基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2014年3月27日

建信社会责任股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,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。

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。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信社会责任股票
基金主代码	530019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月14日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	39,383,545.09份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	采用自上而下的资产配置和自下而上的股票选择相结合的投资策略,本基金在长期价值投资理念的基础上,坚持社会责任投资,重点考察企业社会责任的履行,立足企业基本面,努力实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其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,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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	李芳菲
	联系电话	010-66228888	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lifangfei@abcchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95599
传真		010-66228001	010-63201816

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年	2012年8月14日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	16,088,683.60	-1,795,631.80
本期利润	10,373,137.42	5,985,201.84
加权平均基金份额本期利润	0.2310	0.0147
本期基金份额净值增长率	16.27%	3.90%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.2079	-0.0137
期末基金资产净值	47,569,870.78	143,495,933.07
期末基金份额净值	1.208	1.039

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;

2.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(已实现部分扣抵未实现部分);

3.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 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

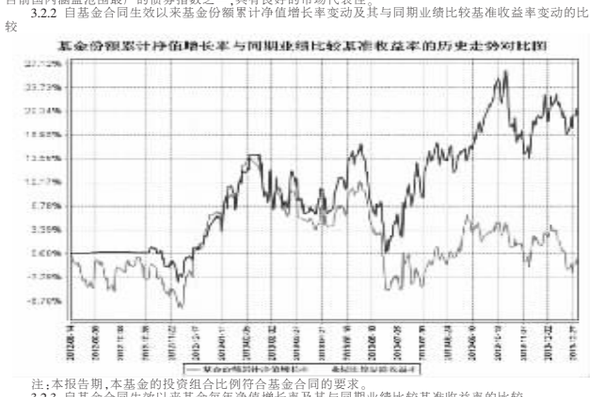
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.17%	1.20%	-2.99%	0.85%	4.16%	0.35%
过去六个月	17.97%	1.21%	3.47%	0.97%	14.50%	0.24%
过去一年	16.27%	1.28%	-5.88%	1.05%	22.15%	0.23%
自基金合同生效起至今	20.80%	1.10%	-0.65%	1.03%	21.45%	0.07%

注:本基金投资业绩比较基准为75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。本基金为股票型证券投资基金,股票资产占基金资产的比例为60%-95%,故本基金采取75%作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重,相应将25%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。

沪深300指数是由中证指数公司编制的,从上海和深圳股票市场中选取的300只A股作为样本编制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深市场七成左右的流通市值和超过四分之三的总市值,是具有良好的市场代表性、能够反映A股市场整体走势的指数。沪深300指数中的很多成份股本身即为业绩优良的监等品种,以其为标的的指数期货也已经推出,从而会为本基金带来新的投资机会和风险管理手段。因此,基金管理人选择沪深300指数作为本基金股票部分的比较基准。

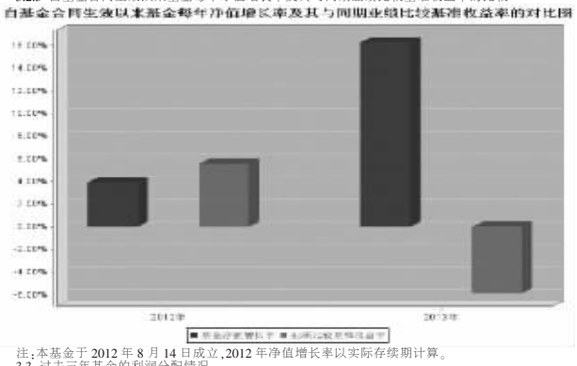
中国债券总指数的发布主体是中央国债登记结算有限责任公司。中央国债登记结算公司是全国债券市场内提供国债、金融债券、企业债券和其他固定收益证券的登记、托管、交易结算等服务的国有独资金融机构,是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构,是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人。同时中国债券总指数是目前国内涵盖范围最广的债券指数之一,具有良好的市场代表性。

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



注:本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

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



注:本基金于2012年8月14日成立,2012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2012年8月14日起生效,基金合同生效以来未发生过利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部,以及深圳、成都、上海、北京四家分公司,并在上海设立了子公司—建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持"诚信、专业、规范、创新"的核心价值观,恪守"持有人利益重于泰山"的原则,以"建设财富生活"为崇高使命,坚持规范运作,致力成为"最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司"。

截至2013年12月31日,公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国股票型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金37只开放式基金和建信信用增强债券型证券投资基金1只封闭式基金,管理的基金资产规模共计为730.45亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚锦	本基金的基金经理	2012年8月14日	-	9	博士,曾任天津通广三星电子有限公司工程师、天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职;2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理;2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理,现任我公司研究部首席策略分析师,2012年2月17日起任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理,2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任股票型证券投资基金基金经理,2014年1月20日起任建信保本基金的基金经理,建信保本基金三年保本期满,根据基金合同约定,转换为建信积极配置混合基金,《建信保本混合型证券投资基金基金合同》于1月22日失效,1月23日起《建信积极配置混合型证券投资基金基金合同》生效,姚锦继续担任该基金的基金经理。
许杰	本基金的基金经理	2012年8月14日	-	11	硕士,特许金融分析师(CFA),曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理,美国迪斯尼公司金融分析员,2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职,2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理,2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理,2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理,2011年10月加入我公司,2012年3月21日起任建信恒稳价值混合型证券投资基金基金经理,2012年8月14日起任建信社会责任股票型证券投资基金基金经理。

注:姚锦自2014年3月6日起不再担任本基金的基金经理。

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《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,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)管理的不同投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下:

当时间窗为1日时,配了1984对投资组合,有496对投资组合未通过T检验,其中190对投资组合的正溢价率占优频率小于55%,其它306对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,有29对投资组合的平均溢价率超过2%,但其组合贡献率低于5%,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为3日时,配了2454对投资组合,有558对投资组合未通过T检验,其中78对投资组合的溢价率占优频率小于55%,其它480对正溢价率占优频率大于55%的投资组合,有9对投资组合的平均溢价率超过5%,但其组合贡献率低于5%,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为5日时,配了2548对投资组合,有673对投资组合未通过T检验,其中92对投资组合的溢价率占优频率小于55%,其它581对正溢价率占优频率大于55%的投资组合,有1对投资组合的平均溢价率超过10%,但其组合贡献率低于5%,同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金上半年主要配置了以下两类股票:一是需求好转同时供给结构良好的细分行业(包括轮胎/轮胎模具/染料/通信设备/家电/电力设备等行业)中的龙头企业,这些公司对组合贡献了较大的超额收益;另外一类是低估值的地产/保险/汽车等行业,这类公司则对组合的表现带来了拖累。下半年减持了地产、保险等周期类行业的股票,增持了成长空间大、进入壁垒高且基本面向好的行业中的优秀企业。

回顾全年的股票投资运作情况,可以看出对基金净值贡献大的股票是那些需求好转同时竞争结构稳定的细分行业中的龙头企业,这些企业业绩的增长带来股价的上涨,对基金净值带来较大拖累的是地产、保险等周期类行业的股票。另外,本基金对于传媒/电子/医药等成长股的配置比例偏低,没有充分享受这些行业估值大幅提升带来的收益。反思成长类股票配置比例低的原因,应该在于没有充分认识到经济转型期的经济特点和股票表现的特征。转型期内,经济增速相对较慢,在经济增长缺乏亮点的背景下,市场资金回避周期类行业,集中投资于代表未来经济增长点的所谓成长类行业,可能会导致这些行业的股票长期处于高估的状态。

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16.27%,波动率1.28%,业绩比较基准收益率-5.88%,波动率1.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年以美国为代表的发达国家的经济可能继续处于复苏进程中,而美国QE也将逐渐退出,全球流动性泛滥的局面开始收敛。新兴市场国家一方面面临经济调整的压力,另一方面也面临QE退出导致资金回流发达国家市场的压力。

2014年中国经济面临较大的挑战:过去推动中国经济增长的两大动力—房地产和基础设施投资的增速都将下滑;传统产业需求不足,处于长期去产能的阶段;利率市场化初期利率水平高企;过去被视为无风险的信托和信用债很有可能出现不能刚性兑付的个案,从而对资本市场带来大的冲击。这些都是经济转型期必然经历的困难。另外一方面我们也看到中国经济也存在很多机遇,互联网/节能环保/医药/软件等新兴行业正在加速成长,成为推动中国经济的新动力;中国仍然具有工程师优势等全球比较优势,机械/电子等行业还在向中国转移的过程中;改革红利终将释放。因此,尽管处于调整期的中国经济潜在增长率下降,但是不会陷入金融危机或经济困境。

2014年A股市场可能不会出现趋势性的投资机会,但结构性机会仍然存在。优质成长股可能继续成为股市的主旋律;创新和新型服务等成长类公司可能继续成为股市的焦点。然而2014年同2013年相比,资金环境不如2013年上半年宽松,市场投资在成长股的比例也有了大幅的提高,目前成长股整体的估值水平偏高。因此,不同于2013年鸡犬升天的概念股行情,2014年成长股会去伪存真,选择真正优质的成长行业和公司更加重要。

周期股也存在供给收缩/改革红利/估值修复的机会:经过2010年以来长期的库存收缩和供给调整,部分周期性行业的供需格局会出现向上的拐点;改革措施会提升部分周期类公司的估值水平;目前很多周期类公司的股价反映了较深的悲观预期,如果宏观经济的走势好于市场预期,这些公司存在估值修复的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策;对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督;对因经济环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成(具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定)。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件,发现估值问题;提议基金估值调整的相关方案并进行校验;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案,报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理,并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的,由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果,基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金)。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未实施利润分配,符合法律法规和基金合同中关于利润分配的相关规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管建信社会责任股票型证券投资基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》、《建信社会责任股票型证券投资基金托管协议》的约定,对建信社会责任股票型证券投资基金基金管理人—建信基金管理有限责任公司2013年1月1日至2013年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司在建信社会责任股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的建信社会责任股票型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司审计了后附的建信社会责任股票型证券投资基金(以下简称"建信社会责任股票基金")的财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表、2013年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2014)第20278号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:建信社会责任股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		12,217,231.26	77,850,196.00
结算备付金		200,048.52	1,210,150.77
存出保证金		67,074.48	-
交易性金融资产		36,172,173.37	108,468,127.40
其中:股票投资		36,172,173.37	108,468,127.40
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		1,342,751.25	-
应收利息		2,972.94	18,604.09
应收股利		-	-
应收申购款		24,630.57	10,147.78
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		50,026,882.39	187,557,226.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,398,090.25	39,858,808.72
应付赎回款		364,281.16	3,460,377.18
应付管理人报酬		60,809.19	201,096.23
应付托管费		10,134.91	33,516.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		386,186.71	289,385.90
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		237,509.39	218,108.90
负债合计		2,457,011.61	44,061,292.97
所有者权益:			
实收基金		39,383,545.09	138,043,923.76
未分配利润		8,186,325.69	5,452,009.31
所有者权益合计		47,569,870.78	143,495,933.07
负债和所有者权益总计		50,026,882.39	187,557,226.04

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.208元,基金份额总额39,383,545.09份。

7.2 利润表

会计主体:建信社会责任股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年8月14日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一.收入		12,718,837.36	9,256,125.88
1.利息收入		95,441.97	2,526,805.25
其中:存款利息收入		89,643.03	576,274.64
债券利息收入		5,798.94	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,950,530.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		18,135,505.37	-2,297,040.34
其中:股票投资收益		17,719,300.06	-2,297,040.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-133,379.57	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		549,584.88	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-5,715,546.18	7,780,833.64
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		203,436.20	1,245,527.33
减:二.费用		2,345,699.94	3,270,924.04
1.管理人报酬		760,491.09	2,242,094.69
2.托管费		126,748.50	373,682.42
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,073,007.90	442,350.22
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		385,452.45	212,796.71
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		10,373,137.42	5,985,201.84
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		10,373,137.42	5,985,201.84

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信社会责任股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	138,043,923.76	5,452,009.31	143,495,933.07
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,373,137.42	10,373,137.42
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-98,660,378.67	-7,638,821.04	-106,299,199.71
其中:1.基金申购款	53,155,517.12	8,057,823.80	61,213,340.92
2.基金赎回款	-151,815,895.79	-15,696,644.84	-167,512,540.63
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	39,383,545.09	8,186,325.69	47,569,870.78
项目	上年度可比期间 2012年8月14日(基金合同生效日)至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	1,111,390,620.35	-	1,111,390,620.35
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,985,201.84	5,985,201.84
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-973,346,696.59	-533,192.53	-973,879,889.12
其中:1.基金申购款	22,504,863.64	28,857.30	22,533,720.94
2.基金赎回款	-995,851,560.23	-562,049.83	-996,413,610.06
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	138,043,923.76	5,452,009.31	143,495,933.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

孙志晨 何斌 秦绪华

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信社会责任股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]第484号《关于核准建信社会责任股票型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,111,324,695.07元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第288号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》于2012年8月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,111,390,620.35份基金份额,其中认购资金利息折合65,925.28份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为60-95%,其中本基金投资于积极履行社会责任的上市公司股票比例不低于股票资产的80%,债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为0-40%,其中权证占基金资产净值的0-3%,任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率X 75% + 中国债券总指数收益率X 25%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2014年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期内所采用的会计政策、会计估计和最近一年年度报告一致。

7.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金从证券市场取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年8月14日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	760,491.09	2,242,094.69
其中:支付销售机构的客户维护费	403,453.55	1,255,760.33

注:1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值X 1.50% / 当年天数;

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年8月14日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	126,748.50	373,682.42

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年8月14日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	12,217,231.26	83,659