

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:2014年3月27日

重要提示
基金管理人、基金托管人本报告所载资料均存在虚假记载、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法律责任。本年度报告已经三二二上独立理事签字同意,并由董事长签发。

本报告期内,工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年3月25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,也不保证基金份额持有人不受本金损失,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。

本报告中财务资料审计机构:普华永道中天会计师事务所有限公司
本年度报告全文:无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本年度报告编制日期:本年度报告投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。
本年度报告自2014年3月17日起至12月31日止。

Table with 2 columns: 2.1 基金基本情况, 2.2 基金简介. Includes details on fund type, management, and investment objectives.

Table with 2 columns: 2.3 基金管理人基本情况, 2.4 信息披露方式. Lists management personnel and contact information.

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

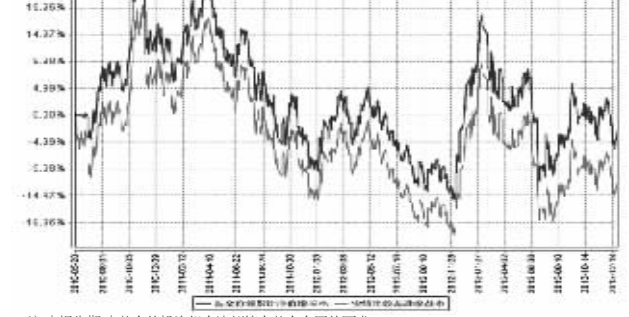
Table with 4 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标. Shows revenue, profit, and other financial metrics for 2013 and 2014.

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可能低于所列数字。

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,则期末可供分配的利润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,则期末可供分配的利润金额为期末未分配利润已实现部分扣除未实现部分。

Table with 2 columns: 3.2 基金净值表现. Shows performance metrics for various periods.

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可能低于所列数字。



注:本报告期末基金投资组合符合基金合同资产配置比例要求。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
基金业绩表现良好,以显著优势超越业绩比较基准,并超越业绩比较基准,历史走势对比图

Table with 2 columns: 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较. Shows performance metrics for various periods.

注:本基金合同自2010年5月28日生效,2010年净值增长率以实际存续期计算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金基金合同自2010年5月28日起生效,基金合同生效以来未发生利润分配情况。

4 基金管理人及其基金业绩情况

4.1 基金管理人及其基金业绩情况
4.1.1 基金管理人及其基金业绩情况
4.1.2 基金管理人及其基金业绩情况
4.1.3 基金管理人及其基金业绩情况

Table with 5 columns: 4.1 基金管理人及其基金业绩情况. Lists management personnel and their roles.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《基金合同》和其他法律法规、部门规章、行业规范及自律性规定,诚实守信、勤勉尽责,严格按照相关法律法规、基金合同和公司内部制度的规定,履行了管理人职责,没有出现违法违规行为。

4.3 管理人对于报告期内基金公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的制定情况
4.3.2 公平交易制度的执行情况
4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.3.3 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1%的情况。本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。
4.4 报告期内本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约定,采取了对标的波动率策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。主要采用持仓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

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

2013 年度报告摘要

2013年12月31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:2014年3月27日

重要提示
基金管理人、基金托管人本报告所载资料均存在虚假记载、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法律责任。本年度报告已经三二二上独立理事签字同意,并由董事长签发。

本报告期内,工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年3月25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,也不保证基金份额持有人不受本金损失,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。

本报告中财务资料审计机构:普华永道中天会计师事务所有限公司
本年度报告全文:无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本年度报告编制日期:本年度报告投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。
本年度报告自2014年3月17日起至12月31日止。

Table with 2 columns: 2.1 基金基本情况, 2.2 基金简介. Includes details on fund type, management, and investment objectives.

Table with 2 columns: 2.3 基金管理人基本情况, 2.4 信息披露方式. Lists management personnel and contact information.

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

Table with 4 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标. Shows revenue, profit, and other financial metrics for 2013 and 2014.

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可能低于所列数字。

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,则期末可供分配的利润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,则期末可供分配的利润金额为期末未分配利润已实现部分扣除未实现部分。

Table with 2 columns: 3.2 基金净值表现. Shows performance metrics for various periods.

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可能低于所列数字。



注:本报告期末基金投资组合符合基金合同资产配置比例要求。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
基金业绩表现良好,以显著优势超越业绩比较基准,并超越业绩比较基准,历史走势对比图

Table with 2 columns: 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较. Shows performance metrics for various periods.

注:本基金合同自2010年5月28日生效,2010年净值增长率以实际存续期计算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金基金合同自2010年5月28日起生效,基金合同生效以来未发生利润分配情况。

4 基金管理人及其基金业绩情况

4.1 基金管理人及其基金业绩情况
4.1.1 基金管理人及其基金业绩情况
4.1.2 基金管理人及其基金业绩情况
4.1.3 基金管理人及其基金业绩情况

Table with 5 columns: 4.1 基金管理人及其基金业绩情况. Lists management personnel and their roles.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《基金合同》和其他法律法规、部门规章、行业规范及自律性规定,履行了管理人职责,没有出现违法违规行为。

4.3 管理人对于报告期内基金公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的制定情况
4.3.2 公平交易制度的执行情况
4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.3.3 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1%的情况。本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。
4.4 报告期内本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约定,采取了对标的波动率策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。主要采用持仓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

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

2013 年度报告摘要

2013年12月31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:2014年3月27日

重要提示
基金管理人、基金托管人本报告所载资料均存在虚假记载、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法律责任。本年度报告已经三二二上独立理事签字同意,并由董事长签发。

本报告期内,工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年3月25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,也不保证基金份额持有人不受本金损失,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。

本报告中财务资料审计机构:普华永道中天会计师事务所有限公司
本年度报告全文:无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本年度报告编制日期:本年度报告投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。
本年度报告自2014年3月17日起至12月31日止。

Table with 2 columns: 2.1 基金基本情况, 2.2 基金简介. Includes details on fund type, management, and investment objectives.

Table with 2 columns: 2.3 基金管理人基本情况, 2.4 信息披露方式. Lists management personnel and contact information.

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

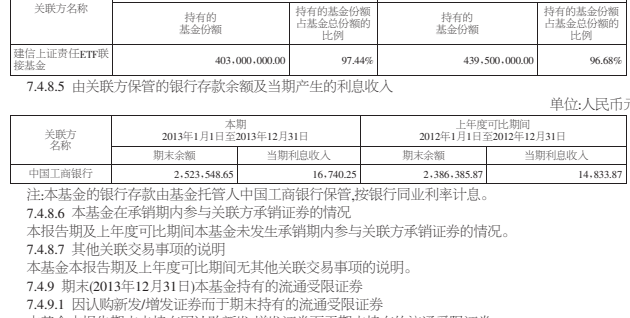
Table with 4 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标. Shows revenue, profit, and other financial metrics for 2013 and 2014.

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可能低于所列数字。

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,则期末可供分配的利润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,则期末可供分配的利润金额为期末未分配利润已实现部分扣除未实现部分。

Table with 2 columns: 3.2 基金净值表现. Shows performance metrics for various periods.

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可能低于所列数字。



注:本报告期末基金投资组合符合基金合同资产配置比例要求。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
基金业绩表现良好,以显著优势超越业绩比较基准,并超越业绩比较基准,历史走势对比图

Table with 2 columns: 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较. Shows performance metrics for various periods.

注:本基金合同自2010年5月28日生效,2010年净值增长率以实际存续期计算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金基金合同自2010年5月28日起生效,基金合同生效以来未发生利润分配情况。

4 基金管理人及其基金业绩情况

4.1 基金管理人及其基金业绩情况
4.1.1 基金管理人及其基金业绩情况
4.1.2 基金管理人及其基金业绩情况
4.1.3 基金管理人及其基金业绩情况

Table with 5 columns: 4.1 基金管理人及其基金业绩情况. Lists management personnel and their roles.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《基金合同》和其他法律法规、部门规章、行业规范及自律性规定,履行了管理人职责,没有出现违法违规行为。

4.3 管理人对于报告期内基金公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的制定情况
4.3.2 公平交易制度的执行情况
4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.3.3 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1%的情况。本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。
4.4 报告期内本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约定,采取了对标的波动率策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。主要采用持仓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

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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例(%)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读我登载于公司网站www.ccbfund.com.cn的年度报告全文。

8.3.2 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五名股票投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例(%)

注:上述买入金额为买入成交金额或成交均价乘以成交数量,不包括相关交易费用。

8.4.2 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权证投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例(%)

注:上述买入金额为买入成交金额或成交均价乘以成交数量,不包括相关交易费用。

买入股票成本、卖出股票收入

Table with 2 columns: 买入股票成本, 卖出股票收入. Shows transaction details.

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交均价乘以成交数量)扣除相关交易费用。

8.6 期末按品种分类的债券投资组合

Table with 2 columns: 类别, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例. Shows bond portfolio breakdown.

8.7 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

Table with 2 columns: 名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例. Shows asset-backed securities portfolio.

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with 2 columns: 名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例. Shows precious metals portfolio.

8.9 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

Table with 2 columns: 名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例. Shows warrants portfolio.

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 2 columns: 名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例. Shows futures portfolio.

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

Table with 2 columns: 名称, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例. Shows treasury futures portfolio.

8.12 投资组合报告附注
8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未发生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、处罚的情况。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额. Shows other assets breakdown.

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: 持有人户数(户), 持有基金份额. Shows shareholder structure.

9.3 期末本基金投资的关联方投资未发生变化情况

10 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 基金期初基金份额, 基金期末基金份额. Shows fund asset changes.

11 重大事件提示

11.1 基金份额持有人大会决议
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动