

汇丰晋信低碳先锋股票型  
证券投资基金

更新招募说明书摘要  
(2012 年第 2 号)

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

### 【重要提示】

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2010 年 4 月 13 日证监许可[2010]471 号文批准发起设立。本基金基金合同于 2010 年 6 月 8 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2012 年 6 月 8 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 3 月 31 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：汇丰晋信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼

办公地址：上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼

法定代表人：杨小勇

成立时间：2005年11月16日

电话：021-38789898

联系人：周慧

注册资本：2亿元人民币

股权结构：山西信托有限责任公司持有51%的股权，HSBC Global Asset Management (UK) Limited (汇丰环球投资管理(英国)有限公司)持有49%的股权。

## (二) 主要人员情况

杨小勇先生，董事长，硕士学历。曾任山西省委组织部正处级干部、山西省信托投资公司副总经理、山西省国信投资(集团)公司副总经理，曾任山西光信实业有限公司副董事长。现任山西省国信投资(集团)公司党委书记、山西信托有限责任公司副董事长。

刘叔肆先生，董事，硕士学历。曾任山西信托有限责任公司地市信托部经理、太原资产管理公司经理、汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。现任山西信托有限责任公司总经理。

Mr. JOHN FLINT，董事。曾任汇丰集团财务主管、汇丰集团集团司库、环球资本市场副主管及环球资本市场之欧洲、中东及非洲主管、汇丰环球投资管理行政总裁。现任汇丰集团幕僚长、汇丰集团策略主管。

Ms. JOANNA MUNRO，董事。曾任汇丰环球投资管理全球投资总监、多元基金经理行政总裁、环球投资产品部主管。现任汇丰环球投资管理董事、亚太行政总裁。

常修泽先生，独立董事。曾任南开大学经济研究所教授、副所长、国家计委

经济研究所常务副所长、教授和博士研究生导师。现任国家发改委经济研究所教授和博士研究生导师。

叶林先生，独立董事，博士学历。现任中国人民大学法学院法学教授和博士研究生导师。

Mr. Alan Howard SMITH，独立董事，本科学历。曾任怡富控股有限公司董事、董事总经理和董事长、瑞士信贷第一波士顿副董事长。现任金威啤酒集团有限公司独立非执行董事。

#### (2) 监事会成员基本情况：

任宏伟先生，监事，硕士学历。曾任山西省信托投资公司计划财务部经理。现任山西省国信投资（集团）公司财务总监兼计划财务部经理。

黄碧娟女士，监事，本科学历。曾任汇丰集团银团贷款经理、资本市场部高级经理、大中华地区债务发行部主管、环球银行部香港区常务总监、汇丰银行（中国）有限公司副行政总裁。现任汇丰集团总经理、汇丰银行（中国）有限公司行长兼行政总裁，同时担任汇丰中国董事会执行董事。

曹菁女士，监事，硕士学历。曾任中宏保险有限公司招聘经理、永乐中国培训部经理，汇丰晋信基金管理有限公司人事经理，现任汇丰晋信基金管理有限公司人力资源总监。

#### (3) 总经理及其他高级管理人员基本情况：

李选进先生，总经理，硕士学历。曾任怡富证券（台湾）有限公司董事长特别助理、怡富集团（台湾）台湾区负责人特别助理、电子商务部经理、怡富基金有限公司电子商务及项目发展部经理、业务拓展总监和汇丰投资管理（香港）有限公司董事兼亚太区企业拓展及中国事业主管。

闫太平先生，副总经理，本科学历。曾任匈牙利金鸥国际贸易公司董事、山西信托投资有限责任公司副处长、国际金融部经理。

李毅先生，副总经理，硕士学历。曾任中国国际期货经纪有限公司客户经理、中国证券监督管理委员会副处长。

林彤彤先生，副总经理，硕士学历。曾任华安基金管理有限公司基金安信、基金安久、基金安顺、基金安瑞的基金经理，投资部总监助理兼基金安信基金经理。现任汇丰晋信基金管理有限公司首席投资官，并担任汇丰晋信龙腾股票型开

放式证券投资基金基金经理。

王立荣，副总经理，硕士学历。曾任山西信托有限责任公司固定收益部副总经理、证券投资部副总经理、创新业务部总监；上海万方投资管理有限公司副总经理；汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。

古韵女士，督察长，硕士学历。曾任国泰君安证券股份有限公司法律事务总部副经理，国联安基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监、董事会秘书和总经理助理。

#### （4）本基金基金经理

邵骥咏先生，上海交通大学会计学硕士，中国注册会计师（CPA），具备基金从业资格。曾任华安基金管理有限公司交易员、汇丰晋信基金管理有限公司交易主管、投资经理。现任汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金经理、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金基金经理。

刘辉先生，澳大利亚阿德莱德大学硕士。曾任华泰证券股份有限公司研究员、东吴基金管理有限公司、汇丰晋信基金管理有限公司研究员。现任汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金基金经理、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金经理。

#### （5）投资委员会成员的姓名和职务

李选进，总经理；林彤彤，副总经理兼首席投资官；曹庆，研究总监；邵骥咏，股票投资部总监兼汇丰晋信动态策略基金基金经理、汇丰晋信低碳先锋基金基金经理和汇丰晋信科技先锋基金基金经理。基金管理人也可以根据需要增加或更换相关人员。

#### （6）上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：618.85亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：张咏东

电话：021-32169999

## 三、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### (1) 直销机构

地址：上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼

电话：021-68596998

传真：021-68880890

联系人：薛蓓

网址：[www.hsbcjt.cn](http://www.hsbcjt.cn)

客户服务中心电话：021-38789998

汇丰晋信基金电子交易平台

网址：<https://etrading.hsbcjt.cn/>

联系人：薛蓓

电话：021-38789898\*6659

#### (2) 代销机构：

##### ■ 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：曹榕

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

##### ■ 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

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

■ 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：010-66106912

传真：021-66107914

联系人：田耕

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

■ 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

传真：（010）85109219

联系人：蒋浩

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

■ 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

电话：（010）66109330

传真：（010）66109144

联系人：邢然



客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

■ 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：汤嘉惠、虞谷云

联系电话：021-63296188—82438、82410

客户服务电话：95528，021-63298615

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

■ 深圳发展银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼（Frank N. Newman）

联系人：张青

联系电话：0755-82088888

客户服务电话：95501

网址：[www.sdb.com.cn](http://www.sdb.com.cn)

■ 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558（全国）

网址：<http://bank.ecitic.com>

■ 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

电话：（0755）83195834，82090060

传真：（0755）83195049，82090817

客户服务电话：95555

联系人：刘薇

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

■ 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：翟鸿祥

联系人：马旭

传真：010—85238680

客户服务中心电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

■ 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

电话：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：董云巍

客户服务热线：95568

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

■ 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客户服务电话：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

■ 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528（上海地区 962528）

网址：[www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

■ 温州银行股份有限公司

住所、办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

电话：（0577）88990082

传真：（0577）88995217

客服电话：（0577）96699

网址：[www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn)

■ 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

联络人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316569

客服电话：400-888-8811

公司网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

■ 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号

办公地址：上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层

法定代表人：胡平西

联系人：吴海平

电话：021-38576666

传真：021-50105124

客服电话：021-962999

公司网址：<http://www.srcb.com>

■ 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

联系电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

客服电话：400-666-1618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

■ 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：万建华

联系电话：021-62580818-213

传真：021-62569400

客服电话：400-8888-666

联系人：芮敏祺

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

■ 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：李清怡

电话：021-54033888

传真：021-54030294

客户服务电话：021-962505

网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

■ 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：4008888108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：<http://www.csc108.com>

■ 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-68816000

传真：021-68815009

客户服务电话：10108998、4008888788、或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

■ 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：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

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636 客服电话：400-8888-111、95565

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

■ 广发证券股份有限公司

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、41和42楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

传真：020-87555305

开放式基金咨询电话：95575转各营业网点

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

■ 中国银河证券股份有限公司

注册地址：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：胡关金

电话：010-66568888

传真：010-66568536

联系人：李洋

客服电话：4008-888-888

网址：<http://www.chinastock.com.cn>

■ 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：021-53594566

传真：021-53858549

客户服务电话：4008888001，021-962503

联系人：金芸、李笑鸣

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

■ 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84683893

传真：010-84865560

客服电话：010-84588888

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

■ 中信万通证券有限责任公司

法定代表人：张智河

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

基金业务联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

■ 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客户服务电话：400-8888-123

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

■ 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82133066

传真：0755-82133302

客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

■ 国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

客服电话：4008-888-777

公司网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

■ 中国国际金融有限公司

注册地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：李剑阁

联系人：罗春蓉

客服电话：010-65051166

公司网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

■ 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：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

联系人：樊昊

电话：025-84457777

传真：025-84579763

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

■ 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山北路318号2号楼21-29楼

办公地址：上海市中山北路318号2号楼21-29楼

法定代表人：潘鑫军

联络人：吴宇、沈燕

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客服电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

■ 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客服电话：4008001001

公司网址：www.essences.com.cn

■ 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

电话：010-66045529

传真：010-66045500

客服电话：010-66045678

公司网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.txjijin.com](http://www.txjijin.com)

■ 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号 6、16、17 楼

法定代表人：雷波

联系人：金喆

客户服务电话：400-660-0109

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

■ 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84683893

传真：010-84865560

客服电话：010-84588888

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

■ 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：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

联系人：丁思聪

客户服务电话：96598

网址：<http://bigsun.qianyan.biz/>

## **(二) 注册登记人**

名称：汇丰晋信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区富城路99号震旦大厦35楼

法定代表人：杨小勇

联系人：赵琳

联系电话：021-38789992

## **(三) 出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

联系人：廖海

经办律师：梁丽金、刘佳

## **(四) 审计基金财产的会计师事务所**

名称：毕马威华振会计师事务所

住所：北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

法定代表人：何潮辉

联系电话：010-8518 5000

传真电话：010-8518 5111

经办注册会计师：陈思杰、于荣

联系人：黎俊文



## 四、基金的名称

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

## 五、基金的类型

股票型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

本基金主要投资于受益于低碳经济概念、具有持续成长潜力的上市公司，通过积极把握资本利得机会以拓展收益空间，以寻求资本的长期增值。

## 七、基金的投资方向

本基金为股票型基金，投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 85%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%。固定收益类证券、现金和其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-15%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金主要投资于受益于低碳经济领域的上市公司，80%以上的股票资产属于上述投资方向所确定的内容。

本基金依据法律法规的规定，本着谨慎和风险可控的原则，可参与创业板上市证券的投资。

在基金实际管理过程中，本基金具体配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化做主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡，但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下，基金管理人可对上述比例做适度调整。



## 八、基金的投资策略

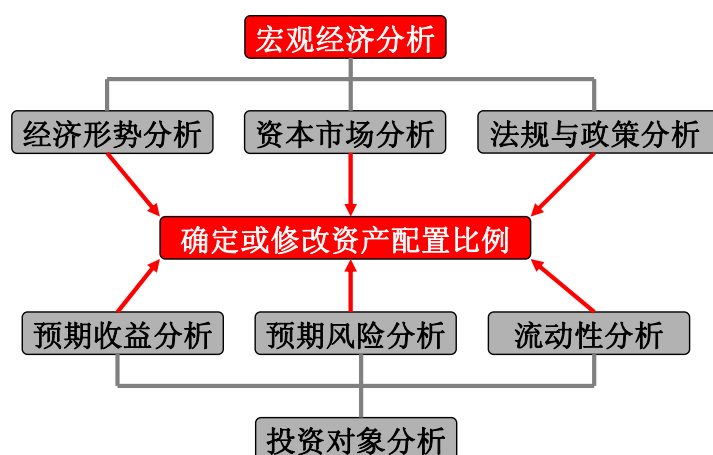
本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自下而上决定股票组合。

### 1、资产配置策略

在投资决策中，本基金仅根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。

股票占基金资产的 85%-95%，其中对环保、节能、新能源、自主创新主题的投资不低于股票投资比例的 80%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-15%；权证占基金资产净值的 0-3%；基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

资产配置决策流程如下：



### 2、行业配置

本基金所投资对象主要定位受益于低碳经济概念、具有持续成长潜力的上市公司，这些上市公司会包含很多一般意义的行业。本基金在行业选择上综合考虑多方面的因素，择优而选。行业研究员通过分析行业特征，定期提出行业投资评级和配置建议。行业比较分析师综合内、外部研究资源，对受益于低碳经济领域、行业基本面因素已出现积极变化、景气程度增加，但股票市场反应滞后的行业进行重点配置。同时，本基金将根据行业的基本面变化以及股票市场行业指数表现，

实施积极的行业轮换，不断寻找新的行业投资机会，实现“资本增值”目标。

### 3、股票资产投资策略：

本基金在股票投资的比例中必须有不少于 80%的比例需投资于低碳经济主题的股票。为充分防范投资风险，并保证基金的投资风格的一致性，基金管理人将在本公司股票库制度的框架内，建立相应的低碳主题股票库。本基金股票投资中投资的不少于 80%市值的股票必须从股票库中选择。该股票库的基本标准如下：

本基金根据上市公司的基本面情况，首先对股票进行初步筛选，将基本面较差、投资价值较低的上市公司剔除基础股票池。在此基础上，按照本基金对于低碳经济概念的识别，我们将依靠研究团队，主要采取自下而上的选股策略，对基础股票池进行二次筛选，筛选出与低碳经济主题相关的上市公司。

根据上市公司与低碳经济主题之间的关系，本基金将低碳经济主题的上市公司细分为两类：（1）直接从事或受益于低碳经济主题的上市公司；（2）与低碳经济主题密切相关的上市公司。

#### （1）直接从事于低碳经济主题的上市公司

直接从事于低碳经济主题的上市公司是指直接从事低碳经济的领域，公司经营受益于低碳经济所带来的高收益的上市公司。对此类上市公司筛选的标准主要有以下几点：

a. 公司主营业务中具有或未来即将具有直接从事与低碳经济主题型相关的业务。

b. 公司盈利前景明确，受益于低碳经济主题带来的高回报。

c. 公司经营状况良好。

#### （2）与低碳经济主题密切相关的上市公司

此类上市公司虽属于传统产业，但与低碳经济的主题密切相关。主要体现在传统高碳排放行业中因引入新技术、新设备，使企业的单位能耗下降，并使企业直接受益的相关上市公司；对低碳经济的相关产业进行投资、提供人力、技术、资金支持的上市公司等。对此类上市公司，我们关注的是其受益于低碳经济的程度及形式。我们的研究团队将从以下几方面进行综合评判：

- a. 上市公司与低碳经济主题关联的程度。
- b. 上市公司与低碳经济主题关联的形式与性质。
- c. 公司经营状况良好。

我们认为，低碳经济将成为我国未来经济政策扶持对象中的重中之重。而随着我国将低碳经济体系被定位为战略性新兴产业，一系列扶持低碳经济的相关措施将会陆续出台，同时，未来新增信贷投入也将向低碳产业倾斜。在此大趋势下，低碳经济主题的上市公司在中长期将具备较高的成长潜力。针对以上特点，在得到以上两类上市公司后，本基金将采用定性分析与定量分析的方法，选择成长潜力较大的上市公司进行投资。

在定量的分析方法上，我们将主要根据成长性指标对上市公司进一步筛选。

本基金所指的成长指标包括：主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、销售毛利率变化率、净利润增长率、净资产收益率（ROE）等。在实际操作中，本基金并不拘泥于上述单一成长标准，而是在综合考虑国家政策扶持力度、低碳技术成熟度等因素，最大程度地筛选出价值低估的上市公司。

各项指标的标准设置原则如下：

#### ■ 主营业务收入增长率

以 GDP 的增长率作为评价指标的参照物：处在持续增长阶段的上市公司，考察其过往 3 年增长率，并预测今后 2 年的增长率。处在增长启动阶段的上市公司，考察其未来 3 年的增长趋势及可能实现的概率水平。

#### ■ 主营业务利润增长率

以 GDP 的增长率作为评价指标的参照物：处在持续增长阶段的上市公司，考察其过往 3 年增长率，并预测今后 2 年的增长率。处在增长启动阶段的上市公司，考察其未来 3 年的增长趋势及可能实现的概率水平。

#### ■ 销售毛利率变化率

销售毛利率的变动趋势也是把握上市公司成长性的重要参考指标，因为该指标反映了公司控制成本和转嫁成本压力的能力，对公司产品销售毛利率的跟踪和预测能排除那些市场份额占比上升是以牺牲公司的盈利能力为代价的公司，从而有助于更准确地把握公司主营业务收入增长的质量和有效性。

#### ■ 净利润增长率

以 GDP 的增长率作为评价指标的参照物：处在持续增长阶段的上市公司，考察其过往 3 年增长率，并预测今后 2 年的增长率。处在增长启动阶段的上市公司，考察其未来 3 年的增长趋势及可能实现的概率水平。

#### ■ 净资产收益率（ROE）

以 1 年期银行定期存款税后收益率作为评价指标的参照物，根据 GDP 的增长速度和上市公司整体的净资产收益率情况，确定净资产收益率（ROE）的筛选值。

在定性分析方面，本基金主要通过借鉴汇丰投资关于上市公司评分体系的运用方法，建立了全面的公司治理评估体系，对公司的治理水平进行全面评估；评估不合格的公司坚决予以规避。同时，本基金通过实地调研对综合评估结果做出实际验证，确保最大程度规避投资风险。

公司治理结构的评估是指对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察，包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度，管理决策的执行和传达的有效性，股东会、董事会和监事会的实际执行情况，企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。公司治理结构是决定公司评估价值的重要因素，也是决定公司盈利能力能否持续的重要因素。在国内上市公司较普遍存在治理结构缺陷的情况下，本基金管理人对个股的选择将尤为注重对上市公司治理结构的评估，以期为投资者挑选出具备持续盈利能力的股票。本基金管理人将主要通过以下五个方面对上市公司治理水平进行评估：

- 产业结构
- 行业展望
- 股东价值创造力
- 公司战略及管理质量
- 公司治理

#### 4、债券投资策略：

本基金投资固定收益类资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时，充分利用固定收益类资产的投资机会，提高基金投资收益，并有效降低基金的整体投

投资风险。本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资，获取超额收益：

#### ■ 利率趋势预期

准确预测未来利率趋势能为债券投资带来超额收益。本基金将密切关注宏观经济运行状况，全面分析货币政策、财政政策和汇率政策变化情况，把握未来利率走势，在预期利率下降时加大债券投资久期，在预期利率上升时适度缩小久期，规避利率风险，增加投资收益。

#### ■ 收益率曲线变动分析

收益率曲线反映了债券期限同收益率之间的关系。投资研究部门通过预测收益率曲线形状的变化，调整债券投资组合长短期品种的比例获得投资收益。

#### ■ 收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债券）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，投资部门采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的，但是在某种情况下，比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或市场供求发生变化时，这种稳定关系会被打破，若能提前预测并进行交易，就可进行套利或减少损失。

#### ■ 公司基本面分析

公司基本面分析是公司债(包括可转债)投资决策的重要决定因素。研究部门对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理层信用度、所处行业竞争状况等因素进行“质”和“量”的综合分析，并结合实际调研结果，准确评价该公司债券的信用风险程度，作出价值判断。对于可转债，通过判断正股的价格走势及其与可转换债券间的联动关系，从而取得转债购入价格优势或进行套利。

### 5、权证投资策略

本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。基金的权证投资策略主要包括以下几个方面：

1) 综合衡量权证标的股票的合理内在价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，运用市场公

认的多种期权定价模型等对权证进行定价。

2) 根据权证的合理内在价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理内在价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理内在价值的考量,决策买入、持有或沽出权证。

3) 通过权证与证券的组合投资,利用权证衍生工具的特性,来达到改善组合风险收益特征的目的。

## **6、资产支持证券投资策略**

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下,秉持稳健投资原则,综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得基金资产的长期稳健回报。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数\*90%+同业存款利率\*10%。

## 十、基金的风险收益特征

本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预计收益较高的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。



## 十一、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证基金投资组合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。

本基金的托管人——交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20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。

本基金投资组合报告的报告期为2012年1月1日起至3月31日止。本报告中的财务资料未经审计。

### 11.1 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	358,777,049.19	86.39
	其中:股票	358,777,049.19	86.39
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	-	-
	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	56,373,012.39	13.57
6	其他各项资产	143,958.08	0.03
7	合计	415,294,019.66	100.00

### 11.2 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	11,758,440.33	2.86
B	采掘业	15,143,040.00	3.69
C	制造业	205,709,896.32	50.07
C0	食品、饮料	59,176,488.21	14.40
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	8,251,704.45	2.01
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	65,485,103.74	15.94
C8	医药、生物制品	72,796,599.92	17.72
C99	其他制造业	-	-
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	2,381,354.00	0.58
G	信息技术业	54,862,470.34	13.35
H	批发和零售贸易	30,285,770.87	7.37
I	金融、保险业	34,123,599.03	8.31
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	4,512,478.30	1.10

L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	358,777,049.19	87.32

### 11.3 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	600887	伊利股份	1,421,885	31,338,345.40	7.63
2	002038	双鹭药业	910,803	24,190,927.68	5.89
3	601318	中国平安	577,857	21,138,009.06	5.14
4	000423	东阿阿胶	497,449	20,057,143.68	4.88
5	002353	杰瑞股份	191,200	15,143,040.00	3.69
6	002073	软控股份	1,089,621	14,862,430.44	3.62
7	002152	广电运通	639,017	13,630,232.61	3.32
8	300020	银江股份	1,290,404	12,426,590.52	3.02
9	600521	华海药业	951,612	11,771,440.44	2.86
10	000860	顺鑫农业	773,073	11,758,440.33	2.86

### 11.4 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。

### 11.5 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。

### 11.6 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。

**11.7 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。

### 11.8 投资组合报告附注

11.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。

11.8.2 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。

#### 11.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,865.62
5	应收申购款	120,092.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	143,958.08

#### 11.8.4 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。

#### 11.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 11.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

本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。

### (一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2010/6/8 (基金合同生效日) - 2010/12/31	21.88%	1.30%	14.48%	1.43%	7.40%	-0.13%
2011/1/1 - 2011/12/31	-24.09%	1.20%	-22.44%	1.17%	-1.65%	0.03%
2012/1/1 - 2012/3/31	-6.04%	1.64%	4.21%	1.37%	-10.25%	0.27%

### (二) 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：

1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 85%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%。固定收益类证券、现金和其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-15%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2010 年 12 月 8 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 沪深 300 指数\*90% + 同业存款利率\*10%。
3. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含沪深 300 指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

## 十三、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金的证券交易费用；
- (4) 基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金银行汇划费用；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费率为年费率 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### (2) 基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第（一）款第（3）至第（7）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- （1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- （2）以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用；
- （3）基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支；
- （4）其他根据法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登公告。

### （五）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

### （六）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。



## 十四、对招募说明书更新部分的说明

- (一) 更新了“三、基金管理人”之“(二) 主要人员情况”部分，更新了董事会成员 Mr. JOHN FLINT、Ms. JOANNA MUNRO；增加了监事会成员曹菁女士的信息，删除了王栋先生的信息；更新了副总经理王立荣先生的信息；增加了本基金基金经理的相关信息。
- (二) 更新了“四、基金托管人”部分的内容。
- (三) 更新了“五、相关服务机构”的有关信息。更新了中国建设银行股份有限公司的信息、增加了中信证券（浙江）有限责任公司的信息。
- (四) 在“十三、基金的投资”中更新了基金投资组合报告（报告期：为 2012 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日）。
- (五) 在“十四、基金的业绩”中更新了自基金合同生效日 2010 年 6 月 8 日起至 2012 年 3 月 31 日止的基金业绩表现数据。
- (六) 在“二十六、其他应披露事项”中披露了自 2011 年 12 月 9 日至 2012 年 6 月 8 日以来涉及本基金的相关公告。

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇一二年七月二十三日