

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
报告送审稿日期:二〇一一年八月二十四日

基金管理人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。
本半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2011年8月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容,保证托管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,也不保证最低收益。
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应仔细阅读本基金的招募说明书。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告财务数据未经审计。
本报告日期自2011年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期.

2.1 目标基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 交易方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期.

2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征.

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人.

2.4 信息披露方式

Table with 2 columns: 信息披露网站, 基金管理人及基金托管人住所.

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 3.1.2 期末数据和指标.

注:1、本期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。

注:2、所述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据。

注:3、期末可供分配利润的计算方法,如对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未分配利润的已实现部分;如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未分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

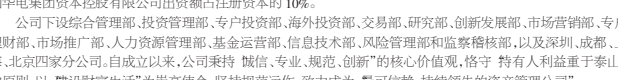
3.2 基金净值表现

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

Table with 2 columns: 阶段, 基金份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, ①-③, ②-④.

注:1、本基金业绩比较基准为:95%×上证社会责任指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。其中:上证社会责任指数收益率作为衡量ETF和股票投资部分的业绩基准,商业银行税后活期存款利率作为衡量现金或到期日在一年以内的政府债券部分的业绩基准。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表现方面表现较好公司股票的趋势,是上证公司治理板块的主题衍生指数之一,该指数本基金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板块中挑选100只基本面价值最优质的公司股票组成。

注:2、本基金合同生效以来基金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:1、本基金以上证社会责任ETF、上证社会责任指数的成份股、基金合同约定的主要投资对象,其中投资于上证社会责任ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;现金或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、增发及可转债等,但不得超过新股及中国证监会上证社会责任指数的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。如法律法规监管机构以后允许基金投资其他品种(包括但不限于指数衍生品金融产品),基金管理人将在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围。

注:2、2011年2月9日,中国人民银行上调了金融机构人民币存款基准利率,作为本基金业绩比较基准商业银行税后活期存款利率由0.36%上调至0.40%;2011年4月6日,该收益率上调至0.50%。

注:3、本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

4.1 基金管理人及基金投资情况

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、安信金融服务公司、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%,安信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%。

注:1、本基金的基金合同于2011年5月28日(基金合同生效日)起生效,至2010年6月30日未满半年。

注:2、本基金的基金合同于2010年5月28日(基金合同生效日)起生效,至2010年6月30日未满半年。

注:3、本基金的基金合同于2010年5月28日(基金合同生效日)起生效,至2010年6月30日未满半年。

注:4、本基金的基金合同于2010年5月28日(基金合同生效日)起生效,至2010年6月30日未满半年。

注:5、本基金的基金合同于2010年5月28日(基金合同生效日)起生效,至2010年6月30日未满半年。

注:6、本基金的基金合同于2010年5月28日(基金合同生效日)起生效,至2010年6月30日未满半年。

注:7、本基金的基金合同于2010年5月28日(基金合同生效日)起生效,至2010年6月30日未满半年。

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

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

报告附注为财务报表的组成部分。
本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:
基金管理人会计负责人:孙志晨,主管会计:王洪斌、何斌、会计机构负责人:秦维华

6.1 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]第378号《准予核准上市公司非公开发行股票投资基金募集说明书》核准,由建信基金管理有限责任公司(以下简称“建信基金”)于2010年5月21日募集成立。截至2011年6月30日,本基金资产净值为424,755,600.94元,基金份额总额为2,396,471,984.76份,基金份额净值为1.81元。

4.4 报告期内基金的业绩表现
2011年上半年本基金净值增长率为0.65%,波动率1.19%,业绩比较基准收益率为0.38%,波动率1.20%。
4.5 管理人应对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
为应对全球的经济危机,政府在2008年8月开始采取了超前的政策刺激手段,经济得以迅速复苏,但为此所支付的代价正逐渐显现。自2010年4季度开始,新一轮通胀来势汹汹,并于2011年6月创出2年多来的新高。展望下半年,我们认为,通胀水平会继续在高位运行一段时间,随着通胀的抬高以及货币政策的持续收紧,通胀压力进一步增加的可能性有所降低,并有望在4季度暂时减轻,市场的悲观情绪可能会有所缓解,但通胀压力在下半年可能依然呈现反复运行特征。

4.6 管理人应对报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期内,本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金估值业务指导意见》(以下简称“指导意见”)等相关规定,持续加强和完善对基金估值的内部控制程序。
公司成立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核,并对因市场环境或市场变化等因素导致调整已实施的估值政策、方法和流程,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经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

6.4 关联方关系
建信基金与本报告期末持有本基金资产净值前10名的股票投资对象之间存在关联方关系。
注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.1.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.1.2 关联方交易
6.4.1.3 本报告期及上年度可比期间未发生过的关联方交易
6.4.1.4 本报告期及上年度可比期间未发生过的关联方交易

6.4.2 基金投资管理
6.4.2.1 基金投资管理
6.4.2.2 基金投资管理

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.3.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.3.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.4.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.4.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.5.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.5.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.6.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.6.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.7.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.7.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.8.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.8.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.9.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.9.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.10.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.10.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.11 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.11.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.11.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.12 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.12.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.12.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.13 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.13.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.13.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.14 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.14.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.14.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.15 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.15.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.15.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.16 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.16.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.16.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.17 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.17.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.17.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.18 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.18.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.18.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.19 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.19.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.19.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.20 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.20.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.20.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.21 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.21.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.21.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.22 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.22.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.22.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.23 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.23.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.23.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.24 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.24.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.24.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.25 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.25.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.25.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.26 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.26.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.26.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.27 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.27.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.27.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.28 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.28.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.28.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.29 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.29.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.29.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.30 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.30.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.30.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.31 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.31.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.31.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.32 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.32.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.32.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.33 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.33.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.33.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.34 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.34.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.34.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.35 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.35.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.35.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.36 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.36.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.36.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.37 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.37.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.37.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.38 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.38.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.38.2 本报告期及上年度可比期间的关联交易

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:1、以上行业分类以2011年6月30日的证监会行业分类标准为依据。
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.1 期末买入股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.2 期末卖出股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.3 期末买入股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.4 期末卖出股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.5 期末买入股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.6 期末卖出股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.7 期末买入股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.8 期末卖出股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.9 期末买入股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.10 期末卖出股票投资明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.cbfund.cn网站的半年度报告全文。

7.5.11 期末买入股票投资明细

7.5.12 期末卖出股票投资明细