# 海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2013年第1号）

## 基金管理人：海富通基金管理有限公司
## 基金托管人：中国建设银行股份有限公司

**重要提示**

海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金（以下简称"本基金"）经2011年11月9日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1801号文核准募集。本基金的基金合同于2012年5月25日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守，诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为2012年11月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年9月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

### 一、 基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人：邵国有

成立时间：2003年4月18日

电话：021-38650999

联系人：包瑾

注册资本：1.5亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎投资管理BE控股公司49%。

（二）主要人员情况

邵国有先生，董事长，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京证券部业务经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加（Stewart Edgar）先生，董事，英国籍，学士。历任英国Ivory & Sime公共有限公司基金经理，美国Fiduciary国际信托公司研究部主任、高级副总裁，英国HD国际有限公司高级基金经理、董事，美国F&C管理公司高级基金经理、董事，比利时富通基金管理公司董事总经理，法国巴黎投资管理公司亚太区董事总经理。

田仁灿先生，董事，总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁Euroequipement S.A.公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

张文伟先生，董事，副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长，现任商学院院长及经济系讲座教授。

巴约特（Marc Bayot）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，Pionner投资公司独立副董事长，Fundcommerce独立董事长，Degroof资产管理公司独立董事和法国巴黎银行B Flexible SICAV 独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

王明权先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任武汉市人民政府副市长、交通银行行长、党委（组）书记、副董事长、中国光大（集团）总公司董事长、党委书记，现任全国人大代表、全国人大财经委员会委员。

李如刚先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

谷若鸿（Mr. Laurent couraudon）先生，法国籍，国际贸易硕士。历任法国巴黎银行瑞士日内瓦分行商品及贸易融资部高级客户经理，法国巴黎银行莫斯科代表处能源及商品融资首席代表，法国外贸银行莫斯科分行董事及企业金融部主管，法国巴黎银行俄罗斯分行业务拓展主管，法国巴黎银行莫斯科分行首席执行官兼俄罗斯区总裁，现任法国巴黎银行（中国）有限公司董事会主席兼中国区总裁。

葛万荣先生，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理、监察稽核总监。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc 公司高级财务经理、加拿大Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生，副总经理，硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通精选混合基金经理，2003年4月至2012年9月任海富通基金管理有限公司投资总监，2005年7月至2006年9月任海富通股票基金经理，2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金经理，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007年2月至2007年8月任海富通风格优势股票基金经理，2007年4月至2007年8月任海富通精选混合基金经理，2008年6月至2011年2月任海富通中国海外股票（QDII）基金经理。

顾小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师，富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部副经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

刘璎女士，硕士。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司，曾任华安上证180ETF基金经理助理；2007年3月至2010年6月担任华安上证180ETF基金经理，2008年4月至2010年6月担任华安中国A股增强指数基金经理。2010年6月加入海富通基金管理有限公司。2010年11月起任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理，2011年4月起兼任海富通上证非周期ETF及海富通上证非周期ETF联接基金经理。2012年1月起兼任海富通中证100指数（LOF）基金经理。2012年5月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理；戴德峰，投资总监；蒋征，股票相对收益组合部总监；丁俊，研究总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；杜晓海，定量及风险管理总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### 二、 基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】12号

联系人：尹 东

联系电话：（010）6759 5003

### 三、 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人：邵国有

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

联系人：唐旭

电话：021-38650797

传真：021-33830160

2.场外代销机构

①）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

联系人：张静

网址：www.ccb.com

②）中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街1 号

法定代表人：肖钢

电话：010-66596688

传真：010-66593777

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

③）中国工商银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

网址：www.icbc.com.cn

④）交通银行股份有限公司

地址：上海市银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

客户服务电话：95559

联系人：曹榕

网址：www.bankcomm.com

⑤）招商银行股份有限公司

地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

客户服务电话：95555

联系人：邓柳鹏

网址：www.cmbchina.com

⑥）中国民生银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：董云巍

网址：www.cmbc.com.cn

⑦）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

联系人：徐伟、汤嘉惠

网址：www.spdb.com.cn

⑧）中国农业银行股份有限公司

地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

传真：010-85108557

网址：www.abchina.com

⑨）浙商银行股份有限公司

地址：中国杭州市庆春路288号

法定代表人：张达洋

客户服务电话：95527

联系人：毛真海

网址：www.czbank.com

⑩）海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553或4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

⑪）东北证券股份有限公司

地址：吉林省长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：4006000686

联系人：潘雷

网址：www.nesc.cn

⑫）招泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：万建华

客户服务电话：95521

联系人：芮敏祺、吴倩

网址：www.gtja.com

⑬）申银万国证券股份有限公司

地址：上海市常熟路171号

法定代表人：储晓明

客户服务电话：95523

联系人：高天

网址：www.sywg.com.cn

⑭）中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

⑮）招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

客户服务电话：95565

联系人：林生迎

网址：www.newone.com.cn

⑯）民族证券股份有限公司

地址：福建省福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

客户服务电话：95562

联系人：谢高得

网址：www.xyzq.com.cn

⑰）长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：95579

联系人：李民

长江证券客户服务网站：www.95579.com

⑱）广发证券股份有限公司

法定代表人：孙树明

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

⑲）东方证券股份有限公司

地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层

法定代表人：潘鑫军

客户服务电话：95503

联系人：吴宇

网址：www.dfzq.com.cn

⑳）国信证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层到26层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

联系人：齐晓燕

网址：www.guosen.com.cn

㉑）中国银河证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

客户服务电话：4008-888-888

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

㉒）平安证券有限责任公司

地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

客户服务电话：95511转8

联系人：郑舒丽

网址：stock.pingan.com

㉓）财通证券有限责任公司

地址：杭州杭大路15号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宇

客户服务电话：96336（浙江）、40086-96336（全国）

联系人：徐轶青

网址：www.ctsec.com

㉔）申信万通证券有限责任公司

地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：0532-96577

联系人：吴忠超

网址：www.zxwt.com.cn

㉕）天相投资顾问有限公司

地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

法定代表人：林义相

客户服务电话：010-66045678

联系人：林爽

网址：www.txsec.com

㉖）开源证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：95597

联系人：肖尔铃

网址：www.hasc.com.cn

㉗）光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

客户服务电话：95525

联系人：刘晨、李芳芳

网址：www.ebscn.com

㉘）中信证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：95588

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

㉙）中信证券（浙江）有限责任公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

客户服务电话：0571-96598

联系人：俞会亮

网址：www.bigsun.com.cn

㉚）瑞银证券有限责任公司

地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

客户服务电话：400-887-8827

联系人：谢宜凡

网址：www.ubssecurities.com

㉛）中航证券有限公司

地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人：杜航

电话：4008866567

联系人：戴雷

网址：www.scstock.com

㉜）国元证券股份有限公司

地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

客户服务电话：95578

联系人：陈琳琳

网址：www.gyzq.com.cn

㉝）德邦证券有限责任公司

住所：上海市福山路500号城建国际中心26层

法定代表人：姚文平

客户服务电话：4008888128

联系人：罗芳

网址：www.tebon.com.cn

㉞）宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：冯戎

客户服务电话：4008-000-562

联系人：李巍

网址：www.hysec.com

㉟）齐鲁证券有限公司

地址：山东省济南市经七路86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：孙蒙志

网址：www.qlzq.com.cn

㊱）第一创业证券股份有限公司

地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人：刘学民

客户服务电话：4008881888

联系人：魏颖

网址：http:/www.fcsc.com

㊲）东任证券股份有限公司

地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

网址：www.essence.com.cn

㊳）中国中投证券有限责任公司

地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层

法定代表人：龙增来

客户服务电话：95532或400-600-8008

联系人：刘毅

网址：http:/www.china-invs.cn/

㊴）华安证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898

联系人：刘丽川

网址：www.cnhbstock.com

㊵）信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

客户服务电话：400-800-8899

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

㊶）长城证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

客户服务电话：4006666888

联系人：尚峰

网址：www.cgws.com

㊷）华福证券有限责任公司

地址：福州五四路新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：0591-96326

联系人：张腾

网址：www.gfhfzq.com.cn

㊸）渤海证券股份有限公司

地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

客户服务电话：400-651-5988

联系人：王兆权

网址：www.ewww.com.cn

㊹）广州证券有限责任公司

地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼

法定代表人：刘东

客户服务电话：020-961303

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

㊺）大通证券股份有限公司

地址：大连市沙河口区会展路129号

法定代表人：于宏民

客户服务电话：4008169169

联系人：谢立军

网址：www.daton.com.cn

㊻）红塔证券有限责任公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：高悦蛟

客服电话：400-666-2288

公司网站：www.jhzq.com.cn

㊼）信达证券股份有限责任公司

地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：张惠

客户服务电话：400-666-1618

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

㊽）国都证券有限责任公司

地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

㊾）财富证券有限责任公司

地址：湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层

法定代表人：陶翀

电话：0731-84403360

联系人：朱友谊

网址：www.cfzq.com

㊿）中山证券有限责任公司

地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

法定代表人：吴永良

客户服务电话：4001022011

联系人：李珍

网址：www.zszq.com.cn

(51)）信证证券有限责任公司

地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号

法定代表人：孔伯杰

客户服务电话：010-88086830

联系人：冯杰

网址：www.rxzq.com.cn

(52)）国联证券股份有限公司

地址：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦7-9楼

法定代表人：雷建辉

客户服务电话：95570

联系人：沈刚

网址：www.glsc.com.cn

(53)）国金证券股份有限公司

地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼

法定代表人：冉云

客户服务电话：4006600109

联系人：金喆

网址：www.gjzq.com.cn

(54)）深圳众禄基金销售有限公司

地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

联系人：张玉静

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(55)）杭州数米基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

联系人：周翡笑

网址：www.fund123.cn

(56)）上海好买基金销售有限公司

地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

联系人：薛眉

网址：www.ehowbuy.com

(57)）上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-089-1289

联系人：张裕

网址：www.erichfund.com

3、场内代销机构

具有开放式基金代销资格的、经中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员可成为本基金的场内销售机构，相关信息同时通过上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）登载。

基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，并按照相关规定及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

电话：010-59378835

传真：010-59378907

联系人：任瑞新

（三）相具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-3135 8600

联系人：吕红

联系电话：021-31358666

经办律师：吕红、李永波

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人：杨绍信

经办注册会计师：汪棣、金毅

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：刘莉

### 四、 基金的名称

本基金的名称：海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

### 五、 基金类型

基金类型：契约型开放式

### 六、 基金的投资目标

本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数。在正常市场情况下，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。

### 七、 投资方向和范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（包括中小板、创业板股票及其它经中国证监会核准上市的股票）、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、权证、股指期货、现金、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的90%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的买差合计值不低于基金资产净值的90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 八、 投资策略

本基金将采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以股指期货等金融衍生工具进行投资管理，以便实现对跟踪误差的有效控制。

①）资产配置比例

本基金主要投资于标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的90%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基金管理人将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

②）股票投资组合构建

1.股票组合构建原则及方法

本基金股票资产投资采用完全复制标的指数的方法进行投资。通常情况下，本基金根据标的指数成分股票在指数中的权重确定成分股票的买卖数量。但在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：

①）法律法规的限制；

②）标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依据指数权重购买某成份股；

③）本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；

④）成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；

⑤）预期标的指数的成份股即将调整；

⑥）有充分而合理的理由认为其市场价格被操纵等。

为了减小跟踪误差，本基金按照同行业，相近市值，相关性高及β值相近等原则来选择替代股票。

2. 股票组合调整

①）定期调整

本基金股票组合将根据标的指数的编制规则、备选股票的预期及调整公告，对股票投资组合及时进行调整。

②）不定期调整

i）标的指数成份股日常跟踪

当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他原因而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。

ii）标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

iii）申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3. 跟踪偏离的监控与管理

基金管理人将每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金与标的指数表现的偏离，并对跟踪误差等进行分析，确定跟踪误差来源，优化指数跟踪方案。

③）债券资产的配置策略

本基金债券投资为在跟踪误差与流动性风险双重约束下的投资。本基金将以降低基金的跟踪误差为目的，在考虑流动性风险的前提下，构建债券投资组合。债券投资上，本基金将坚持稳健投资的原则，采取"自上而下"的投资策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化等趋势，综合考虑不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，选择合适的债券品种进行投资。

④）股指期货的投资

为有效控制指数的跟踪误差，本基金可在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货调整本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

⑤）跟踪误差控制策略

在本基金的管理中，基金管理人将每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案，从而有效控制和管理跟踪误差。

⑥）投资决策

1.决策依据

①）投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；

②）投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；

③）投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

2.决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、助理人员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

①）投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

②）投资总监在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

③）分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

④）定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

⑤）基金经理在投资总监授权下，根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在股票分析师确定的股票池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

⑥）基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

⑦）定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

⑧）定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

### 九、 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证内地低碳经济主题指数×95%+人民币银后活期存款利率×5%。

本基金是被动型投资的指数基金，以紧密跟踪中证内地低碳经济主题指数为投资目标。

中证内地低碳经济主题指数是为了反映在中国内地上市的低碳经济类公司股票的整体走势，从沪深A股中挑选日均总市值较高的50只低碳经济主题公司股票组成样本股，基日为2010年6月30日，基点为1000点。

低碳经济是指以低能耗、低污染、低排放为基础的经济模式，包括了清洁能源发电（太阳能、风能、核能、水电、清洁煤等）、能源转换及存储（智能电网、电池等）、清洁生产及消费（能源效率等）、废物处理（处理和垃圾处理）等投资主题。

中证内地低碳经济主题指数是以"沪深A股为样本空间，根据营业收入占比挑选出其中低碳经济主题股票，再从其中挑选日均总市值较高的50只公司股票组成样本股。中证内地低碳经济主题指数每年定期调整两次，调整时间分为每年1月和7月的第一个交易日，特殊情况也作临时调整。

在编制方法上，中证内地低碳经济主题指数采用了主流的市值加权方法，具有较好的市场代表性；另外还采用了分级靠档技术，分级靠档技术的采用可以使在样本公司股本发生微小变动时保持用于指数计算的样本公司股本数的稳定，可以降低股本变动频繁带来跟踪误差，便于投资者进行跟踪投资。

如果中证内地低碳经济主题指数被上海证券交易所停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下，或者证券市场有其他代表性强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在取得基金托管人同意后，履行适当程序来变更基金的投资目标和投资范围，而无须召开基金份额持有人大会。

### 十、 风险收益特征

本基金属于股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的投资品种，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动投资的指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 十一、 基金投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年12月17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。

本投资组合报告所载数据截止至2012年9月30日（"报告期末"）。

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 | 161,477,326.81 | 76.64 |
| | 其中：股票 | 161,477,326.81 | 76.64 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 38,000,000.00 | 18.03 |
| | 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 | 10,277,072.56 | 4.88 |
| 6 | 其他各项资产 | 947,017.15 | 0.45 |
| 7 | 合计 | 210,701,416.52 | 100.00 |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

2.2 指数投资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 | 2,509,080.00 | 1.20 |
| C | 制造业 | 81,553,110.23 | 38.93 |
| C0 | 食品、饮料 | - | - |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 1,961,424.00 | 0.94 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| C5 | 电子 | 14,147,264.72 | 6.75 |
| C6 | 金属、非金属 | 4,139,950.80 | 1.98 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 60,758,878.71 | 29.00 |
| C8 | 医药、生物制品 | - | - |
| C99 | 其他制造业 | 545,592.00 | 0.26 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 49,162,538.02 | 23.47 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 12,132,346.20 | 5.79 |
| H | 批发和零售贸易 | - | - |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 13,065,493.00 | 6.24 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 3,054,759.36 | 1.46 |
| | 合计 | 161,477,326.81 | 77.08 |

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

3.1期末指数投资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 | 600900 | 长江电力 | 4,147,173 | 26,790,737.58 | 12.79 |
| 2 | 600406 | 国电南瑞 | 683,880 | 12,132,031.20 | 5.79 |
| 3 | 600089 | 特变电工 | 1,778,975 | 11,403,229.75 | 5.44 |
| 4 | 600703 | 三安光电 | 558,117 | 8,544,771.27 | 4.08 |
| 5 | 002202 | 金风科技 | 1,126,800 | 6,434,028.00 | 3.07 |
| 6 | 600875 | 东方电气 | 469,100 | 6,403,215.00 | 3.06 |
| 7 | 300070 | 碧水源 | 174,535 | 6,061,600.55 | 2.89 |
| 8 | 601727 | 上海电气 | 1,390,900 | 5,619,236.00 | 2.68 |
| 9 | 000826 | 桑德环境 | 229,001 | 5,599,074.45 | 2.67 |
| 10 | 600674 | 川投能源 | 754,600 | 5,206,740.00 | 2.49 |

3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

①）报告期内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，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

②）本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

③）其他资产的构成：

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 21,470.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | 889,549.41 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 27,302.03 |
| 5 | 应收申购款 | 8,695.58 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 947,017.15 |

④）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

⑤）a.期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说