兴全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

2013年6月

重要提示

兴全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《关于同意兴全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《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《兴全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基金的招募说明书等法律文件,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为2013年5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2013年第1季度报告,数据截止日为2013年3月31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:冯晓莲
联系电话:021-20398888
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 B.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",公司注册资本由9800万元变更为12000万元人民币。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2013年5月2日,公司旗下管理着兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选股票型证券投资基金(LOF)共十三只开放式基金。

兴业全球基金管理有限公司总部位于上海,在北京、深圳设有分公司,并成立了全资子公司——上海兴全睿众资产管理有限公司。公司总部下设投资决策委员会、风险管理委员会、综合管理部、财务室、监察稽核部、运作保障部、基金管理部、专户投资部、研究部、金融工程与专题研究部、交易室、市场部、渠道部、机构业务部、电子商务部、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,中共党员,高级工商管理硕士、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、中国证券业协会副会长。

郑苏芬女士,董事,1962年生,中共党员,高级工商管理硕士,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,兴业证券股份有限公司副总裁兼首席合规官。现任兴业证券股份有限公司副总裁兼财务总监(财务负责人)。

郑城美先生,董事,1974年生,中共党员,经济学硕士。历任兴业证券股份有限公司客户经理,市场分析师、办公室文秘部经理、营业部副总经理(主持工作)、计划财务部副总经理、计划财务部总经理、董事会秘书处总经理、财务总监(财务负责人),兼计划财务部总经理等职务。现任兴业证券股份有限公司副总裁,分管私人财富管理总部、融资融券部、存管结算部等。

万维德(Mar van Weede)先生,董事,1965年生,经济学硕士,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。

Andrew Fleming先生,董事,1959年生,毕业于纽约大学,英国国籍。历任英国Gartmore基金公司管理培训生、日本公司负责人、美国合资公司首席执行官与首席投资官,荷兰银行资产管理公司首席投资官、组合资产管理全球负责人,AEGON资产管理部门资产配置委员会主席,AEGON资产管理公司董事会成员、第三方资产管理部门负责人、英国地区负责人。

霍以礼先生(Elio Fattorini),董事,1970年生,工商管理硕士,荷兰国籍。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。

吴雅伦先生,独立董事,1948年生,中共党员,工商管理硕士,高级经济师。历任黑龙江兵团一师四团副班长、团宣传队副队长、政治处宣传干事,中国人民银行上海市分行秘书科副科长,上海申银证券公司法定代表人,上海证券交易所交易部经理、总经理助理、副总经理,交易所非会员理事兼会员管理委员会主任和复核委员会主任等职,还曾任上海证券通信有限公司董事长、中国证券登记结算有限责任公司董事,主导了上海证券交易所信息网络有限公司和中证指数有限责任公司的筹建和初期运行等。2008年10月,因年龄原因在上海证券交易所理事位上退休。

张志超先生,独立董事,1952年生,经济学博士。1978年至1997年先后在华东师范大学攻取了经济学学士、经济学硕士、世界经济学博士,英国牛津大学经济学博士学位。现任英国杜伦大学商学院,任国际金融学讲师,此外,兼任复旦大学顾问教授、华东师大紫江学者、中国社会科学院世界经济研究所客座研究员、西南财经大学客座教授等职,同时担任中国世界经济学会副会长、上海国际金融研究中心理事、英国中国经济学会主席等社团职务。

郭辉先生,监事,1959年生,经济学博士,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。

李小天女士,监事,1982年生,文学、经济学双学士。历任《南方日报》、《南方都市报》记者。现就职于兴业全球基金管理有限公司市场部。

2、高级管理人员概况

杨东先生,总经理,1970年生,高级工商管理硕士。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。

冯晓莲女士,督察长,1964年生,中共党员,高级工商管理硕士、高级经济师。先后就职于新疆兵团组织部、新疆兵团驻海南办事处、海南国际信托公司,历任兴业银行党办副科长,兴业证券股份有限公司人力资源部副总经理、人力资源部总经理、合规与风险管理部总经理,兴业全球基金管理有限公司总经理助理。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,中共党员,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,高级工商管理硕士。历任兴业证券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全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兼上海兴全睿众资产管理有限公司总经理。

徐天舒先生,副总经理,1973年生,中共党员,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。

王晓明先生,副总经理,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,兴业全球基金管理有限公司兴全可转债混合型证券投资基金基金经理助理、兴全可转债混合型证券投资基金基金经理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、投资副总监。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理兼投资总监、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

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全可转债混合型证券投资基金基金经理(2004年9月29日至2005年12月7日)、兴全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副总经理兼投资总监、本基金基金经理(2005年11月3日起至今)。

杨岳斌先生,1972年生,工商管理硕士,CFA。历任招商银行总行营业部、公司银行部,兴业全球基金管理有限公司行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理。现任兴业全球基金管理有限公司兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2011年12月28日起至今)。

本基金历任基金经理:
张惠萍女士,于2008年1月31日至2010年5月4日期间担任本基金基金经理。
张光成先生,于2010年5月5日至2011年6月28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。投资决策委员会共由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兼上海兴全睿众资产管理有限公司总经理
王晓明 兴业全球基金管理有限公司副总经理兼投资总监、本基金基金经理
傅鹏博 兴业全球基金管理有限公司研究部总监、兴全社会责任股票型证券投资基金基金经理
董承非 兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全商业模式优选股票型证券投资基金(LOF)基金经理
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:人民币107.86亿元
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
托管部门联系人:刘峰
电话:021-62677777-212017
传真:021-62159217

(二)发展概况及财务状况
兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本107.86亿元。
自开业以来,兴业银行始终坚持与客户"同发展、共成长"和"服务源自真诚"的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2012年12月31日,兴业银行资产总额达到32,509.75亿元,归属于母公司股东权益1695.77亿元,不良贷款比率为0.43%,全年实现归属于母公司股东的净利润347.18亿元。根据英国《银行家》杂志最新排名,公司按一级资本排名69位,按总资产排名61位,均较上年提升14位。根据美国《财富》中文版中国500强企业最新排名,公司排名第78位,较上年提升6位。在国内外各种权威机构组织的评比中,先后获得上海证券交易所"2012年度上市公司董事会奖"、"2012中国最受尊敬中资银行奖"、"十一五时期全国减排先进集体"、"最佳绿色银行奖"、"最佳履行社会责任银行奖"、"年度最具创新力银行奖"等荣誉。

(三)主要人员情况
兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处和养老金管理中心等处室,共有员工90余人,业务岗位人员均具有基金从业资格。

(四)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2013年3月31日,兴业银行已托管开放式基金18只——兴全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、兴全货币市场证券投资基金、兴全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、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、中欧沪深300指数增强型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、兴全保本混合型证券投资基金、中邮战略新兴产业股票型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、工银瑞信60天理财债券型证券投资基金、银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金,托管基金财产规模337.26亿元。

(五)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:制定完善的《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。
(六)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:021-20398927、20398706
直销业务传真:021-58368869
联系人:何佳怡、黄琳蔚
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、招商银行、工商银行、光大银行、中信银行、浦发银行、金华银行、浙商银行、上海农商银行、南京银行、温州银行、顺德农商银行借记卡,农业银行借记卡和准贷记卡、支付宝基金专户)(排名不分先后)
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
客户服务电话:95561
公司网站:http://www.cib.com.cn
(2)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路188 号
办公地址:上海市银城中路188 号
法定代表人:胡怀邦
电话:021-58781234
传真:021-58408483
客服电话:95559
网址:http://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:傅育宁
电话:0755-83198888
客户服务中心电话:95555
网址:http://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
电话:010-66107900
传真:010-66107914
客户服务电话:95588(全国)
网址:http://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:王洪章
客户服务电话:95533(全国)
网址:http://www.ccb.com
(6)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
传真:021-63604199
客户服务热线:95528
网址:http://www.spdb.com.cn
(7)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客户服务电话:95568
传真:010-57092611
网址:http://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:田国立
电话:010-65557013
传真:010-65550827
客户服务电话:95558
网址:http://bank.ecitic.com
(9)中国光大银行股份有限公司
住所:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人:唐双宁
客服电话:95595
传真:010-68560661
网址:http://www.cebbank.com
(10)中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:蒋超良
客服电话:95599
传真:010-85109219
网址:http://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:http://www.boc.cn
(12)宁波银行股份有限公司
住所:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
客户服务统一咨询电话:96528(北京、上海地区962528)
传真:0574-87050024
网址:http://www.nbcb.com.cn
(13)中国邮政储蓄银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:李国华
客户服务电话:95580
传真:010-68858117
网址:http://www.psbc.com
(14)平安银行股份有限公司
住所(办公地址):广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:孙建一
客户服务电话:95511-3
网址:http:// www.bank.pingan.com
(15)重庆银行股份有限公司
住所:重庆市渝中区邹容路153号
法定代表人:马千真
客户服务电话:96899(重庆地区)、400-709-6899(其他地区)
公司网站:http://www.cqcbank.com
(16)上海银行股份有限公司
住所:上海市银城中路168号
法定代表人:范一飞
客户服务电话:(021)962888
公司网站:http:// www.bankofshanghai.com
(17)东莞农村商业银行股份有限公司
住所:东莞市南城路2号
办公地址:东莞市东城区鸿福东路2号东莞农商银行大厦
法定代表人:何沛良
客户服务电话:961122
公司网站:http://www.drcbank.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268号
法定代表人:兰荣
客户服务热线:4008888123
传真:021-38565785
网址:http://www.xyzq.com.cn
(2)广发证券股份有限公司
办公地址:广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼
法定代表人:孙树明
开放式基金咨询电话:95575转各营业网点
开放式基金业务传真:020-87555305
网址:http://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、021-962503或拨打各城市营业网点咨询电话
网址:http://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:万建华
客户服务电话:400-8888-666
传真:021-38670666
网址:http://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:陈有安
客服电话:4008-888-888
传真:010-66568430
网址:http://www.chinastock.com.cn
(6)中信建投证券股份有限公司
办公地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
开放式基金咨询电话:4008888108
开放式基金业务传真:010-85130577
网址:http://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:许刚
开放式基金咨询电话:4006208888
开放式基金业务传真:021-50372474
网址:http://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:025-83290979
传真:025-84579879
客服电话:95597
网址:http://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
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
客服电话:4008888111、95565
网址:http://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:潘鑫军
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客服热线:95503
网址:http://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:95573
传真:0351-8686619
网址:http://www.i618.com.cn
(12)东海证券有限责任公司
注册地址:常州市延陵西路59号常信大厦18、19楼
办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达广场17楼
法定代表人:朱科敏
电话:021-88157761
传真:021-88157761
客服电话:4008888588 、95531
网址:http://www.longone.com.cn
(13)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
电话:021-22169081
传真:021-22169134
客服电话:4008888788
网址: http://www.ebscn.com
(14)湘财证券有限责任公司
注册地址:长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
客服电话:400-888-1551
网址:http://www.xcsc.com
(15)中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
法定代表人:杜航
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
客户服务电话:400-8866-567
网址:http://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:蔡咏
客户服务电话:95578
开放式基金业务传真:0551-2207114
网址:http://www.gyzq.com.cn
(17)国盛证券有限责任公司
注册地址:南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人:曾小普
客户服务电话:0791-86272572
网址:http://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
客户服务热线:400666888
网址:http://www.cgws.com
(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一号
法定代表人:张运勇
电话:0769-22119341
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: http://www.dgzq.com.cn
(20)国海证券有限责任公司
注册地址:广西桂林市辅星路13号
法定代表人:张雅峰
客服热线:4008888100(全国),96100(广西)
开放式基金业务传真:0771-5539033
网址: http://www.ghzq.com.cn
(21)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区福山路500号"城建国际中心"26楼
办公地址:上海市浦东南路588号26楼
法定代表人:姚文平
开放式基金咨询电话: 4008888128
开放式基金业务传真: 021-68767981
网址: http://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:储晓明
电话:021-54033888
传真:021-54035333
客服热线:021-962505
网址:http://www.sywg.com.cn
(23)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95579
电话:021-63219781
传真:021-51062920
网址:http://www.95579.com
(24)渤海证券股份有限公司
住所:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:杜庆平
电话:022-28451861
传真:022-28451892
客户服务电话: 4006515988
网址:http:// www.ewww.com.cn
(25)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
联系电话:010-5832 8752
传真:010-5922 8748
客户服务电话: 400-887-8827
网址:http://www.ubssecurities.com
(26)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:0591-87383623
传真:0591-87383610
客户服务电话:96326(福建省外请加拨0591)
公司网站:http://www.hfzq.com.cn
(27)齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
联系电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客户服务电话:95538
公司网站:http://www.qlzq.com.cn
(28)爱建证券有限责任公司
住所:上海市世纪大道1600号32楼
法定代表人:郭林
联系电话:021-32229888
客服电话:021-63340678
公司网站:http://www.ajzq.com
(29)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
(30)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:宋德清
联系电话:010-58568007
传真:010-58568062
客服电话:010-58568162
公司网站:http://www.hrsec.com.cn
(31)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:0755-82133952
客服电话:95536
公司网站:http://www.guosen.com.cn
(32)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
法定代表人:王东明
统一客服电话:95558
公司网站地址:http://www.cs.ecitic.com
(33)中信万通证券有限责任公司
注册地址:山东省青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层
法定代表人:杨宝林
统一客服电话: 95548
公司网站地址:http://www.zxwt.com.cn
(34)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
统一客服电话:(0571)96598
公司网站:http://www.bigsun.com.cn
●其他代销机构
(1)天相投资顾问有限公司
注册地址: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:010-66045608
客服电话:010-66045678
传真:010-66045527
网址: 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。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:金颖
电话:010-58598853
传真:010-58598907
联系人:任瑞新
(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、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
兴全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;运用兴全多维趋势分析系统,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"兴全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"兴全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交易室。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
由金融工程及专题研究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,金融工程及专题研究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。金融工程及专题研究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全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)2013年第1季度报告,数据截至2013年3月31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	8,528,015,655.81	81.30
	其中:股票	8,528,015,655.81	81.30
2	固定收益投资	997,375,985.08	9.51
	其中:债券	997,375,985.08	9.51
	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	955,543,668.89	9.11
6	其他资产	8,682,451.98	0.08
7	合计	10,489,617,761.76	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	-	-
B	采矿业	81,440,134.36	0.78
C	制造业	4,412,672,572.33	42.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	203,107,420.59	1.94
E	建筑业	454,485,203.75	4.35
F	批发和零售业	571,058,928.51	5.46
G	交通运输、仓储和邮政业	37,250,000.00	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	103,063,125.40	0.99
J	金融业	2,245,025,878.03	21.48
K	房地产业	287,270,583.55	2.75
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	94,500,000.00	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	38,141,809.29	0.36
	合计	8,528,015,655.81	81.59

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	000895	双汇发展	10,244,357	827,744,045.60	7.92
2	600036	招商银行	57,048,668	720,524,676.84	6.89
3	600276	恒瑞医药	16,268,251	546,775,916.11	5.23
4	601318	中国平安	9,500,000	396,815,000.00	3.80
5	600519	贵州茅台	2,187,592	369,396,785.12	3.53
6	600000	浦发银行	34,899,825	353,535,227.25	3.38
7	601668	中国建筑	103,481,639	348,733,123.43	3.34
8	000963	华东医药	6,777,518	289,806,669.68	2.77
9	600600	青岛啤酒	7,025,222	259,019,935.14	2.48
10	002250	联化科技	9,877,941	249,516,789.66	2.39

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	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	86,731,863.60	0.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	910,644,121.48	8.71
8	其他	-	-
9	合计	997,375,985.08	9.54

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	113002	工行转债	3,537,470	382,152,884.10	3.66
2	110015	石化转债	2,263,540	253,607,021.60	2.43
3	113001	中行转债	2,289,150	233,127,036.00	2.23
4	112030	11鲁西债	479,130	49,110,825.00	0.47
5	126013	08青啤债	389,210	37,621,038.60	0.36

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、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
(2)本基金投资股指期货的投资政策
股指期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。
9、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	1,335,972.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,843,094.57
5	应收申购款	1,503,384.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	8,682,451.98

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	382,152,884.10	3.66
2	110015	石化转债	253,607,021.60	2.43
3	113001	中行转债	233,127,036.00	2.23
4	110018	国电转债	15,495,230.40	0.15
5	110013	国投转债	13,438,000.00	0.13
6	110017	中海转债	6,044,487.40	0.06
7	125089	深机转债	1,301,279.58	0.01

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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2013年3月31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
2013年第1季度	3.32%	1.14%	0.37%	0.75%	2.95%	0.39%
2012年度	5.47%	0.87%	5.62%	0.62%	-0.15%	0.25%
2011年度	-18.15%	0.90%	-11.60%	0.65%	-6.55%	0.25%
2010年度	-2.77%	1.15%	-3.78%	0.78%	1.01%	0.37%
2009年度	69.32%	1.45%	42.14%	1.00%	27.18%	0.45%
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年度	1.70%	0.23%	3.17%	0.42%	-1.47%	-0.19%
自基金合同成立起至2013年3月31日	483.99%	1.30%	109.65%	0.96%	374.34%	0.34%

注:2005年度数据统计期间为2005年11月3日(基金合同成立之日)至2005年12月31日,不满一年。

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%归入基金财产。
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2012年12月15日刊登《兴全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、更新了公司联系电话。
2、更新了基金管理人旗下管理基金的情况。
3、更新了公司部门设置情况。
4、更新了公司部分董事任职情况。
5、更新了个别投资决策委员会成员的简历。
三、"四、基金托管人"部分
更新基金托管人发展及财务情况、主要人员情况、托管业务的经营情况。
四、"五、相关服务机构"
1、更新了基金管理人的直销联系电话及网上直销渠道。
2、更新了个别销售代理机构的相关情况。
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2013年3月31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2013年3月31日。
七、"二十四、其他应披露事项"部分
以下为自2012年11月3日至2013年5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	关于旗下部分基金投资浙江震元(000705)非公开发行股票的公告	2012年11月14日
2	关于旗下部分基金参加中国银行手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2012年11月30日
3	关于开通支付宝账户进行网上直销业务的公告	2012年12月4日
4	关于在邮储银行开通基金转换业务的公告	2012年12月6日
5	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	2012年12月17日
6	关于旗下部分基金投资国金证券(600109)非公开发行股票的公告	2012年12月26日
7	关于长期停牌股票(恒生电子)估值政策调整及对基金资产净值影响的公告	2012年12月27日
8	关于参加中国工商银行定投费率优惠活动的公告	2012年12月31日
9	关于旗下部分基金参加平安银行费率优惠活动的公告	2012年12月31日
10	关于旗下部分基金继续参加邮储银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	2012年12月31日
11	关于变更公司电话总机、传真号码及直销中心业务电话的公告	2012年12月31日
12	旗下各基金2012年12月31日资产净值公告	2013年1月1日
13	关于代表兴全趋势基金诉江苏熔盛重工缔约过失责任纠纷案一审结果公告	2013年1月11日
14	关于长期停牌股票(万科A)估值政策调整的公告	2013年1月12日
15	关于设立上海兴全睿众资产管理有限公司的公告	2013年1月17日
16	关于在平安银行开通基金转换业务的公告	2013年1月21日
17	关于调整旗下基金在瑞银证券有限责任公司定期定额投资起点金额的公告	2013年1月29日
18	参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	2013年1月31日
19	关于旗下部分基金投资华邦制药(002004)非公开发行股票的公告	2013年2月18日
20	关于旗下部分基金投资浦东建设(600284)非公开发行股票的公告	2013年2月22日
21	关于江苏省高级人民法院受理我司代表兴全趋势基金诉江苏熔盛重工有限公司缔约过失责任纠纷一案上诉的公告	2013年3月14日
22	关于长期停牌股票(华谊嘉信)估值政策调整的公告	2013年3月14日
23	关于新增"银联通"部分银行卡网上直销业务功能及费率优惠的公告	2013年3月28日
24	关于旗下部分基金继续参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	2013年3月30日
25	关于在网上直销平台开通"银联通"部分银行卡定期定额投资业务的公告	2013年4月12日
26	关于旗下部分基金投资保龄宝(002286)非公开发行股票的公告	2013年4月18日

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
2013年6月15日