兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)招募说明书

【重要提示】

本基金于2010年8月9日经中国证监会证监许可[2010]1068号文核准募集。

本基金管理人保证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投益作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者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。在投资者作出投资决策后，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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
二〇一〇年九月

第一部分 绪言

《兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《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》”)以及《兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“本合同”或“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)(以下简称“基金”或“本基金”)是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“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。基金投资者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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)
2、基金管理人或本基金管理人：指兴业全球基金管理有限公司
3、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
4、基金合同或本基金合同：指《兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书：指《兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)招募说明书》，及其定期的更新
7、基金份额发售公告：指《兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)份额发售公告》
8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订
9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订
10、《销售办法》：指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订
11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订
12、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订
13、中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区
14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
15、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会
16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
17、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
18、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构
19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及其他相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者
20、基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者
21、基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者
22、基金销售业务：指基金的宣传推介、认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
23、销售机构：指直销机构和代销机构
24、直销机构：指兴业全球基金管理有限公司
25、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构
26、基金销售网点：指直销机构的直销柜台、网上直销及代销机构的代销网点
27、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
28、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司或接受兴业全球基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构
29、注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
30、证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
31、基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
32、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户
33、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期
34、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期
35、基金募集期限：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月
36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
38、日：指公历日
39、月：指公历月
40、T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日
41、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)
42、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
43、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
44、发售：在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
45、认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为
46、申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为
47、赎回：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为
48、上市交易：基金合同生效后投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
49、场外：通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回
50、场内：通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回
51、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为
52、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施变更所持基金份额销售机构的操作
53、系统内转托管：投资者将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为
54、跨系统转托管：投资者将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为
55、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
56、巨额赎回：本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的10%的情形
57、元：指人民币元
58、基金收益：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额
59、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
60、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值
61、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值
62、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
63、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、基金管理人、基金托管人的互联网网站及其他媒体
64、《业务规则》：指《兴业证券基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和基金投资者共同遵守
65、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

第三部分 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
住所：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：人民币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”)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3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。

目前，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、兴业稳健增利债券型证券投资基金、兴业合润分级股票型证券投资基金共8只基金。

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、经理及其他高级管理人员概况

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。

邹苏芬女士，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。

万维德(Mar van Weede)先生，董事，1965年出生，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。

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。

霍以礼先生(Elio Fattorini)，董事，1970年生，荷兰国籍，美国达特茅斯学院塔克商学院MBA。历任巴林银行分析师、贝恩管理咨询公司高级助理、博思艾伦咨询公司顾问，荷兰银行资产管理战略和并购部高级副总裁、亚太区公司业务发展部负责人。现任AEGON资产管理公司亚洲区负责人(香港)。

陈百助先生，独立董事，1963年生，哲学博士。历任加拿大萨斯哥彻温大学助理教授，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。

郑辉先生，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。历任摩根士丹利亚洲证券有限公司上海业务部总经理助理，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。

辛爱先生，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，兴业全球基金管理有限公司研究部总监助理，副总监。现任兴业全球基金管理有限公司金融工程与专题研究部总监。

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。现任兴业证券股份有限公司总经理。

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，上海营理总部总经理、人力资源部总经理，兴业全球基金管理有限公司监察稽核部总监。现任兴业全球基金管理有限公司督察长。

杨卫东先生，副总经理兼市场部总监，1968年生，法学学士。历任庆西团省委组织部科员、海南省省委办公接待处科员，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兼市场部总监。

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整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，兴业证券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

申庆宪先生，1974年生，工商管理硕士。1997年7月至2003年9月任兴业证券研究发展中心研究员；2003年9月任兴业基金管理有限公司行业研究员；2007年10月19日至今担任兴业趋势证券投资基金(LOF)基金经理助理；2008年2月26日至今担任基金管理部总监助理；拟任本基金基金经理。

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。投资决策委员会成员由5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，兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理
傅鹏博 兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监，兴业社会责任股票型证券投资基金基金经理
施东非 兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监

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、编制中期和年度基金报告；
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)欺瞒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)挪用社会公德、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控制制度

1、风险管理的总体目标

(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)全工明确、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，及时向合规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

(下转D10版)

兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)份额发售公告

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
发售时间：2010年10月12日至2010年10月26日

重要提示

1、兴业沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请已获中国证监会证监许可[2010]1068号文批准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金是契约上市型开放式股票型证券投资基金，名称为兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)。基金合同生效后，符合基金上市交易条件的，本基金将申请在深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上市交易。

3、本基金的管理人为兴业全球基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“本基金管理人”)，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中登公司”)。

4、基金募集期限：本基金自2010年10月12日起至2010年10月26日止通过场内和场外两种方式公开发售。

5、本基金的场外销售机构包括本公司的直销柜台、网上直销和代销机构，具体名单详见“三、本次基金份额发售当事人或中介机构”；场内通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位公开发售，场内认购需遵守深圳证券交易所相关规则。

代销机构的代销网点以及开户认购等事项的详细情况请向各代销机构咨询。在募集期间，各代销机构可能还将适时增加部分基金代销销售城市。具体联系方式及相关认购事宜，请留意近期本公司及各代销机构的公告，或拨打本公司及各代销机构客户服务咨询电话。本公司在募集期内还可能增加新的代销机构，投资者可留意相关公告信息或拨打本公司客户服务电话进行查询。

对未开设销售网点的地方的投资者，请拨打本公司的客户服务电话(400-6780099、021-38824536)或直销联系电话(021-58368886、58368919)咨询购买事宜。

6、投资者还可在与本公司达成网上直销的相关协议，接受本公司有关服务条款后，通过登录本公司网站(www.xyfunds.com.cn)办理开户、认购等业务，有关基金网上直销的具体业务规则请登录本公司网站查询(目前仅对个人投资者开通网上直销)。

7、本基金募集对象为依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、中国证监会批准的合格境外机构投资者(QFII)。

8、投资者欲通过场外认购本基金，须开立中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。已经在中国证券登记结算有限责任公司开立深圳开放式基金账户的，则不需要再次办理开户手续。募集期内本公司直销柜台、网上直销和指定的基金销售代理机构网点同时为投资者办理场外认购的开户和认购手续。

投资者欲通过场内认购本基金，应使用深圳证券交易所A股账户或基金账户，已经有该类账户的投资者不须另行开立。募集期内具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可同时为投资者办理场内认购的开户和认购手续。

投资者的开户和认购申请可同时办理，但若开户无效，认购申请也同时无效。除法律法规另有规定，一个投资者只能开设和使用一个基金账户；不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

9、本基金募集期间对单个基金认购不设置最高累计认购金额限制。投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

10、投资者在场外通过代销机构及本公司网上直销首次认购本基金单笔最低金额为人民币1,000元(含认购费)，追加认购单笔最低金额为500元(含认购费)，中国工商银行股份有限公司销售网点追加认购单笔最低金额为1000元(含认购费)。各代销机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。投资者通过直销柜台首次认购本基金单笔最低金额为人民币10万元(含认购费)，追加认购单笔最低金额为1万元(含认购费)。超过最低认购金额的部分不设金额级差。

投资者在场内通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位认购本基金单笔最低认购份额为1,000份，超过1,000份的须是1,000份的整数倍，且每笔认购最大不得超过99,999,000份。

11、销售网点(指代销网点、本公司直销柜台或网上直销)对申请的受理并不表示对该申请的成功确认，而仅代表销售网点确实接受了认购申请，申请的成功确认应以基金合同生效后，注册登记机构的确认登记为准。投资者可以在基金合同生效后第二个工作日起到原认购网点打印认购成交确认凭证。认购申请一经销售机构受理，不可以撤销。

12、本公告仅对兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)份额发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)的详细情况，请详细阅读2010年9月30日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》的《兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)招募说明书》等文件。

13、本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.xyfunds.com.cn)、中国农业银行网站(www.abchina.com)、兴业证券网站(www.xyzq.com.cn)、深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。投资者亦可通过本公司网站了解基金份额发售相关事宜和下载基金业务申请表格。

14、本发售公告中未明确指明仅适用于“场内认购”或“场外认购”的相关内容，对于“场内认购”、“场外认购”均适用。

15、基金管理人可综合各种情况对基金份额发售安排做适当调整。

16、提示

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，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑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者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金为股票型基金，各类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的比例为90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深300指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

如投资者对中国证券市场的长期发展和基金管理人的管理能力有信心，也可以本着审慎原则选择投资本基金管理人管理的其他基金产品，亦可在本基金开放申购后进行投资。投资决策前请务必仔细阅读相关基金的《招募说明书》及《基金合同》等法律文件。

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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

17、本公告解释权归本基金管理人。

一、本次基金份额发售基本情况

1、基金名称：兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)
基金简称：兴业沪深300指数，本基金场内认购的基金简称为“兴业300”
基金前端代码：163407，基金后端代码：163408
2、基金类别：股票型
3、基金运作方式：契约型上市开放式
4、基金存续期限：不定期
5、基金份额发售面值：1.00元人民币；深交所认购挂牌价格：1.000元人民币
6、基金份额发售对象

依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的个人、机构投资者以及中国证监会批准的合格境外机构投资者(QFII)。

个人投资者指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人。

机构投资者指符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织。

合格境外机构投资者指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构。

7、销售机构(排名不分先后)

(1)场外销售机构

直销机构：兴业全球基金管理有限公司。

代销银行：农业银行、兴业银行、工商银行(2010年10月14日起代理销售)、邮政储蓄银行、交通银行、中国银行、光大银行、中信银行、宁波银行、浦发银行、深发展银行、华夏银行等。

代销券商：兴业证券、国泰君安证券、中信建投证券、华泰证券、长江证券、海通证券、招商证券、银河证券、广发证券、山西证券、东方证券、德邦证券、中银国际证券、国元证券、光大证券、申银万国证券、湘财证券、华泰联合证券、中航证券、渤海证券、瑞银证券、广发华福证券、齐鲁证券、爱建证券、安信证券、华融证券、国信证券、东莞证券、东海证券、长城证券等。

其他代销机构：天相投资顾问有限公司。

销售机构或网点的联系方式见本公告“三、本次基金份额发售当事人或中介机构”。

(2)场内发售机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。具体名单可在深圳证券交易所网站查询，本基金管理人不就此事项进行公告。

8、基金份额发售时间安排与基金合同生效

根据有关法律、法规的规定，本基金的募集期为自基金份额发售之日起不超过三个月。本基金募集期自2010年10月12日起至2010年10月26日期间，通过场内和场外两种方式面向社会公开发售。

基金募集期满，如果本基金的，募集金额不少于2亿元人民币且募集份数总额不少于2亿份，基金份额持有人的人数不少于200人，基金管理人依法向中国证监会办理基金备案手续，自中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。本基金合同生效前，投资者的认购款项只能存入商业银行，不作它用。认购资金在基金募集期间形成的利息，在本基金合同生效后折成投资者认购的基金份额，归投资者所有。 利息转份额的具体数额以注册登记机构的计算及确认的结果为准。

基金募集期间，经中国证监会批准，基金管理人亦可视情况适当延长募集期，但最长不超过三个月。若三个月的募集期满，本基金仍未达到基金合同规定的备案条件，本基金管理人将承担全部募集费用，并将所募集的资金加计银行同期活期存款利息在募集期结束后30天内退还给基金认购人。

9、基金认购方式与费率

(1)认购方式

本基金场外认购采取金额认购、场内认购采取份额认购的方式。投资者在募集期间多次认购的，单笔计算认购费。

(2)认购费用

1)场外认购费用

本基金提供两种场外认购费用的支付模式。本基金在认购时收取的认购费用称为前端认购费用，在赎回时收取的认购费用称为后端认购费用。基金投资者可以选择支付前端认购费用或后端认购费用。

前端认购费用按申次认购金额采用比例费率，具体费率如下：

认购金额M(元)	费率
M<50万	1.0%
50万≤M<200万	0.6%
200万≤M<500万	0.2%
M≥500万	每笔1000元

后端认购费用按持有年限逐年递减，具体费率如下：

持有年限Y(年)	费率
Y<1	1.2%
1≤Y<2	0.8%
2≤Y<3	0.4%
Y≥3	0

2)场内认购费用

本基金的场内认购费率由销售机构参照场外认购费率执行。

3)认购费用用于本基金直销和代销时发生的开支，包括市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金财产。

(3)认购份额的计算

1)基金场外认购份额的计算

本基金场外认购采用金额认购的方式。

本基金提供两种场外认购费用的支付模式。投资者可以选择前端收费模式，即在认购时支付认购费用；也可以选择后端收费模式，即在赎回时才支付相应的认购费用，该费用随基金份额的持有时间而递减。选择后端收费模式的场外认购基金份额不能跨系统转托管，持有的基金份额不能上市交易。

场外认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。具体计算方法如下：

A.前端收费模式

净认购金额=认购总金额/(1+认购费率)

认购费用=认购总金额