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

2012 第三季度 报告

2012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:二〇一二年十月二十六日

§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2012年10月24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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	建信责任
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	413,896,009.39份
投资目标	通过将绝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。
投资策略	本基金为上证社会责任ETF的联接基金,主要通过投资于上证社会责任ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证社会责任ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。
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混合基金、债券基金与货币市场基金。同时,本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及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

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年8月9日
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

2.1.2目标基金产品概况

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。

§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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-543,364.08
2.本期利润	-26,955,427.99
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0654
4.期末基金资产净值	360,088,506.98
5.期末基金份额净值	0.870

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。

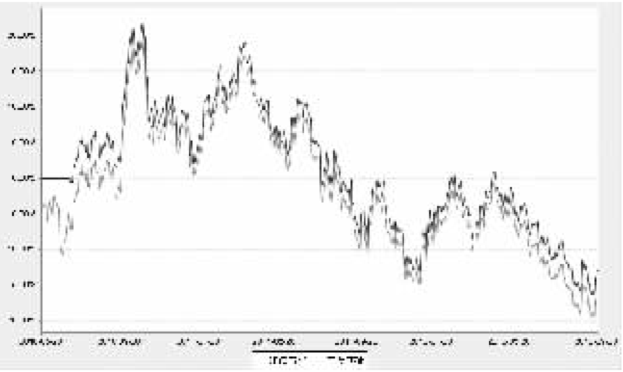
3.2 基金净值表现

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	-7.05%	1.08%	-7.53%	1.09%	0.48%	-0.01%

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

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
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2012年9月30日）



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		
叶乐天先生	本基金基金经理	2012-3-21	-	4	曾就职于中国国际金融有限公司,先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理,从事风险模型、量化研究与投资;2011年9月加入我公司,担任基金经理助理。2012年3月21日起任上证社会责任ETF及联接基金基金经理。

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,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《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对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 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。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

本基金绝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。此外,由于申赎造成的基金份额变动也会对本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偏离度均被控制在基金合同约定的范围内。

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-7.05%,波动率1.08%,业绩比较基准收益率-7.53%,波动率1.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在三季度,随着上市公司陆续发布半年报,经济的下滑态势得到进一步确认,市场情绪非常悲观,指数屡创新低。在三季度末,市场情绪略有回稳,同时市场对十八大“维稳”行情、经济触底反弹有所期待,预计四季度指数仍将维持振荡走势。

本基金管理人将根据基金合同规定,继续将不低于90%的基金资产投资于责任ETF,同时适当对所直接持有的股票组合进行优化,以控制跟踪误差及偏离度。

§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	11,093,391.61	3.07
	其中:股票	11,093,391.61	3.07
2	基金投资	330,943,500.00	91.69
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	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	18,651,722.79	5.17
7	其他各项资产	232,709.81	0.06
8	合计	360,921,324.21	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式指数基金	建信基金管理有限责任公司	330,943,500.00	91.91

5.3 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	-	-
B	采掘业	1,131,344.26	0.31
C	制造业	2,106,547.39	0.59
C0	食品、饮料	74,652.50	0.02
C1	纺织、服装、皮毛	64,248.80	0.02
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	135,007.27	0.04
C5	电子	114,843.62	0.03
C6	金属、非金属	255,748.71	0.07
C7	机械、设备、仪表	927,484.46	0.26
C8	医药、生物制品	534,562.03	0.15
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	65,152.08	0.02
E	建筑业	698,306.04	0.19
F	交通运输、仓储业	128,990.61	0.04
G	信息技术业	464,578.39	0.13
H	批发和零售贸易	361,467.22	0.10
I	金融、保险业	5,487,251.48	1.52
J	房地产业	585,895.00	0.16
K	社会服务业	63,859.14	0.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	11,093,391.61	3.08

注:以上行业分类以2012年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

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	601318	中国平安	21,656	908,252.64	0.25
2	600016	民生银行	146,104	825,487.60	0.23
3	600036	招商银行	80,038	813,186.08	0.23
4	601328	交通银行	152,376	649,121.76	0.18
5	601166	兴业银行	48,823	586,364.23	0.16
6	600000	浦发银行	72,381	534,171.78	0.15
7	600030	中信证券	44,580	525,598.20	0.15
8	601088	中国神华	21,339	491,010.39	0.14
9	601601	中国太保	20,293	410,527.39	0.11
10	600048	保利地产	27,710	298,159.60	0.08

5.5 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。

5.6 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.9.3 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	172,360.98
3	应收股利	8,614.47
4	应收利息	3,860.08
5	应收申购款	47,874.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	232,709.81

5.9.4 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。

5.9.5 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	408,911,961.26
本报告期基金总申购份额	14,035,235.00
减:本报告期基金总赎回份额	9,051,186.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	413,896,009.39

注:上述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上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金设立的文件;
2、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》;
3、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金招募说明书》;
4、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金托管协议》;
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
二〇一二年十月二十六日

建信货币市场基金

2012 第三季度 报告

2012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:二〇一二年十月二十六日

§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2012年10月24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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信货币
基金主代码	530002
交易代码	530002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月25日
报告期末基金份额总额	2,977,852,134.08份
投资目标	在力保本金安全和基金财产较高流动性的前提下,争取获得超过投资基准的收益率。
投资策略	综合运用定量分析和定性分析手段,全面评估货币市场的利率走势、类属资产和券种的风险收益水平及流动性特征,在此基础上制订本基金投资策略。具体而言,包括短期资金利率走势预测、组合剩余期限调整策略、债券期限配置策略、类属资产配置策略、品种选择策略和交易策略等方面。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为6个月银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种;预期收益和风险均低于债券基金、混合基金、股票基金。
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	34,078,592.39
2.本期利润	34,078,592.39
3.期末基金资产净值	2,977,852,134.08

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2基金净值表现

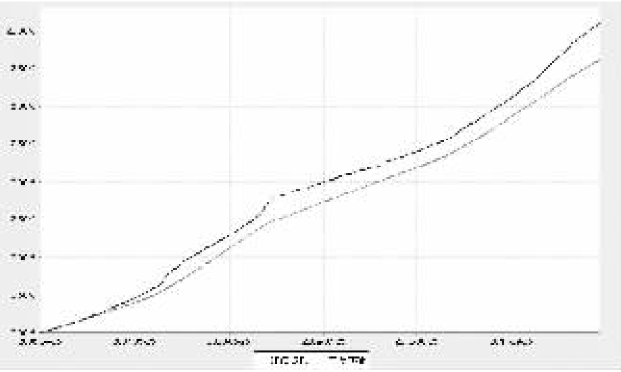
3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8504%	0.0057%	0.7216%	0.0002%	0.1288%	0.0055%

注:基金收益分配按日结转份额。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信货币市场基金
累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2006年4月25日至2012年9月30日）



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		
彭云峰	本基金基金经理	2012-2-17	-	7	硕士。曾任中经网数据有限公司财经分析师、国都证券有限责任公司债券研究员兼宏观研究员,2006年5月起就职于鹏华基金管理公司,历任债券研究员、社保组合投资经理、债券基金经理等职,2010年5月31日至2011年6月14日任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理。彭云峰于2011年6月加入我公司。2011年11月30日起任建信保本混合型证券投资基金的基金经理;2012年5月29日起任建信转债增强基金的基金经理。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,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《建信货币市场基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对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 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。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,我国经济增速仍然处于探底回落的过程,通胀水平总体回落,8月小幅回升。货币政策保持稳健。7月6日,央行年内第二次降低存贷款基准利率。之后,存贷款利率和存款准备金率均未再次调整。6月底开始,央行主要通过在公开市场进行短期逆回购操作对流动性进行管理。

由于对货币政策进一步放松的预期落空,以及国内外潜在的通胀压力上升,同时债券供应量增加较多,因而三季度债市持续调整,各类别、各期限债券收益率均大幅上升。9月中下旬,由于三季度末以及国庆长假的时点因素,资金面相对紧张。

基于债市可能持续调整的判断,本基金在三季度降低了组合平均剩余期限,减持了部分较长期限的短期债券,少量投资较短期限的短期信用债券,主要投资对象为短期逆回购和短期存款。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值收益率0.8504%,波动率0.0057%,业绩比较基准收益率0.7216%,波动率0.0002%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为中国经济增速可能触底回升,但回升幅度不大,通胀水平可能小幅上行,但仍较温和。货币政策仍将保持稳健。除非中国经济增速大幅下行,或者国际经济形势恶化,否则央行可能仍将主要通过公开市场操作调整流动性,利率调整的可能性不大。如果外汇占款持续下降,4季度央行可能会小幅下调存款准备金率。四季度资金面可能前松后紧,总体中性偏紧,而短期债券收益率可能先降后升,波动幅度不大。

四季度本基金仍将审慎投资,灵活调整。具体而言,本基金将更加注重对流动性的管理,将组合剩余期限保持在相对较低的水平,严格控制短期信用债券的投资比例,增加对短期逆回购和短期存款的投资。我们将根据货币市场资金利率和经济形势的变化,积极主动对组合进行调整,在确保组合流动性的基础上,争取获得更多的投资收益。

§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	固定收益投资	1,774,236,321.97	59.53
	其中:债券	1,774,236,321.97	59.53
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	249,281,053.92	8.36
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	911,954,535.18	30.60
4	其他各项资产	44,886,341.17	1.51
5	合计	2,980,358,252.24	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.64	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	161
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	76

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	33.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.01	-
2	30天(含)—60天	12.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	18.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.37	-
4	90天(含)—180天	5.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	28.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.58	-

5.4报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	491,140,600.84	16.49
	其中:政策性金融债	491,140,600.84	16.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,182,870,069.37	39.72
6	中期票据	100,225,651.76	3.37
7	其他	-	-
8	合计	1,774,236,321.97	59.58
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	189,974,388.20	6.38

5.5报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	120218	12国开18	3,000,000	301,166,212.64	10.11
2	110212	11国开12	1,300,000	129,781,313.20	4.36
3	041261013	12津城建CP001	1,200,000	119,966,226.95	4.03
4	041154018	11甘公投CP001	800,000	80,132,322.11	2.69
5	041164008	11青国投CP002	700,000	70,198,357.62	2.36
6	041258029	12三花CP001	600,000	60,214,873.83	2.02
7	0982145	09浙交投MTN3	600,000	60,032,645.79	2.02
8	041260024	12湘高速CP001	600,000	59,891,017.15	2.01
9	041153005	11永辉CP001	500,000	50,239,931.87	1.69
10	041153011	11新奥CP001	400,000	40,336,908.56	1.35

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	6次
报告期内偏离度的最高值	0.26%
报告期内偏离度的最低值	0.06%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.16%

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投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3基金投资的前十名债券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	50,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	44,668,441.17
4	应收申购款	167,900.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	44,886,341.17

§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	3,836,376,919.71
本报告期基金总申购份额	5,393,487,943.04
减:本报告期基金总赎回份额	6,252,012,728.67
本报告期期末基金份额总额	2,977,852,134.08

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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货币市场基金设立的文件;
2、《建信货币市场基金基金合同》;
3、《建信货币市场基金招募说明书》;
4、《建信货币市场基金托管协议》;
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
二〇一二年十月二十六日

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:二〇一二年十月二十六日

§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2012年10月24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2012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
基金合同生效日	2010年5月28日
报告期末基金份额总额	455,581,114.00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	本基金属于股票指数型基金,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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	1,098,576.28
2.本期利润	-26,923,073.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0598
4.期末基金资产净值	342,914,249.04
5.期末基金份额净值	0.753

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。

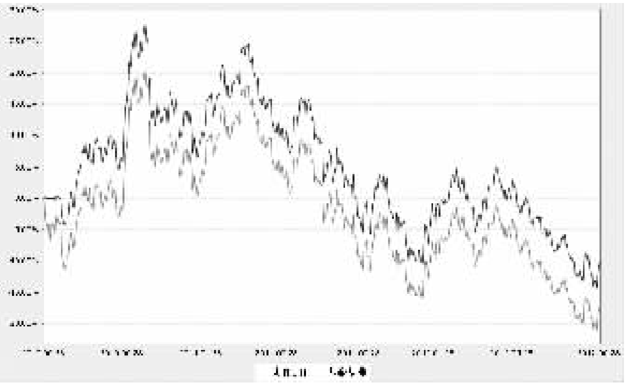
3.2 基金净值表现

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	-7.38%	1.14%	-7.93%	1.15%	0.55%	-0.01%

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2012年9月30日）



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		
叶乐天先生	本基金基金经理	2012-3-21	-	4	曾就职于中国国际金融有限公司,先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理,从事风险模型、量化研究与投资;2011年9月加入我公司,担任基金经理助理。2012年3月21日起任上证社会责任ETF及联接基金基金经理。

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,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 管理人对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 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。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净值保留位数有限造成的舍入误差以及所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。权重结构上的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。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值增长率-7.38%,波动率 1.14%,业绩比较基准收益率-7.93%,波动率1.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在三季度,随着上市公司陆续发布半年报,经济的下滑态势得到进一步确认,市场情绪非常悲观,指数屡创新低。在三季度末,市场情绪略有回稳,同时市场对十八大“维稳”行情、经济触底反弹有所期待,预计四季度指数仍将维持振荡走势。

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	341,488,338.48	99.35
	其中:股票	341,488,338.48	99.35
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	2,035,610.73	0.59
6	其他各项资产	209,004.71	0.06
7	合计	343,732,953.92	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	34,831,851.69	10.16
C	制造业	64,842,385.14	18.91
C0	食品、饮料	2,261,155.00	0.66
C1	纺织、服装、皮毛	1,980,664.45	0.58
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,167,131.10	1.22
C5	电子	3,533,337.26	1.03
C6	金属、非金属	7,939,441.98	2.32
C7	机械、设备、仪表	28,547,584.37	8.32
C8	医药、生物制品	16,413,070.98	4.79
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,000,196.12	0.58
E	建筑业	21,488,358.66	6.27
F	交通运输、仓储业	3,962,868.20	1.16
G	信息技术业	14,265,636.77	4.16
H	批发和零售贸易	11,149,072.18	3.25
I	金融、保险业	168,924,368.65	49.26
J	房地产业	18,073,328.28	5.27
K	社会服务业	1,950,267.03	0.57
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	341,488,332.72	99.58

注:1、合计项不含可退替代款估值增值。

2、以上行业分类以2012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	601318	中国平安	666,793	27,965,298.42	8.16
2	600016	民生银行	4,497,553	25,411,174.45	7.41
3	600036	招商银行	2,461,964	25,013,554.24	7.29
4	601328	交通银行	4,689,068	19,975,429.68	5.83
5	601166	兴业银行	1,503,688	18,059,292.88	5.27
6	600000	浦发银行	2,228,661	16,447,518.18	4.80
7	600030	中信证券	1,371,027	16,164,408.33	4.71
8	601088	中国神华	656,476	15,105,512.76	4.41
9	601601	中国太保	625,900	12,661,957.00	3.69
10	600048	保利地产	852,460	9,172,469.60	2.67

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	-
3	应收股利	208,593.77
4	应收利息	410.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209,004.71

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	450,081,114.00
本报告期基金总申购份额	7,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	1,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	455,581,114.00

§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
二〇一二年十月二十六日