



## 上证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

### 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2010年3月26日证监许可[2010]378号文核准募集。本基金的基金合同于2010年5月28日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资者本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益;因基金份额净值及交易价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全部收回其原本投资。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身风险承受能力,对投资本基金的投资期限、时机、数量和持有行为作出独立判断。投资者根据所持份额享受基金的收益,但同时需承担相应的投资风险。

投资本基金可能遇到的风险包括:标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。基金份额赎回对价的价格折溢价的风险、基金退市风险、投资者申购/赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险以及基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理风险,等等。本基金属股票型基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金与货币市场基金。本基金为主动型基金,紧密跟踪标的指数,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。

投资有风险,投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为2015年11月27日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日(财务数据未经审计),本招募说明书已经基金托管人复核。

### 一、基金管理人

#### (一)基金管理人概况

名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
设立日期:2005年9月19日  
法定代表人:许会斌  
联系人:郭雅菲  
电话:010-66228888  
注册资本:人民币6亿元  
建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
中国建设银行股份有限公司	68.00%
国际金融控股有限公司	25%
中国对外经济贸易信托有限公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金份额持有者的利益。股东大会为公司权力机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确规定了股东大会依法行使权利,不得以任何形式直接或间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构,对股东大会负责,并向股东大会汇报。公司董事会由9名董事组成,其中7名为独立董事,根据公司章程的规定,行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权。公司监事会的职权和对总裁等高级管理人员的监督约束职权。

公司监事会成员,由6名监事组成,其中包括3名职工代表监事。监事会向股东大会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

#### (二)主要人员情况

##### 1.董事会成员

许会斌先生,董事长。自2011年3月起至现在,出任中国建设银行批发业务总监;自2006年5月至2011年5月任中国建设银行河南省分行行长;自1994年5月至2006年5月历任中国建设银行河南省副行长,专业业务部副经理,个人银行部副经理,营业部主要负责人、总经理,个人银行业务部总经理,个人银行业务委员会副主任,个人金融部副经理,许先生是高级经济师,并是国务院特殊津贴获得者,曾荣获中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章等奖项,1983年3月获郑州大学金融财务与信用专业大学本科毕业。2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

孙志毅先生,董事。1985年获东北财经大学经济学学士学位,2006年获得长江商学院EMBA,历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长,中国建设银行总行筹资部零售业务部证券处处长,中国建设银行总行个人银行部副经理,2009年赴北京担任北京中文系副教授,2010年10月担任中国建设银行总行个人银行部副经理,2011年赴北京担任中文系副教授,2012年任中国建设银行北京分行副行长兼财富管理业务部副经理,北京分行安华支行副行长,北京分行西便门支行副行长,北京分行朝阳支行行长,北京分行个人银行部副经理,中国建设银行个人存款与投资部副经理。

张维义先生,董事。现任长安国际北亚副总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位,2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理硕士学位。历任新加坡公共服务委员会副科长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,诚信基金公司首席运营官和总经理,英国保诚集团(马来西亚)资产管理公司首席执行官,宏利全球副总裁,宏利资产管理公司(香港)总经理。

袁时奇先生,董事。现任安国际北亚副总裁。1991年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位,2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理硕士学位。历任新加坡公共服务委员会副科长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,诚信基金公司首席运营官和总经理,英国保诚集团(马来西亚)资产管理公司首席执行官,宏利全球副总裁,宏利资产管理公司(香港)总经理。

殷时先生,董事。现任安国际北亚副总裁。1981年毕业于美国阿诺德商学院,历任香港汇丰银行投资银行部副经理,加拿大丰业银行资本市场部高级经理,香港铁路公司票务部助理,香港置地集团财务部副经理,香港赛马会副集团司库,安国际有限公司大中华区首席运营官。

殷江先生,董事。现任中国华电融资租赁有限公司董事长兼总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数学教育专业,获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部副经理,华电集团财务有限公司投资管理部副经理(主持工作),中国华电集团公司政策重组办副主任,信贷政策处处长,政策与法律事务部政策研究处处长,中国华电集团资本控股有限公司副总经理,现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学金融学院,1988年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员,正大国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理,博时基金管理有限公司副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理。

王建刚先生,独立董事。曾任中国人寿保险有限公司首席行政员,中银保退休信託信托管理有限公司董事,美国保诚保险有限公司首席行政员,美国国际集团亚太区资深副总裁,美国国际集团(香港)有限公司总裁兼首席行政员等,1989年获Pacific Southern University工商管理硕士学位。

伏军先生,独立董事。法学博士,现任对外经济贸易大学法学院教授,兼任中国法学会国际经济法学会常务理事,副秘书长,中国国际经济法学会常务理事。

##### 2.监事会成员

王雪竹女士,监事会主席。毕业于清华大学经济管理学院高级工商管理专业,高级经济师。历任中国建设银行山东省分行计划处职员;中国建设银行新疆分行计划处、信贷处、风险处及人力资源部处长、处长、行政助理,副行长;中国建设银行总行机构管理部副经理。2015年10月起任公司监事会主席。

李亦军女士,监事。现任安国际北亚(亚洲)有限公司亚洲区首席经理,曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和英国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。女士于1990年获新加坡国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士,监事,高级会计师,现任中国华电集团资本控股有限公司机构与风险管理部副经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士学位,2009年获中央财经大学会计学硕士学位。历任北京北电财务有限公司,中进会计师事务所,中瑞华信会计师事务所,中国华电集团财务有限公司计划财务部副经理助理,副经理,中国华电集团资本控股(华电财务公司)计划财务部副经理,中国华电集团财务有限公司财务部经理,中国华电集团资本控股有限公司企业融资部副经理。

吴灵娟女士,职工监事。现任建信基金管理有限责任公司人力资源部副经理兼综合管理部副经理。1996年毕业于中国人民大学经济信息管理系,获得学士学位;2001年毕业于北京师范大学经济学院,获得管理学硕士学位。历任中国建设银行总行人力资源部主任科员,高级经济师助理,建信基金管理公司人力资源部副经理助理,副总监,总监。

安辉先生,职工监事。现任建信基金管理有限责任公司信息技术部副经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用专业,获得学士学位。曾任中国建设银行北京分行科技科科员,中国建设银行信息技术管理部主任科员,副经理。2005年9月加入建信基金管理公司,历任基金运营部高级助理,副总监,信息管理部副经理,总监。

刘福女士,职工监事。现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副经理,英国特普公认会计师公会(ACCA)资深会员,1997年毕业于中国人民大学会计系,获学士学位,2010年毕业于香港中文大学,获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师,华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司监察稽核部。

##### 3.公司高管人员

孙志毅先生,总裁(简历请参见董事会成员)。  
张敬敏先生,副总裁。1997年毕业于大连理工大学,获学士学位;2003年毕业于大连理工大学,获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁省分行筹资处科员,主任科员;中国建设银行总行人力资源部主任科员,高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任市场营销部副经理(主持工作)、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任建信基金管理副总裁。

曲亚军先生,副总裁。1996年毕业于中国人民大学,获学士学位;1999年毕业于中国人民大学,获硕士学位。曾任中国建设银行总行审计部科员,副主任科员;团委书记;重组改制办公室高级副经理;行政办公室高级副经理。2005年9月起任职于建信基金管理公司,历任董事办秘书兼综合管理部副经理、投资管理部副经理、专户投资部总监和公司首席战略师。2013年8月至今,任公司人力资源部副经理兼基金管理部副经理,并于2015年8月6日起任建信基金管理公司副经理。

##### 4.督察长

吴曙明先生,督察长。1992年毕业于中南工业大学管理系,获学士学位;1999年毕业于财政部财政科学研究所,获经济学硕士学位。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作;1999年7月加入中国建设银行总行,先后在营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务,曾任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职。2006年3月加入建信基金管理公司,担任监事会秘书兼综合管理部副经理。2015年8月6日起任建信基金管理公司督察长。

##### 5.本基金基金经理

叶乐夫先生,硕士。曾就职于中国国际金融有限公司,先后担任市场风险分析员,量化分析经理,从事风险管理、量化研究与投资;2011年9月加入我公司,担任基金经理助理。2012年3月21日起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3月28日起任建信央视财经50指数分级开放式证券投资基金的基金经理;2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金基金经理;2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金基金经理。

##### 6.基金经理助理

梁洪均先生,2010年5月28日至2012年5月28日。  
叶乐夫先生,2012年5月21日至今。

##### 6.投资决策委员会成员

孙志毅先生,总裁  
梁洪均先生,总裁、量化及指数投资部总经理。  
钟敏女士,固定收益投资部首席固定收益投资官。  
李辉,固定收益投资部副经理  
姚婉璐女士,权益投资部副经理兼策略部首席策略分析师。  
顾中汉先生,权益投资部副经理。  
许杰先生,权益投资部副经理。

##### 7.上述人员之间均不存在亲属关系。

##### 二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况  
名称:中国工商银行股份有限公司  
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号  
成立时间:1984年1月1日  
法定代表人:姜建清  
注册资本:人民币35,640,625.71万元  
联系电话:010-66105799  
联系人:洪渊  
(二)主要人员情况  
截至2015年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工205人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有本科及以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级职称。

作为中国最大托管服务提供者,中国工商银行自1998年在国内率先提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企事业单位提供安全、高效、专业的托管服务,展现优良的市場形象和影响力,建立了国内托管银行中最早、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QDII资产、QFII资产、股权投资基金、证券组合资产管理等多种基金托管业务,并为客户提供全方位、个性化的托管服务。截至2015年9月,中国工商银行托管证券投资基金496只,自2003年以来,连续十一年获得香港《亚洲货币》、美国《全球托管》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威媒体评选的49项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的认可和广泛好评。

##### 三、相关服务机构

###### (一)基金份额发售机构

1.中国工商银行(简称“一级交易商”)

(1)国泰君安证券股份有限公司

## 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

二〇一六年一月

2016年第1号

### 七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票,一级市场新发股票、债券,权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

### 八、基金的投资策略

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。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。

本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票投资组合,但在特殊情况下,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数的成份股票进行替换,这些情况包括但不限于以下情形:(1)法律法规的限制;(2)标的指数成份股流动性严重不足;(3)标的指数的成份股流动性长期停滞;(4)其他合理原因导致本基金管理人无法对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常市场情况下,本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使得基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不得超过2%。如出现指数编制机构调仓等特殊原因导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施跟踪偏离度,跟踪误差进一步扩大。

1.股票资产组合日常管理  
(1)投资组合的建立  
基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、确定建仓策略和组合调整。

(2)确定建仓策略:根据复制标的指数成份及其权重的方法确定目标组合;  
(3)组合调整:根据目标组合,在合理时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

(1)投资组合日常管理  
1)根据标的指数构成及权重,结合基金当前持有的证券组合及其比例,制作下一交易日基金的申购赎回清单并公告;  
2)将基金持有的证券组合构成与标的指数进行比较,制定目标组合构成及权重,确定合理的交易策略;

(3)替代投资策略,以实现基金最佳组合结构。  
(3)标的指数的成份股票定期调整  
根据标的指数的编制规则及调整公告,在指数成份股票调整生效前,分析并确定组合调整策略,及时进行投资组合的优化调整,减少流动性冲击,尽量减小标的指数的成份变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

(4)成份股公司信息的日常跟踪与分析  
跟踪标的指数成份公司信息(如:股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等)以及成份股公司其他重大信息,分析这些信息对指数的影响,并据此确定基金的申购赎回清单以及基金的每日交易策略。

(5)标的指数的成份股票临时调整  
在标的指数成份股票调整周期内,若出现成份股票临时调整的情形,本基金管理人将密切关注目标股票的调整,并及时制定相应的投资组合调整策略。

(6)申购赎回情况的跟踪与分析  
跟踪基金申购赎回信息,结合基金的资金头寸管理,分析其对组合的影响,制定交易策略以应对基金的申购赎回。  
(7)替代投资  
(11)申购赎回:若存在投资受限、严重的流动性困难、财务风险较大、面临重大不利的司法诉讼或者有充分合理的理由认为其被市场操纵等情形时,本基金可以不投资该成份股,而用备选股、替代现金来代替,或选择与其他行业相近、定价特征类似或收益率相关性较高的其他股票来代替,采用“替代投资策略”时,采用替代投资策略的原则是使得本基金投资组合对标的指数的跟踪误差最小化,以利于本基金投资目标的实现。

(8)跟踪偏离度的监控与管理  
基金经理每日跟踪基金组合与标的指数的表现偏离度。每月末、季末不定期分析基金的实际情况与标的指数的表现偏离度,跟踪误差变化情况及原因,实时监控跟踪标的指数成份股的价格波动,调整组合品种,缩减跟踪偏差。当总体跟踪偏差允许的范围以下时,原则上不调整组合。每进行一次组合、总体跟踪误差超标将“预警”重新计算。

本基金的主要目标不是超越指数,而是取致与指数涨跌基本一致的收益。因此,评判本基金的表现,主要是看基金收益与标的指数的偏离度,偏离度越小,基金表现越好。而跟踪偏离度和跟踪误差衡量基金收益与标的指数的收益偏离度的重要指标。

2.其他基金的投资策略  
基于流动性管理的需要,本基金可以投资于期限在一年期以内的政府债券、央行票据和政策性金融债。债券投资的目标是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

在法律法规范围内,本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对投资组合进行管理,以调整投资组合、管理基金投资组合风险、降低其成本,提高本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的,不得用于投机交易目的,或作为杠杆工具放大基金的投资。本基金投资于各种衍生工具的比例不得超过基金资产净值的10%。

九、基金的业绩比较基准  
本基金标的指数的为:上证社会责任指数。

本基金的风险收益特征  
本基金属于股票基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为主动型基金,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。

十一、基金投资组合报告  
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  
报告期末投资组合情况

11.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.18 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.19 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.20 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.21 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.23 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.24 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.25 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.26 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.27 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.28 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.29 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.30 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.31 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.32 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.33 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.34 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.35 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.36 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.37 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.38 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.39 报告期末按行业分类的股票投资组合

基金本报告期末未投资股指期货。  
11.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
(1)本期国债期货投资政策  
本基金报告期内未投资于国债期货。  
(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
(3)本期国债期货投资评价  
本基金本报告期末未投资国债期货。

11.11 投资组合报告附注  
11.11.1 本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中,中国工商银行股份有限公司(600030)于2015年1月19日发布公告:2015年1月16日发布后,中国证监会在例行新闻发布会上,通报证券公司融资融券业务检查情况,提及本公司等3家证券公司存在存贷分期融资业务合规问题,对本公司等3家证券公司采取暂停开展融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。2015年1月16日17时,本公司网站网络暂时瘫痪,上述处罚。

11.11.2 本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 其他各项资产构成

11.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金报告期内未持有处于转股期的可转换债券。  
11.11.5 报告期末前十名(前五名)股票存在流通受限情况的说明  
11.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。  
11.11.5.2 期末非指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末非指数投资前五名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的费用  
基金业绩截止日为2015年9月30日。  
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财产,但不保证基金一定盈利,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仔细阅读阅读本基金的招募说明书。  
本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金业绩截止日为2015年9月30日。  
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财产,但不保证基金一定盈利,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仔细阅读阅读本基金的招募说明书。  
本报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较