

## 上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

### 2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司  
基金管理人:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年4月22日

#### 1.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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责任。  
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证最低收益。  
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告所载数据截至2014年3月31日止。

#### 1.2 基金产品概况

基金名称	上证社会责任
基金主代码	510909
交易代码	510909
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
报告期末基金份额总额	398,081,114.09
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跟踪标的指数的投资策略,跟踪标的指数的成份股的结构及其权重和建基金投资组合,并跟踪标的指数的涨跌幅及其权重变动进行相应调整。
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的类似风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、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

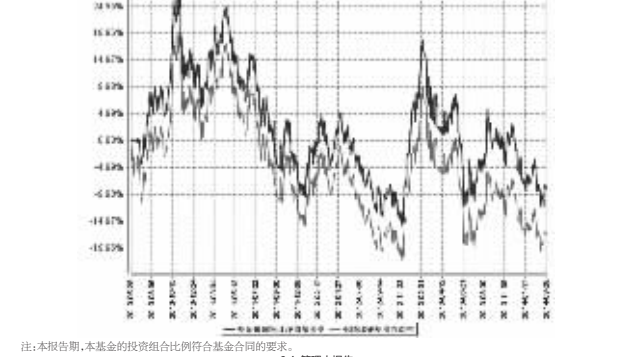
#### 1.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年1月1日—2014年3月31日)
1.本期利润总额	-2,638,116.49
2.本期费用	-20,245,889.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0499
4.期末基金资产净值	303,788,083.77
5.期末基金份额净值	0.763

注:1.本期利润总额按本基金本期利息收入、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。本基金公允价值变动损益。  
2.期末基金份额净值不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用以后实际收益水平要低于列示数字。  
3.基金净值表现  
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

阶段	净值增长率①	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	-4.15%	1.17%	-5.97%	1.18%	-0.18%	-0.03%

3.2.2 本基金自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的对比



注:本基金自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的对比

#### 1.4 管理人报告

4.1 基金管理人(或基金托管人)简介  
姓名 职务 任本基金基金经理年限 说明  
魏士 基金经理 2012年3月21日 - 5 魏士,曾就职于中国国际金融有限公司,先后担任风险管理部分析、量化分析研究员,从事风险管理、量化研究等工作,2011年9月加入本公司,担任社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理,2013年1月20日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况  
本报告期,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,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规和《上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金合同》的规定。  
4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资人,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情形,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》、《证券投资基金公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内控制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公用型资产管理业务管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理规章制度,明确规定了公平交易原则,一旦出现问题基金管理人第一时间,系统自动预警公平交易模块进行干预,确保投资管理部门公平对待不同投资对象,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 异常交易行为的专项说明  
本报告期,本基金不存在异常交易行为。  
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩变动说明  
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩变动说明  
在报告期内,本基金根据基金合同规定,采取了跟踪标的指数复制策略,将年化跟踪误差控制在0.5%以内,跟踪标的指数的跟踪误差控制在基金合同约定的范围内。  
报告期内,本基金跟踪误差主要来自基金份额净值增长率与标的指数收益率以及基金份额净值增长率与跟踪标的指数的跟踪误差,在跟踪标的指数的跟踪误差中,基金份额净值增长率与跟踪标的指数的跟踪误差,平均地控制了基金的跟踪误差与跟踪误差率。  
本报告期,本基金净值增长率-4.15%,业绩比较基准收益率-5.97%,波动率1.18%。  
4.4.2 管理人投资策略、证券市场运行走势的跟踪策略  
2014年一季度,受低通胀的持续影响,价格指数持续处于下行态势,投资者普遍对中期经济走势持悲观态度,这种悲观情绪也体现在股票市场的不同寻常的高位上。展望2014年一季度,市场整体仍是结构行情,投资机会主要体现在改革转型受益个股和超跌上,投资者需密切关注改革主题。  
4.4.3 管理人跟踪标的基金合同,以量化分析研究为基础,跟踪各种因素的影响,不断优化投资组合,将基金的跟踪误差及跟踪误差率控制在基金合同范围内。

报告期利润总额	413,581,114.09
报告期基金份额净值	1,500,000.00
报告期基金份额总额	17,000,000.00
报告期基金份额净值增长率	398,081,114.09

#### 1.5 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	191,053,739.36
报告期期末基金份额总额	206,538,776.66
报告期基金份额净增加额	15,484,937.30
报告期基金份额净增加额(份额减少以“-”填列)	14,960,449.42

#### 1.7 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.8 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.9 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.10 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.11 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.12 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.13 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.14 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.15 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.16 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.17 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.18 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

#### 1.19 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

## 建信全球机遇股票型证券投资基金

### 2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司  
基金管理人:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年4月22日

#### 1.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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责任。  
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证最低收益。  
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告所载数据截至2014年3月31日止。

#### 1.2 基金产品概况

基金名称	建信全球机遇股票(QDII)
基金主代码	590001
交易代码	590001
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
报告期末基金份额总额	148,961,489.22
投资目标	本基金通过全球化的资产配置和组合管理,在分散和抑制投资风险的同时追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的个股选择相结合,定期研究与不定期调整相结合,组合构建与风险控制相结合的投资策略,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	标普500指数(S&P 500 Index) + 70% + 人民币升值(BHPI) (RMB) 指数总收益 (S&P 500 China ex-A-Shares) * 30%
风险收益特征	本基金属全球股票型基金,其风险和预期收益高于货币基金、债券基金和混合基金,属风险较高、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

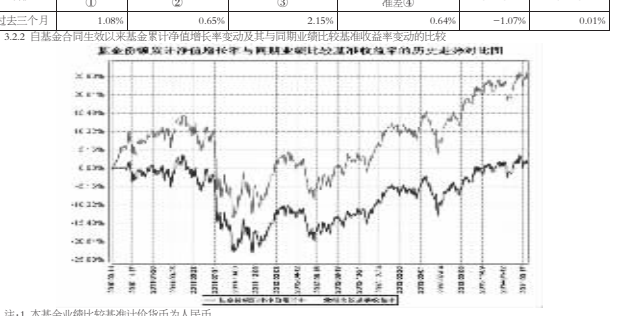
#### 1.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年1月1日—2014年3月31日)
1.本期利润总额	10,791,292.82
2.本期费用	15,009,736.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0993
4.期末基金资产净值	153,264,324.03
5.期末基金份额净值	1.028

注:1.本期利润总额按本基金本期利息收入、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。本基金公允价值变动损益。  
2.期末基金份额净值不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用以后实际收益水平要低于列示数字。  
3.基金净值表现  
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

阶段	净值增长率①	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	1.08%	0.65%	2.15%	0.64%	-1.07%	0.01%

3.2.2 本基金自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的对比



注:1.本基金净值增长率扣除货币汇率变动影响。

#### 1.4 管理人报告

4.1 基金管理人(或基金托管人)简介  
姓名 职务 任本基金基金经理年限 说明  
魏士 基金经理 2011年4月23日 - 3 魏士,曾就职于中国国际金融有限公司,先后担任风险管理部分析、量化分析研究员,从事风险管理、量化研究等工作,2011年9月加入本公司,担任全球机遇股票型证券投资基金及其联接基金的基金经理,2013年1月20日起担任全球机遇股票型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况  
本报告期,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,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规和《建信全球机遇股票型证券投资基金合同》的规定。  
4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资人,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情形,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》、《证券投资基金公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内控制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公用型资产管理业务管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理规章制度,明确规定了公平交易原则,一旦出现问题基金管理人第一时间,系统自动预警公平交易模块进行干预,确保投资管理部门公平对待不同投资对象,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 异常交易行为的专项说明  
本报告期,本基金不存在异常交易行为。  
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩变动说明  
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩变动说明  
在报告期内,本基金根据基金合同规定,采取了跟踪标的指数复制策略,将年化跟踪误差控制在0.5%以内,跟踪标的指数的跟踪误差控制在基金合同约定的范围内。  
报告期内,本基金跟踪误差主要来自基金份额净值增长率与标的指数收益率以及基金份额净值增长率与跟踪标的指数的跟踪误差,在跟踪标的指数的跟踪误差中,基金份额净值增长率与跟踪标的指数的跟踪误差,平均地控制了基金的跟踪误差与跟踪误差率。  
本报告期,本基金净值增长率1.08%,业绩比较基准收益率2.15%,波动率0.64%。  
4.4.2 管理人投资策略、证券市场运行走势的跟踪策略  
2014年一季度,受低通胀的持续影响,价格指数持续处于下行态势,投资者普遍对中期经济走势持悲观态度,这种悲观情绪也体现在股票市场的不同寻常的高位上。展望2014年一季度,市场整体仍是结构行情,投资机会主要体现在改革转型受益个股和超跌上,投资者需密切关注改革主题。  
4.4.3 管理人跟踪标的基金合同,以量化分析研究为基础,跟踪各种因素的影响,不断优化投资组合,将基金的跟踪误差及跟踪误差率控制在基金合同范围内。

报告期利润总额	10,791,292.82
报告期基金份额净值	1,028
报告期基金份额总额	148,961,489.22
报告期基金份额净值增长率	148,961,489.22

4.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.4 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	191,053,739.36
报告期期末基金份额总额	206,538,776.66
报告期基金份额净增加额	15,484,937.30
报告期基金份额净增加额(份额减少以“-”填列)	14,960,449.42

4.5 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.6 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.8 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.9 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.10 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.11 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.12 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.13 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.14 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.15 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.16 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

4.17 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细	
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	

## 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

### 2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司  
基金管理人:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年4月22日

#### 1.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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责任。  
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证最低收益。  
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告所载数据截至2014年3月31日止。

#### 1.2 基金产品概况

基金名称	建信上证社会责任
基金主代码	590010
交易代码	590010
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	359,855,632.76
投资目标	通过复制标的指数,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	本基金为上证社会责任ETF的联接基金,主要通过投资于上证社会责任ETF,跟踪标的指数的表现,实现与标的指数的跟踪误差最小化,或跟踪标的指数的涨跌幅及其权重变动进行相应调整。
业绩比较基准	95%*上证社会责任指数收益率+5%*商业银行活期存款利率
风险收益特征	本基金为上证社会责任ETF的联接基金,风险和预期收益水平高于货币基金、债券基金及货币市场基金,同时,本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场的类似风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、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

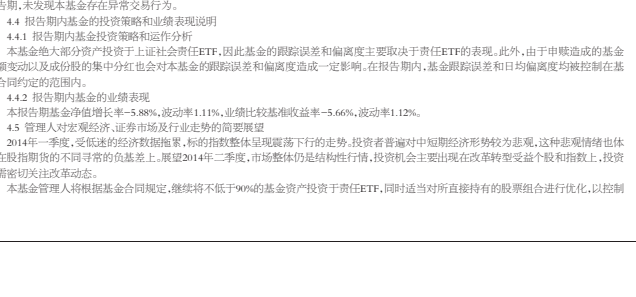
#### 1.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年1月1日—2014年3月31日)
1.本期利润总额	-2,318,840.65
2.本期费用	-19,901,344.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0599
4.期末基金资产净值	317,020,262.15
5.期末基金份额净值	0.881

注:1.本期利润总额按本基金本期利息收入、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。本基金公允价值变动损益。  
2.期末基金份额净值不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用以后实际收益水平要低于列示数字。  
3.基金净值表现  
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

阶段	净值增长率①	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	-5.80%	1.11%	-5.66%	1.12%	-0.22%	-0.01%

3.2.2 本基金自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的对比



注:本基金自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的对比

4.1 基金管理人(或基金托管人)简介  
姓名 职务 任本基金基金经理年限 说明  
叶乐 基金经理 2012年3月21日 - 5 叶乐,曾就职于中国国际金融有限公司,先后担任风险管理部分析、量化分析研究员,从事风险管理、量化研究等工作,2011年9月加入本公司,担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理,2013年1月20日起担任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况  
本报告期,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,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规和《建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金合同》的规定。  
4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为公平对待投资人,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情形,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》、《证券投资基金公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内控制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公用型资产管理业务管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理规章制度,明确规定了公平交易原则,一旦出现问题基金管理人第一时间,系统自动预警公平交易模块进行干预,确保投资管理部门公平对待不同投资对象,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 异常交易行为的专项说明  
本报告期,本基金不存在异常交易行为。  
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩变动说明  
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩变动说明  
在报告期内,本基金根据基金合同规定,采取了跟踪标的指数复制策略,将年化跟踪误差控制在0.5%以内,跟踪标的指数的跟踪误差控制在基金合同约定的范围内。  
报告期内,本基金跟踪误差主要来自基金份额净值增长率与标的指数收益率以及基金份额净值增长率与跟踪标的指数的跟踪误差,在跟踪标的指数的跟踪误差中,基金份额净值增长率与跟踪标的指数的跟踪误差,平均地控制了基金的跟踪误差与跟踪误差率。  
本报告期,本基金净值增长率