兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要

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

重要提示

兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会于2005年9月8日出具的《关于同意兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)设立的批复》(证监基金字[2005]156号)核准募集。本基金基金合同于2005年11月3日起正式生效,自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

本招募说明书摘要是根据《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书》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,应详细查阅本基金的基金合同。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后,基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺依照恪尽职守、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。

本更新招募说明书所载内容截止日2009年11月2日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现摘自本基金2009年第3季度报告,数据截止日为2009年9月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人兴业银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

机构名称:兴业全球基金管理有限公司
成立日期:2003年9月30日
注册地址:上海市黄浦区金陵东路368号
办公地址:上海市张杨路500号时代广场20楼
法定代表人:兰荣
联 系 人:郭贤珺
联系电话:021-58368998
组织形式:有限责任公司
注册资本:1.5亿元

兴业全球基金管理有限公司(以下简称"公司"或"本公司")是经证监基金字[2003] 100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月2日,中国证监会批准(证监许可[2008]6号)了公司股权变更申请,全球人寿保险国际公司(AEGON International N.V)受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后,兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%,全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。同时公司名称由"兴业基金管理有限公司"更名为"兴业全球人寿基金管理有限公司"。

2008年7月7日,经中国证监会批准(证监许可[2008]888号文),公司名称由"兴业全球人寿基金管理有限公司"变更为"兴业全球基金管理有限公司",同时,公司注册资本由人民币1.2亿元变更为人民币1.5亿元,其中两股东出资比例不变。

截止2009年9月30日,公司旗下管理着兴业可转债混合型证券投资基金、兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金、兴业社会责任股票型证券投资基金、兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴业磐稳增利债券型证券投资基金共七只开放式基金。

兴业全球基金管理有限公司下设投资决策委员会、风险管理委员会、基金管理部、研究部、监察稽核部、市场部、客户服务中心、专户投资部、运作保障部和综合管理部,随着公司业务发展的需要,将对业务部门进行适当的调整。

(二)主要人员情况

1、董事、监事概况

兰荣先生,董事长,1960年生,工商管理硕士、高级经济师。历任福建省建设银行投资处干部,福建省福兴财务公司科长,兴业银行总行计划资金部副总经理,兴业银行证券业务部副总经理,福建兴业证券公司总裁,兴业证券股份有限公司董事长、总裁、党委书记。现任兴业证券股份有限公司董事长兼兴业全球基金管理有限公司董事长。

张训苏先生,董事,1963年生,博士后,副教授、高级经济师。历任安徽财贸学院讲师,港澳证券上海总部副总经理、研发总经理,兴业证券股份有限公司研究发展中心总经理、总裁助理兼客户资产管理部总经理、风险管理总监。现任兴业证券股份有限公司副总裁。

郑苏芬女士,董事,1962年生,工商管理硕士,审计师。历任福建省财政厅干部,福建省审计厅副处长,福建省广宇集团股份公司财务部经理,兴业证券股份有限公司副总裁,兴业全球基金管理有限公司董事长。现任兴业证券股份有限公司副总裁兼首席合规官。

夏冬林先生,独立董事,1961年生,注册会计师。历任江西财经大学讲师、副教授,中华财务会计咨询公司经理,清华大学经济管理学院会计系主任。现任清华大学经济管理学院教授、博士生导师。

万维德(Mar van Weede)先生,董事,1965年生,荷兰国籍。历任Forsythe International N.V.财务经理,麦肯锡公司助理到全球副董事,海康人寿保险有限公司总经理。现任全球人寿保险集团执行副总裁。

祖百瑞(Imaad Zuberi)先生,董事,1973年生,美国国籍。历任Irvine风险投资公司,全美人寿副总裁,现任全球人寿保险集团助理副总裁。

Eric Rutten先生,董事,1962年生,荷兰国籍。历任Willems · vd Wildenberg BV合伙人和联合创立人,OOM保险公司市场营销部负责人,Axent-AEGON公司运营和IT部门负责人,阿尔贝特·海恩金融公司筹建管理团队主席,全球人寿派驻世界银行市场工作负责人,全球人寿(荷兰)人寿保险业务首席执行官。现任全球人寿(荷兰)资产管理部首席执行官。

陈百助先生,独立董事,1963年生,哲学博士。历任加拿大萨斯喀彻温大学助理教授,克雷蒙研究所助理教授,美国南加大马歇尔商学院助理教授、副教授。现任美国南加大马歇尔商学院教授。

黄明先生,独立董事,1964年生,金融学博士。历任芝加哥大学商学院金融学助理教授,斯坦福大学商学院金融学助理教授、副教授,长江商学院副院长、金融学访问教授,上海财经大学金融学院院长。现任美国康奈尔大学金融学教授(终身)、长江商学院教授、中国教育部长江学者讲座教授、《美国经济评论》编委。

于宁先生,独立董事,1954年生,律师。历任江苏省镇江市卫生局干部,中央纪律检查委员会副处长、处长。现任中华全国律师协会会长、北京大学法学院兼职教授。

郭辉先生,监事,1959年生,博士,高级经济师。历任中国农业银行信贷部,中国农业银行信托公司,中国农业银行信托公司财务处处长,中国农业银行办公室秘书处副处长、处长,中国农业银行信托公司副总经理、党委书记,中国农业银行托管部总经理,中国农业银行审计特派员。现任兴业证券股份有限公司董事长助理。

陈育能女士,监事,1974年生,工商管理硕士。历任民航快递财务会计助理经理,KPMG助理经理,新加坡Prudential担保公司财务经理,SunLife Everbright人寿保险财务计划报告助理副总裁。现任海康保险副总裁、首席财务官。

辛盟先生,监事,1975年生,经济学博士。历任山东省社会科学院研究员,天同证券研究所研究员、部门副经理、部门经理。现任兴业全球基金管理有限公司研究策划部总监助理。

2、高级管理人员概况

杨东先生,总经理,1970年生,工商管理硕士。历任福建兴业证券公司上海业务部总经理助理,证券投资部副总经理兼上海业务部副总经理,兴业证券股份有限公司证券投资部总经理,兴业证券股份有限公司总裁助理、投资总监。现任兴业全球基金管理有限公司总经理。

杜建新先生,督察长兼监察稽核部总监,1959年生,经济学学士,经济师。历任江西财经大学情报资料中心主任,中国银行三明分行办公室副主任,兴业证券股份有限公司三明营业部副总经理、上海管理总部总经理、人力资源部总经理。现任兴业全球基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

杨卫东先生,副总经理兼市场部总监,1968年生,法学学士。历任陕西团省委组织部科员,海南省省委台办接待处科员,海通证券股份有限公司海口营业部负责人、大连分公司总经理,兴业证券股份有限公司资产管理部副总经理,上海凯业集团公司总裁,兴业全球基金管理有限公司总经理助理兼市场部总监。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理。

杜昌勇先生,副总经理,1970年生,理学硕士。历任兴业证券公司福建天骜营业部电脑房负责人、上海管理总部电脑部经理,兴业证券股份有限公司证券投资部总经理助理,兴业全球基金管理有限公司兴业可转债混合型证券投资基金基金经理、基金管理部总监、投资总监。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理。

徐天舒先生,副总经理,1973年生,经济学硕士,英国特许注册会计师(ACCA)。历任中信证券股份有限公司基金管理部项目经理,澳大利亚怀特控股有限公司基金经理,海康人寿保险有限公司首席执行官特别助理、发展中心负责人、助理副总经理及投资总监。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理。

3、本基金基金经理

王晓明先生,1974年生,经济学硕士。历任上海中技投资顾问有限公司研究员、投资部经理、公司副总经理,兴业基金管理有限公司兴业可转债混合型证券投资基金基金经理(2004年3月6日至2005年10月21日)、兴业全球视野股票型证券投资基金基金经理(2006年9月20日至2007年12月28日),兴业全球基金管理有限公司投资副总监。现任兴业全球基金管理有限公司投资总监、本基金基金经理(2005年11月3日起至今)。

张惠萍女士,1976年生,经济学硕士。2002年6月加入兴业基金管理有限公司(筹),历任兴业基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理。现任本基金基金经理(2008年1月31日起至今)。

4、投资决策委员会成员

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会共由3人组成:

杨 东	兴业全球基金管理有限公司总经理
杜昌勇	兴业全球基金管理有限公司副总经理
王晓明	兴业全球基金管理有限公司投资总监、本基金基金经理

投资决策委员会主任委员由总经理杨东担任,投资决策委员会执行委员由副总经理杜昌勇担任。

上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2、办理基金备案手续;
3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;
4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6、编制季度、半年度和年度基金报告;
7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9、召集基金份额持有人大会;
10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
12、中国证监会规定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1、基金管理人承诺基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资;

2、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

3、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

(1)承销证券;
(2)向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
(5)向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6)买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(8)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

4、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

(1)越权或违规经营;
(2)违反基金合同或托管协议;
(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
(4)在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露;
(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
(6)玩忽职守、滥用职权;
(7)泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
(8)除按本公司制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他股票投资;
(9)协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;
(10)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
(11)贬损同行,以提高自己;
(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
(13)以不正当手段谋求业务发展;
(14)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;
(15)其他法律、行政法规禁止的行为。

5、基金经理承诺

(1)依照法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
(2)不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;
(3)不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
(4)不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五)基金管理人的风险管理与内部风险控制制度

1、风险管理的理念

(1)风险管理是业务发展的保障;
(2)最高管理层承担最终责任;
(3)分工明确、相互牵制的组织结构是前提;
(4)制度建设是基础;
(5)制度执行监督是保障。

2、风险管理的原则

(1)全面性原则:公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;

(2)独立性原则:公司设立独立的监察稽核部,监察稽核部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查;

(3)相互制约原则:公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系;

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性;

(5)重要性原则:公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上,内部风险控制与公司业务发展同等重要。

3、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构,由最高管理层对风险管理负最终责任,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言,包括如下组成部分:

(1)董事会:负责制定公司的风险管理政策,对风险管理负完全的和最终的责任。董事会下设执行委员会和风险控制委员会;

(2)督察长:独立行使督察权利,直接对董事会负责,及时向风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告;

(3)投资决策委员会:负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略;

(4)风险管理委员会:负责对基金投资运作的风险进行测量和监控;

(5)监察稽核部:负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察,并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助,使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标;

(6)业务部门:风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监控和降低风险。

4、内部控制制度综述

(1)风险控制制度

公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格;不断提高经营管理水平,在风险最小化的前提下,确保基金份额持有人利益最大化;建立行之有效的风险控制机制和制度,确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整;维护公司信誉,保持公司的良好形象。

针对公司面临的各种风险,包括政策和市场风险,管理风险和职业道德风险,分别制定严格防范措施,并制定岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

(2)监察稽核制度

监察稽核工作是公司内部风险控制的重要环节。公司设督察长和监察稽核部。督察长全面负责公司的监察稽核工作,可在授权范围内列席公司任何会议,调阅公司任何档案材料,对基金资产运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核;出具监察稽核报告,报公司董事会和中国证监会,如发现公司有重大违规行为,应立即向公司董事会和中国证监会报告。

监察稽核部具体执行监察稽核工作,并协助督察长工作。监察稽核部具有独立的检查权、独立的报告权、知晓权和建议权。具体负责对公司内部风险控制制度提出修改意见,并提交风险管理委员会;检查公司各部门执行内部管理制度的情况;监督公司资产运作、财务收支的合法性、合规性、合理性;监督基金财产运作的合法性、合规性、合理性;调查公司内部的违规事件;协助监管机关调查处理相关事项;负责员工的离任审计;协调外部审计事宜等。

(3)内部财务控制制度

财务管理的目的在于规范公司会计行为,保证会计资料真实、完整;加强财务管理,合理使用公司财务资源,提高公司资金的运用效率,控制公司财务风险,保护公司股东的利益,保证公司财产安全、完整和增值。

公司内部财务控制制度主要内容有:公司财务核算实行权责发生制的原则,会计使用国家许可的电算化软件。公司实行财务预算管理制度,财务行政部财务室在综合各部门财务预算的基础上负责编制并报告公司总经理,经董事会批准后组织实施。各部门应认真做好财务预算的编制和实施工作。

5、风险管理和内部风险控制的措施

(1)建立、健全内控体系,完善内控制度:公司建立、健全了内控结构,高管人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权,确保监察稽核工作是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新;

(2)建立相互分离、相互制衡的内控机制:建立、健全了各项制度,做到基金经理分开,投资决策分开,基金交易集中,形成不同部门,不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险;

(3)建立、健全岗位责任制:建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险;

(4)建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序:建立了风险管理委员会,使用适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度作出决策;

(5)建立内部监控系统:建立了有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控;

(6)使用数量化的风险管理手段:采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失;

(7)提供足够的培训:制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

6、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确,并承诺将根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为兴业银行股份有限公司,基本情况如下:

法定名称:兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")
注册地址:福州市湖东路154号
办公地址:福州市湖东路154号
注册日期:1988年7月20日
注册资本:50亿元人民币
法定代表人:高建平
组织形式:股份有限公司
基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号
托管部门总经理:霍建生
托管部门联系人:张志永
电话:021-62677777-212004

(二)主要人员情况

兴业银行总行设资产托管部,共有员工28人,平均年龄30岁,100%员工拥有大学本科以上学历,业务岗位人员均具有基金从业资格。

(三)证券投资基金托管情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格,基金托管资格批准文号:证监基金字[2005]74号。截止2009年9月30日,兴业银行已托管开放式基金11只——兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金,托管基金财产规模389.86亿元。

(四)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理制度,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部风险控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督;资产托管部内设独立、专职的稽核监察处,配备了专职内控监督监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)全面性原则:风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则:资产托管部设立独立的稽核监察处,该处室保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则:各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性。

(5)防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

4、内部风险控制制度和措施

(1)制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。
(3)风险识别与评估:稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。
(4)相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。
(5)人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。
(6)应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,基金托管人应对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金的申购与赎回、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

(1)基金托管人发现基金管理人有违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

(2)基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

(3)基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。按照规定监督基金管理人的投资运作。

(4)如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或托管协议,基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门,有权利并有义务行使法律法规、基金合同或托管协议赋予的基金托管人的任何及所有权利和救济措施,以保护基金财产的安全和基金投资人的利益,包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金财产的损失向基金管理人索赔。

三、相关服务机构

(一)基金发售机构

1、直销机构

●兴业全球基金管理有限公司直销中心
地址:上海市张杨路500号时代广场20楼
客户服务电话:400-678-0099(免长话费)、021-38824536
直销联系电话:021-58368886、021-58368919
直销业务传真:021-58368869、021-58368915
联系人:汤凡、何佳怡
公司网站:www.xyfunds.com.cn

●兴业全球基金网上直销(目前仅对持有兴业银行、建设银行、农业银行、招商银行储蓄卡的个人投资者开通网上直销业务)
交易网站:https://trade.xyfunds.com.cn
客户服务电话:400-678-0099,021-38824536

2、代销机构:

●代销银行

(1)兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
电话:021-52629999
联系人:苏健
客户服务电话:95561
公司网站: www.cib.com.cn

(2)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市仙霞路18号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:蒋超良
联系人:曹榕
电话: 021-58781234
传真: 021-58408483
客服电话:95559
网址: www.bankcomm.com

(3)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话: 0755-83198888
客户服务中心电话:95555
联系人:兰奇
网址:www.cmbchina.com

(4)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
联系人:田耕
电话:010-66107900
传真:010-66107914
客户服务电话:95588(全国)
网址:www.icbc.com.cn

(5)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
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533(全国)
联系人:王琳
网址:www.ccb.com

(6)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:金运
电话:(021)61618888
传真:(021)63602431
联系人:徐伟、汤嘉惠
客户服务热线:95528
网址:www.spdb.com.cn

(7)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市东城区正义路甲4号
办公地址:北京市东城区正义路甲4号
法定代表人:董文标
客户服务电话:95568
传真:(010)58560794
联系人:吴杰
网址:www.cmbc.com.cn

(8)中信银行股份有限公司
住所: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
电话:(010)65541405
传真:(010)65541281
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

(9)中国光大银行
住所:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
客服电话:95595(全国)
网址:www.cebbank.com

(10)中国农业银行
住所:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
客服电话:95599(全国)
网址:www.abchina.com

(11)中国银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

(12)宁波银行股份有限公司
住所:宁波市江东区中山东路294号
法定代表人:陆华裕
联系人:胡技勋
客户服务统一咨询电话:96528,上海地区962528
传真:(021)63586215
网址:www.nbcb.com.cn

(13)中国邮政储蓄银行有限责任公司
住所:北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人:刘安东
客户服务电话:95580
联系人:陈春林
传真:(010)66415194
网址:www.psbc.com

●代销券商

(1)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
联系人:杨盛芳
电话:021-68419393-1259
网址:www.xyzq.com.cn

(2)广发证券股份有限公司
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人:王志伟
电话: 020-87555888
传真: 020-87557985
联系人:肖中梅
网址:www.gf.com.cn

(3)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话: 021-23219000
传真: 021-53858549
客服电话:4008888001、95553
联系人:金芸、李笑鸣
网址:www.htsec.com

(4)国泰君安证券股份有限公司
注册地址: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:祝幼一
客户服务电话:400-8888-666
传真: 021-62569400
联系人:芮敏祺
联系电话: 021-62580818-213
网址:www.gtja.com

(5)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:李鸣
电话: 010-66568587
联系人:李洋
客服电话:4008-888-888
网址:www.chinastock.com.cn

(6)中信建投证券有限责任公司
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
联系人: 权唐
开放式基金咨询电话:4008888108
开放式基金业务传真:(010)65182261
网址: www.csc108.com

(7)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F
法定代表人:唐新宇
开放式基金咨询电话:4006208888
开放式基金业务传真:(021)50372474
联系人:张静
网址:www.bocichina.com

(8)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025-84457777-950、248
传真:025-84579879
联系人:李金龙、张小波
客服电话:025-84579897
网址:www.htsc.com.cn

(9)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40-45层
法定代表人:宫少林
传真:0755-82943237
电话:0755-82943511
联系人:黄健
客服电话:4008888111,95565
网址:www.newone.com.cn

(10)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东大道720号20楼
法定代表人:王益民
电话:021-50367888
传真:021-63326173
客服热线:021-962506或40088-88506
联系人:吴宇
网址:www.dfzq.com.cn

(11)山西证券有限责任公司
注册地址:山西省太原市迎泽大街282号
法定代表人:侯巍
客服电话:(0351)8686868
传真:(0351)8686709
联系人:张治国
网址:www.i618.com.cn

(12)东海证券有限责任公司
注册地址:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼
办公地址:上海市浦东新区东坊路989号中达广场17楼
法定代表人:朱科敏
联系人:邵一明
电话:021-50586660-8837
传真:021-50585607
网址:www.longone.com.cn

(13)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔15-16楼
法定代表人:王明权
电话:021-50818887-281
传真:021-68815009
客服电话:4008888788
联系人:刘晨
网址: www.ebscn.com

(14)湘财证券有限责任公司
地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:陈学荣
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:陈伟
客服电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com

(15)江南证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市象山北路208号
法定代表人:姚江涛
联系人:余雅娜
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
客户服务电话:0791-6768763
网址:www.scstock.com

(16)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
联系人: 李蔡
开放式基金咨询电话:安徽地区:96888;全国:400-8888-777
开放式基金业务传真:0551-2207114
网址:www.gyzq.com.cn

(17)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市永叔路15号
法定代表人:管荣升
联系人:万齐志
电话:0791- 6285337
网址:www.gsstock.com

(18)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦
法定代表人:黄耀华
联系人:高峰
客户服务热线:0755-82288968
网址:www.cc168.com.cn

(19)东莞证券有限责任公司
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:周建辉
联系人:张建平
电话:0769-2100888
传真:0769-2116999
开放式基金咨询电话:961130
开放式基金业务传真:0769-2119423
网址: www.dgzq.com.cn

(20)国海证券有限责任公司
注册地址:中国广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅峰
联系人:张建勋
开放式基金咨询电话: 0771-96100、4008888100、0755-82485852
开放式基金业务传真: 0755-82485852
网址: www.ghzq.com.cn

(21)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东南路588号26楼
办公地址:上海市浦东南路588号26楼
法定代表人:方加春
开放式基金咨询电话: 021-68761616、4008888128
开放式基金业务传真: 021-68767981
联系人: 罗芳
网址: www.tebon.com.cn

(22)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
电话:021-54033888
传真:021-54035333
客服热线:021-962505
网址:www.sw2000.com.cn

(23)联合证券有限责任公司
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、25层
法定代表人:马昭明
联系人:盛宗凌
联系电话:(0755)82492000
传真电话:(0755)82492962
客服电话:400-8888-555,(0755)25125666
网址:www.lhzq.com

(24)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务热线:4008-888-999或027-85808318
联系人:李良
电话:021-63219781
传真:021-51062920
网址:www.95579.com

(25)江南证券有限责任公司
住所:南昌市抚河北路291号
法定代表人:姚江涛
电话:(0791)6768763
传真:(0791)6789414
联系人:余雅娜
客户服务电话:(0791)6768763
网址:www.scstock.com

(26)渤海证券股份有限公司
住所:天津市经济技术开发区第一大街29号
法定代表人:张志军
联系人:王兆权
电话:(022)28451861
传真:(022)28451892
客户服务电话: 4006515988
网址: www.bhzq.com

(27)瑞银证券有限责任公司
住所: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
传真:(010)59226840
客户服务电话: 400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com

●其他代销机构

天相投资顾问有限公司
注册地址:中国北京市朝阳区幸福村中路锦绣园D座
法定代表人:林义相
联系电话:010-66045522
联系人:陈少震
客服电话:(010)66045678
网址: www.txsec.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少销售城市(网点),并另行公告。

(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:北京西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
电话:010-58598839
传真:010-58598907
联系人: 朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称:上海源泰律师事务所
办公地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦14层
负责人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51150398
经办律师:廖海、吕红
联系人:廖海

(四)审计基金资产的会计师事务所和经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
法定代表人:葛明
电话: 010-58153000
传真: 010-85188298
经办注册会计师:徐艳、蒋燕华
联系人:蒋燕华

四、基金的名称

兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

契约型上市开放式

六、基金的投资目标

本基金为把握投资对象的明确趋势、实现最优化的风险调整后的投资收益的基金产品。具体而言:本基金管理人采用多维趋势分析系统来判断投资对象的综合趋势,并采取适度灵活资产配置的方法,来实现以下目标:

1、把握中长期可测的确定收益,同时增加投资组合收益的确定性和稳定性;
2、分享中国上市公司高速成长带来的资本增值;
3、减少决策的失误率,实现最优化的风险调整后的投资收益。

七、基金的投资方向

(一)投资对象

根据法律法规的规定,本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和固定收益证券(包括各种债券和货币市场工具)以及中国证监会规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。具体投资对象将根据多维趋势分析系统来确定。

(二)投资范围

在大类资产配置层面,本基金的配置比例为:固定收益类证券的投资比重为0%-65%,股票的投资比重为30%-95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于5%。法律法规另有规定时,从其规定。

本基金投资组合至少将拒绝下列股票:

1、存在终止上市风险或者已终止上市的公司;
2、卷入严重法律纠纷,且诉讼未决的;
3、信息披露严重不规范、不透明的;
4、财务数据存在明显疑问的。

八、基金的投资策略与投资组合构建

(一)投资策略

本基金的投资策略主要体现在资产配置和单个投资品种选择两个层面。本基金总体的投资策略可以被概括为:根据对股市趋势分析的结论实施灵活的大类资产配置;运用兴业多维趋势分析系统,对公司成长趋势、行业景气趋势和价格趋势进行分析,并运用估值把关来精选个股。在固定收益类证券投资方面,本基金主要运用"兴业固定收益证券组合优化模型",在固定收益资产组合久期控制的条件下追求最高的投资收益率。

(二)投资程序

基金投资组合的管理采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金的资产配置和行业配置采用自上而下的程序,个股选择采用自下而上的程序,严格控制投资风险。以下是投资决策的各个具体环节。

1、战略性(大类)资产配置决策

投资决策委员会将定期或根据需要召开会议,审议宏观研究员与基金经理根据股市趋势的分析结论,确定今后一段时间内资产配置策略,即基金投资组合中股票和其他金融品种的构成比例。基金经理执行审定后的资产配置计划。

2、行业资产配置决策

首先,研究策划部对各行业进行趋势定位,投资决策委员会根据各行业趋势定位的结论,并在行业配置的规定范围之内初步决定今后一段时间内对一些行业的配置比例;

其次,基金经理可以适当调整投资决策委员会提出的初步行业配置权重,但对投资决策委员会决定的权重调整不得高于20%,且不得超越本基金合同规定的行业配置比例;

第三,投资决策委员会建立严格的考核程序对基金经理主动调整行业权重的合理性进行考核,并根据考核结果在不超过前条所述的权重调整幅度内具体确定基金经理对行业权重进行调整的权限。

3、股票投资组合决策

基金经理根据投资决策委员会关于大类资产配置和行业资产配置的决议,并根据个股趋势定位自主选择投资对象和投资时机,对超过权限范围的投资计划调整及时报告投资总监或投资决策委员会审议。

研究员保持对组合内上市公司的定期跟踪与调研,并每周向基金经理部反馈上市公司的最新动态和个股的趋势变化,以利于基金经理作出相应的投资决策。

4、债券投资组合决策

基金经理在投资决策委员会确定的债券组合久期和投资原则之下,运用"兴业固定收益证券组合优化模型"对中、长、短期的固定收益品种组合进行优化配置,建立债券投资组合。

5、投资指令的下达与执行及反馈

基金经理根据投资组合方案制订具体的操作计划,并以投资指令的形式下达至集中交易室。集中交易室依据投资指令具体执行股票和债券买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理并提供建议,以便基金经理及时调整交易策略。

6、基金业绩与风险评估

由研究策划部负责定期对基金投资组合进行投资绩效评估,研究在一段时期内基金投资组合的变化及由此带来的收益与损失,并对基金业绩进行有效分解,以便能更好地评估资产配置、行业配置、个股选择各自对基金业绩的贡献度。同时,研究策划部还必须对基金资产组合的投资风险进行客观的评价,在此基础上对基金经风险调整后的业绩进行评估。研究策划部定期向投资决策委员会和基金经理提供绩效评估报告,以便及时调整基金投资组合。

(三)投资限制

本基金的投资限制:

1、本基金投资于一家上市公司股票,其市值不超过该基金资产净值的10%;
2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和不超过该证券的10%;
3、本基金参与股票发行申购所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次的股票发售总量;
4、不违反基金合同中对投资比例、投资策略等的约定;
5、中国证监会规定的其他比例限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述比例规定的,基金管理人可以在10个交易日内进行调整,以使基金投资符合上述规定。法律法规或中国证监会对上述比例另有规定时,从其规定。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:中标300指数×50%+中信国债指数×45%+同业存款利率×5%

如果市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人将视情况调整本基金的业绩评价基准,并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金的投资理念是"顺势而为",只有当趋势确定,而且是各种趋势得到相互印证后,才采取相应的投资行动,尽可能地降低投资失误的可能性,加强组合收益的确定性。因此本基金在混合型基金大类中属于强调控制风险,中高风险,中高回报的基金产品。

十一、投资组合报告

本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。

本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,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取自兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)2009年第3季度报告,数据截至2009年9月30日,本报告所列财务数据未经审计。

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	16,652,508,937.82	84.90
	其中:股票	16,652,508,937.82	84.90
2	固定收益投资	1,630,480,240.72	8.31
	其中:债券	1,630,480,240.72	8.31
	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	1,196,677,728.29	6.10
6	其他资产	134,354,012.88	0.68
7	合计	19,614,020,919.71	100.00

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	99,887,030.90	0.51
B	采掘业	2,025,656,962.96	10.38
C	制造业	5,695,993,887.71	29.19
C0	食品、饮料	1,494,208,366.83	7.66
C1	纺织、服装、皮毛	48,966,201.84	0.25
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	6,780,911.76	0.03
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,060,309,437.31	5.43
C5	电子	51,933,719.05	0.27
C6	金属、非金属	900,639,330.02	4.62
C7	机械、设备、仪表	288,805,891.68	1.48
C8	医药、生物制品	1,780,778,054.70	9.13
C99	其他制造业	63,571,974.52	0.33
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,075,971,900.68	5.51
E	建筑业	739,847,104.20	3.79
F	交通运输、仓储业	119,918,601.55	0.61
G	信息技术业	944,045,125.97	4.84
H	批发和零售贸易	369,287,460.39	1.89
I	金融、保险业	4,767,680,231.41	24.43
J	房地产业	602,294,659.93	3.09
K	社会服务业	1,543,886.80	0.01
L	传播与文化产业	6,012,000.00	0.03
M	综合类	204,370,085.32	1.05
	合计	16,652,508,937.82	85.34

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	600036	招商银行	78,170,000	1,155,352,600.00	5.92
2	600016	民生银行	166,000,000	1,118,840,000.00	5.73
3	600000	浦发银行	55,182,640	925,703,650.40	4.74
4	600309	烟台万华	31,586,503	544,551,311.72	2.79
5	000063	中兴通讯	13,864,760	529,356,536.80	2.71
6	600276	恒瑞医药	12,642,812	528,722,397.84	2.71
7	000895	双汇发展	12,576,667	526,459,280.62	2.70
8	601328	交通银行	60,156,484	501,103,511.72	2.57
9	600519	贵州茅台	2,885,970	475,781,014.20	2.44
10	600028	中国石化	41,500,000	468,950,000.00	2.40

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	-	-
2	央行票据	881,740,000.00	4.52
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	745,539,640.32	3.82
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	3,200,600.40	0.02
7	其他	-	-
8	合计	1,630,480,240.72	8.36

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

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	0901037	09央票37	5,000,000	498,350,000.00	2.55
2	126018	08江铜债	3,984,660	279,563,745.60	1.43
3	0901034	09央票34	2,000,000	196,620,000.00	1.01
4	0901036	09央票36	1,900,000	186,770,000.00	0.96
5	126011	08石化债	2,084,140	177,151,900.00	0.91

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)本基金投资的前十名证券的发行主体除中兴通讯外,本期未出现被监管部门立案调查,并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中兴通讯(000063)于2008年10月7日公告称,其因在财政部开展的会计信息质量例行检查中,被财政部驻深圳市财政监察专员办事处发现存在财务报表编制、营业收入核算、个税返还手续费核算等六方面问题。该公司被处以行政处罚金额16万元,及要求公司补缴企业所得税人民币380万元(公司已在检查期间缴纳)。

对该股票投资决策程序的说明:

本基金管理人认为该公司业绩增长相对明确,在宏观经济前景不是很明确的情况下,可以适当给予估值溢价,考虑到上述问题对2007年的财务状况以及经营成果和现金流量未产生重大影响,因此经过公司投研人员和风控人员讨论,按照投资决策流程买入该股票。

(2)本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	7,914,419.89
2	应收证券清算款	96,180,566.92
3	应收股利	8,123,083.56
4	应收利息	4,049,236.54
5	应收申购款	18,086,705.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	134,354,012.88

(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)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600000	浦发银行	866,753,650.40	4.44	非公开增发

十二、基金的业绩

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。

本基金合同生效日2005年11月3日,基金业绩截止日2009年9月30日。

本基金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
2009年第3季度	-3.69%	1.72%	-1.80%	1.20%	-1.89%	0.52%
2009年上半年	51.02%	1.32%	31.80%	0.95%	19.22%	0.37%
2008年度	-40.68%	1.57%	-36.34%	1.48%	-4.34%	0.09%
2007年度	153.24%	1.66%	64.15%	1.15%	89.09%	0.51%
2006年度	160.31%	1.25%	51.71%	0.71%	108.60%	0.54%
2005.11.3-2005.12.31	1.70%	0.23%	3.17%	0.42%	-1.47%	-0.19%
自基金合同成立起至2009年9月30日	478.48%	1.48%	111.70%	1.13%	366.78%	0.35%

十三、基金的费用与税收

(一)基金运作费用的种类

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、基金合同生效后的本基金信息披露费用;
5、基金合同生效后与本基金相关的会计师费和律师费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、按照国家有关规定可以列支的其它费用。

(二)基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金管理费按基金前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提,具体计算方法如下:

$H=E\times1.5\%\div$当年天数

H:为每日应计提的基金管理费;

E:为前一日基金财产净值。

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人按照基金管理人划款指令于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

本基金的基金托管费按基金前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提,具体计算方法如下:

$H=E\times0.25\%\div$当年天数

H:为每日应计提的基金托管费;

E:为前一日基金财产净值。

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

3、上述(一)3至7项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用,由基金托管人从基金财产中支付。基金合同生效前的验资费(会计师费)、律师费、信息披露费用从基金认购费用中列支。

4、经基金管理人与基金托管人协商一致,可以酌情调低基金管理费率及基金托管费率,并报中国证监会核准后公告,无须召开基金份额持有人大会通过。

(三)与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购包括柜台(场外)申购和深圳证券交易所(场内)申购两种方式。投资人场外申购的申购费率按申购金额分段设定如下:

投资人选择交纳前端申购费用时,具体费率如下:

金额(M,含申购费)	前端申购费率
M<50万	1.5%
50万≤M<100万	1.0%
100万≤M<1000万	0.5%
M≥1000万	每笔1000元

投资人选择交纳后端申购费用时,具体费率如下:

持有时间(T)	后端申购费率
T≤1年	1.8%
1年<T≤2年	1.0%
2年<T≤3年	0.5%
T>3年	0

选择场内申购的只能选择交纳前端申购费用方式,投资人场内申购的申购费率由深圳证券交易所会员单位按照基金招募说明书中约定的场外申购的申购费率设定。

2、赎回费

投资人场外赎回的赎回费率按时间分段设定如下:

连续持有期限(T)	赎回费率
T≤1年	0.50%
1年<T≤2年	0.25%
T>2年	0

投资人场内赎回的赎回费率统一为0.5%。

说明:① 认购期持有期限起始日为基金合同生效日;申购期持有期限起始日为基金申购的注册登记日。持有期限的截止日为基金赎回的注册登记日。② 赎回费的25%划归基金财产。

3、基金转换费详见届时的基金转换公告。

4、申购赎回费率的调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费用和赎回费用标准,调整后的申购费用和赎回费用标准在最新的招募说明书中列示。上述费用标准如发生变更,基金管理人最迟应于新的费用标准实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、其他费用

其他基金费用根据有关法规及相关协议规定,按费用实际支出金额,列入当期费用,从基金财产中支付。基金合同生效前的验资费、律师费、基金合同、招募说明书、基金份额发售公告等信息披露费用由基金管理人承担。

(四)不列入基金费用的项目

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本基金财产的损失,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。基金合同生效之前的验资费、律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体应依据国家有关法律法规依法纳税。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关规定,并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动,对本基金管理人于2009年6月17日刊登《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书》进行了更新,主要更新内容如下:

(一)"重要提示"部分
更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。

(二)"三、基金管理人"部分
1、增加了公司旗下基金——兴业磐稳增利债券型证券投资基金。
2、对公司个别部门名称进行了更新。
3、对基金管理人的董事、高级管理人员的任职情况进行了更新。

(三)"四、基金托管人"部分
更新了基金托管人托管业务的经营情况。

(四)"九、基金份额的申购、赎回"部分
更新了强制赎回业务规则。

(五)"十一、基金的投资"部分
更新了"(十)基金投资组合报告"部分,数据内容截止日为2009年9月30日,所列财务数据未经审计。

(六)"十二、基金的业绩"部分
更新了该部分数据,数据内容截止日为2009年9月30日。

(七)"二十一、基金托管协议的内容摘要"部分
就基金管理人基本信息变更部分添加脚注。

(八)"二十四、其他应披露事项"部分
以下为自2009年5月3日至2009年11月2日,本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的基金公告。

序号	事项名称	披露日期
1	关于旗下部分基金参加联合证券定期定额申购费率优惠活动的公告	2009-5-4
2	关于旗下兴业趋势投资混合型基金(LOF)和兴业全球视野股票型基金投资丹化科技(600844)非公开发行股票的公告	2009-5-13
3	关于旗下基金所持有的长江电力(600900)股票估值方法变更的公告	2009-5-19
4	关于旗下部分基金参加中国银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	2009-5-20
5	关于旗下部分基金参加中国银行基金定期定额业务申购费率优惠活动的公告	2009-5-20
6	关于在中国银行开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	2009-5-20
7	关于通过光大证券网上交易系统申购兴业趋势基金费率优惠活动的公告	2009-5-22
8	关于聘任公司高级管理人员的公告	2009-6-3
9	关于旗下部分基金参加兴业银行基金定期定额业务申购费率优惠活动的公告	2009-6-9
10	关于董事变更的公告	2009-6-12
11	关于通过湘财证券、海通证券网上交易系统申购兴业趋势基金费率优惠活动的公告	2009-6-16
12	关于旗下部分基金参加上海浦东发展银行网上基金申购费率优惠活动的公告	2009-6-29
13	关于旗下部分基金参加中国邮储银行定期定额业务申购费率优惠活动延期的公告	2009-6-29
14	旗下各基金2009年半年度资产净值公告	2009-7-1
15	关于调整旗下基金在光大银行定期定额投资业务起点金额的公告	2009-7-8
16	关于修改兴业趋势投资混合型基金强制赎回等相关规定的公告	2009-8-5
17	关于增加光大证券为办理旗下部分基金定期定额投资业务代销机构的公告	2009-8-10
18	兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)第五次分红公告	2009-8-12
19	关于在招商银行开通基金后端定投业务的公告	2009-8-18
20	关于旗下部分基金参加创业板市场投资的公告	2009-9-23
21	关于公司旗下部分基金投资浦发银行(600000)非公开发行股票的公告	2009-10-12
22	关于旗下部分基金参加民生银行网上银行申购费率优惠活动的公告	2009-10-17
23	关于公司旗下部分基金投资烽火通信(600498)非公开发行股票的公告	2009-10-22

上述内容仅为摘要,须与本《招募说明书》(正文)所载之详细资料一并阅读。

兴业全球基金管理有限公司
2009年12月17日