

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

2010 第三季度报告

2010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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2010年10月27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法律责任。

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2010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。投资者有风险,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。

本报告财务资料未经审计。本报告自2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:建信上证社会责任ETF

基金代码: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:391,081,114份

投资策略:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,实现与标的指数的长期投资收益。

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。

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

1.本期已实现收益:26,057,164.41

2.本期利润:47,048,018.55

3.加权平均基金份额本期利润:0.1072

4.期末基金资产净值:353,444,931.38

5.期末基金份额净值:0.905

6.期末基金份额持有人户数:1,080

7.基金份额持有人户数:1,080

8.基金份额持有人户数:1,080

9.基金份额持有人户数:1,080

10.基金份额持有人户数:1,080

11.基金份额持有人户数:1,080

12.基金份额持有人户数:1,080

13.基金份额持有人户数:1,080

14.基金份额持有人户数:1,080

15.基金份额持有人户数:1,080

16.基金份额持有人户数:1,080

17.基金份额持有人户数:1,080

18.基金份额持有人户数:1,080

19.基金份额持有人户数:1,080

20.基金份额持有人户数:1,080

21.基金份额持有人户数:1,080

22.基金份额持有人户数:1,080

23.基金份额持有人户数:1,080

24.基金份额持有人户数:1,080

25.基金份额持有人户数:1,080

26.基金份额持有人户数:1,080

27.基金份额持有人户数:1,080

28.基金份额持有人户数:1,080

29.基金份额持有人户数:1,080

30.基金份额持有人户数:1,080

31.基金份额持有人户数:1,080

32.基金份额持有人户数:1,080

33.基金份额持有人户数:1,080

略,并以量化分析研究为基础,将基金的跟踪误差及偏离度尽力保持在较低水平。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.1 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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值(元)

5.3.2 报告期末积极投资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

5.3.3 报告期末积极投资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

5.3.4 报告期末积极投资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

5.3.5 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股指期货投资明细

5.3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.7 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股指期货投资明细

5.3.8 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

5.3.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.3.10 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

5.3.11 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股指期货投资明细

5.3.12 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

5.3.13 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股指期货投资明细

5.3.14 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

5.3.15 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股指期货投资明细

5.3.16 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

5.3.17 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股指期货投资明细

5.3.18 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

5.3.19 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股指期货投资明细

5.3.20 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

5.3.21 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股指期货投资明细

5.3.22 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

5.3.23 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股指期货投资明细

5.3.24 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

5.3.25 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股指期货投资明细

5.3.26 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

5.3.27 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股指期货投资明细

5.3.28 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

5.3.29 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股指期货投资明细

5.3.30 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

5.3.31 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股指期货投资明细

5.3.32 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

5.3.33 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股指期货投资明细

5.3.34 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

5.3.35 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股指期货投资明细

5.3.36 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

5.3.37 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股指期货投资明细

5.3.38 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

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

2010 第三季度报告

2010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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2010年10月27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法律责任。

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2010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。投资者有风险,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。

本报告财务资料未经审计。本报告自2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:建信上证社会责任ETF联接

基金代码:510010

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:782,382,013.40份

投资策略:通过投资于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。

业绩比较基准:上证社会责任指数

风险收益特征:本基金为上证社会责任ETF联接基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。

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

1.本期已实现收益:74,299,665.45

2.本期利润:87,339,729.31

3.加权平均基金份额本期利润:0.0622

4.期末基金资产净值:815,340,387.37

5.期末基金份额净值:1.042

6.期末基金份额持有人户数:1,042

7.基金份额持有人户数:1,042

8.基金份额持有人户数:1,042

9.基金份额持有人户数:1,042

10.基金份额持有人户数:1,042

11.基金份额持有人户数:1,042

12.基金份额持有人户数:1,042

13.基金份额持有人户数:1,042

14.基金份额持有人户数:1,042

15.基金份额持有人户数:1,042

16.基金份额持有人户数:1,042

17.基金份额持有人户数:1,042

18.基金份额持有人户数:1,042

19.基金份额持有人户数:1,042

20.基金份额持有人户数:1,042

21.基金份额持有人户数:1,042

22.基金份额持有人户数:1,042

23.基金份额持有人户数:1,042

24.基金份额持有人户数:1,042

25.基金份额持有人户数:1,042

26.基金份额持有人户数:1,042

27.基金份额持有人户数:1,042

28.基金份额持有人户数:1,042

29.基金份额持有人户数:1,042

30.基金份额持有人户数:1,042

31.基金份额持有人户数:1,042

32.基金份额持有人户数:1,042

33.基金份额持有人户数:1,042

略,并以量化分析研究为基础,将基金的跟踪误差及偏离度尽力保持在较低水平。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.1 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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值(元)

5.3.2 报告期末积极投资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

5.3.3 报告期末积极投资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

5.3.4 报告期末积极投资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

5.3.5 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股指期货投资明细

5.3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.7 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股指期货投资明细

5.3.8 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

5.3.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.3.10 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

5.3.11 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股指期货投资明细

5.3.12 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

5.3.13 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股指期货投资明细

5.3.14 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

5.3.15 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股指期货投资明细

5.3.16 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

5.3.17 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股指期货投资明细

5.3.18 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

5.3.19 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股指期货投资明细

5.3.20 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

5.3.21 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股指期货投资明细

5.3.22 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

5.3.23 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股指期货投资明细

5.3.24 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

5.3.25 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股指期货投资明细

5.3.26 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

5.3.27 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股指期货投资明细

5.3.28 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

5.3.29 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股指期货投资明细

5.3.30 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

5.3.31 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股指期货投资明细

5.3.32 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

5.3.33 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股指期货投资明细

5.3.34 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

5.3.35 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股指期货投资明细

5.3.36 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

5.3.37 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股指期货投资明细

5.3.38 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

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:2010年10月27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法律责任。

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2010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。投资者有风险,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。

本报告财务资料未经审计。本报告自2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:建信核心精选股票

基金代码:530006

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2008年11月25日

报告期末基金份额总额:1,035,702,565.62份

投资策略:本基金通过研究宏观经济环境、市场环境、行业特征和公司基本面的深入调研,精选具有良好成长性和价值的上市公司股票,在有效控制风险的前提下力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准:本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略,基金管理人将根据市场环境,适时调整资产配置,并适时调整投资组合,作出投资决策。

风险收益特征:本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。

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

1.本期已实现收益:59,763,379.86

2.本期利润:195,201,309.58

3.加权平均基金份额本期利润:0.1631

4.期末基金资产净值:1,158,647,399.73