基金管理人:建信基金管理有限责任公司

# 建信全球机遇股票型证券投资基金

### 2013 第一季度 报告

| 基金托管人:中<br>报告送出日期            |                             |                                 |                 |                 |                  |                      |                       |                              |                              |
|------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|-----------------|-----------------|------------------|----------------------|-----------------------|------------------------------|------------------------------|
| ++ Addomi LAh                | strate A. Ta.               | doubr/tolon-                    | k-40174- s      |                 | § 1 重要提示         |                      |                       | 大遗漏,并对其内                     | n ode Africate retrokalo - M |
| 生和完整性承担个                     |                             |                                 | 四尺百/            | 71360,000,474   | N1F1±ME1bx1G3    | EX.                  | 天守汪附沚以里               | 八退廟, 井刈共化                    | 1合的具大性、作                     |
| 基金托管人中<br>现和投资组合报告<br>基金管理人承 | 国工商银行等内容,保<br>诺以诚实付<br>绩并不代 | 了股份有限<br>证复核内<br>言用、勤勉<br>長其未来? | 容不存尽责的          | 在虚假记原则管理        | 载、误导性陈远和运用基金资    | <sup>太</sup> 或<br>产, | 者重大遗漏。<br>但不保证基金-     | 夏核了本报告中的<br>-定盈利。<br>细阅读本基金的 |                              |
| 本报告期自 20                     |                             |                                 | 3月31            | 日止。             | · 基金产品概          | 识                    |                       |                              |                              |
| 基金简称                         |                             | 建信全球                            | 机遇股             | 票 (QDII )       |                  | 4,70                 |                       |                              |                              |
| 基金主代码                        |                             | 539001                          |                 |                 |                  |                      |                       |                              |                              |
| 交易代码                         |                             | 539001                          |                 |                 |                  |                      |                       |                              |                              |
| 基金运作方式                       |                             | 契约型开                            | 放式              |                 |                  |                      |                       |                              |                              |
| 基金合同生效日                      |                             | 2010年9                          | 月14日            | 3               |                  |                      |                       |                              |                              |
| 报告期末基金份额                     | <b>瓦总额</b>                  | 264,515,0                       | 71.69 (         | i)              |                  |                      |                       |                              |                              |
| 投资目标                         |                             | 本基金通<br>增值。                     | 过全球             | 化的资产            | 配置和组合管           | 理,                   | 在分散和控制的               | 是资风险的同时追                     | 家基金资产长                       |
| 投资策略                         |                             | 结合、组合                           | >构建             | 与风险控制           | 训相结合的投资          | <b>会第</b>            | 18略进行投资组合             |                              |                              |
| 业绩比较基准 标准普尔全球 I 股 指数总收益      |                             |                                 |                 | ¥ 6&P B!        | MI China ex-A    | -B-                  | Shares >30%           |                              |                              |
| 风险收益特征                       |                             |                                 |                 | 殳资品种。           |                  | 益启                   | 于货币基金、债               | 券基金和混合型                      | 基金,属于较高/                     |
| 基金管理人                        |                             |                                 |                 | 限责任公            |                  |                      |                       |                              |                              |
| 基金托管人                        |                             |                                 |                 | 2份有限公司          |                  |                      |                       |                              |                              |
| 境外投资顾问英文                     |                             |                                 |                 | Investors. LLC. |                  |                      |                       |                              |                              |
| 境外投资顾问中文                     |                             | 信安环球                            |                 |                 |                  |                      |                       |                              |                              |
| 境外资产托管人类                     |                             |                                 |                 | Iarriman &      | Co.              |                      |                       |                              |                              |
| 境外资产托管人中                     | 立名称                         | 布朗兄弟                            |                 |                 |                  |                      |                       |                              |                              |
| 3.1 主要财务打                    | 旨标                          |                                 | §               | 3 主要原           | 财务指标和基:          | 金净                   | 值表现                   |                              | ***                          |
| 主要财务指标                       |                             |                                 |                 | 报告期(2           | 013年1月1          | H-:                  | 2013年3月31             | ∃)                           | 单位:人民币                       |
| 1.本期已实现收益                    | :                           |                                 |                 | 6,156,730       | 0.88             |                      |                       |                              |                              |
| 2.本期利润                       |                             |                                 |                 | 9.245,954       |                  |                      |                       |                              |                              |
| 3.加权平均基金份                    | NOT A PRINT                 | 202                             |                 | ., .,.          | 174              |                      |                       |                              |                              |
|                              |                             | 門                               |                 | 0.0337          |                  |                      |                       |                              |                              |
| 4.期末基金资产净                    | 値                           |                                 |                 | 248,418,8       | 346.88           |                      |                       |                              |                              |
| 5.期末基金份额净                    | 値                           |                                 |                 | 0.939           |                  |                      |                       |                              |                              |
| 朝利润为本期已实:                    | 现收益加.<br>绩指标不信<br>長现        | 上本期公分<br>包括持有力                  | で价值?<br>し认购?    | 变动损益。<br>战交易基金  | 论的各项费用,          | 计                    | 人费用后实际收               | 协损益)扣除相关<br>益水平要低于所          |                              |
| 阶段                           | 净值均                         | 自<br>(率①                        | 准差              | 曾长率标            | 业绩比较基/<br>收益率(3) | 隹                    | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③                          | 2-4                          |
| 过去三个月                        |                             | 3.64%                           |                 | 0.62%           | 3.79             | 9%                   | 0.65%                 | -0.159                       | -0.03                        |
| 3.2.2 自基金台                   |                             |                                 | 海值 <sup>均</sup> | 性信全球が<br>対大率与』  | 1.遇股票型证券         | 学投<br>女益             | 资基金<br>率的历史走势对        | 收益率变动的比较<br>比图               | Ž                            |
|                              | · A                         | ALCO                            | " Si            | JV,             |                  |                      |                       | 11/1                         |                              |

|              |         |  |               | 11               | 1 1  | Art of the second   |  |  |  |
|--------------|---------|--|---------------|------------------|--|---|--|--|--|
|              |         |  |               | 15.0             | Co   | April 1   |  |  |  |
|              | 72.     |  |               |                  | ,<br>,, ,,   | ., ., ., .,   |  |  |  |
| 2、本报告        | 与期,本基   | 比较基准计<br>;金的投资组<br>;基金经理小  | 1合比例符         | F合基金合同的要         | 求。<br>管理人报告  |   |  |  |  |
| Tall da      | 7077 da | 任本基  | 金的基金          | 於理期限             | have the little decimal  | NAME  |  |  |  |
| 姓名           | 职务      | 任期   | 只日期           | 离任日期             | 证券从业年限   | 说明  |  |  |  |
| 赵英楷先生        |         |  | 4–20          | -                | 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、高级证券公司研究员、高级证券公司研究员、美林证券公司研究员、政策组给金额的分师师、美国司罗亚投资公司基金宏理,2010年3月加入建信基金管理和模模性公司、几年临券投资部、执行总监(住特工作)总监。2011年6月21日起任建信部关时场优惠处理型企场投资基金基金宏型;2012年6月26日起任建信全球资惠金的基金宏型。   |  |  |  |
|              | 投资顾问    | 可为本基金拉<br>境外投资顾  | 是供投资的<br>证券从』 | <b>並</b> 议的主要成员简 | i介   |   |  |  |  |
| 姓名           | 同月      | 現力的又页iiii<br>折任职务  | 年限            | 说明               |  |   |  |  |  |
| Mustafa Sagu | n 首)    | Mustafa Sagan   全球股票報給<br>全球股票報給付主警<br>2000 年加入公<br>首席投资官   22 金融服务 Mustafa 从 Unii<br>学位。他从土 |               |                  | 的投资组合管理。<br>投资经理。他之间<br>,并且有超过<br>的副总裁和分析<br>versity of South Flo<br>于耳其的 Bogazic<br>使用特许金融分 | 的首席投資官。他负责监督所有国际。国内和<br>即研究,Mustla 从 2002 年升始鐵程任全球股<br>前也担任公司资产配置策略团队的成员。他<br>均 年投資和以股管理整稳。之前,他是 PNC<br>"前利 Jalomon Brothers 的股票价值给专家",<br>500亩取得金融等"Ph.D.争位从国际经济等",<br>500亩取得金融等"Ph.D.争位从国际经济等",<br>400亩和 以中省。在 Ph.D.专业与 Ph.D.专业与<br>有一种称号的权利。他是 CFA Institute 和 CFA |  |  |  |
|              |         |  |               | Christophar Iba  | ch 负责监督支持  | 所有股票策略的全球研究 & 发展, 句括全球  |  |  |  |

| 姓名                | 在境外投资顾<br>问所任职务 | 证券从业<br>年限 | 说明  |
|-------------------|-----------------|------------|---|
| Mustafa Sagun     | 首席投资官           | 22         | Mustafa Sagan 是信贷环以股票的首席投资官。他负责监督所有国际、国际、<br>支税股票等部份投资组合管理所证。<br>新国人、2000 年加入公司,并且有证10 年 电交流电路等理系统。<br>第组合的主管投资经理,他之前也担任公司资产配置资源的形成的成员。<br>企业能服务基础的制度是保护并带和 Salomon Brothers 的股票价主品专业<br>等位。他从上下其前 Bepariet University 取得电子和工程的学士学位、<br>Mustafa 获得了使用特许金融分析研察等的权利。他是 CFA Institute 和 CF.<br>Society of Iowa 例如例。          |
| Christopher Ibach | 投资组合经理          | 19         | Christopher Baach 负责监督支持所有股票领称的全球研究 & 发展,包括左<br>提供所实,股票选择模型度,根投资自会的基础。<br>起价并及,股票选择模型度,根投资自会的基础。<br>会长策略团队。负责被动增强和被动战器,是一位在2000年代为股票研<br>分析师加入公司。专精于分析国际科技公司并在2002年成为投资组合。<br>。在此之间。在first 在Motodo, In。取得了各种相关行业经验。Chris<br>记的verity of Iowa 获得了金融学 MBA 学位和电子工程学士学位。 Chris<br>得了使用辩告之题分析而称号的发射并是是 CFA Institute 的成员       |
| 王睒                | 投资组合经理          | 13         | 上職在信安担任香港和中国股資割合的基金处理,他也是农们的高级投价师和九中年区研究团队员办、三吨的金融职业生涯开始于中国银金行,担任财务总监执行即理配过3年时间,也为该行100 和第二年提供,主领在2003年加入信空,任任香港和中国股票市场的资本总划,工程2003年加入信空,任任香港和中国股票市场的资本总划,工程2003年加入1000年2003年2003年2003年2003年2003年2003年2003年   |
| 李晓西               | 投资组合经理          | 14         | 幸與西田任支持兩有股票藥館的組化研究负责人。他的研究即賽包括为<br>可考關命金雅於平台(GRP 股票选择模型)投资组合被建和风险管理进<br>全球股票量化研究并实流轉模型开发。他也担任全球核心。全球金部間家、<br>线相遇、全球份值。收入和证安专了的冷球组合的共调组合分更,除西<br>2006年加入公司。此前。城門是 Hantang Securities Co., Ld., Bejing 的政政<br>應。他的经历公园样 Yinjian Hustarid Co., Ld., Bejing 的投资组合经理。<br>从社京大学获得 MBA 学位、从北京汇商大学获得会计学商士学位并从对<br>经济贸易大学获得会计学和分量。 |

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 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《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》

| 新兴市场经历了去年下半年的大幅上涨后,本季度略有回调。总体而言,新兴市场经历了前期较大幅度上涨之后,市场   |
|--|
| 面临调整压力,另外新兴市场主要国家经济增长放缓,日元贬值对台湾和韩国出口带来冲击,中国的宏观调控政策等也对整体市场造成压力。首先巴西和印度通胀较高,限制市场上涨幅度,其次巴西、印度、俄罗斯均出现了不同程度回落,几个国家  |
| 的工业生产数据均偏弱,工业 PMI 有所起伏,零售偏中性,失业率偏正面;另外近期中国的主要经济指标,如固定资产投资、   |
| 工业生产、工业 PMI,零售等数据均显示经济呈弱复苏状态,而中国地产和银行表外资产的调控超市场预期,投资人担心未来房地产销量、投资下滑、社会流动性由宽松转向中性将影响未来经济复苏的力度,投资人对未来中国经济复苏力度的担心 |
| 既影响了中国市场,也对全球大宗商品市场产生压力,俄罗斯、巴西等与大宗商品相关度较高的市场也因此受到影响。最后,  |
| 韩国和台湾对出口依赖较大,日元大幅贬值极大地增强了短期日本出口产品的价格竞争力,对韩国、台湾的出口和股票市场都形成了压力。  |
| 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3.64%,波动率0.62%,业绩比较基准收益率3.79%,波动率0.65%。  |

| 1 权益投资           |                  |                              | 215,820,       | 660.52        | 82.59            |  |
|------------------|------------------|------------------------------|----------------|---------------|------------------|--|
|                  | 其中:普通股           |                              | 207,464,       | 808.73        | 79.39            |  |
|                  | 存托凭证             |                              | 8,355,85       | 1.79          | 3.20             |  |
|                  | 优先股              |                              | -              |               | -                |  |
|                  | 房地产信托            |                              | -              |               | -                |  |
|                  | 基金投资             |                              | 18,779,9       | 00.46         | 7.19             |  |
|                  | 固定收益投资           |                              | -              |               | -                |  |
|                  | 其中:债券            |                              | -              |               | -                |  |
|                  | 资产支持证券           |                              | -              |               | -                |  |
|                  | 金融衍生品投资          |                              | -              |               | -                |  |
|                  | 其中:远期            |                              | -              |               | -                |  |
|                  | 期货               |                              | -              |               | -                |  |
|                  | 期权               |                              | -              |               | -                |  |
| 权证<br>5 买人返售金融资产 |                  |                              | -              |               | -                |  |
| 其中:买断式回购的买入返售    |                  |                              | -              |               | -                |  |
|                  |                  | 其中:买断式回购的买人返售金融资产            |                |               | -                |  |
|                  | 货币市场工具           |                              | -              |               | -                |  |
|                  | 银行存款和结算          | 备付金合计                        | 18,733,9       |               | 7.17             |  |
|                  | 其他各项资产           |                              | 7,972,96       |               | 3.05             |  |
|                  | 合计               |                              | 261,307,       | ,445.29       | 100.00           |  |
| 家   他区           | 古期本任各个国家(<br>[ ) | 地区)证券市场的股票及存托组<br>公允价值(人民币元) | 即投資分中          | 占基金资产         | ·净值比例 % )        |  |
| 港                |                  |                              | 80,057,094.42  |               | 32.2             |  |
| 围                |                  |                              | 80,380,983.21  |               | 32.36            |  |
| 本                |                  |                              | 15,712,583.20  |               | 6.3              |  |
| 王                |                  |                              | 12,877,743.92  |               | 5.13             |  |
| 王                |                  |                              | 8,620,021.32   |               | 3.4              |  |
| 国                |                  |                              | 5,116,621.83   |               | 2.00             |  |
| 拿大               |                  |                              | 6,567,108.65   |               | 2.64             |  |
| 典                |                  |                              | 3,166,679.64   | 1.2           |                  |  |
| 大利               |                  |                              | 2,249,509.57   |               | 0.9              |  |
| i±               |                  |                              | 1,072,314.76   |               | 0.4              |  |
| 5.3 报            | 告期末按行业分类的        | 的股票及存托凭证投资组合                 |                |               | and that he is a |  |
| 业类别              |                  | 公允价值(人民币元)                   |                | 占基金资产净值比例 % ) |                  |  |
| 源                |                  |                              | 25,075,514.64  |               | 10.09            |  |
| 融                |                  |                              | 63,492,648.53  |               | 25.50            |  |
| :健               | 44-11            |                              | 19,144,550.52  |               | 7.7              |  |
| 非必需消费品           |                  |                              | 17,629,757.05  |               | 7.10             |  |
| Z需消费品            |                  |                              | 14,145,083.01  |               | 5.69             |  |
| 业                |                  |                              | 19,609,602.61  |               | 7.89             |  |
| 自息技术             |                  |                              | 22,345,619.51  |               | 9.00             |  |
| 料                |                  |                              | 9,257,834.51   | 3.7           |                  |  |
| 信服务              |                  |                              | 12,593,453.51  |               | 5.0              |  |
| 用事业              |                  |                              | 12,526,596.63  |               | 5.0-             |  |
| rit              |                  |                              | 215.820.660.52 | 1             | 86.8             |  |

| 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  | 公司名称<br>(英文)                        | 公司名称 (中文)                | 证券代码         | 所在证<br>券市场  | 所属国家<br>他区) | 数量(段)     | 公允价值 (人<br>民币元) | 占基金资<br>产净值比<br>例 % ) |  |
| 1   | BANK OF CHINA<br>LTD-H              | 中国银行                     | CNE1000001Z5 | 香港证券交<br>易所 | 中国香港        | 3,774,000 | 10,971,969.05   | 4.42                  |  |
| 2   | CHINA MOBILE<br>LTD                 | 中国移动                     | HK0941009539 | 香港证券交<br>易所 | 中国香港        | 84,000    | 5,576,109.34    | 2.24                  |  |
| 3   | AGRICULTURAL<br>BANK OF CHINA-<br>H | 中国农业<br>银行               | CNE100000Q43 | 香港证券交<br>易所 | 中国香港        | 1,705,000 | 5,122,093.48    | 2.06                  |  |
| 1   | CHINA CITIC<br>BANK CORP LTD-<br>H  | 中信银行                     | CNE1000001Q4 | 香港证券交<br>易所 | 中国香港        | 1,346,000 | 5,065,369.77    | 2.04                  |  |
| 5   | TENCENT<br>HOLDINGS LTD             | 腾讯                       | KYG875721485 | 香港证券交<br>易所 | 中国香港        | 19,300    | 3,846,649.73    | 1.55                  |  |
| 5   | PETROCHINA CO<br>LTD-H              | 中国石油<br>天然气              | CNE1000003W8 | 香港证券交<br>易所 | 中国香港        | 418,000   | 3,436,404.17    | 1.38                  |  |
| 7   | CNOOC LTD                           | 中国海洋石油                   | HK0883013259 | 香港证券交<br>易所 | 中国香港        | 285,000   | 3,433,949.15    | 1.38                  |  |
| 3   | CHEVRON CORP                        | 雪佛龙德<br>士古               | US1667641005 | 纽约证券交<br>易所 | 美国          | 4,132     | 3,077,805.72    | 1.24                  |  |
| 9   | DISCOVER<br>FINANCIAL<br>SERVICES   | DISCOV-<br>ER 金融<br>服务公司 | US2547091080 | 纽约证券交<br>易所 | 美国          | 10,706    | 3,009,429.58    | 1.21                  |  |
| 10  | CLASS A                             | 康卡斯特                     | US20030N1019 | 纳斯达克交<br>易所 | 美国          | 11,346    | 2,988,042.72    | 1.20                  |  |

本报告期末未持有债券。 告期末救分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 本报告期末未持有债券。 本设定前班未不有有债券。 市里球袋公允约信止茶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 本设计制建大约有资产支持证券。 市场共和某役公允付自主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 本设计制基本共均有金融均生品投资, 市场共和某人共均有金融均产品投资, 市场共和某人共和,

| 序号                | 基金名称                                  | 基金类型  | 运作方式         | 管理人                             | 公元IIIII<br>(人民币元) | 白基金货产<br>净值比例(%) |
|-------------------|---------------------------------------|-------|--------------|---------------------------------|-------------------|------------------|
| 1                 | SPDR S&P 500<br>ETF TRUST             | ETF基金 | 交易型开放式<br>指数 | SSGA FUNDS<br>MANAGEMENT<br>INC | 10,599,079.99     | 4.27             |
| 2                 | ISHARES DOW<br>JONES US<br>INDEX FUND | ETF基金 | 交易型开放式<br>指数 | BLACKROCK<br>FUND<br>ADVISORS   | 8,180,820.47      | 3.29             |
| 5.10.1 本<br>责、处罚。 | 3组合报告附注<br>基金该报告期内拉                   |       |              |                                 | 和在报告编制日前一组        | 丰内受到公开           |

| 5.10 投资    | 组合报告附注                                  |                        |
|------------|---|------------------------|
| 5.10.1 本記  | 组合报告附注<br>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 |
| 臣 休罚.      |   |                        |
| 5.10.2 基金  | 。<br>投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。<br>也各项资产构成 |                        |
|            | 也各项资产构成                                 |                        |
| 序号         | 名称                                      | 金額(人民币元)               |
| 1          | 存出保证金                                   | -                      |
| 2          | 应收证券清算款                                 | 2,906,490.47           |
| 3          | 应收股利                                    | 407,452.38             |
| 4          | 应收利息                                    | 1,133.62               |
| 5          | 应收申购款                                   | 12,343.65              |
| 6          | 其他应收款                                   | -                      |
| 7          | 待摊费用                                    | -                      |
| 8          | 其他                                      | 4,645,544.76           |
| 9          | 合计                                      | 7,972,964.88           |
| 5 10 4 352 | - 期本技有的体干结股期的可转换债券阻如                    |                        |

| § 6 开放式基金份额变动              |                |  |  |
|----------------------------|----------------|--|--|
| - 0 7130-00000 13 10 20 43 | 单位:份           |  |  |
| 本报告期期初基金份额总额               | 284,626,066.31 |  |  |
| 本报告期基金总申购份额                | 531,477.82     |  |  |
| 减:本报告期基金总赎回份额              | 20,642,472.44  |  |  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              |  |  |
| 本报告期期末基金份额总额               | 264,515,071.69 |  |  |

§ 7 备查文件目录 87 备查文件目录 1.中国证监会批准键信合球机遇股票型证券投资基金放立的文件; 2.(建信会软机遇股票型证券投资基金基金合同); 3.(建信会软机遇股票型证券投资基金相募说明书); 4.(建信会软机遇股票型证券投资基金相募说明书); 5.基金管理人业务资格批件和谐业块积; 6.基金任营人业务资格批件和谐业块积; 6.基金任营人业务资格批件和谐业块积;

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

# 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

### 2013 第一季度 报告

### 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:二〇一三年四月十九日

业绩比较基本 险收益特征

\$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

海盗百選人的馬平安及馬甲條此平原在可報政科不仔任康康以釋、民守住地於近風上人國輔, 并內共內容的與失任, 信朝 印影整使我因外別是帶潛任。 基金任管人中国工商維持股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2013 年 4 月17 日复核了本报告中的财务指标, 净值表 和投资组合报告等内容, 保证更极收客不存在虚假记载, 误寻性除处或者重大遗漏。 基金管理人承诺以诚实信用,勤勉尽贵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。 本报告申财务资料未经审计。 本报告申财务资料未经审计。 本报告申财务资料未经审计。

| 平板古朔日 2013 平 1 月 1 日起 |   |
|-----------------------|---|
| 2.1 基金产品概况            | § 2 基金产品概况  |
| 023000 300100-0       | Talk file that for  |
| 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            | 403,070,520.97 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 的既接基金。主要通过投资于上证社会责任 ETF 以<br>实达到投资目标。当本基金申银顺即和在二级市场买土证社会责任 ETF 或本<br>基金自身的申羁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<br>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<br>进行适当调整、降低弱等误差。 |
| 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 注权 重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及 註权重   |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标

|                     | 平位:八尺川九                             |
|---------------------|-------------------------------------|
| 要财务指标               | 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)           |
| 本期已实现收益             | 223,440.23                          |
| 本期利润                | -10,162,620.29                      |
| 加权平均基金份额本期利润        | -0.0251                             |
| 期末基金资产净值            | 397,631,146.71                      |
| 期末基金份额净值            | 0.987                               |
| 注:1、本期已实现收益指基金本期利息收 | 人、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 |
|                     |                                     |

|   | 阶段  | 净值增长率① | 净值增长率标<br>准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | 1)-3)  | 2-4    |  |  |
|---|---|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|--|--|
| Г | 过去三个月   | -2.57% | 1.83%         | -2.42%         | 1.84%                 | -0.15% | -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                      |        |               |                |                       |        |        |  |  |

NWY 2007 200"

| 在:中区内约,中签述的区页组合记例行合签並自用的安小。 |                      |           |                |                   |  |  |  |  |  |
|-----------------------------|----------------------|-----------|----------------|-------------------|--|--|--|--|--|
| 4.1 廿合织1                    | 11(或基金经理小            |           | 1 管理人报告        |                   |  |  |  |  |  |
| 4.1 ZESZEZEZ                | E ( BX/3ES3ESE/E/1/5 |           | tor one theory |                   |  |  |  |  |  |
| 姓名                          | 职务                   | 任本基金的基金   | 於性期限           | 证券从业年限            | 说明   |  |  |  |  |
| XEA                         | H/1.75               | 任职日期      | 离任日期           | III.9779CHE-T-PIK | 0097   |  |  |  |  |
| 叶乐天先生                       | 本基金基金经理              | 2012–3–21 | 1              | 5                 | 管線即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,从审风险 機要、量化研究与投资;2011年9月加入及公司,担任基金经理助理。2012年3月21日起任上部社会责任ETF及联接基金基金经理。2013年3月28日起任处规财经50指数基金基金经理。 |  |  |  |  |

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

4.2 旨证外公司。例外不確認出行經濟。目前仍認到 本报告期的、基金管理人不存在網售基金的網持有人科益的行为。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 经基金基金信间的规定。 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 4.31 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轮割指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《益金管理公司特定委 上》、《证券投资基金管理公司内部轮割指导意见》,等风险管险制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易管理办法》、《公司防范的集交易管理办法》、《科益冲突管理办法》等风险和公司的部制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金侧时买卖同一证券时,系统自动的接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发绀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 本报告期内未进则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56的情况。本报告期,实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债表现设明 4.4.1 报告期内基金的投资策略和业债表现设明 4.4.1 报告期内基金的投资策略和业债表现设明 4.4.1 报告期内基金的投资策略和业债表现设明 本基金他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,由于申联遗应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-2.57%,波动率 1.83%,业绩比较基准收益率-2.42%,波动率 1.84%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势局高限程 2013 年年初,市场经线表中 12 月的涨势被投票则,从春节后,市场纠结于经济是否复苏以及对政策的猜测中,陷人震荡 行情。3 月份房地产地还政策和"8号文"的出台严重打击了市场对经济复苏的期待,市场重现调整观望情绪。预计二季度这种情绪仍将延续,并根限最新的经济数据有所调整 本基金管理人将根据基金信周规定、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、以控制限路误差及偏离度。

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 字号 | 项目   | 金額 (元)         | 占基金总资产的比例 %) |
|----|--|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资                                       | 3,772,099.20   | 0.94         |
|    | 其中:股票                                      | 3,772,099.20   | 0.94         |
| 2  | 基金投资                                       | 369,800,000.00 | 92.54        |
| 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  | 买人返售金融资产                                   | _              | -            |
|    | 其中:买断式回购的买入返售金融资<br>产                      | -              | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计                               | 21,729,223.12  | 5.44         |
| 7  | 其他各项资产                                     | 4,290,098.47   | 1.07         |
| 8  | 合计   | 399,591,420.79 | 100.00       |
| 4  | In the litt No. on 100 this A. on 100 tons |                |              |

|            | 5.2 男                | 日本投資日初                       | F基金明     | 月細              |                |                  |                |                  |
|------------|----------------------|------------------------------|----------|-----------------|----------------|------------------|----------------|------------------|
|            | 序号                   | 基金名                          | 称        | 基金类型            | 运作<br>方式       | 管理人              | 公允价值 (元 )      | 占基金资产<br>净值比例 %) |
|            | 1                    | 建信上证社<br>任交易型开<br>指数证券报<br>金 | 于放式      | 股票型             | 交易型开放<br>式指数基金 | 建信基金管理<br>有限责任公司 | 369,800,000.00 | 93.00            |
|            | 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<br>%) |                |                  |                |                  |
| A 农、林、牧、渔业 |                      |                              |          | -               | -              |                  |                |                  |

| 代码 | 行业类别                      | 公允价值 (元)     | 占基金资产净值比例<br>%) |  |
|----|---------------------------|--------------|-----------------|--|
| A  | 农、林、牧、渔业                  | -            | -               |  |
| В  | 采矿业                       | 310,134.46   | 0.08            |  |
| С  | 制造业                       | 778,984.05   | 0.20            |  |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业          | 26,337.60    | 0.01            |  |
| E  | 建筑业                       | 228,533.24   | 0.06            |  |
| F  | 批发和零售业                    | 141,902.33   | 0.04            |  |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业               | 47,168.77    | 0.01            |  |
| H  | 住宿和餐饮业                    | -            | -               |  |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业           | 84,063.57    | 0.02            |  |
| J  | 金融业                       | 1,935,208.74 | 0.49            |  |
| K  | 房地产业                      | 206,726.64   | 0.05            |  |
| L  | 租赁和商务服务业                  | 13,039.80    | 0.00            |  |
| M  | 科学研究和技术服务业                | -            | -               |  |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业             | -            | -               |  |
| 0  | 居民服务、修理和其他服务业             | -            | -               |  |
| P  | 教育                        | -            | -               |  |
| Q  | 卫生和社会工作                   | -            | -               |  |
| R  | 文化、体育和娱乐业                 | -            | -               |  |
| S  | 综合                        | -            | -               |  |
|    | 合计                        | 3,772,099.20 | 0.95            |  |
|    | 以 2013 年 3 月 31 日的中国证监会行业 |              | •               |  |

| 5.4 10 | 石州木仅公儿川且白 | 基並页厂   伊且   比   別 人 | 小肝片的削工石取赤纹如 | (19/1/20)  |                 |
|--------|-----------|---------------------|-------------|------------|-----------------|
| 序号     | 股票代码      | 股票名称                | 数量 般)       | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例<br>%) |
| 1      | 600036    | 招商银行                | 27,600      | 348,588.00 | 0.09            |
| 2      | 600016    | 民生银行                | 29,568      | 285,035.52 | 0.07            |
| 3      | 601318    | 中国平安                | 6,613       | 276,225.01 | 0.07            |
| 4      | 601166    | 兴业银行                | 14,868      | 257,216.40 | 0.06            |
| 5      | 600000    | 浦发银行                | 21,851      | 221,350.63 | 0.06            |
| 6      | 601328    | 交通银行                | 38,289      | 180,341.19 | 0.05            |
| 7      | 600030    | 中信证券                | 13,415      | 163,260.55 | 0.04            |
| 8      | 601088    | 中国神华                | 6,417       | 139,762.26 | 0.04            |
| 9      | 601601    | 中国太保                | 6,114       | 111,825.06 | 0.03            |
| 10     | 601668    | 中国建筑                | 29,234      | 98,518.58  | 0.02            |
| 55 振   | 告期末按债券品种分 | 类的债券投资组合            | <u> </u>    |            |                 |

5.5 报告期未按债务品种分类的债券投资组合 本基金本报告期未未持有债券。 各。报告期未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 本基金本报告期未未持有债券。 5.7 报告期未死处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 本基金本报告期未未持有资产支持证券。 5.8 报告期未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 本基金和报告期未未决有较严少值比例大小排名的前五名权证投资明细 本基金和程告期未未决会投资的股指则货交易情况说明 本基金和程告期未未被会投资的股指则货交易情况说明 本基金和报告期未未投资股报期货。 5.10 投资组合报告附注 5.10.1 投资组合报告附注 5.10.1 本基金被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处罚。

| 字号 | 名称      | 金额 (元 )      |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 16,471.33    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 4,958.37     |
| 5  | 应收申购款   | 4,268,668.77 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    |              |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,290,098.47 |

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

| 本报告期期初基金份额总额                 | 410,150,883.25 |  |  |  |  |
|------------------------------|----------------|--|--|--|--|
| 本报告期基金总申购份额                  | 60,931,036.45  |  |  |  |  |
| 减:本报告期基金总赎回份额                | 68,011,398.73  |  |  |  |  |
| 本报告期基金拆分变动份额                 | -              |  |  |  |  |
| 本报告期期末基金份额总额                 | 403,070,520.97 |  |  |  |  |
| 注:上述总申购份额含转换人份额,总赎回份额含转换出份额。 |                |  |  |  |  |
| § 7 备查文件目录                   |                |  |  |  |  |

7.1 审查 2.4 Te 3.4 Te 3

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;

7. 报告期内基金管理人在指定报刊上被露的各项公告。

基金管理人或基金托管人处。

恭要百年八、以孫並行日八旦。 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

13,675,008.6

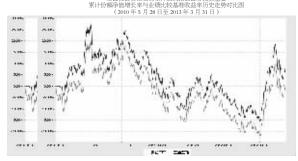
集金管理人的董事を及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和意整性不担个别及告带责任 基金性等人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标。净值表现比较、设导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人不诺以该定任用,勤险是帮助照管理和证用基金资产。但不使证基金产定码,基金的过往业绩非不代表其未来表现。投资有风险、投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 本招生的财务资料未经时,

|            | § 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 | 442,581,114.00 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般<br>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<br>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、<br>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<br>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  |

| 3.1 主要财务指标                                      | 主要财务指标和基金净值表现   |
|---|---|
| 3.1 土安则 夯指怀                                     | 单位:人民币元   |
| 主要财务指标  | 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)   |
| 1.本期已实现收益                                       | -816,622.10   |
| 2.本期利润  | -10,148,928.55  |
| 3.加权平均基金份额本期利润                                  | -0.0228   |
| 4.期末基金资产净值                                      | 380,681,544.42  |
| 5.期末基金份额净值                                      | 0.860   |
| 注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、<br>期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动机 | を<br>・<br>・<br>・<br>・<br>は<br>・<br>・<br>は<br>・<br>・<br>は<br>・<br>・<br>は<br>・<br>は<br>・<br>は<br>・<br>に<br>も<br>ら<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>も<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>に<br>る<br>る<br>る<br>に<br>る<br>る<br>る<br>に<br>る<br>る<br>る<br>る<br>る<br>る<br>る<br>る<br>る<br>る<br>る<br>る<br>る |

铜两为本期已来现收益加上本别公允的值要动物益。 2.所述基金谢特斯不包括持有人以确或交易基金的各项费用.计人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 基金净值表现。

| 阶段   | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率3 | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | 1)-(3) | 2-4    |
|--|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月  | -2.71%     | 1.93%         | -2.60%         | 1.94%                 | -0.11% | -0.01% |
| 3.22 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变功及其与同期业绩性较基神收益率变功的比较<br>上班社会费任交易更开放式转数正等较变量,<br>发现的企业,<br>第1计份额价值增长率与业绩比较基相收益率页电走势对比图<br>(2010年5月28日至2013年5月3日日) |            |               |                |                       |        |        |
| ILUE- ILUE-  |            |               |                |                       |        |        |



# 上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

2013年3月31日

占基金资产净值比例 %)

2.252.540.84 1,258.82

30,176,900.0

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。

全态或全级后列水不过时间芬。 56 报告期末校公允价值占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。

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。

5.9.1 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、 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。

| 序号 | 名称      | 金額 (元 )  |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 783.37   |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | 475.45   |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 待摊费用    | -        |
| 8  | 其他      | -        |
| 9  | 合计      | 1,258.82 |

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 5.9.5.1 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。 5.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

454,581,114.00 本报告期基金总申购份额 减:本报告期基金总赎回份 5,500,000.00 17,500,000.0

§ 7 备查文件目录

2、《上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3、《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》;

4、《 ト证社会责任交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

基金管理人或基金托管人处。

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

### 2013 第一季度 报告

银行左封和结管各付金合

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。

其中:买断式回购的买人返售金融资

| 注:本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。<br><b>8.4 管理人报告</b><br>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   |  |  |  |
| 妊治   | 职分      | 任职日期      | 离任日期   |        | 15095  |  |  |  |
| 十乐天先<br>生  | 本基金基金经理 | 2012-3-21 | -      | 5      | 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,从事风险管理分析员,量化分为5块货;2011年9月加人我公司,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;2013年3月28日起任建信央视财 |  |  |  |

经50指数基金基金经理。

3

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 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人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。权重结构上的差异原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。

44.2 报告期内基金的业绩表现 本基金本报告哪价值标准率 - 2.71%, 波动率 1.93%, 业绩比较基准收益率 - 2.60%, 波动率 1.94%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 2013 年年初,市场延续去年 12 月的液势继续反弹、从春节后、市场纠结于经济是否复苏以及对政策的猜测中,陷入震荡 行情。 3 月份净少调验政策和 18 号文"的出合严重打击了市场对经济复苏的期待,市场重现调整观望情绪。预计二季度这 种情绪仍将延续,并根据最新的经济数据有所调整。 FFIII年2017的VIEW,计时据报谢时形22介数据有所调整。 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 跟踪波差及偏离度保持在技能太平。

| § 5 投资组合报告   |        |                |               |
|--------------|--------|----------------|---------------|
| 报告期末基金资产组合情况 |        |                |               |
| 루            | 项目     | 金额 (元)         | 占基金总资产的比例 66) |
|              | 权益投资   | 379,149,559.69 | 99.41         |
|              | 其中:股票  | 379,149,559.69 | 99.41         |
|              | 基金投资   | -              | -             |
|              | 固定收益投资 | -              | -             |
|              | 其中:债券  | -              | -             |
|              | 资产支持证券 | -              | -             |

2,553,948.84 0.67 22,262,720.47 13,616,179,9 3.58 交通运输、仓储和邮政业 4,614,759.9 1.21 信息传输、软件和信息技术服务业 8,184,200.78 202,130,071.2 53.10 20,196,224.99 科学研究和技术服务 水利、环境和公共设施管理》 居民服务、修理和其他服务。 文化、体育和娱乐』

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 600016 41.455.586 600036 2,690,65 33,982,922.1 601318 601166 600000 21,585,074.9