

# 上证社会责任交易型开放式指数证券投资 基金 2016 年第 1 季度报告

2016 年 3 月 31 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：2016 年 4 月 20 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 2016 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 2016 年 1 月 1 日起至 3 月 31 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
交易代码	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	89,081,114.00 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（2016年1月1日—2016年3月31日）
1. 本期已实现收益	-208,386.03
2. 本期利润	-15,404,073.90
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1729
4. 期末基金资产净值	106,647,342.70
5. 期末基金份额净值	1.1972

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。

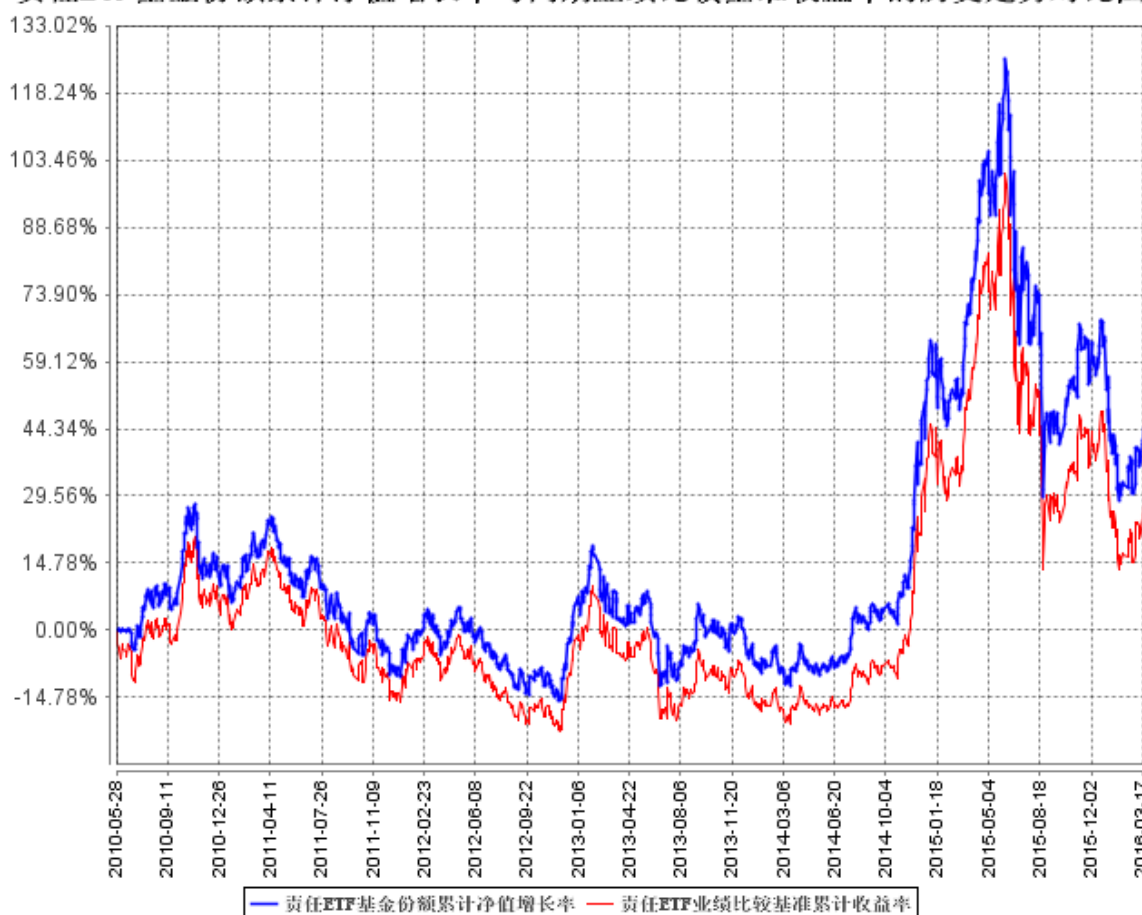
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-12.62%	2.22%	-12.48%	2.23%	-0.14%	-0.01%

### 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基金份额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，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## §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		
叶乐天	本基金的基金经理	2012年3月21日	-	7	硕士。曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、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

					<p>3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理；</p> <p>2014 年 1 月 27 日起任中证 500 指数增强基金经理；</p> <p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《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 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 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基金净值保留位数有限造成的舍入误差以及所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。权重结构上的差异源自部分股票由于舍入取整等原因，

申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比有所变化。同时指数成份股的大比例分红在给基金带来超额收益的同时也很大程度上增加了基金的跟踪误差。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

本报告期基金净值增长率-12.62%，波动率 2.22%，业绩比较基准收益率-12.48%，波动率 2.23%。

### §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	106,055,164.43	98.63
	其中：股票	106,055,164.43	98.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,472,015.08	1.37
8	其他资产	1,007.19	0.00
9	合计	107,528,186.70	100.00

#### 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	-	-
B	采矿业	2,541,361.27	2.38
C	制造业	20,359,834.31	19.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,559,742.50	1.46
E	建筑业	11,405,602.33	10.69
F	批发和零售业	3,742,536.44	3.51

G	交通运输、仓储和邮政业	736,847.68	0.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,523,284.13	3.30
J	金融业	53,909,407.67	50.55
K	房地产业	7,747,467.07	7.26
L	租赁和商务服务业	529,081.03	0.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	106,055,164.43	99.44

注：以上行业分类以 2016 年 3 月 31 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

## 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	600016	民生银行	1,264,412	11,518,793.32	10.80
2	601166	兴业银行	570,675	8,862,582.75	8.31
3	600000	浦发银行	399,616	7,165,114.88	6.72
4	600036	招商银行	441,130	7,097,781.70	6.66
5	600030	中信证券	336,685	5,992,993.00	5.62
6	601328	交通银行	1,007,053	5,609,285.21	5.26
7	601668	中国建筑	641,864	3,658,624.80	3.43
8	601601	中国太保	133,925	3,512,852.75	3.29
9	600104	上汽集团	141,468	2,837,848.08	2.66
10	600048	保利地产	275,371	2,555,442.88	2.40

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.9.2 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。

### 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

本基金报告期内未投资于国债期货。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。



## 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，中信证券股份有限公司（600030）于 2015 年 1 月 19 日发布公告：2015 年 1 月 16 日收市后，中国证监会在例行的新闻发布会上，通报证券公司融资融券业务检查情况，提及本公司等 3 家证券公司由于存在为到期融资融券合约展期的问题，对本公司等 3 家证券公司采取暂停新开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 日约 17 时，本公司通过网络报道知悉上述处罚。2015 年 11 月 27 日中信证券收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书，本次调查的范围是本公司在融资融券业务开展过程中，存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”规定之嫌。

### 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	683.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	324.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,007.19

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

**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**

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

报告期期初基金份额总额	89,081,114.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	89,081,114.00

**§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**

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**§8 备查文件目录****8.1 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。

## 8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 8.3 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  
2016 年 4 月 20 日