建信优选成长股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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：2011年10月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优选成长股票
基金主代码	530003
交易代码	530003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月8日
报告期末基金份额总额	3,095,107,969.43份
投资目标	通过投资于具有良好业绩成长性和投资价值的上市公司，实现基金资产长期增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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	报告期（2011年7月1日–2011年9月30日）
1.本期已实现收益	–187,950,286.20
2.本期利润	–360,150,948.61
3.加权平均基金份额本期利润	–0.1157
4.期末基金资产净值	2,601,223,938.28
5.期末基金份额净值	0.8404

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、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。

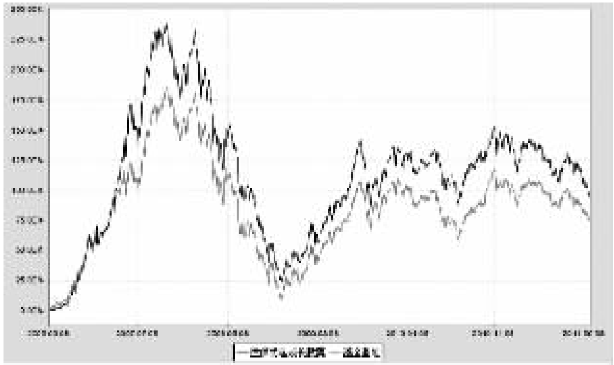
3.2基金净值表现

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	–12.18%	1.11%	–10.92%	0.97%	–1.26%	0.14%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

建信优选成长股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2006年9月8日至2011年9月30日）



注：注：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李涛先生	本基金基金经理	2008–11–27	–	12	学士。先后就职于中国经济开发信托投资公司、西南证券、国泰君安证券公司、新时代证券、中海基金管理公司等单位，曾担任投资银行部经理、行业研究员、基金经理等职。李涛于2005年6月至2007年7月期间担任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理；于2007年7月至2008年7月期间担任中海优质成长证券投资基金基金经理。李涛于2008年9月加入建信基金管理公司；2011年5月11日起任建信优化配置基金的基金经理。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人不存在与本基金投资风格相似的投资组合。

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

三季度市场呈现单边下行格局，沪深300指数下跌15个百分点，各风格板块均出现较大幅度调整，但中小盘股首次在单季度表现优于大盘股，特别是三季度前两个月，中小板和创业板在政策放松预期下的高成长性吸引市场资金的追逐。

本报告期内，本基金依然维持了较高的仓位，主要在持仓结构上进行调整，在季度中早期，加大了医药、商贸等消费类股票配置，在季末加大了银行业配置比例。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率–12.18%，波动率1.11%，业绩比较基准收益率–10.92%，波动率0.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第四季度，经济虽有小幅回落可能，但经济内生动力强劲，出现硬着陆风险较小。证券市场将在流动性、业绩、估值中艰难寻找平衡，从行业趋势来看，前期调整幅度较大的板块将具备较大反弹动能，而符合产业升级与结构调整的行业在调整过程中，或将迎来较好的长期买点。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,407,541,891.51	83.25
	其中：股票	2,407,541,891.51	83.25
2	固定收益投资	176,026,896.00	6.09
	其中：债券	176,026,896.00	6.09
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	303,157,706.68	10.48
6	其他各项资产	5,372,503.75	0.19
7	合计	2,892,098,997.94	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	28,803,022.06	1.11
B	采掘业	115,880,043.29	4.45
C	制造业	1,147,645,896.10	44.12
C0	食品、饮料	220,356,670.00	8.47
C1	纺织、服装、皮毛	59,343,282.34	2.28
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	6,357,980.77	0.24
C4	石油、化学、塑胶、塑料	64,469,258.24	2.48
C5	电子	43,123,787.80	1.66
C6	金属、非金属	47,430,359.60	1.82
C7	机械、设备、仪表	341,801,754.04	13.14
C8	医药、生物制品	321,582,079.25	12.36
C99	其他制造业	43,180,724.06	1.66
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	148,599,738.59	5.71
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	151,327,987.59	5.82
H	批发和零售贸易	207,623,184.99	7.98
I	金融、保险业	450,954,434.80	17.34
J	房地产业	82,306,491.44	3.16
K	社会服务业	44,287,255.80	1.70
L	传播与文化产业	23,196,876.79	0.89
M	综合类	6,916,960.06	0.27
	合计	2,407,541,891.51	92.55

注：以上行业分类以2011年9月30日的证监会行业分类标准为依据。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600000	浦发银行	14,956,379	127,727,476.66	4.91
2	000650	仁和药业	6,951,837	95,518,240.38	3.67
3	600015	华夏银行	7,719,847	78,047,653.17	3.00
4	000001	深发展A	4,850,901	77,808,452.04	2.99
5	601166	兴业银行	6,264,475	77,616,845.25	2.98
6	601601	中国太保	3,520,390	65,092,011.10	2.50
7	002065	东华软件	2,842,781	55,945,930.08	2.15
8	600537	海通集团	2,026,024	55,107,852.80	2.12
9	600887	伊利股份	2,899,708	53,064,656.40	2.04
10	600970	中材国际	2,149,091	50,503,638.50	1.94

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	173,898,000.00	6.69
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	2,128,896.00	0.08
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	176,026,896.00	6.77

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1101022	11央票22	1,500,000	144,900,000.00	5.57
2	1101018	11央行票据18	300,000	28,998,000.00	1.11
3	112006	08万科G2	21,120	2,128,896.00	0.08

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8投资组合报告附注

5.8.1本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.8.3其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,435,778.27
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,775,990.03
5	应收申购款	160,735.45
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,372,503.75

5.8.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	3,144,858,877.80
本报告期基金总申购份额	38,238,193.08
减：本报告期基金总赎回份额	87,989,101.45
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	3,095,107,969.43

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、中国证监会批准建信优选成长股票型证券投资基金设立的文件；
2、《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》；
3、《建信优选成长股票型证券投资基金招募说明书》；
4、《建信优选成长股票型证券投资基金托管协议》；
5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.2存放地点：

基金管理人或基金托管人处。

7.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年十月二十六日

建信新兴市场优选股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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：二〇一一年十月二十六日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信新兴市场股票（QDII）
基金主代码	539002
交易代码	539002
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2011年6月21日
报告期末基金份额总额	177,418,341.05份
投资目标	通过主要投资于注册地或主要经济活动在新兴市场国家或地区的上市公司股票，在分散投资风险的同时追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在投资策略方面，将采取自上而下的资产配置与自下而上的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合等多种方式进行投资组合的构建。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：摩根士丹利资本国际新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index（Net Total Return））。
风险收益特征	本基金为股票型基金，一般情况下基金投资风险收益水平高于债券型基金和混合型基金。同时，由于本基金主要投资于新兴市场上市公司股票，预期风险–收益水平高于一般的境外投资股票型基金。
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
境外投资顾问英文名称	Principal Global Investors，LLC.
境外投资顾问中文名称	信安环球投资有限公司
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman & Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§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（2011年7月1日–2011年9月30日）	报告期（2011年6月21日–2011年06月30日）
1.本期已实现收益	–14,365,633.11	142,772.44
2.本期利润	–14,546,990.94	142,772.44
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0689	0.0003
4.期末基金资产净值	163,558,917.92	426,789,847.57
5.期末基金份额净值	0.922	1.000

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、汇兑损益、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字。

3、本基金基金合同自2011年6月21日生效。

3.2 基金净值表现

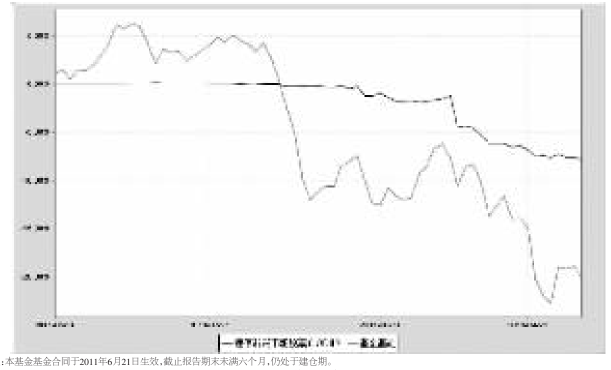
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	–7.80%	0.50%	–23.49%	1.91%	15.69%	–1.41%

注：本基金同期业绩比较基准以人民币计价。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

建信新兴市场优选股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2011年6月21日至2011年9月30日）



注：本基金基金合同于2011年6月21日生效，截止报告期末未满六个月，仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵英楷先生	海外投资部总监，本基金基金经理	2011–6–21	–	15	美国哥伦比亚大学商学院MBA，曾任美国美林证券公司研究员、高盛证券公司研究员、美林证券公司投资组合策略分析师、美国阿罗亚投资公司基金经理；2010年3月加入建信基金管理有限责任公司，历任海外投资部执行总监（主持工作）、总监。2011年4月20日起任建信全球机遇股票型证券投资基金基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Michael L. Reynal	本基金境外投资顾问	20	达特茅斯学院Amos Tuck商学院MBA毕业。1991年–1993年，在Barclays de Zoete Wedd先后担任兼并与收购部门分析师，拉丁美洲股票销售。1993年–1997年，在Paribas Capital Markets担任股票销售总监。1998年在花旗集团参加暑期实习。1999年–2001年，在Wafra 投资顾问集团担任副总裁，投资组合经理和分析师。2001年至今，在信安环球投资担任投资组合经理。负责领导新兴市场团队，他同时分管分散投资的新兴市场组合和专门的亚洲区域股票策略。他同时也进行公司研究，主要侧重于全球制药公司以及拉美/东欧/中东/非洲的消费品和不动产。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、其他有关法律法规的规定和《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人不存在与本基金投资风格相似的投资组合。

4.4.3 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

本季度全球新兴市场出现较大跌幅，七月走势相对平稳，但八月、九月市场大幅下跌。新兴市场下跌围绕三个主题：一是欧洲债务问题恶化和美国经济走势疲软导致投资人对全球经济形势担忧；二是投资人去风险情绪导致资金从新兴股票市场撤离，转入成熟市场或较为安全的债券市场；三是新兴市场主要国家通胀较高，从南美、亚洲、到欧洲，主要新兴市场国家通胀率都处于近几年高位，虽然其宏观经济形势的前景不容乐观，但在高通胀的压力下，多数国家维持了紧缩政策，但也有少数例外。具体而言，虽然中国的CPI从7月的6.4%下降到9月的6.1%，表明通胀的峰值已经确立，压力有所缓解，但CPI仍处于偏高的水平，从而决定了近期的政策取向还是延续前期的紧缩政策为主，但同时辅助一些局部微调。在政策不太可能更紧的情况下，我们需要密切关注经济基本面和企业盈利在政策压力下的表现。印度仍然在受通胀上行的困扰，其央行仍处在加息通道中，但市场普遍预期加息周期已接近尾声。巴西是个例外，它选择了下调了利率保经济增长，很大一部分原因是巴西的实际利率超过5%，具备下调条件。

我们在三季度采取了谨慎原则，在市场回调后进行了一些试探性建仓，但随着市场动荡进一步加剧，我们对宏观形势转向悲观，立即减仓降低风险，从而避免了本季市场暴跌对净值带来过大冲击。我们对近期市场走势依旧保持谨慎，认为市场会继续大幅度震荡。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为–7.80%，波动率为0.50%，业绩比较基准收益率为–23.49%，波动率为1.91%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为新兴市场仍可能经历较大幅度的震荡。新兴市场经济基本面好于成熟市场，其经济增长速度、政府债务水平、居民储蓄率、潜在的消费能力等方面都强于成熟市场。但是新兴市场也面临短期风险，其中最大的困扰因素是较高的通胀水平，新兴市场国家政府需要在高通胀和保增长两者间做出选择。另外新兴市场国家的出口较大程度上依赖成熟市场国家，成熟市场，尤其是欧洲未来几个季度的走向可能会决定新兴市场国家短期经济和股票市场的走势。近期，欧洲方面德法宣布即将推出对银行重组和主权债的一揽子政策救市措施，但介于欧元区的复杂国家构成和相关国家在过去一年中表现出的较大立场差异，我们仍对欧洲的主权债危机和相关结构性问题的根本解决抱审慎态度。另一方面，如果欧元区确实在政策方面能重树市场信心，那将为全球经济和全球市场消除一个最主要的风险。

投资人需要注意的是如果欧洲问题确实带动全球经济下滑，新兴市场国家较好的经济基本面会保障其促增长的政策迅速推出。而欧洲问题得到妥善解决，新兴市场目前的低估值和结构性增长潜力也会为投资人带来上行机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	732,770.80	0.44
	其中：普通股	732,770.80	0.44
	存托凭证	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中：远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	55,000,000.00	33.19
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	109,933,094.78	66.33
8	其他各项资产	65,582.91	0.04
9	合计	165,731,448.49	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
美国	732,770.80	0.45
合计	732,770.80	0.45

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
材料	732,770.80	0.45
合计	732,770.80	0.45

注：注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	证券代码	公司名称（英文）	公司名称（中文）	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	US7802871084	ROYAL GOLD INC	–	纳斯达克交易所	美国	1,800	732,770.80	0.45

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	18,791.64
3	应收股利	8,727.61
4	应收利息	10,890.10
5	应收申购款	5,807.16
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	21,366.40
9	合计	65,582.91

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	426,647,075.13
本报告期基金总申购份额	563,810.33
减：本报告期基金总赎回份额	249,792,544.41
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	177,418,341.05

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信新兴市场优选股票型证券投资基金设立的文件；
2、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》；
3、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金招募说明书》；
4、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金托管协议》；
5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年十月二十六日

建信信用增强债券型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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：交通银行股份有限公司
报告送出日期：2011年10月26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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信信用增强债券
基金主代码	165311
交易代码	165311
基金运作方式	契约型，3年封闭，3年后转为LOF
基金合同生效日	2011年6月16日
报告期末基金份额总额	761,256,172.26份
投资目标	在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。同时，在固定收益资产所提供的稳健收益基础上，适当参与新股发行申购及增发新股申购，为基金份额持有人增加收益，实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中等风险基金产品。其预期风险和收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 由于主要投资于除国债、中央银行票据以外的信用类金融工具，因此本基金投资蕴含一定的信用风险，预期风险和收益水平高于一般的不涉及股票二级市场投资的债券型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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（2011年7月1日–2011年9月30日）	2011年6月16日–2011年06月30日）
1.本期已实现收益	6,452,297.06	1,114,075.89
2.本期利润	3,273,158.65	1,469,021.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0043	0.0019
4.期末基金资产净值	765,998,352.60	762,725,193.95
5.期末基金份额净值	1.006	1.002

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收益。

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。

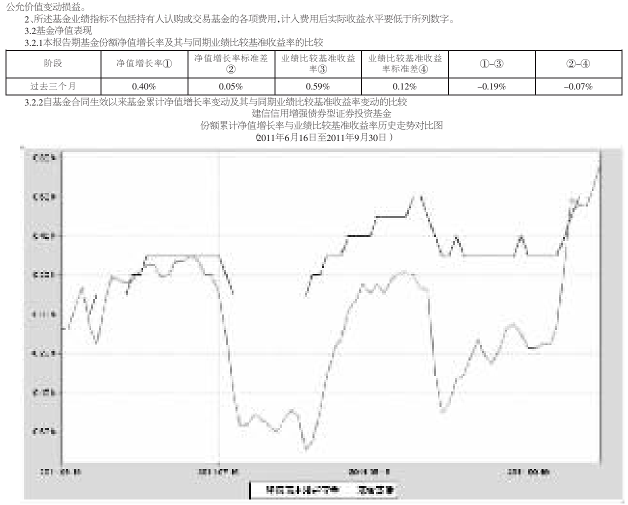
3.2基金净值表现

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	0.40%	0.05%	0.59%	0.12%	–0.19%	–0.07%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

建信信用增强债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2011年6月16日至2011年9月30日）



注：本基金基金合同于2011年6月16日生效，截止本报告期末成立不满6个月，尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李菁女士	本基金基金经理	2011–6–16	–	6	硕士。2002年7月进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作，从事基金托管业务，任主任科员，2005年9月加入本公司，先后任债券研究员和本基金基金经理助理、基金经理，2007年11月1日起任建信货币市场基金基金经理；2009年6月2日起任建信收益增强基金基金经理。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、其他有关法律法规的规定和《建信信用增强债券型证券投资基金基金合同》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本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人不存在与本基金投资风格相似的投资组合。

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

三季度，在居民物价水平同比数据居高不下的情况下，政策调控的重心仍然是控制通货膨胀，并于季度初再次上调了存贷款基准利率，进一步规范了金融机构缴存法定存款准备金的范围以及对银行理财产品和票据融资进行规范核查。国际市场方面，欧债危机的恶化、欧美经济复苏步伐低于预期从而触发评级机构对主要经济体以及银行评级的下调，国际金融市场震荡加剧。

三季度初市场资金仍然延续紧张局面，包括信用债在内各期限品种收益率持续大幅上行，至季中随着资金略有缓解，利率产品收益率基本企稳，但信用产品仍然维持弱势。权益市场方面，随着市场对政策放松预期的落空、流动性的紧缩和外围经济的持续恶化，市场继续震荡下行。

本基金于6月16日成立，回顾前期的基金管理工作，建仓期内本基金采取了逐步缓慢建仓策略，初期以回购资产为主，后期逐步增加了金融债和短期融资券等产品的配置比例。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率0.40%，波动率0.05%，业绩比较基准收益率0.59%，波动率0.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下季度，我们认为CPI同比数据将会缓慢下行，在此过程中，货币政策的微调和转向或将有所滞后，在信贷紧缩和房地产调控的背景下，未来一段时间内经济难以维持较高增长。在信贷紧缩和资金成本较高的情况下，企业盈利空间也受到挤压，而未来股票市场的持续扩容也使得市场的流动性处于相对紧张的状态。总体上我们认为，股票市场仍然难以出现系统性的估值扩张的趋势性行情，债券市场方面相对更看好随着大家对经济增长预期改变所带来的利率产品投资机会。

本基金在四季度将积极关注市场波动带来的机会，继续关注利率产品和高评级信用债的投资机会，继续延长组合久期，增强资产组合的灵活性。权益市场方面，充分关注可转债市场扩容风险释放后所带来的投资机会。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	665,989,521.65	80.54
	其中：债券	665,989,521.65	80.54
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	147,690,741.54	17.86
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	6,604,958.73	0.80
6	其他各项资产	6,577,057.98	0.80
7	合计	826,862,279.90	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	19,122,203.50	2.50
2	央行票据	–	–
3	金融债券	161,660,000.00	21.10
	其中：政策性金融债	161,660,000.00	21.10
4	企业债券	157,848,139.69	20.61
5	企业短期融资券	310,046,000.00	40.48
6	中期票据	–	–
7	可转债	17,313,178.46	2.26
8	其他	–	–
9	合计	665,989,521.65	86.94

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	041152001	11国电集CP004	1,000,000	100,230,000.00	13.08
2	041153002	11华能CP002	1,000,000	100,130,000.00	13.07
3	070225	07国开25	500,000	51,260,000.00	6.69
4	041160001	11陕延油CP002	500,000	50,130,000.00	6.54
5	122092	11大秦01	350,000	34,895,000.00	4.56

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8投资组合报告附注

5.8.1本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.8.3其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	5,551,195.82
5	应收申购款	–
6	其他应收款	10,000.00
7	待摊费用	15,862.16
8	其他	–
9	合计	6,577,057.98

5.8.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	125709	唐钢转债	7,219,892.46	0.94
2	113002	工行转债	5,098,000.00	0.67
3	113001	中行转债	2,726,060.40	0.36

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	19,999,722.22
报告期期间买入总份额	–
报告期期间卖出总份额	–
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	19,999,722.22
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例（%）	2.63

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、中国证监会批准建信信用增强债券型证券投资基金设立的文件；
2、《建信信用增强债券型证券投资基金基金合同》；
3、《建信信用增强债券型证券投资基金招募说明书》；
4、《建信信用增强债券型证券投资基金托管协议》；
5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年十月二十六日

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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：2011年10月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	责任ETF
基金主代码	510090
交易代码	510090
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2010年5月28日
报告期末基金份额总额	482,081,114.00份
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，即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。
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	报告期（2011年7月1日–2011年9月30日）
1.本期已实现收益	–2,222,349.98
2.本期利润	–67,134,990.86
3.加权平均基金份额本期利润	–0.1431
4.期末基金资产净值	387,764,116.15
5.期末基金份额净值	0.804

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、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。

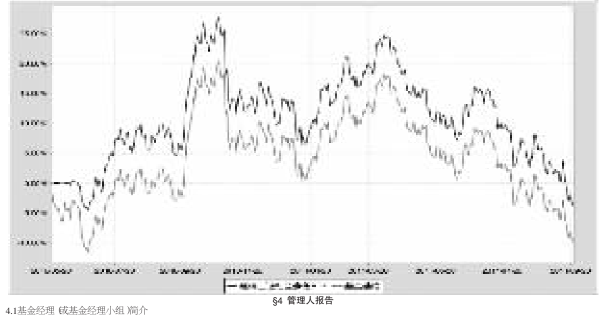
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	–15.10%	1.42%	–15.39%	1.42%	0.29%	0.00%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2010年5月28日至2011年9月30日）



§4 管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁洪昀先生	投资管理部执行总监，本基金基金经理	2010–5–28	–	8	注册金融分析师（CFA），2003年1月获清华大学经济学博士学位，2003年1月至2005年8月，就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理；2010年5月28日起任建信上证社会责任ETF联接基金基金经理；2011年9月8日起任深证基本面60ETF及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，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《上证社会责任交易型指数证券投资基金基金合同》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本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人不存在与本基金投资风格相似的投资组合。

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 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

在报告期内，本基金根据基金合同规定，采取了对指数的被动复制策略，将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内，本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪的指数在权重结构上的差异。这种差异源自部分股票由于舍入取整等原因，申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人在量化分析基础上，采取了适当的组合调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

报告期初，本基金跟踪的标的指数进行了成份股调整，本基金继上季度末期，继续对组合进行调整，并对申赎清单中部分股票的现金替代标志进行了适当设置。这一过程对基金的跟踪误差和偏离度未造成明显影响。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率–15.10%，波动率1.42%，业绩比较基准收益率–15.39%，波动率1.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年四季度，从外部环境来看，欧债危机仍有诸多不确定性，从内部环境来看，通胀压力预计会随着经济下行压力的增加而有所缓解。短期内股指仍旧承压，但下行风险比较有限，预计责任指数在四季度内低位反复震荡的可能性仍然较高。

本基金管理人将根据基金合同，以量化分析研究为基础，克服各种因素的不利影响，不断优化和改进量化模型，将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	385,206,322.28	99.20
	其中：股票	385,206,322.28	99.20
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	2,909,282.91	0.75
6	其他各项资产	189,977.98	0.05
7	合计	388,305,583.17	100.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采掘业	50,606,004.02	13.05
C	制造业	89,342,212.11	23.04
C0	食品、饮料	3,356,374.92	0.87
C1	纺织、服装、皮毛	3,952,867.86	1.02
C2	木材、家具	796,363.80	0.21
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,716,485.56	1.47
C5	电子	3,446,028.83	0.89
C6	金属、非金属	11,604,266.89	2.99
C7	机械、设备、仪表	41,993,277.92	10.83
C8	医药、生物制品	18,476,546.33	4.76
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	965,362.79	0.25
E	建筑业	16,883,756.89	4.35
F	交通运输、仓储业	4,120,568.56	1.06
G	信息技术业	22,107,415.35	5.70
H	批发和零售贸易	10,074,978.77	2.60
I	金融、保险业	172,073,337.13	44.38
J	房地产业	16,924,047.22	4.36
K	社会服务业	2,108,639.44	0.54
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	385,206,322.28	99.34

注：以上行业分类以2011年9月30日的证监会行业分类标准为依据。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	2,863,153	31,666,472.18	8.17
2	600016	民生银行	5,230,689	28,873,403.28	7.45
3	601318	中国平安	775,936	26,048,171.52	6.72
4	601328	交通银行	5,298,775	23,738,512.00	6.12
5	600000	浦发银行	2,590,760	22,125,090.40	5.71
6	601166	兴业银行	1,748,475	21,663,605.25	5.59
7	601088	中国神华	763,700	19,352,158.00	4.99
8	600030	中信证券	1,596,274	17,958,082.50	4.63
9	600031	三一重工	703,471	10,137,017.11	2.61
10	600050	中国联通	1,961,987	10,045,373.44	2.59

5.3.2期末积极投资按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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	48,308.83
3	应收股利	125,930.30
4	应收利息	615.10
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	15,123.75
8	其他	–
9	合计	189,977.98

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5报告期末前十名（前五名）股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	469,081,114.00
本报告期基金总申购份额	35,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	22,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	482,081,114.00

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准上证社会责任交易型指数证券投资基金募集设立的文件；
2、《上证社会责任交易型指数证券投资基金基金合同》；
3、《上证社会责任交易型指数证券投资基金招募说明书》；
4、《上证社会责任交易型指数证券投资基金托管协议》；
5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年十月二十六日