兴业全球基金管理有限公司 兴业银行股份有限公司（LOF）2008年年度报告摘要

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
送出日期：2009年3月28日

§1 重要提示及目录

1.1 本年度报告摘要摘自本基金2008年年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

§2 基金简介

2.1 基金简况

基金简称	兴业趋势投资混合（LOF）	
基金主代码	163402	
交易代码	163403	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年11月3日	
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	
报告期末基金份额总额	20,130,765,832.39份	

2.2 联系人和联系方式

	基金管理人	基金托管人
姓名	王佩	张志刚
联系电话	021-58358998	021-62677777－212004
电子邮箱	dujx@xyfunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话	4006780099，021-38824536	95561
传真	021-58368858	021-62159217

2.4 信息披露方式及置备地点

本基金年度报告摘要刊载媒体名称	www.xyfunds.com.cn
本基金年度报告全文置备地点	基金管理人、基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年
基金净收益	-1,192,483,355.85	1,027,251,485.29	252,270,680.55
基金净亏损	-11,301,975,983.28	7,762,188,304.37	628,792,246.42
期末可分配基金份额利润	-54.22%	60.53%	107.77%
期末基金资产净值	-40.68%	153.24%	160.31%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年
期末可分配单位份额利润	0.0289	0.1341	0.5813
期末基金资产净值	15,281,833,307.84	26,506,985,239.03	1,340,635,970.80
期末基金份额净值	0.7591	1.3470	2.4081

注：1、本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入扣减不计入损益的前期公允价值变动损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加本期公允价值变动损益。

2、上述基金业绩指标不包含投资者申购基金的费用，也不考虑投资者赎回基金的费用。

3、期末可分配利润按期末可分配单位份额利润乘以期末基金份额总额计算。

3.2 基金净值表现

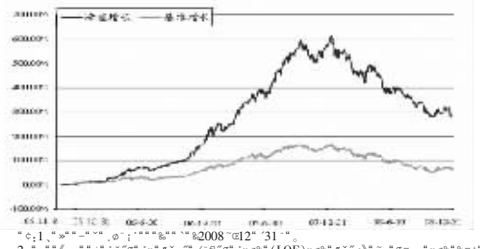
3.2.1 本报告期（2008年1月1日至2008年12月31日）基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-9.74%	1.45%	-6.99%	1.49%	-2.75%	-0.04%
过去三个月	-17.83%	1.36%	-15.21%	1.46%	-2.62%	-0.10%
过去六个月	-40.68%	1.57%	-36.34%	1.48%	-4.34%	0.09%
过去一年	291.06%	1.52%	58.53%	1.17%	232.53%	0.35%
自基金合同生效起至今	297.71%	1.48%	63.56%	1.14%	234.15%	0.34%

注：1、业绩比较基准=300×沪深300指数收益率+100×上证国债指数收益率

2、本基金合同生效日为2005年11月3日，本报告期末基金尚处于建仓期，本报告期内各项投资比例均在合同规定的范围内。

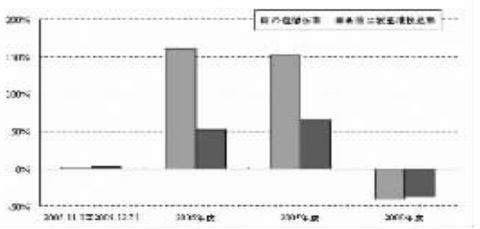
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、业绩比较基准=300×沪深300指数收益率+100×上证国债指数收益率

2、本基金合同生效日为2005年11月3日，本报告期末基金尚处于建仓期，本报告期内各项投资比例均在合同规定的范围内。

3.2.3 基金净值表现与同类型基金业绩比较情况



注：1、业绩比较基准=300×沪深300指数收益率+100×上证国债指数收益率

2、本基金合同生效日为2005年11月3日，本报告期末基金尚处于建仓期，本报告期内各项投资比例均在合同规定的范围内。

3.3 过去三年每个会计年度的收益率

年度	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	超额收益率
2008年	0.420	444,291,822.49	382,936,034.55	827,227,857.04	
2007年	1.300	891,123,788.24	613339534.35	1,504,463,322.59	
2006年	1.000	32,489,229.81	11,189,610.61	43,678,840.42	
合计	2.720	1,367,904,840.54	1,007,465,179.51	2,375,370,020.05	

§4 管理人报告

4.1 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.1.1 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的说明

本报告期内，本基金管理人能够按照证券投资基金管理人的法律法规、基金合同的规定，谨慎、勤勉地管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。

4.1.2 报告期内本基金投资策略的执行情况

报告期内，本基金根据宏观经济、证券市场的变化，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。

4.2 报告期内本基金投资组合的主要变动情况

报告期内，本基金投资组合的主要变动情况

4.3 报告期内本基金业绩表现

4.3.1 报告期内本基金业绩表现

报告期内，本基金业绩表现

4.3.2 报告期内本基金业绩表现与同类型基金业绩比较

报告期内，本基金业绩表现与同类型基金业绩比较

4.4 报告期内本基金投资策略的执行情况

报告期内，本基金投资策略的执行情况

4.5 报告期内本基金投资组合的主要变动情况

报告期内，本基金投资组合的主要变动情况

4.6 报告期内本基金业绩表现

报告期内，本基金业绩表现

4.7 报告期内本基金投资策略的执行情况

报告期内，本基金投资策略的执行情况

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况的说明

报告期内，本基金托管人遵规守信

5.2 报告期内本基金托管人的业务活动情况

报告期内，本基金托管人的业务活动情况

§6 审计报告

本基金2008年年度报告财务报表经过了具有证券从业资格的会计师事务所的审计，请投资者阅读。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

兴业趋势投资混合（LOF）

资产	2008年12月31日	2007年12月31日
银行存款	632,225,957.44	5,955,905,652.01
结算备付金	28,091,114.62	5,906,678.18
存出保证金	3,750,000.00	3,477,091.21
交易性金融资产	14,521,819,276.75	20,366,752,832.02
其中：股票投资	7,608,231,244.96	19,016,938,976.42
债券投资	-	-
资产支持证券投资	6,913,588,031.79	1,349,813,855.60
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	45,569,443.65
应收证券清算款	-	-
应收利息	-	210,250,000.00
应收股利	165,584,329.44	12,344,197.84
其他资产	-	-
应收申购款	1,056,615.86	62,479,903.30
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
递延所得税资产	15,352,527,294.11	26,662,685,798.21
其他流动资产	-	-
资产总计	2008年12月31日	2007年12月31日
负债：银行透支	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	-	-
应付托管费	-	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	23,970,262.48	-
其他负债	14,649,541.01	114,397,468.78
应付利息	20,332,808.51	31,660,654.87
预计负债	3,388,801.43	5,276,775.82
应付赎回费	-	-
其他应付款	6,647,103.88	2,471,250.43
递延所得税负债	-	-
其他负债	-	-
负债合计	-	-
实收基金	5,040,389,246.01	4,927,188,076.63
未分配利润	10,241,444,061.83	21,579,797,162.40
净资产：	15,281,833,307.84	26,506,985,239.03
其中：未分配利润	15,352,527,294.11	26,662,685,798.21
净资产总计	2008年12月31日	2007年12月31日
基金份额总额	5,040,389,246.01	4,927,188,076.63
单位净值	0.7591	1.3470
基金份额净值	20,130,765,832.39	26,506,985,239.03

注：1、本报告期末基金份额总额为20,130,765,832.39份。

2、本报告期末基金份额净值为0.7591元。

7.2 利润表

兴业趋势投资混合（LOF）

项目	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入	-10,853,293,570.20	8,043,488,759.22
1.利息	239,984,679.47	39,839,147.99
2.投资收益	35,219,375.38	21,690,769.60
3.公允价值变动损益	198,860,389.62	16,285,732.30
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	5,904,914.47	1,862,646.09
减：二、费用	-	-
6.管理人报酬	-992,567,132.50	1,255,594,320.96
7.托管费	-1,118,410,234.30	1,176,386,597.94
8.销售服务费	-	-
9.交易费用	11,461,996.59	12,501,489.82
10.利息支出	-	-
11.其他费用	-10,080,195.89	16,274,623.70
三、利润总额（亏损以“-”号填列）	124,461,301.10	50,431,609.50
减：四、所得税费用	-10,109,492,627.43	6,734,936,819.08
五、净利润（亏损以“-”号填列）	-	-
加：六、年初未分配利润	8,781,510.26	13,118,471.19
其中：调整年初未分配利润	-448,682,413.08	-281,300,454.85
七、可供分配利润	-314,713,356.76	-188,254,043.64
减：八、应付普通股股利	-52,452,226.17	-31,375,673.93
九、期末可供分配利润	-	-
减：十、应付优先股股利	-73,852,295.99	-52,496,050.18
十一、期末未分配利润	-7,104,308.49	-8,720,260.03
其中：期末未分配利润	-7,104,308.49	-8,720,260.03
十二、可供股东分配的利润	-560,225.67	-454,427.07
十三、未分配利润	-11,301,975,983.28	7,762,188,304.37
其中：已分配利润	-	-
十四、可供分配的利润	-11,301,975,983.28	7,762,188,304.37

7.3 所有者权益（净资产）变动表

兴业趋势投资混合（LOF）

项目	2008年1月1日至2008年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、期初净资产	4,927,188,076.63	21,579,797,162.40	26,506,985,239.03
二、本期经营活动产生的净资产变动数（本期利润）	-	-11,301,975,983.28	-11,301,975,983.28
三、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净值减少以“-”号填列）	113,201,169.38	790,850,739.75	904,051,909.13
其中：1.申购款	1,872,658,575.10	6,726,758,830.31	8,599,417,405.41
2.赎回款	-1,759,457,405.72	-5,935,908,090.56	-7,695,365,496.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净值减少以“-”号填列）	-	-827,227,857.04	-827,227,857.04
五、期末净资产	5,040,389,246.01	10,241,444,061.83	15,281,833,307.84

兴业趋势投资混合（LOF）

项目	2007年1月1日至2007年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、期初净资产	556,708,177.54	783,927,793.26	1,340,635,970.80
二、本期经营活动产生的净资产变动数（本期利润）	-	7,762,188,304.37	7,762,188,304.37
三、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净值减少以“-”号填列）	4,370,479,899.09	14,538,144,387.36	18,908,624,286.45
其中：1.申购款	6,668,462,805.99	22,866,242,643.39	29,534,705,449.38
2.赎回款	-2,297,982,906.90	-8,328,098,256.03	-10,626,081,162.93
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,504,463,322.59	-1,504,463,322.59
五、期末净资产	4,927,188,076.63	21,579,797,162.40	26,506,985,239.03

7.4 报表附注

7.4.1 基金会计责任方声明

7.4.1.1 基金会计责任方声明

7.4.1.2 基金会计责任方

7.4.2 会计政策、会计估计及其变更

7.4.2.1 会计政策

7.4.2.2 会计估计

7.4.2.3 会计政策、会计估计及其变更的影响

7.4.3 税项

7.4.3.1 税项

7.4.3.2 税项说明

7.4.4 投资

7.4.4.1 投资

7.4.4.1.1 投资

7.4.4.1.2 投资

7.4.4.1.3 投资

7.4.4.2 投资

7.4.4.2.1 投资

7.4.4.2.2 投资

7.4.4.3 投资

7.4.4.3.1 投资

7.4.4.4 投资

7.4.4.4.1 投资

7.4.4.5 投资

7.4.4.6 投资

7.4.5 投资

7.4.5.1 投资

7.4.5.2 投资

7.4.5.3 投资

7.4.6 投资

7.4.6.1 投资

7.4.6.2 投资

7.4.7 关联方关系及关联方交易

7.4.7.1 关联方关系

7.4.7.2 关联方交易

7.4.8 利润分配

7.4.8.1 本报告期内利润分配

7.4.8.2 本报告期内利润分配

7.4.8.3 本报告期内利润分配

7.4.9 其他重大事项

7.4.9.1 其他重大事项

7.4.9.2 其他重大事项

7.4.9.3 其他重大事项

7.4.9.4 其他重大事项

7.4.9.5 其他重大事项

7.4.9.6 其他重大事项

7.4.9.7 其他重大事项

7.4.9.8 其他重大事项

7.4.9.9 其他重大事项

7.4.9.10 其他重大事项

7.4.9.11 其他重大事项

7.4.9.12 其他重大事项

7.4.9.13 其他重大事项

7.4.9.14 其他重大事项

7.4.9.15 其他重大事项

7.4.9.16 其他重大事项

7.4.9.17 其他重大事项

7.4.9.18 其他重大事项

7.4.9.19 其他重大事项

7.4.9.20 其他重大事项

7.4.9.21 其他重大事项

7.4.9.22 其他重大事项

7.4.9.23 其他重大事项

7.4.9.24 其他重大事项

7.4.9.25 其他重大事项

7.4.9.26 其他重大事项

7.4.9.27 其他重大事项

7.4.9.28 其他重大事项

7.4.9.29 其他重大事项