# 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 2016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:2017年3月29日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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2016年3月27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。

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。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信责任 |
| 基金主代码 | 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 |
| 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 | 75,827,631.69份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

### 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 |

### 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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。 |

### 2.2.1 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,因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。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 建信基金管理有限责任公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 吴晓明 | 郭明 |
| | 联系电话 | 010-66228888 | (010)66105799 |
| | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-81-95533<br>010-66228000 | 95588 |
| 传真 | | 010-66228001 | (010)66105798 |

### 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ccbfund.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016年 | 2015年 | 2014年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 1,767,104.03 | 75,097,103.80 | -2,507,645.45 |
| 本期利润 | -6,608,472.66 | 24,730,850.90 | 128,538,515.43 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0831 | 0.2026 | 0.4099 |
| 本期基金份额净值增长率 | -4.92% | 2.36% | 60.59% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4629 | 0.5386 | 0.1738 |
| 期末基金资产净值 | 110,929,949.85 | 126,287,599.84 | 305,062,441.09 |
| 期末基金份额净值 | 1.4629 | 1.5386 | 1.5031 |

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(不含公允价值变动收益)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收益。

2、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,则期末可供分配利润的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,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分)。

3、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。

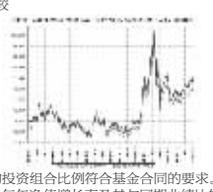
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.49% | 0.71% | 3.89% | 0.72% | -0.40% | -0.01% |
| 过去六个月 | 10.16% | 0.72% | 9.74% | 0.73% | 0.42% | -0.01% |
| 过去一年 | -4.92% | 1.21% | -5.59% | 1.23% | 0.67% | -0.02% |
| 过去三年 | 56.29% | 1.69% | 52.31% | 1.72% | 3.98% | -0.03% |
| 过去五年 | 64.93% | 1.57% | 55.67% | 1.59% | 9.26% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 46.29% | 1.50% | 35.18% | 1.54% | 11.11% | -0.04% |

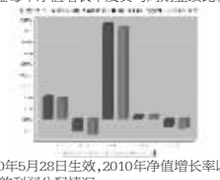
本基金的业绩比较基准为:95%×上证社会责任指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。上证社会责任指数用于反映上证公司治理板块中在社会责任的履行方面表现良好公司股票的走势,同时为投资者提供新的投资标的。该指数基日为2009年6月30日,基点为1000点,指数代码为000048,指数简称为责任指数。上证社会责任指数是上证公司治理指数的主题衍生指数之一,指数样本股是在进行一定的流动性筛选后,从已披露社会责任报告的上证公司治理指数样本股中挑选100只每股社会贡献值最高的公司股票组成。

#### 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,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

#### 3.2.3 过去五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



本基金合同自2010年5月28日生效,2010年净值增长率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北两个营销中心,并在上海设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,恪守“持有人利益重于泰山”的原则,以“建设财富生活”为崇高使命,坚持规范运作,致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至2016年12月31日,公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、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、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒丰纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金共82只开放式基金,管理的公募基金资产规模共计为3770.62亿元。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 叶乐天 | 金融工程及指数投资部总经理助理、本基金的基金经理 | 2012年3月21日 | 2016年7月20日 | 8 | 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日至2016年7月20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;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;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。 |
| 薛玲 | 本基金的基金经理 | 2016年7月4日 | - | 3 | 博士。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院农电配电研究所工作,任项目经理;2010年1月至2013年4月在路通世纪公司工作,任亚洲数据收集部门高级软件工程师;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,任基金经理助理,2016年7月4日起任上证社会责任ETF及其联接基金的基金经理。 |

### 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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)管理的不同投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下:

当时间窗为1日时,配了19338对投资组合,有4101对投资组合未通过T检验,其中1329对投资组合的正溢价率占优频率小于55%,其它2772对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,其中1807对平均溢价率低于2%,其它965对平均溢价率超过2%的投资组合中,其中920对贡献率均未超过5%,另外45对溢价金额占组合净资产比例很小,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为3日时,配了20730对投资组合,有4694对投资组合未通过T检验,但其中822对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它3872对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,其中3601对平均溢价率低于5%,其它271对平均溢价率超过5%的投资组合中,有235对贡献率未超过5%,另外36对溢价金额占组合净资产比例很小,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为5日时,配了21350对投资组合,有5960对投资组合未通过T检验,但其中1162对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它4798对正溢价率占优频率大于55%的投资组合,其中4709对平均溢价率低于10%,其它89对平均溢价率超过10%的投资组合中,有80对贡献率均未超过5%,另外9对溢价金额占组合净资产比例很小,同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人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%的情况有2次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 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-4.92%,波动率1.21%,业绩比较基准收益率-5.59%,波动率1.23%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年在经历了1月份的大幅下跌之后,指数总体处于震荡上行的趋势。期间虽然受到英国脱欧,A股未能纳入MSCI,特朗普当选美国总统等风险事件影响,但指数并未出现明显的下跌。进入12月,受流动性收紧、美债收益率上行的影响,债券市场大幅调整,指数也出现了下跌,但下跌幅度有限。展望2017年,预计经济数据仍然在低位震荡,供给侧改革的效应将逐步显现,通胀逐步抬头,指数预计仍将维持震荡上行的态势,重点关注改革带来的主题性投资机会和受益于通胀、业绩增长确定的股票。

本基金管理人将根据基金合同规定,继续将不低于90%的基金资产投资于责任ETF,同时适当对直接持有的股票组合进行优化,以控制跟踪误差及偏离度。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值执策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策;对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督;对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总�、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及监察稽核总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成(具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定)。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件,发现估值问题;提议基金估值调整的相关方案并进行校验;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不通用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案,报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理,并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的,由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果,基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金)。

自2015年3月26日起,公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格,对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)进行估值。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配,符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对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的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,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的管理人——建信基金管理有限责任公司在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的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,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未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的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2016年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司审计了后附的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的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2017)第21896号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: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
报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 6,721,671.62 | 7,330,894.55 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 3,678.45 | 21,180.62 |
| 交易性金融资产 | | 104,794,249.60 | 119,759,488.00 |
| 其中:股票投资 | | 2,957,449.60 | 560,788.00 |
| 基金投资 | | 101,836,800.00 | 119,198,700.00 |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | | 1,455.94 | 1,842.82 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,982.48 | 8,811.32 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 111,523,038.09 | 127,122,217.31 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 119,009.86 | 149,500.50 |
| 应付管理人报酬 | | 3,866.42 | 2,993.03 |
| 应付托管费 | | 773.27 | 598.59 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 29,870.72 | 342,591.36 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 439,567.97 | 338,933.99 |
| 负债合计 | | 593,088.24 | 834,617.47 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 75,827,631.69 | 82,077,922.57 |
| 未分配利润 | | 35,102,318.16 | 44,209,677.27 |
| 所有者权益合计 | | 110,929,949.85 | 126,287,599.84 |
| 负债和所有者权益总计 | | 111,523,038.09 | 127,122,217.31 |

报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.4629元,基金份额总额75,827,631.69份。

### 7.2 利润表

会计主体: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
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -6,155,997.75 | 25,696,980.61 |
| 1.利息收入 | | 48,890.79 | 94,402.88 |
| 其中:存款利息收入 | | 48,890.79 | 94,402.88 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 2,157,954.97 | 75,676,785.30 |
| 其中:股票投资收益 | | 91,695.26 | 551,320.59 |
| 基金投资收益 | | 2,013,406.92 | 75,103,918.43 |
| 债券投资收益 | | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 52,852.79 | 21,546.28 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | -8,375,576.69 | -50,366,252.90 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | | 12,733.18 | 292,045.33 |
| 减:二、费用 | | 452,474.91 | 966,129.71 |
| 1. 管理人报酬 | | 38,797.20 | 63,045.96 |
| 2. 托管费 | | 7,759.39 | 12,609.18 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | 25,164.04 | 504,491.33 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 380,754.28 | 385,983.25 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | -6,608,472.66 | 24,730,850.90 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | -6,608,472.66 | 24,730,850.90 |

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: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
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 82,077,922.57 | 44,209,677.27 | 126,287,599.84 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -6,608,472.66 | -6,608,472.66 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -6,250,290.88 | -2,498,886.45 | -8,749,177.33 |
| 其中:1.基金申购款 | 8,724,261.96 | 3,373,753.42 | 12,098,015.38 |
| 2.基金赎回款 | -14,974,552.84 | -5,872,639.87 | -20,847,192.71 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 75,827,631.69 | 35,102,318.16 | 110,929,949.85 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 202,957,553.70 | 102,104,887.39 | 305,062,441.09 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 24,730,850.90 | 24,730,850.90 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -120,879,631.13 | -82,626,061.02 | -203,505,692.15 |
| 其中:1.基金申购款 | 120,967,705.08 | 72,727,190.38 | 193,694,895.46 |
| 2.基金赎回款 | -241,847,336.21 | -155,353,251.40 | -397,200,587.61 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 82,077,922.57 | 44,209,677.27 | 126,287,599.84 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____孙志晨_____ _____赵乐峰_____ _____丁颖_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]378号《关于核准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募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,396,209,783.92元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第130号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2010年5月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,396,471,984.76份基金份额,其中认购资金利息折合262,200.84份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)的联接基金。目标ETF是采用完全复制法实现对上证社会责任指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定,本基金以目标ETF、上证社会责任指数成份股、备选成份股为主要投资对象,其中投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股(首次发行或增发等,包括创业板新股)及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为95%×上证社会责任指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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会计》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和基金投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

##### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和基金投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的