汇添富社会责任混合型证券投资基金
2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 25 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 23 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富社会责任混合
交易代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 29 日
报告期末基金份额总额	2,532,101,827.47 份
投资目标	精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。本基金投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘积极履行社会责任的优质上市公司，以谋求基金资产稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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（ 2017 年 7 月 1 日 － 2017 年 9 月 30 日 ）
1.本期已实现收益	177,787,250.77
2.本期利润	815,358,632.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.3976
4.期末基金资产净值	5,024,313,519.56
5.期末基金份额净值	1.984

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（不含公允价值变动收益）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收益。

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。

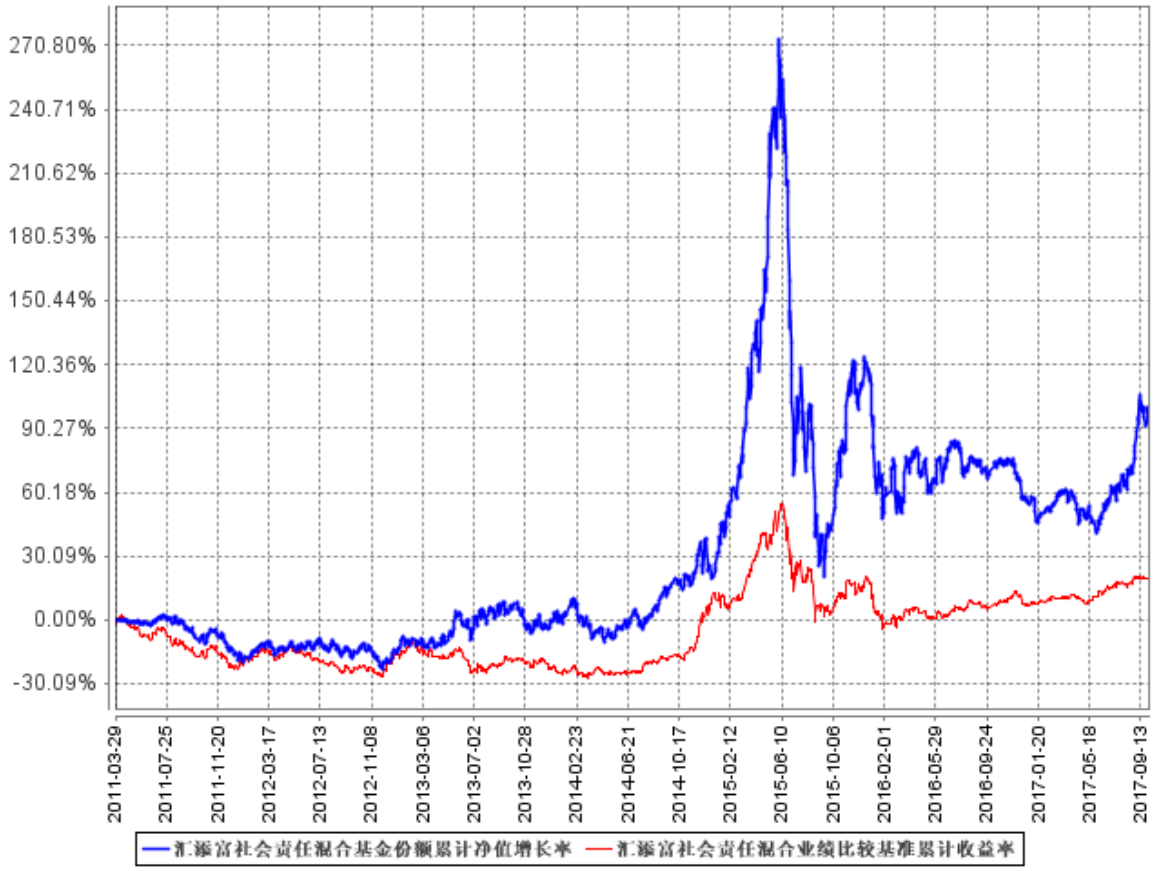
3.2 基金净值表现

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	27.10%	1.66%	3.82%	0.47%	23.28%	1.19%

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

汇添富社会责任混合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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011 年 3 月 29 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
欧阳沁春	汇添富社会责任混合基金、汇添富移动互联股票基金、汇添富全	2011 年 3 月 29 日	-	16 年	国籍：中国。学历：卫生部武汉生物制品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经

	球移动互联混合基金的基金经理，移动互联网行业投资总监。				历：曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络（百慕大）有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限公司行业研究员，2006 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任移动互联网行业投资总监，2007 年 6 月 18 日至 2012 年 3 月 2 日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，2011 年 3 月 29 日至今任汇添富社会责任混合基金的基金经理，2014 年 8 月 26 日至今任汇添富移动互联股票基金的基金经理，2017 年 1 月 25 日至今任汇添富全球移动互联混合基金的基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合未出现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总成交量 5%的情况，经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年三季度的 A 股市场迎来了不错的反弹窗口：价值股与成长股都显现了不错的投资空间，其中上证指数上涨 4.90%，深圳成指上涨 5.30%，中小板指上涨 8.86%，创业板指差强人意，微涨 2.69%。宏观经济角度方面：美国经济数据显示复苏仍在进行中，且未来有可能大幅减税，推动企业盈利进一步上升。国内社会融资与信贷增长再度超预期，M2 同比也有所回升，反应了金融对于实体的支持力度进一步加强，国内经济保持平稳增长，经济的韧性远超市场预期。风格资产继续强劲分化，强周期和新能源产业链表现相对出色，但是各个行业的细分龙头表现依然优异。

三季度社会责任基金投资依旧遵循行业相对均衡配置，个股适度集中的原则。我们一直在寻找业绩中高增点，估值相对合理或者低估的股票进行重点投资。在行业配置方面：我们以低估值蓝筹作为我们组合配置的核心标的，在另一个方面我们一直试图寻找在经济转型过程中，能够代表未来发展方向的新型产业，我们认为全球的新能源产业方兴未艾，是未来 5-8 年的投资机遇，

其产业空间巨大，而中国的部分优秀企业具备了全球竞争力，在国家战略与产业转型双重背景下，其盈利空间与盈利能力会极大的提升，因此我们适当的增加了部分新能源产业链方面特别是上游资源和具备核心竞争力的锂电设备的个股配置。在目前快速变革的社会过程中，消费者主体的口味和习惯正在发生深刻变化。我们也加大了符合中国消费变革产业的个股投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.9840 元；本报告期基金份额净值增长率为 27.10%，业绩比较基准收益率为 3.82%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	4,523,527,542.76	89.00
	其中：股票	4,523,527,542.76	89.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	82,206.66	0.00
	其中：债券	82,206.66	0.00
	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	514,937,253.42	10.13
8	其他资产	43,893,196.68	0.86
9	合计	5,082,440,199.52	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	45,809.40	0.00
B	采矿业	117,638,405.92	2.34
C	制造业	4,014,912,310.26	79.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	46,400,000.00	0.92
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	308,835,272.45	6.15
J	金融业	9,971.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	118,075.12	0.00
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	220,044.00	0.00
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	35,174,875.63	0.70
S	综合	-	-
	合计	4,523,527,542.76	90.03

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未持有港股通股票。

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

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	603799	华友钴业	5,425,109	496,234,720.23	9.88
2	002460	赣锋锂业	4,600,256	401,602,348.80	7.99
3	300450	先导智能	4,843,081	361,293,842.60	7.19
4	002466	天齐锂业	4,950,066	347,940,139.14	6.93
5	002497	雅化集团	14,014,558	258,848,886.26	5.15
6	002384	东山精密	8,128,115	233,439,462.80	4.65

7	300618	寒锐钴业	1,106,950	214,371,937.00	4.27
8	002176	江特电机	14,499,853	210,682,864.09	4.19
9	300340	科恒股份	2,996,864	193,567,445.76	3.85
10	002273	水晶光电	7,521,821	192,107,308.34	3.82

5.4 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	-	-
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）	82,206.66	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	82,206.66	0.00

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

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	110031	航信转债	420	43,755.60	0.00
2	128013	洪涛转债	380	38,451.06	0.00

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,517,651.30
2	应收证券清算款	2,997,477.69
3	应收股利	-
4	应收利息	101,439.95
5	应收申购款	39,276,627.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,893,196.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	43,755.60	0.00
2	128013	洪涛转债	38,451.06	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	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	300340	科恒股份	193,567,445.76	3.85	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,819,892,566.75
报告期期间基金总申购份额	1,143,723,044.59
减:报告期期间基金总赎回份额	431,513,783.87
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	2,532,101,827.47

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准汇添富社会责任混合型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富社会责任混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富社会责任混合型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富社会责任混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2017 年 10 月 25 日