

汇添富社会责任股票型证券投资基金

2014] 第三季度报告

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:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明:本公司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的规定,于2014年10月22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信、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2014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
报告期末基金资产总额	792,363,46,249.00

投资目标 通过积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理团队、良好的公司治理结构、优秀的行业地位,谋取基金资产的稳健增值。

基金经理基金类型:股票型基金,其投资策略和投资风格适用于大类资产配置比例以及对股票、债券等金融工具的配置比例,并根据市场情况适时调整大类资产配置比例,以谋求基金资产的稳健增值。

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 具有较高风险、高收益特征的股票型基金。

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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期已实现收益 39,376,248.94

2.本期利润 137,087,618.88

3.加权平均基金份额本期利润 0.1451

4.期末基金资产净值 928,307,698.37

5.期末基金份额净值 1.172

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. 所列基金业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(%) 净值增长率偏离度(%) 基金期初净值 期末净值 份额变动比例(%) ①-③ ②-④

过去三个月 15.24% 1.12% 10,825% 0.72% 4.47% 0.40%

3.2.2 本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

图:本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

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起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间 证券从业年限 说明

欧阳沁春 本基金的基金经理 2011年3月29日 - 13年 国研中国, 学习、卫生和医疗卫生用品研究所在读硕士, 相关业务经历: 2000年7月至2001年6月, 在国研新经济研究所工作; 2001年6月至2002年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2002年6月至2003年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2003年6月至2004年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2004年6月至2005年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2005年6月至2006年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2006年6月至2007年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2007年6月至2008年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2008年6月至2009年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2009年6月至2010年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2010年6月至2011年6月, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验; 2011年6月至今, 在国研新经济研究所项目组, 大量基金项目经验。

注:本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遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》以及其他法律法规、证监会规定和基金合同的约定, 诚实守信、勤勉尽责地原则管理运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋取利益, 无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为, 本基金投资组合符合合同约定的比例限制。

4.3 公公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视公平交易制度的执行, 包括投资决策、研究分析、投资执行、交易监控和报告分析等环节, 在公平交易方面严格执行, 包括设立独立的研究分析平台、研究公开分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告分析等环节, 在公平交易方面严格执行。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人定期向公司合规部报告公平交易制度的执行情况。

4.3.2 公平交易行为的专项说明

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》, 公司制定了同日反向交易控制的规则, 同时加强对基金、专户、社保区间不同日期的反向交易的监控和隔离反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统, 对各组合间不同日期的反向交易进行实时监控, 并定期对组合间的同向交易分析。本报告期未发现本基金存在违反公平交易制度的行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人定期向公司合规部报告公平交易制度的执行情况。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视公平交易制度的执行, 包括投资决策、研究分析、投资执行、交易监控和报告分析等环节, 在公平交易方面严格执行, 包括设立独立的研究分析平台、研究公开分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告分析等环节, 在公平交易方面严格执行。

4.4 报告期内基金的业绩表现

三季本基业绩收益1.172%, 同期业绩比较基准收益10.825%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场走势的简要展望

展望2014年四季度, 我们相对乐观的观点: 比较宽松的流动性+上市市场的赚钱效应能够吸引增量资金

不断进入股市, 但基本面的起伏可能加大市场的波动。股市依然存在不少比较好的投资机会; 特别是经济在转轨过程中会衍生不少商业模式使得成长股的估值大幅提升, 我们会重点关注和研究这些公司的变化和持续性, 我们特别会聚焦低估值、穿越周期的真正具备成长性的个股进行中长期投资。

4.6 投资组合报告

4.6.1 本期报告期末基金资产配置情况

本基金投资于固定收益类资产的比例不高于基金资产的80%, 其他对企业的投资比例不低于企业资产的20%, 其他投资包括买入返售金融资产、股票、债券、基金、衍生品等, 其中, 买入返售金融资产占基金资产的比例不高于5%。

4.6.2 业绩比较基准

本基金为债券型基金, 属于风险较低的理财产品, 风险收益特征与货币市场基金相似。

4.6.3 风险收益特征

本基金为债券型基金, 其风险收益特征与货币市场基金相似, 高于货币市场基金, 低于股票型基金。

4.6.4 基金管理人

汇添富基金管理股份有限公司

4.6.5 基金托管人

中国建设银行股份有限公司

4.6.6 报告期末基金资产配置比例

注: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。

3.2.1 本基金报告期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(%) 净值增长率偏离度(%) 基金期初净值 期末净值 份额变动比例(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.78% 0.16% 0.70% 0.07% 5.08% 0.09%

§ 2 基金产品概况

汇添富实业债券型证券投资基金

报告送出日期:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明:本公司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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定, 于2014年10月22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信、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2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

汇添富实业债券C

报告送出日期:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明:本公司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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定, 于2014年10月22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信、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2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

汇添富实业债券C

报告送出日期:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明:本公司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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定, 于2014年10月22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信、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2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

汇添富实业债券C

报告送出日期:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明:本公司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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定, 于2014年10月22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信、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2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

汇添富实业债券C

报告送出日期:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明:本公司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。