

Disclosure

兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF) 2008年年度报告摘要

202

§1 重要提示及目录

基金管理人的董事会、董事保证本报告所披露资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担责任。本年度报告经基金三分之一以上独立董事签字并发表意见。

基金的托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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。

基金经理过往业绩并不代表其未来表现。投资人认购、申购或赎回本基金前，请仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要、基金合同、基金产品资料概要、基金份额发售公告、投资人须知等信息披露文件，了解基金的具体情况。

本报告期自2008年1月1日起至2008年3月31止。

§2 基金简介

基金基本情况	兴业趋势投资混合型证券投资基金
交易代码	前端 163402 后端 163403
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月3日
报告期末基金份额总额	20,130,765,832.39份
2.2 基金产品说明	兴业趋势投资混合型证券投资基金
投资目标	本基金在合理控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现超越业绩基准的收益。即在充分考虑国内经济形势变化为国内需求等多方面因素，使得我们对市场的表现将始终持较为谨慎的态度。同时根据市场资金状况和宏观经济形势，将极大地破坏现有的体系和规则，而重新建立新的金融、经济秩序，本基金将从此次金融危局中寻找机会，把握短期波动的阶段性特征，但不可否认，金融危机是A股市场走势的因素并不仅是经济基本面，在短期波动的阶段，股市的表现可能与经济基本面相背离，在流动性的清淡的情况下，以及考虑到A股市场本身具有很多的不确定性，因此，本基金将通过积极主动的资产配置，把握短期波动的阶段性特征，从而在把握市场操作中，可能需要适时“留一半清醒，留一半醉”，即在对宏观经济进行一定的评估的情况下，适当参与一部分行业，题材类的个股投资，可能在2008年盈利变差的趋势下盈利水平更为重要。在投资策略上，对股票的配置比例将适当高于2006年的总体水平，在行业配置上，关注周期性股票通过调整的错位效应，从而在股票资产组合中获得更好的收益。
投资策略	本基金在合理控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现超越业绩基准的收益。即在充分考虑国内经济形势变化为国内需求等多方面因素，使得我们对市场的表现将始终持较为谨慎的态度。同时根据市场资金状况和宏观经济形势，将极大地破坏现有的体系和规则，而重新建立新的金融、经济秩序，本基金将从此次金融危局中寻找机会，把握短期波动的阶段性特征，但不可否认，金融危机是A股市场走势的因素并不仅是经济基本面，在短期波动的阶段，股市的表现可能与经济基本面相背离，在流动性的清淡的情况下，以及考虑到A股市场本身具有很多的不确定性，因此，本基金将通过积极主动的资产配置，把握短期波动的阶段性特征，从而在把握市场操作中，可能需要适时“留一半清醒，留一半醉”，即在对宏观经济进行一定的评估的情况下，适当参与一部分行业，题材类的个股投资，可能在2008年盈利变差的趋势下盈利水平更为重要。在投资策略上，对股票的配置比例将适当高于2006年的总体水平，在行业配置上，关注周期性股票通过调整的错位效应，从而在股票资产组合中获得更好的收益。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益及风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金。
2.3 基金管理人和基金托管人	基金管理人：兴业全球基金管理有限公司 基金托管人：兴业银行股份有限公司

2.4 信息披露方式	登载基金年度报告的管理人互联网网址： www.xyfund.com.cn
基金年度报告备置地	基金管理人、基金代销机构的办公场所

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	金额单位：人民币元
3.1.1 期间数据和指标	2006年 2007年 2006年
本期已实现收益	-1,192,483,365.05 1,027,251,485.29 252,270,680.55
本期利润	-11,301,975,982.38 7,762,188,304.37 629,792,246.42
本期平均净值利润率	-54.22% 60.53% 107.77%
本期末净值增长率	-40.65% 153.24% 160.31%
3.1.2 期末数据和指标	2006年 2007年 2006年
期末可供分配基金份额利润	0.0289 0.1341 0.0513
期末基金净值	15,281,333,307.04 26,506,985,230.03 1,340,635,970.90
期末可供分配基金份额总额	4,070.91 13,470.7 2,498.01
3.1.3 资产负债表	金额单位：人民币元
资产：	
1. 应收利息	632,226,967.44 5,965,486,652.01
2. 应收基金	26,506,985,230.03
3. 其他应收款	3,760,000.00
4. 存出保证金	3,477,001.00
5. 买入返售金融资产	14,521,819,276.75
6. 投资性房地产	20,362,562,332.02
7. 在建工程	7,608,231,249.46
8. 固定资产	19,016,386,972.42
9. 在途物资	2,289,000.00
10. 预付款项	6,912,589,031.79
11. 其他应收款	1,349,813,895.63
12. 其他流动资产	45,569,443.05
13. 待摊费用	106,584,324.44
14. 其他资产	12,344,197.94
资产总计	1,066,615.86
负债：	
1. 短期借款	62,479,903.90
2. 吸收存款	3,260,801.43
3. 应付票据	5,276,775.52
4. 应付账款	16,362,527,294.11
5. 预收款项	26,652,665,798.21
6. 应付职工薪酬	1,093,968.27
7. 应交税费	156,700,569.00
8. 其他应付款	1,093,968.27
9. 预提费用	1,093,968.27
10. 其他流动负债	1,093,968.27
11. 其他负债	1,093,968.27
负债总计	1,066,615.86
12. 所有者权益：	
1. 实收资本	23,970,264.40
2. 资本公积	14,649,514.07
3. 盈余公积	20,332,800.43
4. 未分配利润	3,269,801.43
5. 其他综合收益	4,277,001.00
6. 其他权益工具	3,522,768.19
7. 其他综合收益	2,685.00
所有者权益总计	1,066,615.86
3.2 基金净值表现	金额单位：人民币元
3.2.1 基金份额净值增长情况及其同行业业绩比较基准收益率的比较	
3.2.2 基金净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较	
3.2.3 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.4 基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较	
3.2.5 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.6 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.7 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.8 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.9 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.10 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.11 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.12 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.13 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.14 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.15 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.16 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.17 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.18 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.19 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.20 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.21 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.22 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.23 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.24 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.25 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.26 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.27 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.28 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.29 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.30 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.31 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.32 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.33 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.34 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.35 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.36 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.37 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.38 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.39 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.40 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.41 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.42 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.43 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.44 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.45 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.46 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.47 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.48 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.49 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.50 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.51 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.52 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.53 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.54 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.55 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.56 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.57 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.58 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.59 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.60 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.61 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.62 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.63 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.64 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.65 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.66 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.67 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.68 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.69 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.70 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.71 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.72 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.73 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.74 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.75 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.76 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.77 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.78 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.79 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.80 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.81 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.82 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.83 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.84 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.85 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.86 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.87 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.88 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.89 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.90 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.91 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.92 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.93 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.94 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.95 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.96 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	
3.2.97 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较</	