

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

2014年第1号

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
二〇一四年一月

11.3 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	600016	民生银行	4148,131	39,656,132.36	11.52
2	600036	招商银行	3,053,581	33,093,942.30	9.61
3	601166	兴业银行	2,099,190	23,447,952.30	6.81
4	601318	中国平安	615,339	21,967,602.30	6.32
5	600000	浦发银行	2,055,477	20,739,762.00	6.08
6	601328	交通银行	2,883,540	12,399,222.00	3.60
7	604601	中国国贸	577,223	10,141,790.54	2.95
8	601088	中信银行	465,674	10,096,585.58	2.93
9	601668	中国建筑	2,754,422	8,869,238.84	2.58
10	600104	上汽集团	467,360	8,217,580.00	2.39

- 11.3.2 期末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股票投资。
- 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序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券投资。
- 11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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序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 本基金对基金合同的跟踪误差情况
本基金本报告期末未持有跟踪误差。
- 11.9 本基金对基金合同的跟踪误差情况
本基金本报告期末未持有跟踪误差。
- 11.10 投资组合报告附注
11.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,且在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
11.10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。
11.10.3 报告期内无停牌。

序号	名称	金额(元)
1	银行存款	9,725.86
2	应收债券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	119,283.85
5	应收中期款	519.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	129,529.08

- 11.10.4 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。
- 11.10.5 报告期末持有的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投资。
- 11.10.6 报告期末持有的权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。
- 11.10.7 本基金对基金合同的跟踪误差情况
本基金本报告期末未持有跟踪误差。
- 11.10.8 本基金对基金合同的跟踪误差情况
本基金本报告期末未持有跟踪误差。
- 11.10.9 本基金对基金合同的跟踪误差情况
本基金本报告期末未持有跟踪误差。

阶段	份额净值增长率(长短期)	业绩比较基准增长率(长短期)	业绩比较基准超越率	①-③	②-④
2010年5月28日至2011年12月31日	12.14%	1.40%	5.92%	1.57%	0.22%
2011年1月1日至2011年12月31日	-18.30%	1.34%	-18.28%	1.35%	-0.01%
2012年1月1日至2012年12月31日	15.10%	1.28%	13.42%	1.29%	1.68%
2013年1月1日至2013年9月30日	-5.77%	1.70%	-8.07%	1.71%	-0.01%
自基金合同生效之日起至2013年9月30日止	-0.62%	1.42%	-10.34%	1.46%	-0.04%

- 11.11 投资组合报告附注
11.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,且在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
11.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。
11.11.3 报告期内无停牌。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	342,434,772.57	99.20
2	基金投资	342,434,772.57	99.20
3	固定收益投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和拆借资金合计	2,618,121.27	0.76
7	其他各项资产	129,529.08	0.04
8	合计	345,182,422.92	100.00

- 11.12 报告期末按行业分类的股票投资组合
11.12.1 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投资。
- 11.12.2 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投资。

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	23,091,689.01	6.71
C	制造业	79,361,830.27	23.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,296,533.06	0.96
E	建筑业	21,521,267.78	6.29
F	批发和零售业	13,661,079.43	3.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,856,023.37	0.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	8,350,419.52	2.43
J	金融业	172,424,022.53	50.07
K	房地产业	17,429,500.06	5.09
L	租赁和商务服务业	1,284,358.38	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
P	教育	-	-
Q	体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
S	合计	342,434,772.57	99.45

注:以上行业分类为2013年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

信息披露

一、基金概况
(一)基金名称
(二)基金管理人
(三)基金托管人

股东名称	股权比例
建信基金管理有限责任公司	65%
嘉信财富管理(香港)有限公司	25%
中国华英集团投资有限公司	10%

二、基金管理人
(一)基金管理人概况
(二)主要人员情况
(三)基金经理

三、基金托管人
(一)基金托管人概况
(二)主要人员情况

四、投资策略
(一)资产配置策略
(二)股票投资策略
(三)债券投资策略
(四)货币市场工具投资策略

五、投资组合报告
(一)报告期末基金资产组合情况
(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
(三)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
(四)报告期末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
(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
(七)报告期末持有的权证投资明细
(八)报告期末基金投资的股指期货交易情况
(九)报告期末基金投资的期权交易情况
(十)报告期末基金投资的国债期货交易情况
(十一)投资组合报告附注

六、业绩比较基准
(一)业绩比较基准
(二)业绩比较基准的说明

七、风险收益特征
(一)基金风险收益特征
(二)基金投资范围

八、基金管理人承诺
(一)基金管理人承诺
(二)基金管理人承诺

九、基金托管人承诺
(一)基金托管人承诺
(二)基金托管人承诺

十、基金销售机构
(一)基金销售机构
(二)基金销售机构

十一、基金募集
(一)基金募集
(二)基金募集

十二、基金合同的生效
(一)基金合同的生效
(二)基金合同的生效

十三、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

十四、基金合同的变更
(一)基金合同的变更
(二)基金合同的变更

十五、基金合同的修订
(一)基金合同的修订
(二)基金合同的修订

十六、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

十七、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

十八、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

十九、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十一、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十二、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十三、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十四、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十五、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十六、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十七、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十八、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

二十九、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

三十、基金合同的终止
(一)基金合同的终止
(二)基金合同的终止

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130227	13国债27	900,000	89,595,000.00	3.58
2	128211	12国债21	800,000	80,212,000.00	3.21
3	108247	10国债27	800,000	79,165,000.00	3.19
4	108216	10国债16	109,000	69,855,000.00	2.76
5	110023	11国债23	645,980	68,351,143.80	2.73

(六)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资产支持证券投资明细
(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
(八)报告期末基金投资的股指期货交易情况
(九)报告期末基金投资的期权交易情况
(十)报告期末基金投资的国债期货交易情况
(十一)投资组合报告附注

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006	央行票据	1	0.0261	0.00
2	603000	招商银行	3	30269	0.00
3	000012	央行票据	4	30269	0.00
4	601111	招商银行	6	60111	0.00
7	300037	招商银行	7	30007	0.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	258,720,363.83	10.55
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	65,730,000.00	2.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
P	教育	-	-
Q	体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
S	合计	324,450,363.83	12.90

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	002601	联创视讯	1	0.0261	0.00
2	603000	招商银行	2	60300	0.00
3	000012	央行票据	4	30269	0.00
4	601111	招商银行	6	60111	0.00
7	300037	招商银行	7	30007	0.00

注:以上基金本报告期末持有上述证券。
(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006	央行票据	1	0.0261	0.00
2	603000	招商银行	3	30269	0.00
3	000012	央行票据	4	30269	0.00
4	601111	招商银行	6	60111	0.00
7	300037	招商银行	7	30007	0.00

注:以上基金本报告期末持有上述证券。
(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006	央行票据	1	0.0261	0.00
2	603000	招商银行	3	30269	0.00
3	000012	央行票据	4	30269	0.00
4	601111	招商银行	6	60111	0.00
7	300037	招商银行	7	30007	0.00

注:以上基金本报告期末持有上述证券。
(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130227	13国债27	900,000	89,595,000.00	3.58
2	128211	12国债21	800,000	80,212,000.00	3.21
3	108247	10国债27	800,000	79,165,000.00	3.19
4	108216	10国债16	109,000	69,855,000.00	2.76
5	110023	11国债23	645,980	68,351,143.80	2.73

(六)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资产支持证券投资明细
(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
(八)报告期末基金投资的股指期货交易情况
(九)报告期末基金投资的期权交易情况
(十)报告期末基金投资的国债期货交易情况
(十一)投资组合报告附注

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006	央行票据	1	0.0261	0.00
2	603000	招商银行	3	30269	0.00
3	000012	央行票据	4	30269	0.00
4	601111	招商银行	6	60111	0.00
7	300037	招商银行	7	30007	0.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	23,091,689.01	6.71
C	制造业	79,361,830.27	23.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,296,533.06	0.96
E	建筑业	21,521,267.78	6.29
F	批发和零售业	13,661,079.43	3.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,856,023.37	0.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	8,350,419.52	2.43
J	金融业	172,424,022.53	50.07
K	房地产业	17,429,500.06	5.09
L	租赁和商务服务业	1,284,358.38	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
P	教育	-	-
Q	体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
S	合计	342,434,772.57	99.45

注:以上行业分类为2013年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006	央行票据	1	0.0261	0.00
2	603000	招商银行	3	30269	0.00
3	000012	央行票据	4	30269	0.00
4	601111	招商银行	6	60111	0.00
7	300037	招商银行	7	30007	0.00

注:以上基金本报告