汇添富社会责任混合型证券投资基金 2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 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

送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富社会责任混合
基金主代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 03 月 29 日
报告期末基金份额总额(份)	358,913,072.41
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。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。本基金的投资策略还包括：债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。
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	本基金是混合型基金，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		
下属分级基金的基金简称	汇添富社会责任混合 A	汇添富社会责任混合 C	汇添富社会责任混合 D
下属分级基金的交易代码	470028	015192	015193
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	354,536,267.72	4,061,012.81	315,791.88

§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(2026 年 07 月 01 日 - 2026 年 09 月 30 日)		
	汇添富社会责任混合 A	汇添富社会责任混合 C	汇添富社会责任混合 D
1.本期已实现收益	54,614,364.14	561,465.60	46,616.12
2.本期利润	-252,482,025.26	-2,470,265.43	-219,776.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.7080	-0.6129	-0.6983
4.期末基金资产净值	691,857,832.91	7,711,635.32	604,097.86
5.期末基金份额净值	1.951	1.899	1.913

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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

汇添富社会责任混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-26.54%	2.59%	-9.85%	1.03%	-16.69%	1.56%

过去六个月	4.56%	2.41%	-1.03%	1.03%	5.59%	1.38%
过去一年	3.94%	2.11%	-3.94%	0.91%	7.88%	1.20%
过去三年	41.68%	1.53%	18.37%	0.91%	23.31%	0.62%
过去五年	-19.28%	1.45%	-3.08%	0.89%	-16.20%	0.56%
过去七年	25.95%	1.43%	20.60%	0.94%	5.35%	0.49%
过去十年	14.97%	1.49%	40.77%	0.93%	-25.80%	0.56%
自基金合同生效起至今	95.10%	1.72%	52.47%	1.07%	42.63%	0.65%
汇添富社会责任混合 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-26.65%	2.58%	-9.85%	1.03%	-16.80%	1.55%
过去六个月	4.28%	2.41%	-1.03%	1.03%	5.31%	1.38%
过去一年	3.32%	2.11%	-3.94%	0.91%	7.26%	1.20%
过去三年	39.22%	1.53%	18.37%	0.91%	20.85%	0.62%
自基金合同生效起至今	-19.50%	1.47%	5.50%	0.91%	-25.00%	0.56%
汇添富社会责任混合 D						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-26.62%	2.58%	-9.85%	1.03%	-16.77%	1.55%
过去六个月	4.36%	2.41%	-1.03%	1.03%	5.39%	1.38%
过去一年	3.52%	2.11%	-3.94%	0.91%	7.46%	1.20%
过去三年	39.84%	1.53%	18.37%	0.91%	21.47%	0.62%
自基金合同生效起至今	-18.91%	1.47%	5.50%	0.91%	-24.41%	0.56%

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

汇添富社会责任混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富社会责任混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011 年 03 月 29 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2022 年 03 月 07 日新增 C、D 类份额。

§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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
詹杰	本基金的基金经理	2023 年 12 月 28 日	-	16	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾在三星综合技术研究院、阿里巴巴云计算有限公司

					从事技术研究工作。2010 年起从事证券相关工作，相继任职于华创证券、易方达基金。2015 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，任投资经理助理、投资经理、基金经理。2021 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2022 年 3 月 7 日至 2026 年 3 月 20 日任汇添富稳进双盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 6 日至 2026 年 1 月 23 日任汇添富稳健睿享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 12 日至今任汇添富高质量成长 30 一年持有期混

					合型证券投资基金的基金经理。2023年12月28日至今任汇添富社会责任混合型证券投资基金的基金经理。

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

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。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
詹杰	公募基金	3	4,196,043,780.80	2022 年 4 月 28 日
	私募资产管理计划	3	10,131,339,451.86	2024 年 8 月 22 日
	其他组合	-	-	
	合计	6	14,327,383,232.66	

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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，

力争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。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本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成交量的 5%的次数为 0。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，国内经济呈现总量温和修复，新动能强、传统内需偏弱格局，经济继续处于渐进修复通道。CPI 温和上涨，PPI 涨幅回落。消费：呈现明显分化。服务消费（文旅、餐饮）韧性较强；耐用消费品偏弱。升级类消费（美妆、通信器材）相对好于必选消费品。投资：制造业投资内部分化，AI 相关高端制造资本开支高增；地产投资仍处于调整期；基建依靠专项债、政府债发力托底，实物工作量逐步落地，对冲地产下行压力。出口：整体韧性维持，结构上，AI 硬件、新能源车、机电产品为出口主力。货币政策维持稳健偏宽松基调，保持流动性合理充裕；财政政策发力，三季度政府债供给放量，专项债加速落地，政策重心聚焦稳内需、托地产、培育新兴产业。社融总量平稳，信贷结构分化：企业中长期贷款向高端制造、科创倾斜，居民信贷修复偏弱。新产业动能（AI、高端制造）向上，传统地产链条内需偏弱。

权益市场方面，A 股整体震荡调整，风格再平衡，前期大热的高拥挤成长板块大幅回撤，红利、资源低估值板块相对抗跌甚至上涨，市场从上半年成长单边行情进入结构再平衡阶段。行业方面：资源红利板块领涨，煤炭、石油石化涨幅居前，高估值科技成长大幅回调，电子、通信、AI 硬件板块拥挤交易结构变差，引发估值杀跌；消费板块分化，必选消费防御属性凸显，可选消费跟随地产链偏弱；金融板块震荡，银行高分红防御属性较强。整体市场增量资金入场放缓，存量博弈特征明显。此外外部宏观扰动加剧，美债利率高位、美元波动，进一步压制风险偏好。

组合运作方面：三季度逐步降低高位拥挤 AI 硬件仓位，止盈部分兑现充分标的；增加医药、造船、化工等低位成长性个股，提升组合防御性；保留 AI 部分核心公司，不全面放弃成长主线。仓位：整体维持中高仓位，但降低组合集中度，均衡杠铃配置，控制单一行业上限，降低组合波动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富社会责任混合 A 类份额净值增长率为-26.54%，同期业绩比较基准收益率为-9.85%。本报告期汇添富社会责任混合 C 类份额净值增长率为-26.65%，同期业绩比较基准收益率为-9.85%。本报告期汇添富社会责任混合 D 类份额净值增长率为-26.62%，同期业绩比较基准收益率为-9.85%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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	609,039,932.57	86.61
	其中：股票	609,039,932.57	86.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,832,020.68	0.69
	其中：债券	4,832,020.68	0.69
	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	82,896,940.18	11.79
8	其他资产	6,448,361.59	0.92
9	合计	703,217,255.02	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	-	-
B	采矿业	40,262,676.00	5.75
C	制造业	519,873,867.92	74.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,899,763.00	0.56
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	662,949.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	3,760,424.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,847,426.22	0.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,376,832.00	0.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	36,134,024.43	5.16
N	水利、环境和公共设施管理业	221,970.00	0.03
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	609,039,932.57	86.98

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:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	300308	中际旭创	72,400	58,531,056.00	8.36
2	300502	新易盛	150,460	58,528,940.00	8.36

3	603259	药明康德	184,500	30,874,230.00	4.41
4	002001	新 和 成	1,031,700	26,772,615.00	3.82
5	601899	紫金矿业	831,600	24,773,364.00	3.54
6	603268	松发股份	102,700	21,942,882.00	3.13
7	002463	沪电股份	181,300	21,018,109.00	3.00
8	600276	恒瑞医药	386,200	18,228,640.00	2.60
9	002916	深南电路	46,230	17,244,252.30	2.46
10	002353	杰瑞股份	134,500	14,824,590.00	2.12

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	4,832,020.68	0.69
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-

10	其他	-	-
11	合计	4,832,020.68	0.69

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	019827	26 国债 01	27,000	2,723,373.86	0.39
2	019835	26 国债 09	21,000	2,108,646.82	0.30

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处

罚的情况。

5.11.2

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	435,383.66
2	应收证券清算款	5,917,739.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	95,238.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,448,361.59

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富社会责任混合 A	汇添富社会责任混合 C	汇添富社会责任混合 D
本报告期期初基金份额总额	362,480,523.92	2,114,047.96	317,165.83
本报告期基金总申购份额	7,934,126.15	2,447,182.93	6,523.12
减：本报告期基金总赎回份额	15,878,382.35	500,218.08	7,897.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-

本报告期期末基金份额总额	354,536,267.72	4,061,012.81	315,791.88

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注: 本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期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者超过 20%的情况

注：无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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股票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规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

上海市黄浦区外马路 728 号　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

2026 年 10 月 27 日