 1.02% 20.29% 1.74% 9.26% 0.00%

3.3.10 日均基金合同期间以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.4 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期已实现收益

23,294,806.40

2.本期利润

116,503,653.97

3.加权平均基金份额本期利润

0.4304

4.期末基金份额净值

416,361,948.68

5.期末基金份额净值

1.743

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，计算费用后实际收益水平要低于所列示数字。

3.3.11 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 净值增长率为(%) ① 净值增长率标准差(%) ② 业绩比较基准收益率为(%) ③ 业绩比较基准收益率的标准差(%) ④ ①-③ ②-④

过去三个月 30.17% 1.02% 20.29% 1.74% 9.26% 0.00%

3.3.12 日均基金合同期间以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较</