上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2012年第1号

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2010年3月26日证监许可［2010］378号文核准募集。本基金的基金合同于2010年5月28日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益；因基金份额净值及交易价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数收回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身风险承受能力，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。

投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金退市风险、投资者申购赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险以及基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，等等。本基金属股票基金，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，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。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为2011年11月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年9月30日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
设立日期：2005年9月19日
法定代表人：江先周
联系人：路彩营
电话：010-66228888
注册资本：人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字［2005］158号文批准设立。公司的股权结构如下：

股东名称	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
美国信安金融服务公司	25%
中国华电集团资本控股有限公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由5名监事组成，其中包括2名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营管理由总经理负责。公司根据经营运作需要设置综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部十五个职能部门以及深圳分公司、成都分公司、北京分公司和上海分公司。此外，公司还设有投资决策委员会和风险管理委员会。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

江先周先生，董事长。1982年毕业于东北财经大学，获经济学学士学位。1986年获财政部财政科学研究所经济学硕士学位。1993年获美国Heriot-Watt大学商学院国际银行金融学硕士学位。历任中国建设银行行长办公室副处长，中国建设银行国际业务部处长，中国建设银行行长办公室副主任，中国建设银行国际业务部副总经理，中国建设银行基金托管部总经理，中国建设银行基金托管部总经理兼机构业务部总经理。

孙志晨先生，董事。1985年获东北财经大学经济学学士学位，2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长，中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。

马梅琴女士，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1984年获中央财政金融学院学士学位。历任中国建设银行筹资储蓄部证券处副处长、中国建设银行筹资储蓄部外币储蓄处处长、中国建设银行零售业务部自动服务处处长、中国建设银行个人银行业务部证券业务处处长、中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理兼证券处高级经理、中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理、中国建设银行个人金融业务部副总经理。

俞斌先生，董事，现任中国建设银行财务会计部总经理助理。1992年获南京大学计算数学专业硕士学位。历任中国建设银行江苏分行泰州分行行长助理、副行长，中国建设银行财务会计部处长。

袁时奋先生，董事，现任信安国际有限公司大中华区首席营运官。1981年毕业于美国阿而比学院。历任香港汇丰银行投资银行部副经理，加拿大丰业银行资本市场部高级经理，香港铁路公司库务部助理司库，香港置地集团库务部司库，香港赛马会副集团司库，信安国际有限公司大中华区首席营运官。

殷红军先生，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司副总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数量经济学专业，获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理（主持工作）、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长。

顾建国先生，独立董事，现任中国信达资产管理股份有限公司总裁助理。1984年获浙江工业大学管理工程学学士学位，1991年获浙江大学经济系宏观经济专业硕士学位，1994年获财政部财科所研究生部财务学博士学位。历任中国建设银行信托投资公司总裁助理兼财会部经理、中国建设银行会计部副总经理、香港华建国际集团公司总经理。

关启昌先生，独立董事，现任MORRISON & Company Limited总裁。1970年获新加坡大学会计学（荣誉）学士学位。并于1992年修完斯坦福大学行政人员课程。历任Accountant General's Office，Singapore Government 会计师、Turquand Young， Chartered Accountants Hong Kong 核数师、Irish，Young & Outhwaite 核数师、Bechwith Kwan & Company，Chartered Accountants Australia and Hong Kong 合伙人、美林证券总裁、协和集团董事兼总经理、Morrison & Co.，LTD总裁。

沈四宝先生，独立董事，现任对外经贸大学法学院院长。1981年获北京大学法律系国际经济法学硕士学位。历任北京大学助教、对外经济贸易大学法学院院长。

2、监事会成员

罗中海女士，监事会主席。1977年毕业于天津南开大学政治经济学专业。历任国家统计局干部、副处长，中国建设银行投资调查部副处长、信贷部副处长、处长，委托代理部处长，中国建设银行基金托管部副总经理，中国建设银行投资托管服务部总经理。

谭旭耀先生，监事，现任现任信安信托（亚洲）有限公司和信安保险（香港）有限公司财务及精算总监，负责信安香港会计、精算及财务管理、产品设计及报价、风险管理等。

唐湖晖女士，监事，现任中国华电集团资本控股有限公司金融管理部经理。1993年获北京物资学院会计学学士，2007年获得清华-麦考瑞大学应用金融硕士。历任中电联电力财会与经济发展研究中心、原电力工业部经济调节司、国家电力公司财务与资产管理部、中国华电集团公司财务与资产管理部、中国华电集团公司结算中心、中国华电集团公司金融管理部副处长、中国华电集团资本控股（财务）公司监审部经理。

霍峰先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。1988年获得安徽省安庆师范学院文学学士学位，1990年获得上海复旦大学国际经济法专业法学学士学位。历任中国日报评论部记者、秘备首钢铁矿股份有限公司内部审计部副主任，中国信达信托投资有限公司（原名为中国建设银行信托投资公司）证券发行部副总经理，宏源证券股份有限公司投资银行总部副总经理，上海永嘉投资管理有限公司执行董事、副总经理。

吴洁女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司风险管理部总监。1992年毕业于南开大学金融系，1995年毕业于中国人民银行金融研究所研究生部。历任中国建设银行国际业务部外汇资金处主任科员、中国建设银行资金部交易风险管理处副处长、中国建设银行资金部交易风险管理处、综合处高级副经理（主持工作）。

3、公司高管人员

孙志晨先生，总经理（简历请参见董事会成员）。

何斌先生，副总经理。1992年获东北财经大学计划统计系学士学位。先后就职于北京市财政局、北京京都会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部、国泰基金管理公司副总经理、建信基金管理有限责任公司副总经理。

张延明先生，副总经理。1993年获中国人民大学投资经济系学士学位，1997年获中国人民大学投资经济系硕士学位。先后供职于深圳市建设集团、中国建设银行，历任中国建设银行信贷管理部主任科员、中国建设银行行长办公室主任科员、副处长、处长。2006年11月加入建信基金管理有限责任公司，任总经理助理；2008年6月起任建信基金管理有限责任公司副总经理。

王新艳女士，副总经理。注册金融分析师（CFA），硕士。1998年10月加入长盛基金管理公司，历任研究员、基金经理助理，2002年11月2日至2004年5月22日担任长盛成长价值股票型证券投资基金的基金经理。2004年6月加入景顺长城基金管理公司，历任基金经理、投资副总监、投资总监等职，2005年3月16日至2009年3月16日期间担任景顺长城眼益股票型证券投资基金（LOF）的基金经理，2007年6月18日至2009年3月16日期间担任景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2009年3月加入本公司，任总经理助理，2010年5月起任副总经理。2009年12月17日至2011年2月1日任建信恒久价值股票型证券投资基金的基金经理；2010年4月27日起任建信核心精选股票型证券投资基金的基金经理；2010年11月16日起任建信内生动力股票型证券投资基金的基金经理。

4、督察长

路彩营女士，督察长。1979年毕业于河北大学经济系计划统计专业。历任中国建设银行副主任科员、主任科员、副处长、处长，华夏证券部门副总经理，宝盈基金管理公司首席顾问（公司副总经理级），建信基金管理有限责任公司监事长。

5、本基金基金经理

梁洪昀先生，投资管理部执行总监。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9月起任投资管理部副总监。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日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理；2011年9月8日起任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金和建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总经理。

王新艳女士，副总经理。

梁洪昀先生，投资管理部执行总监。

万志勇先生，研究部执行总监兼投资管理部副总监。

钟敬棣先生，投资管理部副总监。

姚锦女士，研究部首席策略分析师。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
批准设立机关及批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发［1983］146号）
组织形式：国有独资
存续期间：持续经营
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系人：赵会军
联系电话：010-66105799

（二）主要人员情况

截至2011年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工145人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年9月，中国工商银行共托管证券投资基金225只，其中封闭式7只，开放式218只。自2003 年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的26项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

①国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市延平路135号
法定代表人：万建华
客服电话：400-8888-666
网址：www.gtja.com

②中信证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
客服电话：95558
网址：www.citics.com

③中信万通证券有限责任公司
住所：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：张智河
客服电话：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

④光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
客服电话：10108998
网址：www.ebscn.com

⑤招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
客户服务热线：95565、4008888111
网址：www.newone.com.cn

⑥中信金通证券有限责任公司
住所：浙江省杭州市中河南路11号万凯商务楼A座
法定代表人：刘军
客服电话：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn

⑦长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
客服电话：0755-82288968
网址：www.cc168.com.cn

⑧海通证券股份有限公司
住所：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
客户服务电话：400-8888-001，（021）962503
网址：www.htsec.com

⑨中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座
法定代表人：顾伟国
客户服务电话：4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn

⑩长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
客户服务电话：4008-888-999
公司网址：www.95579.com

⑪华泰联合证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道4011 号香港中旅大厦25 、24楼
法定代表人：马昭明
客户服务电话：95513
公司网址：www.lhzq.com

⑫中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
客户服务电话：400-8888-108
公司网址：www.csc108.com

⑬华泰证券股份有限公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
客户咨询电话：025-84579897
网址：www.htsc.com.cn

⑭齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
客户服务热线：95538
网址：www.qlzq.com.cn

⑮东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
客户服务电话：0431-96688、0431-85096733
网址：www.nesc.cn

⑯渤海证券股份有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人：杜庆平
客户服务电话：4006515988
网址：www.bhzq.com

⑰广发证券股份有限公司
住所：广州市天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人：林治海
客户服务电话：020-95575
网址：www.gf.com.cn

⑱华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
客服热线：0591-96326
网址：www.gfhfzq.com.cn

⑲信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人：高冠江
客服热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

⑳兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路99号
法定代表人：兰荣
客户服务电话：4008888123
网址：www.xyzq.com.cn

㉑平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
客服热线：4008866338
网址：stock.pingan.com

㉒东海证券有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
法定代表人：朱科敏
客服热线：4008888588
网址：www.longone.com.cn

㉓国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦
法定代表人：何如
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

㉔中国建银投资证券有限责任公司
注册地址：深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
法定代表人：杨明辉
开放式基金咨询电话：4006008008
网址：www.cjis.cn

㉕宏信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心20层
法定代表人：牛冠兴
客户服务电话：0755-82825555
网址：www.axzq.com.cn

㉖宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
客服电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

㉗上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路336号
法定代表人：郁忠民
客服电话：021-962518
网址：www.962518.com

㉘国元证券股份有限公司
注册地址：合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
客户服务热线：400-8888-777
网址：www.gyzq.com.cn

㉙红塔证券股份有限公司
注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人：倪面林
客服电话：0871-3577888
网址：www.hongtastock.com

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人：金颖
办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层
电话：010-58598839
传真：010-58598907

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层
负责人：王丽
联系人：徐建军
电话：010-66575888
传真：010-65232181
经办律师：徐建军、李晓明

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
联系人：常旭
联系电话：021-61238888
传真：021-61238800
经办注册会计师：薛竞 张鸿

四、基金的名称

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

股票型基金

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

八、基金的投资策略

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。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。

本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在特殊情况下，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：①法律法规的限制；②标的指数成份股流动性严重不足；③标的指数的成份股票长期停牌；④其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、股票资产组合日常管理

①投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和组合调整。

1）确定目标组合：根据复制标的指数成份股及其权重的方法确定目标组合；

2）确定建仓策略：根据对成份股流动性、公司行为等因素的分析，确定合理的建仓策略；

3）组合调整：根据目标组合，在合理时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

②投资组合日常管理

1）根据标的指数构成及权重，结合基金当前持有的证券组合及其比例，制作下一交易日基金的申购赎回清单并公告；

2）将基金持有的证券组合构成与标的指数进行比较，制定目标组合构成及权重，确定合理的交易策略；

3）实施交易策略，以实现基金最优组合结构。

③标的指数成份股票定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

④成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息（如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等）以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并据以确定基金的申购赎回清单以及基金的每日交易策略。

⑤标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

⑥申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

⑦替代投资

对个别成份股，若其存在投资受限、严重的流动性困难、财务风险较大、面临重大不利的司法诉讼或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替，或者选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其他股票来代替，即采用“替代投资策略”应对。采用替代投资策略的原则是使得本基金投资组合对标的指数的跟踪误差最小化，以利于本基金投资目标的实现。

⑧跟踪偏离度的监控与管理

基金经理每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度。每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等，并优化跟踪偏离度管理方案。

本基金选择“总体累积偏差”、“行业偏差”及“个股偏差”作为评估指标，评估投资组合与标的指数的跟踪误差、行业构成比例偏差、个股比例偏差和个股构成差异。本基金通过设定上述指标的最大允许值，对投资行为予以约束，以控制基金相对于比较基准的偏差。

本基金将“总体累积偏差”作为决定是否启动修正程序的监控指标，将“行业偏差”、“个股偏差”指标作为调整指标，以达到控制跟踪偏差的目的。

在具体的修正过程中，本基金将采用定量化分析模型，每日计算总体累积偏差指标，计算区间从组合修正日开始累积。如该指标超过允许的最大值，则基金管理人将通过控制行业偏差、个股偏差等指标，调整组合品种，缩减跟踪偏差。当总体累积偏差在允许的最大值以下时，原则上不调整组合。每修正一次组合，总体累积偏差指标将“归零”重新计算。

本基金的投资目标不是超越指数，而是取得与指数涨跌基本一致的收益。因此，评判本基金的表现，主要是看基金收益与标的指数收益的偏离度，偏离度越小，基金表现越好。而跟踪偏离度和跟踪误差是衡量基金收益与标的指数收益偏离度的重要指标。

2、其他金融工具投资策略

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于期限在一年期以内的政府债券、央行票据和政策性金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率、管理基金投资组合风险并更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。本基金投资于各种衍生工具的比例不超过基金资产净值的10%。

九、基金的业绩比较标准

本基金的标的指数为：上证社会责任指数。

本基金的业绩比较基准为：本基金标的指数。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告

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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自2011年1月1日起至9月30日止。

11.1 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

11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.2.1 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。

11.2.2 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日的中国证监会行业分类标准为依据。

11.3 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

11.3.1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

11.3.2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。

11.4 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。

11.5 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。

11.6 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。

11.7 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。

11.8 投资组合报告附注

11.8.1 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。

11.8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

11.8.3 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

11.8.4 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。

11.8.5.1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。

11.8.5.2 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。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2011年9月30日。

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。

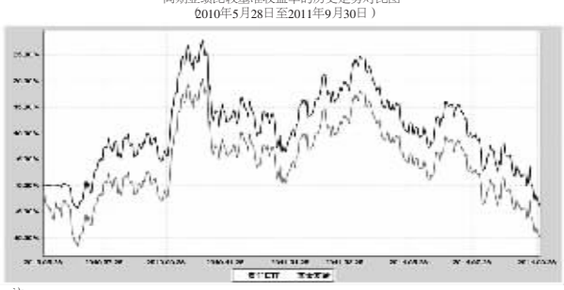
1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
2010年5月28日至2010年12月31日	12.14%	1.40%	5.92%	1.57%	6.22%	-0.17%
2011年1月1日至2011年9月30日	-14.47%	1.31%	-15.10%	1.32%	0.63%	-0.01%
自基金合同生效之日2010年5月28日至2011年9月30日	-4.08%	1.35%	-10.08%	1.44%	6.00%	-0.09%

2、自基金合同生效以来基金份额净值及其业绩比较基准的变动情况

建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2010年5月28日至2011年9月30日）



注：

1、本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

2、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

十三、基金的费用概提

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、“基金合同”生效后与基金相关的信息披露费用；
4、“基金合同”生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金上市费及年费；
6、基金收益分配中发生的费用；
7、基金份额持有人大会费用；
8、基金的证券交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、标的指数许可使用费；
11、按照国家有关规定和“基金合同”约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

①基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

②基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.1%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述（一）“基金费用的种类”中第3-11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

2、与基金销售有关的费用

申购、赎回的对价及费用

①申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

②申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。申购赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

③投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用