

# 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招募说明书（更新） 摘要

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

二〇一八年一月

## 【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，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

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，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为上证社会责任 ETF 的联接基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合基金、债券型基金和货币市场基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 11 月 27 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币 2 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：中国建设银行股份有限公司，65%；美国信安金融服务公司，25%；中国华电集团资本控股有限公司，10%。

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构，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。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者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，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由 9 名董事组成，其中 3 名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，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，高级经济师，享受国务院特殊津贴，中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章获得者。1983年毕业于辽宁财经学院基建财务与信用专业，获学士学位。历任中国建设银行筹资储备部副主任，零售业务部副总经理，个人银行部副总经理，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，个人金融部总经理，2006年5月起任中国建设银行河南省分行行长，2011年3月出任中国建设银行批发业务总监，2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

孙志晨先生，董事，现任建信基金管理有限责任公司总裁，兼建信资本管理公司董事长。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业务部副总经理。

曹伟先生，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生，董事，现任信安北亚地区总裁。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工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长，新加坡电信国际有限公司业务发展总监，信诚基金公司首席运营官和代总经理，英国保诚集团（马来西亚）资产管理公司首席执行官，宏利金融全球副总裁，宏利资产管理公司（台湾）首席执行官和执行董事，信安北亚地区副总裁

郑树明先生，董事，现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席营运官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理，新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长，爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监。

华淑蕊女士，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学，获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者，湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监，锦辉控股集团有限公司副总裁、锦辉精细化工有限公司总经理，吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理、财富管理总监兼理财中心总经理、副总经理，光大证券财富管理中心总经理（MD）。

李全先生，独立董事，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财政金融学院，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。

王建国先生，独立董事，曾任大新人寿保险有限公司首席行政员，中银保诚退休金信托管理有限公司董事，英国保诚保险有限公司首席行政员，美国国际保险集团亚太区资深副总裁，美国友邦保险（加拿大）有限公司总裁兼首席行政员等。1989年获PacificSouthernUniversity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研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

## 2、监事会成员

张军红先生，监事会主席。毕业于国家行政学院行政管理专业，获博士研究生学位。历任中国建设银行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员；零售业务部主任科员；个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理；行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理；投资托管服务部总经理助理、副总经理；投资托管业务部副总经理；资产托管业务部副总经理。2017年3月起任公司监事会主席。

方蓉敏女士，监事，现任信安国际（亚洲）有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。方女士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责任公司机构与战略研究部总经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士，2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司，中进会计师事务所，中瑞华恒信会计师事务所，中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、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经理。

严冰女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司人力资源部总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理

专业，获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005年8月加入建信基金管理公司，历任人力资源管理专员、主管、部门总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司内控合规部副总经理兼内控合规部审计部（二级部）总经理，英国特许公认会计师公会（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内控合规部。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司信息技术总监兼信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用系，获得学士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术部，中国建设银行信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长，建信基金管理公司基金运营部总经理助理、副总经理，信息技术部执行总经理、总经理。

### 3、公司高管人员

孙志晨先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

曲寅军先生，副总裁，硕士。1999年7月加入中国建设银行总行，历任审计部科员、副主任科员、团委主任科员、重组改制办公室高级副经理、行长办公室高级副经理；2005年9月起就职于建信基金管理公司，历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和首席战略官；2013年8月至2015年7月，任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理。2015年8月6日起任我公司副总裁，并专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理。

张威威先生，副总裁，硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行，从事个人零售业务，2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部，从事证券投资基金销售业务，任高级副经理；2005年9月加入建信基金管理公司，一直从事基金销售管理工作，历任市场营销部副总监（主持工作）、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任我公司副总裁。

吴曙明先生，副总裁，硕士。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，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006年3月加入我公司，担任董事会秘书，并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长，2016年12月23日起任我公司副总裁。

吴灵玲女士，副总裁，硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作；2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部，历任副主任科员、业务经理、高级经理助理；2005年9月加入建信基金管理公司，历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

### 4、督察长

吴曙明先生，督察长（简历参见公司高级管理人员）

### 5、本基金基金经理

薛玲女士，博士。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院农电配电研究所工作，任项目经理；2010年1月至2013年4月在路通世纪公司亚洲数据收集部门工作，任高级软件工程师；2013年4月至2015年8月在中国中投证券基金公司工作，历任研究员、投资经理；2015年9月加入我公司金融工程及指数投资部，任基金经理助理，2016年7月4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；2017年5月27日起任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017年9月13日起任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理；2017年9月28日起任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理。

本基金历任基金经理：

梁洪昀先生：2010年5月28日至2012年5月28日。

叶乐天先生：2012年3月21日至2016年7月20日。

薛玲女士：2016年7月4日至今。

### 6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总裁。

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。

钟敬棣先生，固定收益投资部首席固定收益投资官。

李菁女士，固定收益投资部总经理。

姚锦女士，权益投资部总经理。

许杰先生，权益投资部副总经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 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：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2017 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 218 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，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业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、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、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 745 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 54 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持续认可和广泛好评。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。

##### （1）直销柜台

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

法定代表人：许会斌

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

##### （2）网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址：[www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)。

#### 2、代销机构

##### （1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼（长安兴融中心）

法定代表人：田国立

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客服电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

（3）中国农业银行

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

公司网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

（4）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

（5）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

网址：[www.95559.com.cn](http://www.95559.com.cn)

（6）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555

传真：0755-83195049

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

（7）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

（8）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(9) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

客户客服电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

(10) 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

客服电话：95541

网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

(11) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006788887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)，[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(12) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：400-076-6123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(13) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(14) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客户服务电话：400-181-8188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(15) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

网址：[www.Licaike.com](http://www.Licaike.com)

(16) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：400-877-3772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(17) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

客户服务电话：400-818-8866

网址：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

(18) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人：梁越

客户服务电话：400-786-8868

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(19) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

法定代表人：张晶

客户服务电话：400-820-2819

网址：[www.chinapnr.com](http://www.chinapnr.com)

(20) 北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：梁洪军

客户服务电话：400-819-6665

网址：[www.buyforyou.com.cn](http://www.buyforyou.com.cn)

(21) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(22) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-821-9031

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(23) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：胡伟

客户服务电话：400-618-0707

网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

(24) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位

法定代表人：刘鹏宇

客户服务电话：0755-83999913

网址：[www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(25) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)



(26) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人: TANYIKKUAN

客户服务热线: 400-684-0500

网址: [www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(27) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人: 王伟刚

客户服务热线: 010-56282140

网址: [www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

(28) 天津国美基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层

法定代表人: 丁东华

客户服务热线: 400-111-0889

网址: [www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

(29) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人: 李兴春

客户服务热线: 400-921-7755

网址: [www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

(30) 上海万得基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

法定代表人: 王廷富

客户服务热线: 400-821-0203

网址: [www.windmoney.com.cn](http://www.windmoney.com.cn)

(31) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

法定代表人: 张彦

客户服务热线: 400-166-1188

网址: [www.jrj.com.cn](http://www.jrj.com.cn)

(32) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址: 南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

法定代表人: 袁顾明

客户服务热线: 400-928-2266

网址: [www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

(33) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

地址: 北京市朝阳区建国门外大街19号国际大厦A座1504/1505室。

法定代表人: 张冠宇

客户服务热线: 400-819-9868

网址: [www.tdyhfund.com](http://www.tdyhfund.com)

(34) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人: 钟斐斐

客户服务热线: 4000-618518400-817-5666010-



网址：[danjuanapp.com](http://danjuanapp.com)

(35) 上海长量基金销售投资顾问有限公司地址：上海浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层电话：400-820-2899 网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(36) 中信期货有限公司地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层法定代表人：张皓客服电话：400-990-8826 网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

#### (二) 注册登记机构

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

法定代表人：许会斌

联系人：郑文广

电话：010-66228888

#### (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：北京德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010-66575888

传真：010-65232181

经办律师：徐建军、刘焕志

#### (四) 审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：许康玮、陈熹

#### 四、基金的名称

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。

#### 五、基金的类型

ETF 联接基金。

#### 六、基金的投资目标

通过将绝大部分基金财产投资于上证社会责任 ETF，密切跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

#### 七、基金的投资方向

本基金以上证社会责任 ETF、上证社会责任指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于上证社会责任 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

#### 八、基金的投资策略

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 以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证社会责任 ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：在正常情况下，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### （一）资产配置策略

本基金主要投资于上证社会责任 ETF、上证社会责任指数成份股和备选成份股，采取自上而下的资产配置策略，保留现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，然后通过一级市场将剩余的大部分资产投资于上证社会责任 ETF 并使该投资比例不低于基金资产净值的 90%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

#### （二）目标 ETF 投资策略

##### 1、基金组合的构建原则

本基金对基金的投资仅限于指定的目标 ETF，现时目标 ETF 仅指上证社会责任 ETF。

##### 2、基金组合的构建方法

本基金可以以成份股实物形式在一级市场申购及赎回上证社会责任 ETF 基金份额；本基金可在二级市场上买卖上证社会责任 ETF 基金份额，本基金在二级市场上买卖上证社会责任 ETF 基金份额是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。

本基金作为上证社会责任 ETF 的联接基金，主要通过成份股实物形式从一级市场申购 ETF 份额来构建 ETF 投资组合。不足一级市场最小申购赎回单位资产净值的部分可以从二级市场买入 ETF 份额或者投资于上证社会责任指数的成份股和备选成份股等。本基金在二级市场的 ETF 份额投资将不以套利为目的，作为被动投资的开放式基金，套利不符合本基金的投资特点和运作目的。

##### 3、基金组合的调整

本基金为 ETF 联接基金，基金所构建的 ETF 投资组合将根据目标 ETF 的变动而发生相应变化。本基金将根据法律法规中的投资比例限制、申购和赎回情况、现金头寸，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

#### （三）成份股投资策略

##### 1、股票组合的构建原则

成份股组合的构建主要是基金经理根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，以抽样复制法构建组合。

##### 2、股票组合的构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化进行上证社会责任指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用抽样复制基准指数的方法，在综合考虑个股的市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证社会责任指数的相关性等因素的基础上，采用重点抽样的方法，选择上证社会责任指数的成份股构建股票投资组合。考虑到个股集中度因素，本基金主要投资于上证社会责任指数的前 5 大成份股，按照其在社会责任指数的原有比例分配权重后构成抽样组合。

##### 3、股票组合的调整

###### （1）定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的上证社会责任指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

###### （2）不定期调整

基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

对个别成份股，若其存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大不利的司法诉讼、或者有充分而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、甚至现金来代替。

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购。

#### （四）债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性和有效利用基金资产。

通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融

债、短期金融工具等产品的比例。并灵活地采用收益率曲线方法、市场和品种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合。力求这些有效的固定收益类证券组合，在一定的风险度下能提供最大的预期收益，或者在确定收益率上承担最小的风险。

#### （五）其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。本基金的基金管理人运用上述金融衍生工具必须是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。

#### （六）跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金跟踪误差的来源包括：留存现金及债券部分、成份股和各选成份股的投资、基金每日现金流入或流出的建仓或变现策略、股息的再投资策略等。基金管理人将通过对上述因素的有效管理，追求跟踪误差最小化。本基金每日跟踪基金组合与业绩比较基准表现的偏离度，每月末定期分析基金组合与业绩比较基准表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

#### 九、投资业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：95%上证社会责任指数收益率+5%商业银行税后活期存款利率。

#### 十、基金的风险收益特征

本基金为上证社会责任ETF的联接基金，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。

#### 十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月20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、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2017年9月30日，本报告中的财务资料未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 1,950,761.03 1.65

其中：股票 1,950,761.03 1.65

2 基金投资 109,018,000.00 92.14

3 固定收益投资 5,806,618.00 4.91

其中：债券 5,806,618.00 4.91

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 1,413,533.50 1.19

8 其他各项资产 124,288.98 0.11

9 合计 118,313,201.51 100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### （1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业 --

B 采矿业 25,468.00 0.02

C 制造业 376,099.80 0.32

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 21,255.00 0.02

E 建筑业 193,607.20 0.16  
 F 批发和零售业 67,912.60 0.06  
 G 交通运输、仓储和邮政业 27,791.35 0.02  
 H 住宿和餐饮业 --  
 I 信息传输、软件和信息技术服务业 57,156.00 0.05  
 J 金融业 1,061,819.28 0.90  
 K 房地产业 104,635.80 0.09  
 L 租赁和商务服务业 4,286.00 0.00  
 M 科学研究和技术服务业 6,306.00 0.01  
 N 水利、环境和公共设施管理业 --  
 O 居民服务、修理和其他服务业 --  
 P 教育 --  
 Q 卫生和社会工作 --  
 R 文化、体育和娱乐业 4,424.00 0.00  
 S 综合 --  
 合计 1,950,761.03 1.66

以上行业分类以 2017 年 9 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

3、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

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 601318 中国平安 6,000 324,960.00 0.28  
 2 600036 招商银行 5,500 140,525.00 0.12  
 3 601166 兴业银行 6,700 115,843.00 0.10  
 4 600016 民生银行 12,700 101,854.00 0.09  
 5 601328 交通银行 15,000 94,800.00 0.08  
 6 600000 浦发银行 6,064 78,043.68 0.07  
 7 601668 中国建筑 8,200 76,096.00 0.06  
 8 601601 中国太保 1,700 62,781.00 0.05  
 9 600104 上汽集团 2,000 60,380.00 0.05  
 10 600048 保利地产 3,700 38,480.00 0.03

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 5,806,618.00 4.94  
 2 央行票据 --  
 3 金融债券 --  
 其中：政策性金融债 --  
 4 企业债券 --  
 5 企业短期融资券 --  
 6 中期票据 --  
 7 可转债(可交换债) --  
 8 同业存单 --  
 9 其他 --  
 10 合计 5,806,618.00 4.94

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 019563 17 国债 09 48,000 4,797,600.00 4.08

2 019571 17 国债 17 10,000 999,000.00 0.85

3 019117 11 国债 17 100 10,018.00 0.01

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、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基金投资明细

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 上证社会责任 ETF 股票型 交易型开放式指数基金 建信基金管理有限责任公司 109,018,000.00 92.66

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

11、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。

12、投资组合报告附注

(1) 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(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。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 3,562.72

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 71,137.24

5 应收申购款 49,589.02

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 124,288.98

(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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2017 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。

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比较

阶段 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 — —

2010 年 5 月 28 日至 2010 年 12 月 31 日 7.60% 1.21% 5.72% 1.49% 1.88% -0.28%

2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 -17.57% 1.27% -17.86% 1.28% 0.29% -0.01%

2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 14.21% 1.21% 12.83% 1.22% 1.38% -0.01%

2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 -7.60% 1.50% -9.42% 1.51% 1.82% -0.01%

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 60.59% 1.27% 57.91% 1.28% 2.68% -0.01%

2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 2.36%

2.34%

2.16%

2.39%

0.20%

-0.05%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 -4.92% 1.21% -5.59% 1.23% 0.67% -0.02%

2017 年 1 月 1 日-2017 年 9 月 30 日

17.88%

0.65%

14.88%

0.66%

3.00%

-0.01%

自基金合同生效之日 2010 年 5 月 28 日至 2017 年 9 月 30 日

72.44%

1.43%

55.29%

1.47%

17.15%

-0.04%

## 十三、基金的费用概览

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1、基金费用的种类

(1) 基金管理人的管理费；

(2) 基金托管人的托管费；

(3) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

(4) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；

(5) 基金份额持有人大会费用；

(6) 基金的证券交易费用；

(7) 基金的银行汇划费用；

(8) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## 2、基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提基金管理费。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### (2) 基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提基金托管费。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费率、基金托管费率，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须最迟于新的费率实施前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

本条第 1 款第 (3) 至第 (8) 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

本条第 1 款第 (3) 至第 (8) 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## (二) 基金销售时发生的费用

### 1、申购费

本基金对申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过 1.5%：

申购金额 (M) 申购费率

M < 100 万元 1.5%

100 万元 ≤ M < 500 万元 0.7%

M ≥ 500 万元 1000 元/笔

申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费用用于本基金的市场推广、注册登记和销售。

### 2、赎回费

持有期限 (Y) 赎回费率

持有期 < 1 年 0.5%



1年≤持有期<2年 0.3%

持有期≥2年 0%

赎回费用由赎回人承担，赎回费中 25%归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

（注：1年指 365 天）

### 3、基金转换

（1）基金转换是指本公司旗下的开放式基金持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为本公司管理的其他开放式基金的份额。

#### （2）基金转换业务规则

1) 本基金管理人旗下基金办理日常转换的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日（本基金管理人公告暂停申购或转换时除外）。

由于各基金销售机构系统及业务安排等原因，各销售机构办理基金转换业务的具体时间段及其他有关信息等事项，请以各销售机构的规定为准。

2) 基金转换只能在同一销售机构进行。

3) 转入的基金份额持有期自该部分基金份额登记于注册登记系统之日起开始计算。转入的基金在赎回或转出时，按照自基金转入确认日起至该部分基金份额赎回或转出确认日止的持有时段所适用的赎回费率档次计算其所应支付的赎回费。基金转换后可赎回的时间为 T+2 日。

4) 基金转换，以申请当日基金份额净值为基础计算。投资者采用份额转换的原则提交申请。基金转换遵循先进先出的原则。

5) 投资者办理基金转换业务时，转出的基金必须处于可赎回状态，转入的基金必须处于可申购状态，已冻结的基金份额不得申请基金转换。

6) 单笔转换基金份额不得低于 10 份。

#### （3）基金转换费用

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和转出基金的赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担，如转出基金有赎回费用的，收取该基金赎回费的 25% 归入基金财产。

基金转换费用的具体计算公式如下：

1) 转出金额=转出基金份额转出基金当日基金份额净值

2) 转入金额：

A.如果转入基金的申购费率>转出基金的申购费率，

转入金额=转出金额（1-转出基金赎回费率）/（1+转入基金申购费率-转出基金申购费率）

B.如果转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率，

转入金额=转出金额（1-转出基金赎回费率）

3) 转换费用=转出金额-转入金额

4) 转入份额=转入金额/转入基金当日基金份额净值

本基金自 2010 年 7 月 19 日开始办理基金转换业务。

4、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告。

#### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

十四、对招募说明书更新部分的说明

- 1、更新了第三部分：基金托管人的相关信息；
- 2、更新了第四部分：基金托管人的基本情况及基金托管业务经营情况；
- 3、更新了第五部分：相关服务机构中代销机构的相关变动信息；
- 4、更新了第九部分：基金的投资的基金投资组合报告，并经基金托管人复核；
- 5、更新了第十部分：基金的业绩，并经基金托管人复核；
- 6、更新了第二十二部分：其他应披露事项，添加了期间涉及本基金和基金管理人的相关临时公告。

上述内容仅为本招募说明书（更新）摘要，投资人欲查询本更新招募说明书正文，可登陆基金管理人网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)。

建信基金管理有限责任公司

二〇一八年一月五日