

# B508 信息披露 Disclosure

## 建信社会责任混合型证券投资基金

### 2017年第三季度报告

2017年9月30日
基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月25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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月20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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中所称财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	建信社会责任组合
基金代码	530019
交易代码	530019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月14日
报告期末基金份额总额	15,327,611.94
投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	采用自上而下资产配置和自下而上的股票选择相结合的投资策略,本基金采用均衡型资产配置策略,严格控制仓位,追求稳健增值,重点考虑社会责任责任的履行,立足全市场布局,努力实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券综合收益率
风险收益特征	本基金属于平衡型证券投资基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币型基金,属于风险程度中等的证券投资基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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 2017年7月1日至2017年9月30日
1.本期已实现收益	1,005,720.36
2.本期利润	388,776.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0251
4.期末基金份额净值	31.643,506.88
5.期末基金份额净值	2.064

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、上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	净值增长率基准收益②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	-1.20%	0.09%	3.56%	0.44%	-4.76%	0.25%

2017年9月30日	
基金管理人：建信基金管理有限责任公司	
基金托管人：中国农业银行股份有限公司	
报告送出日期：2017年10月25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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月20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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中所称财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	建信中证100指数增强
基金代码	530018
交易代码	530018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月14日
报告期末基金份额总额	62,096,199.73
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用均衡型资产配置策略,严格控制仓位,追求稳健增值,重点考虑社会责任责任的履行,立足全市场布局,努力实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	96%×沪深100指数收益率+4%×商业银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于平衡型证券投资基金,其预期的风险收益水平高于货币型基金,低于股票型基金,属于风险程度中等的证券投资基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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 2017年7月1日至2017年9月30日
1.本期已实现收益	8,475,193.76
2.本期利润	6,390,775.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0163
4.期末基金份额净值	105.086,915.71
5.期末基金份额净值	1.700

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、上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。

阶段	净值增长率①	净值增长率基准收益②	业绩比较基准收益③	①-③	②-③
过去三个月	6.39%	0.72%	5.55%	0.79%	0.84%
过去六个月	10.21%	1.44%	8.77%	1.44%	0.84%
过去一年	12.85%	2.16%	10.69%	2.16%	0.84%
过去两年	15.49%	2.88%	12.61%	2.88%	0.84%
过去三年	18.13%	3.60%	14.53%	3.60%	0.84%
过去四年	20.77%	4.32%	16.45%	4.32%	0.84%
过去五年	23.41%	5.04%	18.37%	5.04%	0.84%
过去六年	26.05%	5.76%	20.29%	5.76%	0.84%
过去七年	28.69%	6.48%	22.21%	6.48%	0.84%
过去八年	31.33%	7.20%	24.13%	7.20%	0.84%
过去九年	33.97%	7.92%	26.05%	7.92%	0.84%
过去十年	36.61%	8.64%	27.97%	8.64%	0.84%

本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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:本基金建仓期自2012年8月14日至2013年2月14日止,建仓期结束后本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2017年9月30日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2017年10月25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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月20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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中所称财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	建信中证基本60ETF联接
基金代码	530015
交易代码	530015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月8日
报告期末基金份额总额	80,737,690.75
投资目标	本基金投资于标的ETF跟踪基金,主要通过投资于标的ETF以求跟踪标的ETF净值表现,力争实现长期资本增值,并力争在控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金主要采取ETF跟踪策略,即跟踪标的ETF净值表现,力争实现长期资本增值,并力争在控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	95%×中证基本60ETF跟踪基金净值增长率+5%×银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于平衡型证券投资基金,其预期的风险收益水平高于货币型基金,低于股票型基金,属于风险程度中等的证券投资基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

2.1.1 报告期末基金概况	
基金名称	建信F60ETF
基金代码	530015
交易代码	530015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月8日
基金合同上市交易日期	2015年10月24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	中国农业银行股份有限公司

2.1.2 报告期末基金净值表现	
基金名称	建信F60ETF
基金代码	530015
交易代码	530015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月8日
基金合同上市交易日期	2015年10月24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	中国农业银行股份有限公司

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、上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	净值增长率基准收益②	业绩比较基准收益③	①-③	②-③	
过去三个月	5.24%	0.77%	3.76%	0.79%	1.48%	-0.02%

# 信息披露 Disclosure

## 建信社会责任混合型证券投资基金

### 2017年第三季度报告

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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:本基金建仓期自2012年8月14日至2013年2月14日止,建仓期结束后本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

本报告期,本基金的投资比例符合基金合同约定。

4.1 基金管理人(或基金托管人)简介				
姓名	职务	在本基金基金托管期限	证券从业年限	说明
		任职日期 离任日期		
孙志	权益投资部副 总经理,负责 管理的基金 经理	2012年8月14 日至今	15	硕士、特许金融分析师 (CFA),曾任美国纳斯达克 上市公司公共关系经理、美国 纳斯达克上市公司董事,2002 年加入美国建信基金管理公 司,2002年3月加入泰达宏利 基金管理公司,历任研究 员、研究员助理、基金经 理等职务,2006年12月23 日至2011年9月30日担任 建信社会责任混合型基金经 理,2010年2月8日至2011 年9月30日担任建信中证 100指数增强型基金经 理,2012年3月21日至2017 年9月26日担任建信社会 责任混合型基金基金经理, 2012年9月16日至2017 年1月24日担任建信价值 精选混合型证券投资基金经 理,2012年9月14日起任 建信社会责任混合增强型证 券投资基金基金经理,2014 年9月10日起任建信社会 责任混合型证券投资基金经 理,2015年2月3日起任 建信社会责任混合增强型证 券投资基金基金经理,2015 年5月16日起任建信社会 责任混合增强型证券基金 基金经理,2017年3月 22日起担任建信社会混合 增强型基金经理。

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》、其他有关证券法律法规的规定和《建信社会责任混合型证券投资基金合同》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

为了公平对待投资者,保护投资者利益,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》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金公平交易制度指导意见》、《基金管理人公平交易管理制度》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易管理制度》、《公司内外部交易管理制度》等风险管理制度。

公司使用的交易系统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,严禁通过第三方交易方式发生不公平交易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多的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金管理人量化分析研究为基础,利用量化模型对基金投资组合进行数据跟踪和风险管控,在报告期内,基金跟踪误差出现一度收缩,但整体一季度后有所收敛,基金取得了比较明显的超额收益,跟踪误差保持在较低水平。

4.5 报告期内基金的投资组合

5.1 投资组合报告

4.1 基金管理人(或基金托管人)简介

姓名	职务	在本基金基金托管期限	证券从业年限	说明
孙志	基金经理	2012年8月14日至今	14	通过全球金融分析师(CFA),2010年1月获清华大学经济管理学院学士学位,2003年1月2005年8月就职于美国纳斯达克上市公司公共关系经理,美国纳斯达克上市公司董事,2002年加入美国建信基金管理公司,历任研究员、研究员助理、基金经理等职务,2006年12月23日至2011年9月30日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2010年2月8日至2011年9月30日任建信中证100指数增强型证券投资基金基金经理,2012年3月21日至2017年9月26日任2011年9月30日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2012年9月16日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2014年9月10日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2015年3月25日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2015年5月16日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2015年5月16日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2017年3月22日起担任建信社会责任混合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》、其他有关证券法律法规的规定和《建信100指数增强型证券投资基金合同》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

为了公平对待投资者,保护投资者利益,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》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金公平交易制度指导意见》、《基金管理人公平交易管理制度》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易管理制度》、《公司内外部交易管理制度》等风险管理制度。

公司使用的交易系统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,严禁通过第三方交易方式发生不公平交易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多的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金管理人量化分析研究为基础,利用量化模型对基金投资组合进行数据跟踪和风险管控,在报告期内,基金跟踪误差出现一度收缩,但整体一季度后有所收敛,基金取得了比较明显的超额收益,跟踪误差保持在较低水平。

4.5 报告期内基金的投资组合

5.1 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	98,303,256.92	91.04
2	其中:股票	98,303,256.92	91.04
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和其他货币资金合计	9,490,361.60	8.76
8	其他资产	191,154.32	0.18
9	合计	108,074,722.84	100.00

姓名	职务	在本基金基金托管期限	证券从业年限	说明
孙志	基金经理	2012年8月14日至今	4	通过全球金融分析师(CFA),2010年1月获清华大学经济管理学院学士学位,2003年1月2005年8月就职于美国纳斯达克上市公司公共关系经理,美国纳斯达克上市公司董事,2002年加入美国建信基金管理公司,历任研究员、研究员助理、基金经理等职务,2006年12月23日至2011年9月30日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2010年2月8日至2011年9月30日任建信中证100指数增强型证券投资基金基金经理,2012年3月21日至2017年9月26日任2011年9月30日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2012年9月16日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2014年9月10日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2015年3月25日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2015年5月16日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2015年5月16日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理,2017年9月28日起担任建信社会责任混合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》、其他有关证券法律法规的规定和《建信中证基本60ETF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

为了公平对待投资者,保护投资者利益,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》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金公平交易制度指导意见》、《基金管理人公平交易管理制度》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易管理制度》、《公司内外部交易管理制度》等风险管理制度。

公司使用的交易系统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,严禁通过第三方交易方式发生不公平交易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多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金大部分资产投资于沪深基本60ETF,因此基金的跟踪误差和跟踪度主要取决于沪深基本60ETF的表现。此外,由于市场造成的基金份额波动,持有的短期债券和货币资金及成份股的价格波动也会对基金净值产生影响,因此,在报告期内,基金跟踪误差和跟踪度均符合基金合同约定的范围内。

4.5 报告期内基金的投资组合

5.1 投资组合报告

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资者,保护投资者利益,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》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金公平交易制度指导意见》、《基金管理人公平交易管理制度》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易管理制度》、《公司内外部交易管理制度》等风险管理制度。

公司使用的交易系统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,严禁通过第三方交易方式发生不公平交易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多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金报告期内重点配置了食品饮料、医药等消费类行业以及电子、高端制造等创新类行业的龙头企业,中国经济未来增长的动力将主要来自消费和创新,而从微观层面上市公司的经营情况来看,这两类企业也表现出良好的增长势头和长期潜力。由于本基金三季度对于周期类行业以及主题投资参与较少,而这类行业报告期内上述较多,消费和创新新行业的龙头企业大多处于企稳状态,因此本基金在三季度的表现落后于市场,但本基金认为消费和创新的方向不会发生变化,长期来看坚定持有消费和创新的龙头企业将取得较好的投资收益。

4.5 报告期内基金的投资组合

5.1 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,389,963.09	71.64
2	其中:股票	23,389,963.09	71.64
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和其他货币资金合计	3,899,934.69	11.94
8	其他资产	60,376.04	0.18
9	合计	32,660,275.82	100.00

5.2 报告期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,389,963.09	71.64
2	其中:股票	23,389,963.09	71.64
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和其他货币资金合计	3,899,934.69	11.94
8	其他资产	60,376.04	0.18
9	合计	32,660,275.82	100.00

5.3 报告期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,389,963.09	71.64
2	其中:股票	23,389,963.09	71.64
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和其他货币资金合计	3,899,934.69	11.94
8	其他资产	60,376.04	0.18
9	合计	32,660,275.82	100.00

5.4 报告期内基金资产组合情况

5.1 投资组合报告

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,127,738.28	1.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,347,826.96	48.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	924,440.00	0.87
F	批发和零售业	1,088,610.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	506,796.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,353,018.04	3.17
J	金融业	11,392,368.00	10.79
K	房地产业	5,569,081.48	5.36
L	租赁和商务服务业	1,018,878.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,908,784.00	2.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,008,744.00	1.90
S	合计	81,291,192.28	76.92

以上行业分类以2017年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期内基金资产组合情况