兴业社会责任股票型证券投资基金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:中国建设银行股份有限公司

二零一零年十二月

【重要提示】

本基金于2008年3月7日经中国证监会证监许可[2008]356号文核准募集。本基金基金合同于2008年4月30日起正式生效,自该日起兴业全球基金管理有限公司(以下简称“本公司”)正式开始管理本基金。

本招募说明书摘要是根据《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》和《兴业社会责任股票型证券投资基金招募说明书》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为2010年10月29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2010年第3季度报告,数据截止日为2010年9月30日(财务数据未经审计)。

第一部分 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。

截至2010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、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、兴业合润分级股票型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)共9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、综合管理部、监察稽核部、运作保障部、基金管理部、研究部、金融工程与专题研究部、专户投资部、交易室、市场部、渠道部和客户服务中心,随着公司业务发展的需要,将对业务部门进行相应的调整。

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。

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监事长。

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。

辛曌先生,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。现任兴业全球基金管理有限公司总经理。

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、上海管理总部总经理、人力资源部总经理,兴业全球基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。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骛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

傅鹏博先生,经济学硕士。历任上海财经大学经济管理系讲师,申银万国证券股份有限公司企业融资部经理,东方证券股份有限公司资产管理部负责人、研究所首席策略师;汇添富基金管理有限公司首席策略师。现任兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监兼本基金基金经理。

本基金历任基金经理:刘兆洋先生,于2008年4月30日至2009年8月27日期间担任本基金基金经理。

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
董承非	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副总经理杜昌勇担任。

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)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,并提交风险控制委员会;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。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人情况

(一)基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:尹 东
联系电话:(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。

截至2010年6月30日,中国建设银行实现净利润707.79亿元,较上年同期增长26.75%。手续费及佣金净收入336.42 亿元,较上年同期增长43.63%,在营业收入中的占比提高至21.94%。年化平均资产回报率为1.43%,年化加权平均净资产收益率为24.00%,分别较上年同期提高0.09 个百分点和1.46 个百分点;净利息收益率为2.41%,呈现企稳回升态势。信贷资产质量继续稳定向好,不良贷款较上年末实现“双降”,拨备覆盖率大幅提高至204.72%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约及胡志明市设有分行,在悉尼设有代表处,设立了安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行4家村镇银行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)37,487台,拥有员工约30万人,为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,2010 年上半年共获得 50 多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第2 位,为中资银行之首;在美国《福布斯》杂志公布的“2010 中国品牌价值 50 强”列第3 位;荣获英国《金融时报》颁发的“中国最佳渠道银行”;被《亚洲金融》杂志评为 2010 年度“中国最佳银行”;连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”;被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室,现有员工130余人。2008年,中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会(AICPA)颁布的审计准则公告第70号(SAS70)进行的内部控制审计,安永会计师事务所为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”,中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

(二)主要人员情况

罗中涛,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2010年9月30日,中国建设银行已托管169只证券投资基金,其中封闭式基金6只,开放式基金163只。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。2010年初,中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度“国内最佳托管银行”(Domestic Top Rated),并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,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。

(二)内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控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。

(三)内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

(一)监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(二)监督流程

1、每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2、收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3、根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

4、通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

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
联系人:汤凡、何佳怡
客户服务电话: 4006780099、(021)38824536
直销联系电话:(021)58368886、58368919
传真: (021)58368915、58368869

兴业全球基金管理有限公司电子直销(目前仅开通建设银行、兴业银行、工商银行、招商银行借记卡,农业银行借记卡、准贷记卡)

交易网站:https://trade.xyfunds.com.cn
客服电话:4006780099;(021)38824536

2、代销机构

代销银行

(1)中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
公司网站: http://www.ccb.com

(2)兴业银行股份有限公司
住所(办公地址):福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
客户服务热线:95561
公司网站:http://www.cib.com.cn

(3)中国工商银行股份有限公司
住所(办公地址):中国北京复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588
传真:(010)66107914
公司网站:http://www.icbc.com.cn

(4)中国邮政储蓄银行有限责任公司
住所(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
传真:(010)68858117
公司网站:http://www.psbc.com

(5)招商银行股份有限公司
住所: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
传真:(0755)83195109
客服电话:95555
公司网站:http://www.cmbchina.com

(6)交通银行股份有限公司
住所: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
电话:(021)58781234
传真:(021)58408483
客户服务电话:95559
公司网站:http:// www.bankcomm.com

(7)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
公司网站:http://bank.ecitic.com

(8)中国民生银行股份有限公司
住所(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
公司网站:http://www.cmbc.com.cn

(9)中国银行股份有限公司
住所(办公地址):北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
传真:(010)66594853
客户服务电话: 95566
公司网站:http://www.boc.cn

(10)上海浦东发展银行股份有限公司
住所: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:吉晓辉
电话:(021)61618888
传真:(021)63604199
客户服务电话:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

(11)中国光大银行股份有限公司
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
电话:(010)68098778
传真:(010)68560311
客服电话:95595
公司网站:www.cebbank.com

(12)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
网址:www.abchina.com

(13)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
客户服务统一咨询电话:96528,上海地区962528
传真:(021)63586215
公司网站:http://www.nbcb.com.cn

(14)华夏银行股份有限公司
住所(办公地址):北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
法定代表人:吴建
客户服务电话:95577
公司网站:http://www.hxb.com.cn

(15)深圳发展银行股份有限公司
住所(办公地址): 深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:肖遂宁
客户服务电话:95501
公司网站:http://www.sdb.com.cn

(16)渤海银行股份有限公司
住所(办公地址):天津市河西区马场道201-205号
法定代表人:刘宝凤
客服电话:400-888-8811
公司网址:http://www.cbhb.com.cn

代销券商

(1)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
客户服务热线:4008888123
传真:(021)38565785
公司网站:http:// www.xyzq.com.cn

(2)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:祝幼一
电话:(021)38676666
传真:(021)38670161
客户服务热线:4008888666
公司网站:http://www.gtja.com.cn

(3)中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:张佑君
开放式基金咨询电话:4008888108
开放式基金业务传真:(010)85130577
公司网站:http://www.csc108.com

(4)华泰证券股份有限公司
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:(025)84457777-950、248
客户咨询电话:(025)84579897
公司网站:http://www.htsc.com.cn

(5)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
电话:(027)65799999
传真:(027)85481900
客户服务热线:4008888999或(027)85808318
公司网站:http://www.95579.com

(6)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
办公电话:(021)23219000
客服电话:4008888001、(021)962503或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站:http://www.htsec.com

(7)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755)82960223
传真:(0755)82943636
客户服务热线:95565、4008888111
公司网站:http://www.newone.com.cn

(8)中国银河证券股份有限公司
住所: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:顾伟国
客服电话:4008888888
传真:010-66568116
公司网站:http://www.chinastock.com.cn

(9)广发证券股份有限公司
住所:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
法定代表人:王志伟
开放式基金咨询电话:95575或致电各地营业网点
开放式基金业务传真:(020)87557985
公司网站:http://www.gf.com.cn

(10)山西证券有限责任公司
办公(注册)地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:侯巍
客服电话:(0351)8686868
联系电话:(0351)8686703
传真:(0351)8686619
公司网站:http://www.i618.com.cn

(11)东方证券股份有限公司
住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:王益民
电话:(021)63325888
传真:(021)63326173
客服热线:(021)962506或40088-88506
公司网站:http://www.dfzq.com.cn

(12)德邦证券有限责任公司
办公地址:上海市浦东新区浦东南路588号浦发大厦26楼
法定代表人:方加春
联系电话:(021)68761616
传真电话:(021)68767981
客服电话:4008888128
公司网站:http://www.tebon.com.cn

(13)中银国际证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:唐新宇
开放式基金咨询电话:4006208888或各地营业网点咨询电话
开放式基金业务传真:(021)50372474
公司网站:http://www.bocichina.com.cn

(14)国海证券有限责任公司
住所:中国广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅峰
联系电话:(0771)5539262
传真:(0771)5539033
客服热线:4008888100(全国)、96100(广西)
公司网站:http://www.ghzq.com.cn

(15)光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:王明权
联系电话:(021)22169081
传真:(021)22169134
客服热线:4008888788
公司网站:http://www.ebscn.com

(16)国元证券股份有限公司
法定代表人:凤良志
住所: 合肥市寿春路179号
联系电话:安徽地区:96888;全国:4008888777
传真电话:(0551)2207114
公司网站:http://www.gyzq.com.cn

(17)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:林俊波
电话:(021)68634518
传真:(021)68865680
客服电话:4008881551
公司网站:http://www.xcsc.com

(18)申银万国证券股份有限公司
住所(办公地址):上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:(021)54033888
传真:(021)54035333
客服电话:(021)962505
公司网站:http://www.sw2000.com.cn

(19)华泰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
联系电话:(0755)82492000
传真电话:(0755)82492962
客服电话:4008888555,(0755)25125666
公司网站:http://www.lhzq.com

(20)中航证券有限公司
住所:南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
电话:(0791)6768763
传真:(0791)6789414
客服电话:4008866567
公司网站:http://www.scstock.com

(21)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:王春峰
电话:(022)28451861
传真:(022)28451892
客户服务电话: 4006515988
公司网站: http://www.bhzq.com

(22)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)59228748
客户服务电话:4008878827
公司网站:http://www.ubssecurities.com

(23)广发华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
联系电话:(0591)87841160
传真:(0591)87841150
公司网站:http://www.gfhfzq.com.cn

(24)齐鲁证券有限公司
住所:济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
联系电话:(0531)81283906
传真:(0531)81283900
公司网站:http://www.qlzq.com.cn

(25)爱建证券有限责任公司
住所:上海市南京西路758号24楼
法定代表人:张建华
联系电话:(021)32229888
客服电话:(021)63340678
公司网站:http://www.ajzq.com

(26)安信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
联系电话:(0755)82825551
传真:(0755)82558355
客服电话:4008001001
公司网站:http://www.essence.com.cn

(27)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区月坛北街26号
法定代表人:丁之锁
联系电话:(010)58568007
传真:(010)58568062
客服电话:(010)58568118
公司网站:http://www.hrsec.com.cn

(28)国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133302
客服电话:95536
公司网站:http://www.guosen.com.cn

其他代销机构

天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人:林义相
联系电话:(010)66045529
传真:(010)66045500
客服电话:(010)66045678
公司网站:http://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。

二、注册登记机构

名称:兴业全球基金管理有限公司
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
电话:(021)58368998
传真:(021)58368858

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
住所(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
经办律师:廖海、吕红
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
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
经办注册会计师:徐艳、蒋燕华
法定代表人:葛明
电话:(010)58153000
传真:(010)85188298
联系人:蒋燕华

第四部分 基金的名称

兴业社会责任股票型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资目标

本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值,同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。

第七部分 基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金为股票型基金, 各类资产的投资比例为: 股票投资比例为65%-95%; 债券投资比例为0%-30%; 资产支持证券占0%-20%;权证投资比例0%-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的5%。如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

本基金投资组合中突出社会责任投资股票的合计投资比例不低于股票资产的80%。

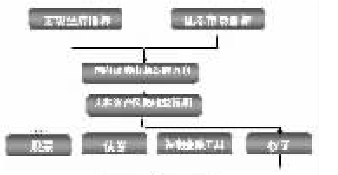
第八部分 基金的投资策略及投资组合管理

一、投资策略

本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略。

1、大类资产配置策略

在大类资产配置上,本基金采取“自上而下”的方法,定性与定量研究相结合,在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估,动态优化资产配置。



本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在给定收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产投资权重,实现资产合理配置。

2、行业配置策略

在行业配置策略上,本基金根据行业所处生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素对各行业进行评估,从中选取盈利能力较好、持续发展潜力强的行业。在此基础上,采用“兴业双层行业筛选法”进行优化调整,首先运用“消极筛选法”低配或规避在持续发展责任、法律责任、内外部道德责任履行等方面具有较差表现的行业;其次,运用“积极筛选法”超配或寻求在持续发展责任、法律责任、内外部道德责任履行等方面具有较好表现的行业,定期动态优化行业配置资产。

3、股票投资策略

本基金采用“兴业社会责任四维选股模型”精选股票。

本基金的股票选择程序如下:

首先,根据公司的经济责任表现指标,定期对股票进行初步筛选,经济责任较好的股票进入基础股票池;同时,还剔除社会责任表现指标特别差的某些公司。

在此基础上,按照经济责任、持续发展责任、法律责任、道德责任等不同社会责任对公司价值的相对贡献,对基础股票池中的股票进行二次筛选,进入备选股票池。

对于备选股票池,本基金将定期(一般一个季度)或不定期(突发事件)进行四维风险因子度量,以判断经济责任、持续发展责任、法律责任、道德责任对公司价值的相对贡献因子大小。

同时,本基金将结合研究员对公司社会责任情况的实地调研,定期、动态调整股票组合,并根据实际估值、市场环境等多种因素作出投资决策,从而构建实际股票组合。

本基金的股票选择标准为:

(1)经济责任表现

公司经济责任指公司生产、盈利、满足消费需求的责任表现,其核心是公司创造利润、实现价值的能力。公司的经济责任表现可以通过三个方面进行考察:

A. 财务指标——衡量公司创造利润的表现。

本基金主要通过估值指标(如动态市盈率PEG、市净率B/M等)和增长指标(如主营业务增长率SG、EBIT增长率等)进行多重考察。

B. 产品与服务——衡量公司利润创造的源泉。

公司提供的产品和服务是公司实现价值的源泉,也是考察公司对社会贡献的关键点之一。本基金要求公司所生产或营销的产品和服务具有较强的竞争力、能为公司实现利润,并提高消费者健康水平和生活质量水平,具体而言:

●产品和服务安全、健康、环保,符合国家消费者商品安全条例;
●实施质量控制措施和顾客满意原则;
●对质量安全问题能迅速反应,并采取合理措施;
●产品广告、包装与产品内容一致。

在具体的量化指标选择上,本基金可通过品牌指标(如市场占有率、行业集中度、品牌渗透率等)和质量指标(如产品合格率、产品返修率等)等进行考察。

C. 治理结构——衡量利润创造的保证。

本基金从多个角度考察公司的治理状况:信息披露程度和强度、董事会的独立性及多样性、执行赔偿、是否关心股东利益等。对那些管理结构较差,委托-代理制度混乱、以及在大股东操纵、内部人控制、担保欺骗、行受贿等方面存在可疑或违法行为的公司,本基金将不予投资。相反,本公司寻求具有以下特征的公司:

●具有多样化且独立的董事会;
●具有健全、可操作性强的、责权利明确的公司管理治理规则,能保证内控的贯彻实施;
●具有完善的风险管理和内部人监督体系;
●能强化信息披露,保证公司的透明度;
●注重培养健康、有道德的公司文化

同时,本基金通过股东制衡表现(如大股东持股比例、股东持股量的集中度等)、管理层激励表现(如是否实施股权激励制度、高管人员的持股比例等)等具体量化指标方面进行考察。

(2)其他责任表现

A. 持续发展责任——保证企业与社会可持续发展的责任。

本基金通过两方面对公司进行考察:

一方面是环保责任,即公司保护和利用现有资源的责任履行情况。在评估公司环境保护方面的表现时,本基金要求公司:

●始终遵守国家及所在地方政府的环境政策和条例;
●有专门为保护环境及提高资源利用效率的方案及措施;
●每年有稳定的预算经费用于环境保护及治理;

除上述三个基本标准外,本基金更偏好于满足以下一个或多个要求的公司:

●公司本身拥有新能源开发、环保相关产品研发、经营等环保产业的一项或多项业务。
●实施独创性的有效防止污染、节约自然资源的环境保护方案,以表明公司正走在可持续发展的道路上;
●高层管理者具有环境保护意识和责任,并对那些在环境保护上做出成绩者给与奖赏;
●对可能造成环境污染的项目进行披露,并采取措施把污染降低到最低程度。

在量化指标选择上,本基金可通过计算公司的单位收入能耗、单位工业产值主要污染物排放量、环保投资率、横向比较公司在同行业的环保表现等方法,评估公司的环保责任表现。

另一方面是创新责任,即公司研发、创造新产品、新资源的责任。

从公司来看,其研发能力、业务创新实力与公司的长期绩效紧密相关;从社会来看,一国的科研与创新能力是实现社会可持续发展的关键点,因此,公司的创新能力表现也是本基金重点关注的因素之一。本基金寻求满足以下一个或多个要求的公司:

●拥有一项或多项在本行业具有先进水平的自主研发技术;
●每年新产品推出的速度和数量居行业前列;
●制订有切实可行的政策,奖励在创新方面做出突出贡献的员工;
●每年有稳定的经费专用于公司产品或服务的研发、创新。

在量化指标的选择上,本基金可通过两大类指标考察公司的创新能力:一是创新产出指标,如新产品产值率、专利水平等项;二是创新潜力指标,包括技术创新投入率、技术开发人员比率等项。

B. 法律责任——履行法律法规各项义务的责任。

本基金通过两方面对公司进行考察:

一方面是税收责任,即公司按照有关法律法规的规定,照章纳税和承担政府规定的其他责任义务。具体看来,本基金要求公司:

●积极配合政府的干预和监督,不逃税、偷税、漏税或非法避税;
●依照各项法律制度及时地缴税、纳税;
●不存在挤占挪用国家税款的违法行为。

在具体的量化指标上,本基金可通过资产纳税率、税款上缴率等指标对该项进行考察。

另一方面是雇主责任,即公司承担对职工的福利、安全、教育等方面义务的责任。具体看来,本基金要求公司:

●严格遵守政府建立的各项劳动政策法规和制度条例,提供完备的员工利益保障;
●具有完备的员工健康安全保障体系以及良好的安全性表现记录;
●强调使用法律来保障劳资双方的合法权益。

在具体的量化指标上,本基金可通过工资支付率、法定福利支付率、社保提取率、社保支付率等指标对该项进行考察。

C. 道德责任——满足社会准则、规范和价值观、回报社会的责任。

本基金通过两方面对公司进行考察:

一方面是内部道德责任。即公司对内部员工的福利、未来发展等方面所承担的责任。本基金寻求满足以下要求的公司:

●实施良好的员工培训计划,树立健康的劳工关系以及劳资共赢的观念;
●建立效益挂钩的绩效制度与利益分享的激励机制。

在具体的量化指标选择上,可以通过员工培训支出比率、员工人均年培训经费、员工工资增长率、就业贡献率等指标对该项进行考察。

另一方面是外部道德责任。即公司对社会慈善事业和其他公益事业的社会责任。本基金所投资的公司须有良好的反馈社会意识,积极投身于有益于国家和社会和谐发展的项目和产业,积极参与公益事业,主动把企业发展与社会发展融为一体,实现企业与社会的共同发展。具体而言,本基金偏好于满足以下一个或多个要求的公司:

●坚定支持所在地的建设和活动,与公司所在地居民和社区的各类发展组织具有良好的合作关系;
●参与国家政策积极引导、大力提倡的投资项目或产业;
●参与国家政策积极引导、大力提倡的投资项目或产业(如西部开发等);
●在公司慈善、员工自愿者计划、弱势群体扶助等公益方面有较完善的实施计划及良好表现。

在具体的量化指标选择上,本基金可通过捐赠收入比率等指标对该项进行考察。

本基金在精选股票的同时强调以下两个原则:一是行业内社会责任的相对表现;二是辅以优化行业配置策略调整最终的股票投资组合,以避免过高的行业配置风险。

本基金以四维社会责任综合指标作为投资评价依据,将定期(一般一个季度)或不定期(突发事件)进行社会责任指标度量,并对不符合下述标准的股票予以剔除:一是相关指标发生变化导致其综合社会责任指标排名下降,不再符合相应股票组合入选标准的股票;二是发生重大、突发事件,导致某项指标严重违反本基金设定的社会责任标准的股票。剔除的股票品种池将及时告知托管行。

4、债券投资策略

本基金将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等积极投资策略,发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。这些积极投资策略是在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上作出的。

本基金还将凭借多年的可转债投资研究力量积累进行可转债品种投资,着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究,重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债,并依据科学、完善的“兴业可转债评价体系”选择具有较高投资价值的个券进行投资。

另外,对于公司发行的各类债券,本基金将参考“兴业社会责任四维选股模型”对相关公司进行筛选。

5、权证投资策略

本基金将综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行投资,主要运用的投资策略为:正股价值发现驱动的杠杆投资策略、组合套利策略以及复制性组合投资策略等。

本基金将在进行充分风险控制和遵守中国证监会相关法律规定的基础上,投资于未来出现的新投资品种。

二、投资限制

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;
(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;
(6)本基金不得违反本基金合同关于投资范围和投资比例的约定。本基金为股票型基金,各类资产的投资比例为:股票投资比例为65%-95%;债券投资比例为0%-30%;资产支持证券占0%-20%;权证投资比例为0%-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的5%。本基金投资组合中突出社会责任投资股票的合计投资比例不低于股票资产的80%。
(7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(8)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(11)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
(12)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(13)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;
(14)如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(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)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。
(9)法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

第九部分 基金的业绩比较基准

业绩比较基准=80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,因此其基本风险收益特征为较高风险,较高回报。

第十一部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,复核了本投资组合报告,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社会责任股票型证券投资基金2010年第3季度报告,所载数据截至2010年9月30日,本报告中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	6,752,138,797.93	87.02
	其中:股票	6,752,138,797.93	87.02
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	993,384,679.64	12.80
6	其他资产	13,616,767.92	0.18
7	合计	7,759,140,245.49	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	1,437,450.30	0.02
B	采掘业	122,890,000.00	1.59
C	制造业	3,765,190,826.49	48.80
C0	食品、饮料	513,484,140.88	6.65
C1	纺织、服装、皮毛	1,239,953.30	0.02
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	10,196,489.80	0.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	989,140,619.70	12.82
C5	电子	19,688,573.88	0.26
C6	金属、非金属	61,161,000.00	0.79
C7	机械、设备、仪表	368,296,807.88	4.77
C8	医药、生物制品	1,717,462,815.14	22.26
C99	其他制造业	84,520,425.91	1.10
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	293,150,241.46	3.80
F	交通运输、仓储业	60,350.00	0.00
G	信息技术业	657,441,266.60	8.52
H	批发和零售贸易	368,847,002.89	4.78
I	金融、保险业	1,317,975,558.65	17.08
J	房地产业	55,519,104.40	0.72
K	社会服务业	17,937,000.00	0.23
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	151,689,997.14	1.97
	合计	6,752,138,797.93	87.51

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	601318	中国平安	11,244,155	594,703,357.95	7.71
2	002007	华兰生物	9,001,500	459,076,500.00	5.95
3	600276	恒瑞医药	9,168,161	447,314,575.19	5.80
4	600036	招商银行	22,727,630	294,322,808.50	3.81
5	600887	伊利股份	6,687,632	280,412,409.76	3.63
6	600570	恒生电子	17,209,860	280,348,619.40	3.63
7	600315	上海家化	6,771,210	273,286,035.60	3.54
8	600316	洪都航空	7,880,361	272,896,901.43	3.54
9	002250	联化科技	7,003,712	261,238,457.60	3.39
10	600352	浙江龙盛	21,358,956	230,890,314.36	2.99

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

(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	5,214,221.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	190,338.84
5	应收申购款	8,212,207.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,616,767.92

(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	600316	洪都航空	272,896,901.43	3.54	非公开发行

第十二部分 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2008年4月30日,基金业绩截止日2010年9月30日。

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
2010年3季度	16.14%	1.12%	12.02%	1.04%	4.12%	0.08%
2010年上半年	-14.75%	1.31%	-21.98%	1.26%	7.23%	0.05%
2009年度	108.57%	1.54%	72.39%	1.63%	36.18%	-0.09%
2008.4.30-2008.12.31	-22.20%	1.55%	-42.12%	2.34%	19.92%	-0.79%
自基金合同成立起至2010年9月30日	60.67%	1.47%	-12.79%	1.77%	73.46%	-0.30%

第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金财产拨划支付的银行费用;
4、基金合同生效后的基金信息披露费用;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
7、基金的证券交易费用;
8、在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;
9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

二、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费,E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费,E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

五、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会,但应报中国证监会批准。基金管理人必须最迟于新的费率实施2日前在指定媒体上刊登公告。

六、与基金销售有关的费用

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购、赎回与转换”中的“六、申购费率和赎回费率”中的相关规定。

七、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

第十四部分 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2010年6月11日刊登《兴业社会责任股票型证券投资基金更新招募说明书》进行了更新,主要更新内容如下:

一、“重要提示”部分
1、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。
2、增加了“基金托管人中国建设银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书中涉及托管业务的相关内容”。

二、“第三部分 基金管理人”部分
1、增加了兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF),旗下管理的基金总数由8只改为9只。
2、更新了公司下设部门的情况。
3、更新了投资决策委员会成员的情况。

三、“第四部分 基金托管人”部分
对基金托管人的基本情况、托管业务经营情况进行了更新。

四、“第五部分 相关服务机构”
1、增加了农业银行准贷记卡的电子直销渠道。
2、更新了个别代销机构的基本情况。
3、增加了渤海银行股份有限公司、国信证券股份有限公司为代销机构。

五、“第九部分 基金的投资”部分
更新了“九、基金投资组合报告”部分,数据内容截止日为2010年9月30日,所列财务数据未经审计。

六、“第十部分 基金的业绩”部分
更新了该部分数据,数据内容截止日为2010年9月30日。

七、“第十四部分 基金的费用与税收”部分
删除了对基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式的表述。

八、“第二十二部分 其他应披露事项”部分

以下为自2010年4月30日至2010年10月29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	关于兴业社会责任股票型证券投资基金继续暂停接受三万元以上申购及转入申请的提示性公告	2010-5-24
2	关于旗下基金参加华融证券费率优惠活动的公告	2010-5-29
3	关于增加国信证券为旗下基金代销机构的公告	2010-6-3
4	关于增加国信证券为办理旗下基金定期定额投资业务代销机构的公告	2010-6-3
5	关于旗下部分基金在国信证券开通转换业务的公告	2010-6-3
6	关于旗下部分基金参加农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	2010-6-4
7	关于兴业社会责任股票型证券投资基金继续暂停接受三万元以上申购及转入申请的提示性公告	2010-6-24
8	关于增加申银万国证券为办理旗下基金定期定额投资业务代销机构的公告	2010-6-24
9	关于旗下基金参加安信证券网上申购费率优惠活动的公告	2010-6-25
10	关于旗下基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	2010-6-30
11	关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	2010-6-30
12	关于继续参加邮储银行网上银行申购费率优惠活动的公告	2010-6-30
13	旗下各基金2010年上半年度资产净值公告	2010-7-1
14	关于长期停牌股票估值政策调整及对基金资产净值影响的公告	2010-7-1
15	关于旗下基金代销机构名称变更的公告	2010-7-10
16	关于公司旗下部分基金投资洪都航空(600316)非公开发行股票的公告	2010-7-16
17	关于增加渤海银行为旗下部分基金代销机构的公告	2010-7-22
18	关于旗下部分基金在渤海银行开通转换业务的公告	2010-7-22
19	关于在渤海银行开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	2010-7-22
20	关于兴业社会责任股票型证券投资基金继续暂停接受三万元以上申购及转入申请的提示性公告	2010-7-24
21	关于旗下部分基金参加渤海银行费率优惠活动的公告	2010-8-5
22	关于开展中国农业银行金穗卡基金网上直销申购费率优惠活动的公告	2010-8-20
23	关于兴业社会责任股票型证券投资基金继续暂停接受三万元以上申购及转入申请的提示性公告	2010-8-24
24	关于在广发华福证券开通后端定期定额投资业务的公告	2010-8-28
25	关于旗下部分基金继续参加农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	2010-8-31
26	关于旗下基金2010年半年度报告的更正公告	2010-9-1
27	关于旗下基金所持有的中国平安(601318)股票估值方法变更的公告	2010-9-3
28	关于某媒体报道本公司参与浦发“定增”巨亏错误报道的澄清公告	2010-9-16
29	关于旗下部分基金参加华泰证券定期定额申购费率优惠活动的公告	2010-9-18
30	关于兴业社会责任股票型证券投资基金继续暂停接受三万元以上申购及转入申请的提示性公告	2010-9-21
31	关于网上直销平台开通一户多卡功能的公告	2010-9-28
32	关于增加长江证券为办理旗下基金定期定额投资业务代销机构的公告	2010-10-22
33	关于兴业社会责任股票型证券投资基金继续暂停接受三万元以上申购及转入申请的提示性公告	2010-10-23

九、“第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式”部分
将招募说明书存放地点改为基金管理人的办公场所和营业场所。

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
2010年12月10日