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。

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。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。

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)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。

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2006年11月2日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2006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:郑苏芬
联 系 人:陈静
联系电话:021-58368998
组织形式:有限责任公司
注册资本:9,800万元

兴业基金管理有限公司(以下简称"公司")是经中国证监会证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。由兴业证券股份有限公司(持股比例48.98%)、国家开发投资公司(持股比例25.51%)、中投信用担保公司(持股比例15.31%)和福建省邮政局(持股比例10.2%)共同发起设立,注册资本为9800万元。

截止2006年11月2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和兴业全球视野股票型证券投资基金共四只开放式基金。

兴业基金管理有限公司下设投资决策委员会、风险控制委员会、基金管理部、研究策划部、监察稽核部、市场部、客户服务中心、机构理财咨询部、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、经理及其他高级管理人员概况

郑苏芬女士,董事长,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。

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。

杨东先生,董事、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。

祝要斌先生,董事,1962年生,硕士研究生,中共党员,高级工程师。历任国家原材料投资公司钢铁处副处长、国家开发投资公司处长、国融资产管理有限公司总经理助理、证券投资部、投资银行部副经理、战略发展部战略处处长,现任国家开发投资公司金融投资部副总经理。

孙家骐先生,董事,1942年生,高级会计师,中国注册会计师,中央财经大学兼职教授,硕士生导师。历任北京市第一食品公司总经理,北京市国有资产管理局局长,北京市财政局局长,北京市地方税务局局长,中国交通银行董事,世界银行住房与社会保障制度改革北京项目办公室主任,北京市证监会主席、中国证监会北京证管办主任。现任中投信用担保有限公司董事长。

董志宏先生,董事,1967年生,工商管理硕士。历任福建省邮电管理局计划财务处会计,福建省南平市邮电局计划财务科科长,福建省福州市邮政局副总会计师兼计划财务科科长,福建省邮电管理局计划财务处副处长,福建省邮政局计划财务处副处长,福建省邮政储汇局副局长,福建省邮政局副总会计师兼计划财务处处长、企业发展处处长。现任福建省邮政局副局长。

夏冬林先生,独立董事,1961年生,清华大学经济管理学院教授、博士生导师、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。

于宁先生,独立董事,1954年生,律师。历任江苏省镇江市卫生局任干部,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。

王连万先生,独立董事,1962年生,马来西亚国籍。历任澳大利亚安保(AMP)总公司精算与投资产品业务助理,新加坡吉宝保险公司(富通Fortis附属公司)财务总监兼投资部总经理,新加坡吉宝投资管理有限公司执行董事,法国巴黎银行(BNP Paribas)高级业务经理、太平养老保险有限公司总经理。现任新加坡大东方人寿保险有限公司国际市场发展总经理。

黄亚钧先生,独立董事,1953年生,复旦大学经济学教授、博士生导师。历任复旦大学世界经济系副主任、经济学院副院长、院长,澳门大学副校长等。

严卫先生,监事,1968年生,硕士,注册会计师、律师。历任广东顺德市信德集团财务总监,兴业证券股份有限公司投资银行总部副总经理,兴业证券股份有限公司财务会计部副总经理,现任兴业证券股份有限公司财务会计部总经理。

苏日庆先生,监事,1962年生,理工硕士和工商管理硕士。历任国家能源投资公司工程师,国投中型水电公司经营部、计划财务部部门副经理、经理,湖北金源水电发展有限公司副总经理、总经理和董事,国融资产管理有限公司部门经理。现任国家开发投资公司金融投资部高级经理、资深经理。

杜建新先生,督察长,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,兴业基金管理有限公司监察稽核部总监。

陈曦女士,副总经理,1971年生,工商管理硕士。历任兴业证券股份有限公司上海天钥桥路营业部总经理、上海管理总部总经理、总裁助理兼投资银行副总监。

2、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团队式投资管理模式。投资决策委员会共由三人组成:

杨 东 兴业基金管理有限公司总经理
杜昌勇 兴业基金管理有限公司投资总监兼兴业可转债混合型证券投资基金基金经理
王晓明 兴业基金管理有限公司投资副总监、本基金和兴业全球视野股票型证券投资基金基金经理

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投资总监杜昌勇担任。

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)。现任兴业基金管理有限公司投资副总监、本基金(2005年11月3日起至今)和兴业全球视野股票型证券投资基金基金经理。

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

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:39.99亿元人民币
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:赵建明
电话:021-62159219

(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。截至2006年9月30日,兴业银行已托管开放式基金五只 -- 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,托管基金财产规模 50.78亿元。

三、相关服务机构

(一)基金发售机构

1、直销机构

名称:兴业基金管理有限公司
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:郑苏芬
客户服务电话:021-38714536
直销联系电话:021-58368886
直销业务传真:021-58368869
联系人:汤凡
公司网站:www.xyfunds.com.cn

2、代销机构:

(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)62677777-218937
联系人:陈晓瑾
客户服务电话:95561
公司网站:www.cib.com.cn

(2)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
客服热线:021-68419974
联系人:杨盛芳
公司网站:www.xyzq.com.cn

(3)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

(4)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:021-53594566
传真:021-53858549
客服电话:021-962503
联系人:金芸
网址:www.htsec.com

(5)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

(6)中国银河证券有限责任公司
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:朱利
电话:010-66568587
联系人:郭京华
网址:www.chinastock.com.cn

(7)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:黎晓宏
联系电话:010-65183888-86073
联系人:权唐
公司网站:www.csc108.com

(8)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:平岳
联系电话:021-68604866
联系人:张静
网址:www.bocichina.com

(9)华泰证券有限责任公司
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:025-84457777-721
传真:025-84579879
联系人:袁红彬
客服电话:025-84579897
网址:www.htsc.com.cn

(10)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:4008888111,0755-26951111
网址:www.newone.com.cn

(11)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:021-50367888-3006
传真:021-50366868
客服热线:021-962506
联系人:刘方
网址:www.dfzq.com.cn

(12)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:吴晋安
联系电话:0351-8686766、8686708
联系人:刘文康、邹连星
网址:www.i618.com.cn

(13)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
法定代表人:顾森贤
联系人:龙涛
电话:021-50588876
传真:021-50586660-8880
网址:www.longone.com.cn

(14)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:021-68816000
传真:021-68815009
客服电话:021-68823685
联系人:刘晨
网址:www.ebscn.com

(15)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、021-68634818-8631
传真:021-68865938
联系人:陈伟
客服电话:021-68865020
网址:www.xcsc.com

(16)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:肖军生
电话:0755-83325909
传真:0755-83366612
客户服务电话:0755-83325909、83341390
网址:www.scstock.com

(17)国元证券有限责任公司
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:0551-2634400-1171
网址:www.gyzq.com.cn

(18)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:010-84533151转802、822
联系人:陈少震
网址:www.txsec.com

(19)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:0791-6289771
网址:www.gsstock.com

(20)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:魏云鹏
联系人:高峰
电话:0755-83516094
传真:0755-83516199
客户服务热线:0755-82288968
网址:www.cc168.com.cn

(21)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:张劲春
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

(22)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

(23)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:021-58408842
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(24)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)82090060
客户服务中心电话:95555
联系人:刘薇
客户服务电话:95555
公司网站:www.cmbchina.com

(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楼
负责人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51150398
经办律师:廖海、田卫红
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:安永大华会计师事务所
办公地址:上海市长乐路989号
法定代表人:沈钰文
电话:021-24052000
传真:021-54075507
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截至2006年9月30日,本报告所列财务数据未经审计。

1、本报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
1	股票	444,096,352.66	82.50%
2	债券	2,594,840.90	0.48%
3	权证	—	0.00%
4	银行存款及清算备付金合计	79,442,427.72	14.76%
5	其他资产	12,180,137.07	2.26%
资产合计		538,313,758.35	100%

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	783,217.66	0.15%
B	采掘业	6,430,608.30	1.21%
C	制造业	268,596,381.44	50.45%
C0	其中:食品、饮料	64,140,425.54	12.05%
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	2,142,500.00	0.40%
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	20,883,580.80	3.92%
C5	电子	17,052,717.36	3.20%
C6	金属、非金属	34,875,693.68	6.55%
C7	机械、设备、仪表	97,310,459.08	18.28%
C8	医药、生物制品	25,901,445.28	4.86%
C99	其他制造业	6,289,559.70	1.18%
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	7,772,800.00	1.46%
G	信息技术业	22,592,874.25	4.24%
H	批发和零售贸易	31,661,575.04	5.95%
I	金融、保险业	87,160,325.22	16.37%
J	房地产业	15,902,967.75	2.99%
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	3,195,603.00	0.60%
M	综合类	—	—
	合计	444,096,352.66	83.41%

3、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	5,038,413	50,081,825.22	9.41%
2	000895	S双汇	1,389,055	43,296,844.35	8.13%
3	600016	民生银行	4,830,000	26,033,700.00	4.89%
4	600150	沪东重机	1,003,418	23,871,314.22	4.48%
5	000768	西飞国际	2,000,000	21,500,000.00	4.04%
6	600143	金发科技	800,000	20,312,000.00	3.81%
7	600563	法拉电子	1,450,061	17,052,717.36	3.20%
8	600765	力源液压	1,559,126	16,620,283.16	3.12%
9	600500	中化国际	2,867,307	16,458,342.18	3.09%
10	600675	中华企业	2,000,000	15,120,000.00	2.84%

4、本报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
国家债券	—	—
央行票据	—	—
可转换债券	2,594,840.90	0.49%
债券投资合计	2,594,840.90	0.49%

5、本报告期末债券明细

(1)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	凯诺转债	2,410,693.70	0.45%
2	招商转债	184,147.20	0.03%

(2)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名可转换债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	凯诺转债	2,410,693.70	0.45%
2	招商转债	184,147.20	0.03%

6、投资组合报告附注

(1)本基金本期投资的前十名证券中,无报告期内发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、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库之外的股票。

(3)本基金在本报告期内没有超过净值10%的股票投资。

(4)本报告期末基金的其他资产构成

序号	项目	金额
1	交易保证金	2,488,090.18
2	应收证券交易清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	24,699.90
5	应收申购款	408,056.19
6	其他应收款	9,200,000.00
7	待摊费用	59,290.80
8	合 计	12,180,137.07

(5)本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金持有的可转换债券均未处于转股期。

(6)报告期内基金持有权证情况

本报告期内本基金未持有权证。

(7)报告期内本基金未投资资产支持证券情况

本报告期内本基金未投资资产支持证券。

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2006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
过去一个月	7.85%	0.77%	2.75%	0.46%	5.10%	0.31%
过去三个月	9.94%	1.05%	1.20%	0.68%	8.74%	0.37%
自基金合同生效起至2006年9月30日	87.34%	1.08%	30.24%	0.65%	57.10%	0.43%

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×1.5%÷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×0.25%÷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2005年9月16日刊登《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》进行了更新,主要更新内容如下:

(一)"三、基金管理人"部分

1、本基金管理人管理基金增加了2006年9月20日成立的兴业全球视野股票型证券投资基金。
2、公司下设部门中增加了客户服务中心和机构理财咨询部。
3、"(二)主要人员情况"中删除不再担任本公司董事兰荣先生的简历,增加了担任本公司董事张训苏先生的简历。
4、更新了公司投委会个别成员的任职情况。
5、根据新颁布的《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》的要求,增加了本基金现任基金经理曾经管理的基金名称及管理时间,本基金历任基金经理的姓名及管理本基金的时间。

(二)"四、基金托管人"部分

对基金托管人主要人员情况和托管业务经营情况进行了更新。

(三)"五、相关服务机构"部分

1、更新了销售代销机构兴业银行股份有限公司和交通银行股份有限公司联系人及电话。
2、增加"招商银行股份有限公司"作为销售代理机构。

(四)"六、基金的募集"

删去"(三)募集信息"的部分内容,调整为"本基金经中国证监会证监基金字[2005]156号文批准,由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集,自2005年9月19日起至2005年10月28日向全社会公开募集。经安永大华会计师事务所验资,截止2006年11月3日,募集期募集的基金份额及利息转份额共计927,645,098.72份,募集户数为6783户。"

(五)"九、基金份额的申购、赎回"部分

1、更新了本基金申购费率结构。
2、增加了"(十)定期定额投资计划"部分内容。

(六)"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2006年9月30日,所列财务数据未经审计。

(七)"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2006年9月30日。

(八)"十五、基金的费用与税收"部分

删除了"(三)与基金销售有关的费用"中认购费部分,并更新了申购费率结构。

(九)"二十四、其他应披露事项"部分

更新了该部分内容,以下为自2006年5月3日刊登本基金更新招募说明书至2006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	关于增加招商银行为兴业可转债混合型证券投资基金和兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)代销机构的公告	2006-5-11
2	关于旗下兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)申购费率优惠活动的公告	2006-5-18
3	关于兴业趋势投资混合型基金(LOF)恢复大额申购业务的公告	2006-6-2
4	兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书及摘要	2006-6-17
5	兴业基金管理有限公司旗下各基金2006年半年度资产净值公告	2006-7-1
6	兴业基金管理有限公司关于旗下基金资产支持证券投资方案的公告	2006-7-5
7	兴业基金管理有限公司关于董事变更的公告	2006-7-17
8	兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)2006年第2季度报告	2006-7-20
9	关于旗下基金开办定期定额投资业务的公告	2006-8-4
10	关于调整通过兴业银行网上交易系统认、申购旗下基金费率的公告	2006-8-18
11	兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)2006年半年度报告及摘要	2006-8-26
12	关于旗下兴业趋势投资基金投资G重机(600150)非公开发行股票的公告	2006-8-31
13	关于旗下部分基金投资G名流(000667)非公开发行股票的公告	2006-10-17
14	关于调整旗下部分基金费率结构的公告	2006-10-18
15	兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)2006年第3季度报告	2006-10-25

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。

兴业基金管理有限公司
2006年12月16日

证券编码:600603 证券简称:ST兴业 编号:2006-028

上海兴业房产股份有限公司诉讼事项公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本公司根据法院分案诉讼的要求,于二〇〇六年十二月十四日向上海市第二中级人民法院递交民事起诉状。原告上海兴业房产股份有限公司因利息损失追偿起诉被告上海纺织住宅开发总公司。

起诉的事实和理由:由于被告系原告的原大股东,长期以来被告利用其实际控制地位向原告巨额借款,期间发生数众多,原告、被告之间也每年均有函证确认相互间的欠款总款及应付利息的情况,并在原告已经撤诉的贵院(2006)沪二中民三(商)初字第154号案件的前期审理过程中,在法院的主持下,原被告进行了全面细致的对帐工作,借款本金及保证代偿的本息已经通过分案诉讼以贵院(2006)沪二中民三(商)初字第236号民事判决书、(2006)沪二中民三(商)初字第237号民事调解书已经得到法院的支持,但另有借款利息没有归还,故依据《民法通则》的有关规定提起诉讼。

诉讼请求:

1、依法判令被告归还1977年1月17日至2005年12月31日期间因被告向原告借款占用原告资金以同期银行借款利率计算的原告利息损失人民币115,409,110.11元及根据借款合同约定超出同期银行贷款利率的差额利率计提的被告应付利息人民币46,105,047.92元,利息损失追偿总计人民币161,514,158.03元。

2、依法判令本案诉讼费由被告承担。

目前,上海市第二中级人民法院正在立案之中。本公司按《上市规则》的要求,及时披露相关信息。本公司提请投资者注意市场风险。

特此公告。

上海兴业房产股份有限公司
二〇〇六年十二月十五日

股票简称:钱江生化 证券代码:600796 编号:临2006—031

浙江钱江生物化学股份有限公司2006年第二次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

重要内容提示:

● 本次会议没有否决和修改提案的情况;
● 本次会议没有新增提案;
● 本次会议以现场记名投票方式表决

一、会议召开和出席情况

浙江钱江生物化学股份有限公司2006年第二次临时股东大会于2006年12月15日上午9时在公司会议室召开。出席大会的股东、股东代表和委托代理人共28人,代表股份122,524,795股,占公司股份总数的44.72%。符合《公司法》和《公司章程》的有关规定。

会议由公司董事长马炎主持,经认真审议,并以记名投票方式表决通过了如下决议:

二、提案审议情况

以122,524,795股赞成,0股反对,0股弃权,通过了关于核销应收帐款坏帐和设备净值共计8,884,047.75元的议案。

上述议案均系普通决议案,经出席本次股东大会的股东及股东代理人所持表决权的二分之一以上通过。

三、律师见证情况

本次股东大会审议的上述议案,经上海市锦天城律师事务所李波律师现场见证,并出具了《法律意见书》,认为:本次大会的召集、召开程序、出席会议的人员资格及会议表决程序符合法律、法规和《公司章程》的规定,大会决议合法有效。

四、备查文件目录

1、2006年第二次临时股东大会决议;
2、上海市锦天城律师事务所律师出具的《法律意见书》。

特此公告。

浙江钱江生物化学股份有限公司
2006年12月16日