

汇添富社会责任股票型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告

2015 年 6 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：2015 年 7 月 18 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 2015 年 7 月 15 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 2015 年 4 月 1 日起至 6 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	1,730,080,916.07 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（2015年4月1日—2015年6月30日）
1. 本期已实现收益	423,384,051.42
2. 本期利润	654,216,457.19
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2896
4. 期末基金资产净值	4,241,342,917.02
5. 期末基金份额净值	2.452

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。

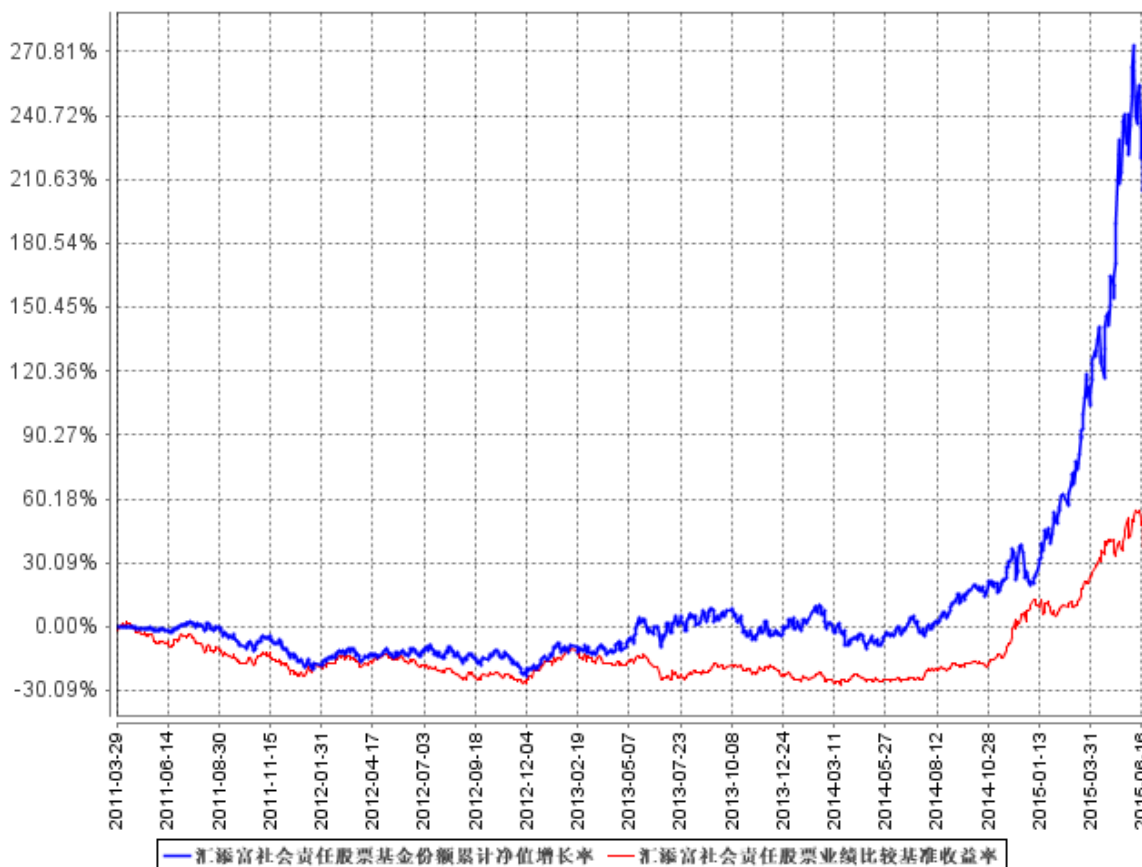
3.2 基金净值表现

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	16.60%	3.84%	9.09%	2.09%	7.51%	1.75%

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

汇添富社会责任股票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	汇添富社会责任股票基金、汇添富移动互联网股票基金的基金经理。	2014年8月26日	-	14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基金的基金经理助理，2007 年 6 月 18 日至 2012 年 3 月 2 日任汇添富均衡增长股票基金的基金经理，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。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，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%的交易次数为 1 次，是由于投资流动性的需求导致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度的 A 股市场大幅上扬：上证指数在冲高后回落，上涨 14.12%，创业板指数更是波动极大，上涨 22.42%，但是已经从高点回落 29.2%。市场表现分化十分严重：国防军工、轻工制造、传媒等行业表现居前，而非银金融、银行和有色金属等行业表现相对疲弱。

二季度我们早已认识到市场的波动性，但因本基金大额申赎较为频繁，基金仓位变化较大，难以形成比较理想仓位状态。在行业配置方面：我们继续在互联网相关的行业做了进行深耕细作，我们认为很多传统行业与互联网结合以后，能够迸发出新的生命活力，大幅提升公司的价值。因此，我们继续投资于智慧医疗、互联网电商与互联网金融。我们根据行业产业政策的变化，调整了医药行业的配置比例，重点配置了基因测序和个性化治疗的相关标的。由于本基金在报告期内赎回较多，加上市场的持续下跌，基金净值回撤较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

二季度本基金收益率 16.60%，同期业绩比较基准收益率 9.09%。

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 2015 年三季度，我们依然认为市场有结构性投资机会，经过市场的大幅调整，很多股票跌幅超过 5 成，部分股票已经凸显了投资价值：我们认为国企改革的红利有望持续推动股指、资

本市场的改革与创新也是重要推动因素、居民财富的再分配也是牛市形成的主要推动力之一。总体而言，股市在波折中不断前行，存在不少比较好的投资。我们会主要布局以下三大股票：1、低估值蓝筹股、2、真正能够穿越周期的增长确定商业模式清晰的中盘成长股。3、具备广阔成长空间的互联网的公司。

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	3,949,795,269.55	85.89
	其中：股票	3,949,795,269.55	85.89
2	固定收益投资	61,030.20	0.00
	其中：债券	61,030.20	0.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	256,737,797.70	5.58
7	其他资产	391,825,752.70	8.52
8	合计	4,598,419,850.15	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	采矿业	-	-
C	制造业	1,055,368,186.82	24.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	27,869,092.63	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	33,810,000.00	0.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,626,970,778.49	61.94

J	金融业	-	-
K	房地产业	14.43	0.00
L	租赁和商务服务业	27.32	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,881,408.00	0.04
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	69.06	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	203,895,692.80	4.81
S	综合	-	-
	合计	3,949,795,269.55	93.13

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	002175	广陆数测	6,746,499	374,430,694.50	8.83
2	002657	中科金财	3,854,716	354,710,966.32	8.36
3	300168	万达信息	6,686,018	328,417,204.16	7.74
4	300085	银之杰	4,315,046	309,518,249.58	7.30
5	300033	同花顺	3,429,734	294,922,826.66	6.95
6	600446	金证股份	1,990,355	245,729,228.30	5.79
7	600570	恒生电子	2,051,248	229,842,338.40	5.42
8	300419	浩丰科技	907,710	207,366,349.50	4.89
9	300291	华录百纳	5,399,780	203,895,692.80	4.81
10	300383	光环新网	2,653,255	193,899,875.40	4.57

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	61,030.20	0.00
8	其他	-	-
9	合计	61,030.20	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	61,030.20	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**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

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**

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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	1,668,001.04
2	应收证券清算款	376,020,412.82
3	应收股利	-
4	应收利息	70,241.63
5	应收申购款	14,067,097.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	391,825,752.70

5.11.4 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

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	300291	华录百纳	203,895,692.80	4.81	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	2,658,467,485.41
报告期期间基金总申购份额	2,878,963,332.79
减：报告期期间基金总赎回份额	3,807,349,902.13
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	1,730,080,916.07

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公司管理的基金。

§ 8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 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

8.3 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
2015 年 7 月 18 日