

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 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

报告送出日期：2019 年 10 月 22 日

§ 1 重要提示

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 2019 年 10 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 责任 ETF |
| 场内简称 | 责任 ETF |
| 基金主代码 | 510090 |
| 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 | 66,581,114.00 份 |
| 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股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。 |
| 业绩比较基准 | 上证社会责任指数。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票指数型基金，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。 |
| 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 |

§ 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（2019年7月1日-2019年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 10,714,966.74 |
| 2. 本期利润 | 883,914.23 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0153 |
| 4. 期末基金资产净值 | 119,126,377.84 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.7892 |

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要低于所列数字。

3.2 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比较

| 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 | 1.17% | 0.98% | -3.29% | 0.96% | 4.46% | 0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

责任ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 薛玲 | 本基金的基金经理 | 2016年7月4日 | - | 6年 | 薛玲女士，金融工程及指数投资部总经理助理，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，历任基金经理助理、基金经理，2018年5月起兼任部门总经理助理，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日至2018年4月25日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；2017年12月20日起任建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017年12月22日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018年3月5日起任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2018年10月25日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018年12月13日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人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%的情况有1次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内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规定，采取了对指数的被动复制策略，将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内，本基金跟踪误差主要来自于所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。权重结构上的差异主要源自以下四个部分：第一，股票数量的舍入取整；第二，适当提高小权重股票便于提高基金可供申赎的篮子个数；第三，参与新股申购；第四，部分股票停牌导致无法交易。本基金管理人在量化分析基础上，采取了适当的组合调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率1.17%，波动率0.98%，业绩比较基准收益率-3.29%，波动率0.96%。

§ 5 投资组合报告

5.1 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 | 117,411,762.17 | 98.18 |
| | 其中：股票 | 117,411,762.17 | 98.18 |
| 2 | 基金投资 | - | 0.00 |
| 3 | 固定收益投资 | - | 0.00 |
| | 其中：债券 | - | 0.00 |
| | 资产支持证券 | - | 0.00 |
| 4 | 贵金属投资 | - | 0.00 |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | 0.00 |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | 0.00 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | 0.00 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,880,083.80 | 1.57 |
| 8 | 其他资产 | 296,826.30 | 0.25 |
| 9 | 合计 | 119,588,672.27 | 100.00 |

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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 | - | 0.00 |
| B | 采矿业 | 2,261,615.22 | 1.90 |
| C | 制造业 | 22,442,231.13 | 18.84 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,154,780.07 | 0.97 |
| E | 建筑业 | 8,685,940.86 | 7.29 |
| F | 批发和零售业 | 2,613,041.00 | 2.19 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,971,267.50 | 2.49 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,801,252.59 | 4.87 |
| J | 金融业 | 65,066,771.30 | 54.62 |
| K | 房地产业 | 5,571,730.44 | 4.68 |
| L | 租赁和商务服务业 | 213,110.43 | 0.18 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 126,394.84 | 0.11 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | 0.00 |
| P | 教育 | - | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 258,588.00 | 0.22 |
| S | 综合 | - | 0.00 |
| | 合计 | 117,166,723.38 | 98.35 |

注：以上行业分类以2019年9月30日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末积极投资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 | - | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | 0.00 |
| C | 制造业 | 21,942.24 | 0.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | 0.00 |
| E | 建筑业 | - | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | - | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 223,129.40 | 0.19 |
| J | 金融业 | - | 0.00 |
| K | 房地产业 | - | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | 0.00 |
| P | 教育 | - | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | 0.00 |
| S | 综合 | - | 0.00 |
| | 合计 | 245,071.64 | 0.21 |

注：以上行业分类以2019年9月30日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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

5.3.1 报告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

| 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 | 313,600 | 27,295,744.00 | 22.91 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 284,230 | 9,876,992.50 | 8.29 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 386,675 | 6,778,412.75 | 5.69 |
| 4 | 601328 | 交通银行 | 816,853 | 4,451,848.85 | 3.74 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 349,669 | 4,140,080.96 | 3.48 |
| 6 | 601668 | 中国建筑 | 624,570 | 3,391,415.10 | 2.85 |
| 7 | 601601 | 中国太保 | 93,625 | 3,264,703.75 | 2.74 |
| 8 | 600048 | 保利地产 | 212,271 | 3,035,475.30 | 2.55 |
| 9 | 600104 | 上汽集团 | 104,068 | 2,474,737.04 | 2.08 |
| 10 | 600309 | 万华化学 | 46,074 | 2,034,167.10 | 1.71 |

5.3.2 报告期末积极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

| 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 | 688368 | 晶丰明源 | 2,557 | 144,930.76 | 0.12 |
| 2 | 603927 | 中科软 | 884 | 78,198.64 | 0.07 |
| 3 | 603786 | 科博达 | 816 | 21,942.24 | 0.02 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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

名债券投资明细

无。

5.6 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资产支持证券投资明细

无。

5.7 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

无。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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，上海浦东发展银行股份有限公司（600000）于 2019 年 10 月 14 日发布公告，中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）对公司成都分行授信业务及整改情况严重失察、重大审计发现未向监管部门报告、轮岗制度执行不力的违规行为依法查处，执行罚款 130 万元人民币（银保监罚决字【2019】7 号）。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,482.84 |
| 2 | 应收证券清算款 | 294,071.52 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 271.94 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 296,826.30 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 公司名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 688368 | 晶丰明源 | 144,930.76 | 0.12 | 新发未上市 |
| 2 | 603786 | 科博达 | 21,942.24 | 0.02 | 新发未上市 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 58,081,114.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 35,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 26,500,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 66,581,114.00 |

§ 7 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份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|-------------------------------------|---------------|---------------|--------------|---------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 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 | 1 | 2019 年 07 月 01 日 - 2019 年 09 月 30 日 | 56,000,000.00 | 12,500,000.00 | 3,500,000.00 | 65,000,000.00 | 97.63 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20% 的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。 | | | | | | | |

注：本基金本报告期申购、赎回份额中包含了买入、卖出份额。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金募集设立的文件；
- 2、《上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《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》；
- 4、《上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2019 年 10 月 22 日