

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:二〇一一年八月二十四日

§1 重要提示

基金管理人及董事承诺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。  
本报告自2011年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

基金名称	建信上证社会责任ETF联接
基金代码	530010
交易代码	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	424,755,600.94份
基金合同存续期	不定期

基金名称	上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	510090
基金运作方式	交易开放式(ETF)
基金合同生效日	2010-05-28
基金上市证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010-08-09
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

投资目标	本基金将大部分资产投资于上证社会责任ETF,密切跟踪标的指数表现,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,主要投资于上证社会责任ETF以求达到投资目标。
业绩比较基准	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
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组合基金,本基金为指数型基金,具有和标的指数相近的风险和收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

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目标。
投资策略	本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证社会责任指数+银行活期存款利率
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,具有和标的指数相近的风险和收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

名称	姓名	职务	基金管理人	基金托管人
信息披露负责人	魏春霞	基金运营部	建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
客户服务电话	400-6628888	010-66105799		
网址	www.ccbfund.cn	www.ccb.com.cn		

基金管理人网站	http://www.ccbfund.cn
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	金额单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	5,292,700.30
本期利润	4,813,186.66
加权平均基金份额本期利润	0.0118
基金份额净值增长率	6.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0828
期末可供分配利润	459,011,156.29
期末基金份额净值	1.083

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。  
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,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3、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未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.84%	1.17%	0.21%	1.19%	0.63%	-0.02%
过去三个月	-4.16%	1.10%	-4.63%	1.12%	0.47%	-0.02%
过去六个月	0.65%	1.19%	0.38%	1.20%	0.27%	-0.01%
过去一年	8.30%	1.25%	16.89%	1.34%	-8.59%	-0.09%
成立以来	8.30%	1.26%	6.12%	1.36%	2.18%	-0.16%

注: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良好公司股票的趋势,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只市值最高、流动性最好的公司股票组成。

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



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、金融或债券为主要投资对象,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、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%。如法律法规或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,将其纳入投资范围。

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%。  
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  
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%。

4.1.2 基金管理人及其管理基金的经验  
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%。

4.2 管理人报告期内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》、《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、安全规范的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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,由于申购赎回造成的基金份额变动也会对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跟踪误差均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 基金业绩 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
魏春霞	基金运营部 基金经理 基金经理	2010-05-28 - 8	8	注册金融分析师(CFA),2003年1月获博士学位经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工银理财研究员,现任基金部产品设计,助理基金经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员、基金经理、助理基金经理,现任基金经理。2009年11月5日起担任建信上证社会责任ETF基金基金经理(LOF基金基金经理),2010年5月28日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内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》、《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、安全规范的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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,由于申购赎回造成的基金份额变动也会对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跟踪误差均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 基金业绩 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
魏春霞	基金运营部 基金经理 基金经理	2010-05-28 - 8	8	注册金融分析师(CFA),2003年1月获博士学位经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工银理财研究员,现任基金部产品设计,助理基金经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员、基金经理、助理基金经理,现任基金经理。2009年11月5日起担任建信上证社会责任ETF基金基金经理(LOF基金基金经理),2010年5月28日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内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》、《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、安全规范的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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,由于申购赎回造成的基金份额变动也会对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跟踪误差均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 基金业绩 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
魏春霞	基金运营部 基金经理 基金经理	2010-05-28 - 8	8	注册金融分析师(CFA),2003年1月获博士学位经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工银理财研究员,现任基金部产品设计,助理基金经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员、基金经理、助理基金经理,现任基金经理。2009年11月5日起担任建信上证社会责任ETF基金基金经理(LOF基金基金经理),2010年5月28日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内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》、《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、安全规范的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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,由于申购赎回造成的基金份额变动也会对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跟踪误差均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 基金业绩 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
魏春霞	基金运营部 基金经理 基金经理	2010-05-28 - 8	8	注册金融分析师(CFA),2003年1月获博士学位经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工银理财研究员,现任基金部产品设计,助理基金经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员、基金经理、助理基金经理,现任基金经理。2009年11月5日起担任建信上证社会责任ETF基金基金经理(LOF基金基金经理),2010年5月28日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内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》、《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、安全规范的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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,由于申购赎回造成的基金份额变动也会对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跟踪误差均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 基金业绩 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
魏春霞	基金运营部 基金经理 基金经理	2010-05-28 - 8	8	注册金融分析师(CFA),2003年1月获博士学位经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工银理财研究员,现任基金部产品设计,助理基金经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员、基金经理、助理基金经理,现任基金经理。2009年11月5日起担任建信上证社会责任ETF基金基金经理(LOF基金基金经理),2010年5月28日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内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》、《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、安全规范的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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,由于申购赎回造成的基金份额变动也会对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跟踪误差均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 基金业绩 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
魏春霞	基金运营部 基金经理 基金经理	2010-05-28 - 8	8	注册金融分析师(CFA),2003年1月获博士学位经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工银理财研究员,现任基金部产品设计,助理基金经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员、基金经理、助理基金经理,现任基金经理。2009年11月5日起担任建信上证社会责任ETF基金基金经理(LOF基金基金经理),2010年5月28日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内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》、《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、安全规范的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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,由于申购赎回造成的基金份额变动也会对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跟踪误差均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 基金业绩 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
魏春霞	基金运营部 基金经理 基金经理	2010-05-28 - 8	8	注册金融分析师(CFA),2003年1月获博士学位经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工银理财研究员,现任基金部产品设计,助理基金经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员、基金经理、助理基金经理,现任基金经理。2009年11月5日起担任建信上证社会责任ETF基金基金经理(LOF基金基金经理),2010年5月28日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内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》、《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、安全规范的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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,由于申购赎回造成的基金份额变动也会对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跟踪误差均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 基金业绩 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
魏春霞	基金运营部 基金经理 基金经理	2010-05-28 - 8	8	注册金融分析师(CFA),2003年1月获博士学位经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工银理财研究员,现任基金部产品设计,助理基金经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员、基金经理、助理基金经理,现任基金经理。2009年11月5日起担任建信上证社会责任ETF基金基金经理(LOF基金基金经理),2010年5月28日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内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》、《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、安全规范的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资者,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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,确保公平交易制度的有效执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 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,由于申购赎回造成的基金份额变动也会对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跟踪误差均被控制在基金合同约定的范围内。

4.4.2 基金业绩 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
魏春霞	基金运营部 基金经理 基金经理	2010-05-28 - 8	8	注册金融分析师(CFA),2003年1月获博士学位经济学学士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工银理财研究员,现任基金部产品设计,助理基金经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员、基金经理、助理基金经理,现任基金经理。2009年11月5日起担任建信上证社会责任ETF基金基金经理(LOF基金基金经理),2010年5月28日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内基金运作遵