# 上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

## 2013 半年度 报告摘要

2013年6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**
**送出日期:2013年8月26日**

### §1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 责任ETF |
| 基金主代码 | 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 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 428,081,114.00份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2010-08-09 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 建信基金管理有限责任公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 路彩营 | 蒋松云 |
| | 联系电话 | 010-66228888 | 010-66106912 |
| | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-81-95533 010-66228000 | 95588 |
| 传真 | | 010-66228001 | 010-66106904 |

2.4信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http:/www.ccbfund.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所。 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2013年1月1日 - 2013年6月30日) |
| 本期已实现收益 | -6,328,062.30 |
| 本期利润 | -53,559,729.72 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1214 |
| 本期基金份额净值增长率 | -14.37% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2013年6月30日 ) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0811 |
| 期末基金资产净值 | 324,116,139.03 |
| 期末基金份额净值 | 0.757 |

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。

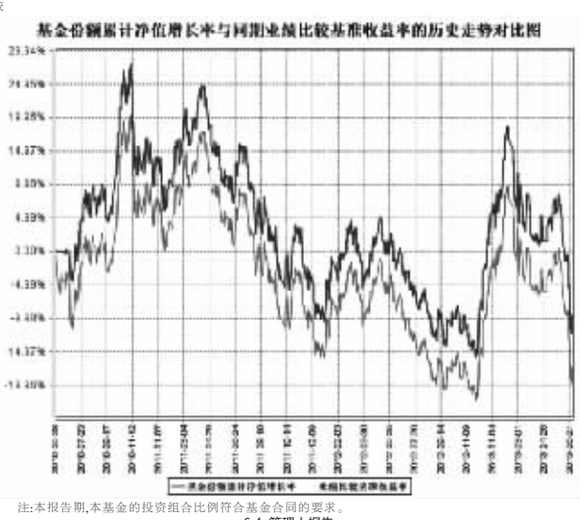
3、期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -15.51% | 2.03% | -16.44% | 2.07% | 0.93% | -0.04% |
| 过去三个月 | -11.98% | 1.58% | -13.01% | 1.60% | 1.03% | -0.02% |
| 过去六个月 | -14.37% | 1.76% | -15.27% | 1.77% | 0.90% | -0.01% |
| 过去一年 | -6.89% | 1.52% | -8.13% | 1.53% | 1.24% | -0.01% |
| 过去三年 | -6.61% | 1.42% | -8.50% | 1.44% | 1.89% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.69% | 1.40% | -17.37% | 1.44% | 7.68% | -0.04% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较


基金份额累计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
23.34%
9.45%
-4.39%
-14.37%
-24.39%
-34.39%
-44.39%
-54.39%
-64.39%
-74.39%
-84.39%
-94.39%
2010-5-28
2010-7-27
2010-9-27
2010-11-27
2011-1-27
2011-3-27
2011-5-27
2011-7-27
2011-9-27
2011-11-27
2012-1-27
2012-3-27
2012-5-27
2012-7-27
2012-9-27
2012-11-27
2013-1-27
2013-3-27
2013-5-27
2013-6-30
-0.1214
-0.1451
-0.1537
-0.1437
-0.1368
-0.1369
-0.1369
-0.1369