

# 汇添富社会责任股票型证券投资基金 2011 年第 3 季度报告

2011 年 9 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 10 月 26 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 2011 年 10 月 24 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 2011 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	汇添富社会责任股票
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	3,924,348,922.52 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	本基金为股票型基金。股票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	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
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（2011年7月1日—2011年9月30日）
1. 本期已实现收益	-7,659,551.94
2. 本期利润	-305,236,914.03
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0730
4. 期末基金资产净值	3,583,166,542.16
5. 期末基金份额净值	0.913

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。

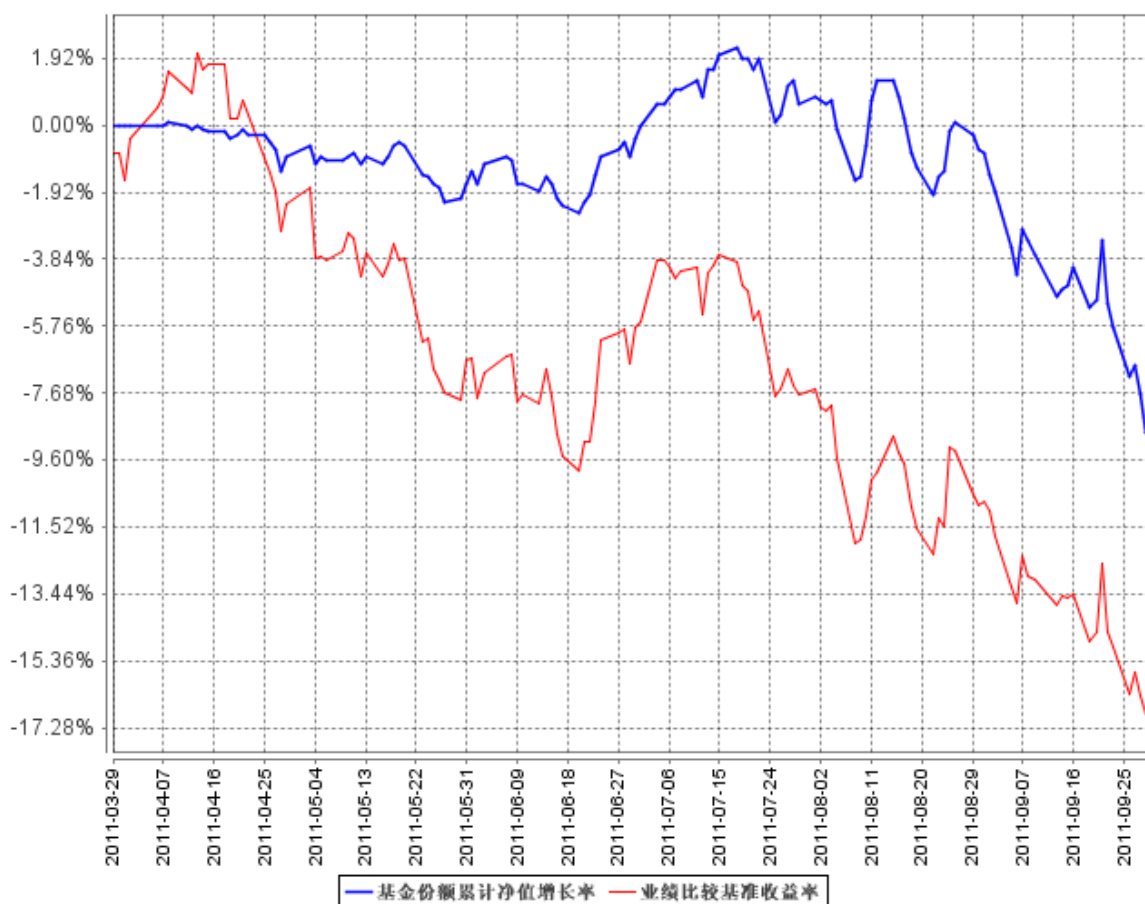
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-8.33%	0.75%	-12.15%	1.05%	3.82%	-0.30%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

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：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 3 月 29 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；本基金建仓期为自《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	本基金的基金经理，汇添富均衡增长股票型证券投资	2011年3月29日	-	10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

	基金的基金经理			<p>从业资格。从业经历：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有限公司，任高级行业分析师，2007 年 3 月 6 日至 2007 年 6 月 17 日任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理助理，2007 年 6 月 18 日至今任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，2011 年 3 月 29 日至今任汇添富社会责任股票型证券投资基金的基金经理。</p>
--	---------	--	--	---

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

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健

全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注：本基金精选积极履行社会责任，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，是专注于社会责任投资的股票型基金，截止报告期，与本基金管理人旗下其他基金风格不同。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

第三季度的 A 股市场表现持续低迷，在欧美市场大幅回落和宏观紧缩政策双重影响下，市场的估值体系逐步下移，A 股市场大幅下跌，消费品行业表现最为优异，部分股票在市场大幅下跌过程中依然取得了正向收益，前期估值过高的和基本面趋势不好的行业与公司出现了较大调整。

本季度是汇添富社会责任基金的建仓期，我们对三季度市场持谨慎态度，但由于建仓期临近结束，我们只能将股票仓位提升到了契约规定的标准之上。在行业配置方面，我们一直倾心非周期与成长性资产来降低市场风险，我们在有长期增长潜力的消费品行业进行了中长期的布局，重点选择了业绩突出、成长性好、管理层优秀的公司进行了投资，我们也选择了部分估值比较低、有一定瓶颈的资源股的投资。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度本基金收益率为-8.33%，同期业绩比较基准收益率为-12.15%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年四季度，美国经济正走在缓慢复苏的过程中，欧债危机短期会有阶段性解决方案，但是本质性问题还是无法解决。国内的通货膨胀率到顶并逐步下行，我们判断宏观政策继续收紧的空间逐渐减小，流动性最紧张的时刻已经过去。经济基本面方面，部分指标显示经济增速出现减缓迹象，当前实体经济确实有一定程度的下滑，部分企业的业绩在四季度会低于市场预期。我们认为股指下跌已经提前反应了大部分不利的因素，综合看来，我们认为市场会处于低部区域，指数波动幅度不会太大，目前更应该保持积极的心态，寻找结构性机会。

本基金在下个季度依然挑选有社会责任感的企业，结合企业的基本面，精选有企业家精神、激励机制完善、治理结构清晰、财务报表质量稳健的上市公司做中长期的布局。

## § 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	2,509,813,338.37	69.81
	其中：股票	2,509,813,338.37	69.81
2	固定收益投资	50,005,000.00	1.39
	其中：债券	50,005,000.00	1.39
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	200,400,500.60	5.57
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	830,204,324.66	23.09
6	其他资产	4,680,794.45	0.13
7	合计	3,595,103,958.08	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	392,351,173.67	10.95
C	制造业	1,463,680,091.23	40.85
C0	食品、饮料	437,193,623.02	12.20
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	199,029,389.93	5.55
C6	金属、非金属	46,314,725.00	1.29
C7	机械、设备、仪表	223,737,702.74	6.24
C8	医药、生物制品	553,610,953.86	15.45
C99	其他制造业	3,793,696.68	0.11
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	38,186,264.00	1.07

H	批发和零售贸易	293,268,705.89	8.18
I	金融、保险业	149,131,114.62	4.16
J	房地产业	15,968,825.40	0.45
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	50,116,146.08	1.40
M	综合类	107,111,017.48	2.99
	合计	2,509,813,338.37	70.04

### 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	600519	贵州茅台	1,576,166	300,401,477.94	8.38
2	600997	开滦股份	6,271,433	104,105,787.80	2.91
3	002241	歌尔声学	3,932,645	90,804,773.05	2.53
4	000501	鄂武商A	5,039,910	85,124,079.90	2.38
5	600859	王府井	2,091,074	80,506,349.00	2.25
6	600535	天士力	1,998,210	79,249,008.60	2.21
7	600887	伊利股份	4,209,391	77,031,855.30	2.15
8	601699	潞安环能	2,540,480	74,156,611.20	2.07
9	002123	荣信股份	3,499,301	69,286,159.80	1.93
10	601601	中国太保	3,739,924	69,151,194.76	1.93

### 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	50,005,000.00	1.40
	其中：政策性金融债	50,005,000.00	1.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	50,005,000.00	1.40

### 5.5 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	080416	08 农发 16	500,000	50,005,000.00	1.40
---	--------	----------	---------	---------------	------

### 5.6 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

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名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.8 投资组合报告附注

**5.8.1** 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。

**5.8.2** 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。

#### 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,307,596.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,237,647.03
5	应收申购款	135,550.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,680,794.45

#### 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	5,442,798,556.82
本报告期基金总申购份额	317,177,684.91

减:本报告期基金总赎回份额	1,835,627,319.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,924,348,922.52

## § 7 备查文件目录

### 7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富社会责任股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富社会责任股票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股票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。

### 7.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理有限公司

### 7.3 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](http://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。

汇添富基金管理有限公司  
2011 年 10 月 26 日