

银河沪深 300 价值指数证券投资基金招募说明书

（更新摘要）

【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会 2009 年 9 月 28 日《关于核准银河沪深 300 价值指数证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]1025 号）的核准，进行募集。

基金管理人保证《银河沪深 300 价值指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）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收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，投资人认购（或申购）本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。

本次更新内容仅涉及《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》对基金信息披露事项相关要求的更改。本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 6 月 28 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

原招募说明书与本次更新的招募说明书不一致的，以本次更新的招募说明书为准。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

第一节 基金管理人

一、基金管理人概况

基金管理人：银河基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层

法定代表人：刘立达

成立日期：2002 年 6 月 14 日

注册资本：2.0 亿元人民币

电话：（021）38568888

联系人：罗琼

股权结构：

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
中国银河金融控股有限责任公司	10000	50%
中国石油天然气集团有限公司	2500	12.5%
上海城投（集团）有限公司	2500	12.5%
首都机场集团公司	2500	12.5%
湖南电广传媒股份有限公司	2500	12.5%
合 计	20000	100%

二、主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

董事长刘立达先生，中共党员，英国威尔士大学（班戈）金融 MBA。2014 年 4 月被选举为银河基金管理有限公司董事。1988 年至 2008 年在中国人民银行总行工作，历任金融研究所国内金融研究室助理研究员，研究局资本市场处主任

科员、货币政策处副调研员。2008 年 6 月进入中国银河金融控股有限责任公司工作，曾任股权管理运营部总经理、银河保险经纪公司董事、战略发展部总经理、综合管理部总经理等职。2016 年加入银河基金管理有限公司担任总经理。

董事周浩先生，中共党员，工商管理硕士。2018 年 8 月被选举为银河基金第四届董事会董事。历任上海新江湾城工程建设指挥部指挥，上海市城市建设投资开发总公司行政人事部副总经理、总经理，上海城投控股股份有限公司党委书记、副总裁、监事会主席、上海城投（集团）有限公司纪委书记、监事会副主席等职，现任上海城投（集团）有限公司党委委员、副总裁。

董事熊人杰先生，大学本科学历。2006 年 3 月被选举为银河基金管理有限公司第二届董事会董事，第三届董事会、第四届董事会连任。曾任职于湖南人造板厂进出口公司、湖南省广电总公司、湖南电广传媒股份有限公司。现任深圳市达晨创业投资公司副总裁。

董事付华杰先生，中共党员，硕士研究生学历。2018 年 3 月被选举为银河基金管理有限公司第四届董事会董事。历任金飞民航经济发展中心投资主管，首都机场地产集团有限公司部门经理助理，首都机场集团资产管理有限公司部门经理。现任首都机场集团公司资本运营部副总经理。

董事陆地先生，中共党员，大学本科学历。2017 年 2 月被选举为银河基金管理有限公司第四届董事会董事。历任中国人保信托投资公司副处长、中国银河证券经纪业务总部机构部副经理、中国银河证券北京安外证券营业部总经理、中国银河金融控股有限责任公司综合部董事长秘书，现任中国银河金融控股有限责任公司股权管理运营部副总经理。

董事戚振忠先生，中共党员，企业管理硕士，高级经济师。2017 年 2 月被选举为银河基金管理有限公司第四届董事会董事。历任大港油田总机械厂技术员、大港油田局办公室科员、大港油田经济研究所科员，现任中石油集团公司资本运营部处长。

独立董事王福山先生，大学本科学历，高级工程师。2002 年 6 月被选举为银河基金管理有限公司第一届董事会独立董事，第二届、第三届、第四届董事会连任。历任北京大学教师，国家地震局副局长，中国人民保险公司部门总经理，中国人保信托投资公司副董事长，深圳阳光基金管理公司董事长等职。现任中国

人寿保险公司巡视员。

独立董事王建宁先生，中共党员，硕士，律师。2015 年 11 月被选举为银河基金管理有限公司第四届董事会独立董事。历任国家建设委员会干部，国家经济委员会外事局干部，国家计划委员会工业经济联合会国际部干部，日本野村证券株式会社总部投资及咨询顾问，全国律协会员法律助理，现任北京德恒律师事务所律师、合伙人。

独立董事郭田勇先生，2014 年 4 月被选举为银河基金管理有限公司独立董事。中央财经大学金融学院教授、博士生导师，中央财经大学中国银行业研究中心主任。亚洲开发银行高级顾问、中国人民银行货币政策委员会咨询专家、中国银监会外聘专家、中国支付清算协会互联网金融专家委员会委员、中国国际金融学会理事。

独立董事李笑明先生，中共党员，经济师。2014 年 4 月被选举为银河基金管理有限公司独立董事。历任中国人民银行国家外汇管理局办公室副主任、主任；国家外汇管理局办公室副主任、主任；中央汇金投资有限公司副总经理；中再保、国开行董事。

监事长李立生先生，中共党员，硕士研究生学历。历任建设部标准定额研究所助理研究员，中国华融信托投资公司证券总部研究发展部副经理，中国银河证券有限责任公司研究中心综合研究部副经理，银河基金管理有限公司筹备组成员，银河基金管理有限公司研究部总监、基金管理部总监、基金经理、金融工程部总监、产品规划部总监、督察长等职。

监事周宇女士，中共党员，经济学博士。2018 年 8 月被选举为银河基金管理有限公司第四届监事会监事。历任河北财达证券经纪有限责任公司投资银行部职员，北京华证普惠信息股份有限公司 XBRL 应用部业务经理，中国证券投资者保护基金有限责任公司资产管理部业务经理，中国证券投资者保护基金有限责任公司党委（纪检监察）办公室高级经理，中国证券投资者保护基金有限责任公司证券市场交易结算资金监控中心（统计分析中心）高级经理，中国证券投资者保护基金有限责任公司调查评价部高级经理，现任中国银河金融控股有限责任公司高级经理，中国银河金融控股有限责任公司第一党支部组织委员、纪检委员。

监事赵斌先生，中共党员，大学本科学历。2015 年 11 月被选举为银河基金

管理有限公司第四届监事会监事。先后任职于北京城建华城监理公司、银河证券有限公司。现为银河基金管理有限公司员工。

董事长刘立达先生（代为履行总经理职务），中共党员，英国威尔士大学（班戈）金融 MBA。1988 年至 2008 年在中国人民银行总行工作，历任金融研究所国内金融研究室助理研究员，研究局资本市场处主任科员、货币政策处副调研员。2008 年 6 月进入中国银河金融控股有限责任公司工作，曾任股权管理运营部总经理、银河保险经纪公司董事、战略发展部总经理、综合管理部总经理等职。2016 年 2 月加入银河基金管理有限公司担任总经理，2017 年 12 月转任董事长。

原总经理范永武先生因个人原因辞职，经公司第四届董事会审议通过，由董事长刘立达先生代为履行总经理职务。该事项已经于 2019 年 5 月 30 日对外公告。

副总经理陈勇先生，中共党员，大学本科学历。历任哈尔滨证券公司友谊路证券交易营业部电脑部经理、和平路营业部副总经理，联合证券有限责任公司哈尔滨和平路营业部总经理、联合证券公司投资银行总部高级经理，中国银河证券有限责任公司总裁办公室秘书处副处长、处长、（党委办公室）副主任，中国银河证券股份有限公司总裁办公室（党委办公室）副主任（主持工作），期间任北京证券业协会秘书长（兼），中国银河金融控股有限责任公司战略发展部执行总经理，银河资本资产管理有限公司董事长、法定代表人。

督察长秦长建先生，中共党员，研究生学历，硕士学位。持有中国注册会计师、国际注册内部审计师、法律职业资格证书、中国注册资产评估师等专业资格证书，先后在会计师事务所、上市公司等行业从事内审、财务、资产评估等工作。2007 年加入银河基金，先后任监察部监察稽核(内审)、财务部总监、综合管理部总监。

副总经理钱睿南先生，硕士研究生，17 年证券从业经历。曾先后在中国华融信托投资公司、中国银河证券有限责任公司工作。2002 年 6 月加入银河基金管理有限公司，历任交易主管、基金经理助理、基金经理、股票投资部总监、公司总经理助理等职务。

2、本基金基金经理

罗博先生，中共党员，博士研究生学历，14 年证券从业经历。曾就职于华

夏银行，中信万通证券有限公司，期间从事企业金融、投资银行业务及上市公司购并等工作。2006 年 2 月加入银河基金管理有限公司，历任产品设计经理、衍生品数量化投资研究员、行业研究员等职务，现担任基金经理。2009 年 12 月起担任银河沪深 300 价值指数证券投资基金的基金经理，2014 年 3 月担任银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 2 月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

3、投资决策委员会成员

董事长刘立达先生，副总经理陈勇先生，副总经理兼股票投资部总监钱睿南先生，总经理助理兼战略规划部总监吴磊先生，固定收益部总监韩晶先生，股票投资部副总监张杨先生，股票投资部基金经理神玉飞先生。

上述人员之间均无近亲属关系。

第二节 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：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码 939），于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码 601939）。

2018 年 6 月末，本集团资产总额 228,051.82 亿元，较上年末增加 6,807.99 亿元，增幅 3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加 93.27 亿元至 1,814.20 亿元，增幅 5.42%；净利润较上年同期增加 84.56 亿元至 1,474.65 亿元，增幅 6.08%。

2017 年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017 年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017 最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017 年中国最佳数字银行”、“2017 年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017 最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017 全球银行 1000 强”中列第 2 位；在美国《财富》“2017 年世界 500 强排行榜”中列第 28 名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 315 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银

行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珏，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，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、(R)QFII、(R)QDII、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 2018 年二季度末，中国建设银行已托管 857 只证券投资基金。中国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。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

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。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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“新一代托管应用监督子系统”，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。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. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。
2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。
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和投资独立性等方面进行评价，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。

第三节 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

（1）银河基金管理有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层

法定代表人：刘立达

网址：www.galaxyasset.com（支持网上交易）

客户服务电话：400-820-0860

直销业务电话：(021)38568981/ 38568507

传真交易电话：(021)38568985

联系人：郑夫桦、徐佳晶

（2）银河基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区月坛西街 6 号院 A-F 座三层(邮编：100045)

电话：(010) 56086900

传真：(010) 56086939

联系人：郭森慧

（3）银河基金管理有限公司广州分公司

住所：广州市天河区天河北路 90-108 号光华大厦西座三楼(邮编：510620)

电话：(020) 37602205

传真：(020) 37602384

联系人：史忠民

（4）银河基金管理有限公司哈尔滨分公司

住所：哈尔滨市南岗区果戈里大街 206 号三层

电话：(0451) 82812867

传真：(0451) 82812869

联系人：崔勇

（5）银河基金管理有限公司南京分公司

住所：南京市江东中路 201 号 3 楼南京银河证券江东中路营业部内（邮编：210019）

电话：（025）84671299

传真：（025）84523725

联系人：李晓舟

（6）银河基金管理有限公司深圳分公司

住所：深圳市福田区深南大道 4001 号时代金融中心大厦 6F（邮编：518046）

电话：（0755）82707511

传真：（0755）82707599

联系人：史忠民

2、场外代销机构

（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：田国立

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（2）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：陈四清

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

（3）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（4）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：周慕冰

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

（5）交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

法定代表人：彭纯

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（6）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：李建红

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（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

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

网址：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9号

法定代表人：李庆萍

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

（9）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

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号A座

法定代表人：李晓鹏

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

（10）华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：李民吉

开放式基金咨询电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

（11）北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：张东宁

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

（12）兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561，或拨打当地咨询电话

网址：www.cib.com.cn

（13）东莞农村商业银行股份有限公司

住所：东莞市南城路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

网址：www.drcbank.com

（14）厦门银行股份有限公司

住所：厦门市湖滨北路101号商业银行大厦

法定代表人：吴世群

客户服务热线：400-858-8888

网址：www.xmbankonline.com

（15）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A座

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

网址：www.psbc.com

（16）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：陈共炎

电话：（010）66568292

传真：（010）66568990

联系人：邓颜

客户服务电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

（17）德邦证券股份有限公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：武晓春

联系人：朱磊

电话：（021）68761616

传真：（021）68767880

客户服务电话：4008888128

网址：www.tebon.com.cn

（18）华龙证券股份有限公司

住所：甘肃省兰州市城关区静宁路308号

办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号

法定代表人：李晓安

电话：（0931）4890208

传真：（0931）4890628

联系人：邓鹏怡

客户服务电话：95368

网址：www.hlzq.com

（19）江海证券有限公司



住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人：孙名扬

联系人：姜志伟

电话：(0451)87765732

传真：(0451)82337279

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(20) 华宝证券有限责任公司

住所：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57楼

法定代表人：陈林

电话：(021) 68778075

传真：(021) 68777723

联系人：汪明丽

客户服务电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

(21) 国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

电话：(021) 38676767

传真：(021) 38670666

联系人：芮敏祺、朱雅崑

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(22) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

电话: (010)85130588

传真: (010)65182261

联系人: 权唐

客户服务电话: 4008-888-108

网址: www.csc108.com

(23) 广发证券股份有限公司

住所: 广州市天河北路183-187号大都会广场43楼

办公地址: 广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人: 林治海

电话: (020)87555888

传真: (020)87555305

联系人: 黄岚

客户服务电话: 95575或02095575

网址: www.gf.com.cn

(24) 华安证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座

法定代表人: 李工

电话: (0551) 65161666

传真: (0551) 65161600

联系人: 范超

客户服务电话: 95318

网址: www.hazq.com

(25) 国联证券股份有限公司

住所: 无锡市县前东街168号

办公地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号

法定代表人: 雷建辉

电话: (0510)82831662

传真: (0510)82830162

联系人：沈刚

客户服务电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

（26）山西证券股份有限公司

住所：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

电话：(0351)8686703

传真：(0351)8686619

联系人：邓颖云

客户服务电话：95573

网址：www.i618.com.cn

（27）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：薛峰

电话：(021)22169999

传真：(021)22169134

联系人：李芳芳

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

（28）湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省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：孙永祥

电话：（021）38784580-8918

传真：（021）68865680

联系人：李欣

客户服务电话：95351

网址：www.xcsc.com

（29）海通证券股份有限公司

住所: 上海市淮海中路98号

办公地址: 上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

电话: (021)23219000

传真: (021)23219100

联系人: 金芸、李笑鸣

客户服务电话: 95553或拨打各城市营业网点咨询电话

网址: www.htsec.com

(30) 金元证券股份有限公司

住所: 海口市南宝路36号证券大厦4楼

办公地址: 深圳市深南大道4001号时代金融中心17层

法定代表人: 陆涛

电话: (0755)83025666

传真: (0755)83025625

联系人: 许方迪

客户服务电话: 400-8888-228

网址: www.jyzq.cn

(31) 申万宏源证券有限公司

住所: 上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人: 李梅

电话: (021)33389888

传真: (021)33388224

联系人: 黄莹

客户服务电话: 95523或4008895523

网址: www.swhysc.com

(32) 申万宏源西部证券有限公司

住所: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20

楼2005室 (邮编:830002)

法定代表人: 韩志谦

联系人: 王怀春

电话: (0991) 2307105

传真: (0991) 2301927

客户服务电话: 400-800-0562

网址: www.hysec.com

(33) 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) 82943666

传真: (0755) 82943636

联系人: 林生迎

客户服务电话: 95565、4008-888-111

网址: www.newone.com.cn

(34) 广州证券股份有限公司

住所: 广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人: 邱三发

电话: (020) 88836999

传真: (020) 88836654

联系人: 林洁茹

客户服务电话: (020) 961303

网址: www.gzs.com.cn

(35) 中泰证券股份有限公司

住所: 山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人: 李炜

电话: 021-20315290

传真: 021-20315125

联系人: 许曼华

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（36）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

办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

电话：(0755)82825551

传真：(0755)82558355

联系人：朱贤

客户服务电话：4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

（37）中航证券有限公司

住所：江西省南昌市抚河北路291号

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人：杜航

电话：(0791)6768763

传真：(0791)6789414

联系人：余雅娜

客户服务电话：400-8866-567

网址：www.scstock.com

（38）国元证券股份有限公司

住所：中国安徽省合肥市梅山路18号

办公地址：安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座国元证券

法定代表人：蔡咏

联系人：米硕

电话：(0551) 68167601

传真：(0551) 62207773

（39）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层

办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人: 赵俊

电话: (021) 20333333

传真: (021) 50498851

联系人: 王一彦

客户服务电话: 95531; 400-8888-588

网址: www.longone.com.cn

(40) 长江证券股份有限公司

住所: 湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人: 尤习贵

电话: (027) 65799999

传真: (027) 85481900

联系人: 奚博宇

客户服务电话: 4008-888-999或95579

网址: www.95579.com

(41) 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、23层、25层-29层

办公地址: 上海市中山南路318号2号楼13层、21层-23层、25-29层、32 层、36 层、39 层、40 层

法定代表人: 潘鑫军

联系人: 孔亚楠

电话: (021) 63325888

传真: (021) 63326729

客户服务电话: 95503

网址: www.dfzq.com.cn

(42) 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

办公地址: 北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人: 林义相

电话: (010)66045566

传真: (010)66045500

联系人: 林爽

客户服务电话: (010) 66045678

网址: www.txsec.com

(43) 信达证券股份有限公司

住所: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人: 张志刚

电话: (010)63081000

传真: (010)63080978

联系人: 唐静

客户服务电话: 95321

网址: www.cindasc.com

(44) 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

办公地址: 福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人: 黄金琳

电话: (021) 20655183

传真: (0591)87841150

联系人: 王虹

客户服务电话: (0591) 96326

网址: www.hfzq.com.cn

(45) 中国国际金融股份有限公司

住所: 北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座6层

法定代表人: 金立群

联系电话: (010) 65051166

传真: (010)65058065

联系人: 肖婷

客户服务电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

（46）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12层

法定代表人：徐勇力

电话：(010)66555316

传真：(010)66555246

联系人：汤漫川

客户服务电话：4008-888-993

网址：www.dxzq.net

（47）财通证券股份有限公司

办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、

1601-1615、1701-1716

法定代表人：沈继宁

电话：(0571) 87789160

传真：(0571) 87818329

邮编：310007

联系人：陶志华

客户服务电话：95336

网址：www.ctsec.com

（48）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观40层

法人代表：高利

电话：(010)59355807

传真：(010)56437013

联系人：程博怡

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（49）华泰证券股份有限公司

住所：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：（0755）82492193

传真：（0755）82492962

联系人：庞晓芸

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（50）民生证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区朝阳门外大街18号中国人寿大厦1901

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：岳献春

电话：（010）85127622

传真：（010）85127917

联系人：赵明

客户服务电话：400-619-8888

网址：www.msza.com

（51）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

办公地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

法定代表人：林炳城

电话：（0755）82943755

传真：（0755）82960582

联系人：罗艺琳

客户服务电话：95329

网址：www.zszq.com

（52）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦20层经纪业务管理部

法定代表人：王东明

电话：（010）84683893

传真：（010）84685560

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

网址：www.cs.ecitic.com

（53）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路13号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼

法定代表人：张雅锋

电话：（0755）83709350

传真：（0755）83700205

联系人：牛孟宇

客户服务电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

（54）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼20层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：（0532）85022326

传真：（0532）85022605

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

（55）西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：王珠林

客户服务电话：4008-096-096

网址：www.swsc.com.cn



(56) 东北证券股份有限公司

住所: 长春市生态大街6666号

办公地址: 长春市生态大街6666号

法定代表人: 李福春

电话: (0431) 85096517

传真: (0431) 85096795

联系人: 安岩岩

客户服务电话: 95360

网址: www.nesc.cn

(57) 中国中投证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A 栋第18 层-21 层及第04 层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址: 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心A 栋第04、18 层至21 层

法定代表人: 高涛

联系人: 万玉琳

电话: 0755-82026907

传真: (0755)82026539

网址: www.china-invs.cn

客户服务电话: 400-600-8008、95532

(58) 第一创业证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人: 刘学民

联系人: 毛诗莉

电话: (0755) 23838750

传真: (0755) 25838701

客户服务电话: 95358

网址: www.firstcapital.com.cn

（59）上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

电话：（021）53686888

传真：（021）53686100-7008、（021）53686200-7008

客户服务电话：（021）962518

网址：www.962518.com

（60）中信期货有限公司

住所：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13层

1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：洪诚

电话：（0755）23953913

传真：（0755）83217421

客户服务电话：4009908826

网址：www.citicsf.com

（61）国金证券股份有限公司

住所：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：（028）86690057、（028）86690058

传真：（028）86690126

客户服务电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

（62）华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：李进

电话：(021)65080566

传真：(028)86150040

客户服务电话：95584、4008-888-818

网址：www.hx168.com.cn

（63）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元

法定代表人：俞洋

电话：（021）54967552

传真：（021）54967293

联系人：杨莉娟

客户服务电话：95323，4001099918

网址：www.cfsc.com.cn

（64）南京证券股份有限公司

住所：南京市江东中路389号

办公地址：南京市江东中路389号

法定代表人：步国旬

电话：(025)58519523

传真：(025)83369725

联系人：王万君

客户服务电话：95386

网址：www.njzq.com.cn

3. 第三方独立销售机构

（1）上海天天基金销售有限公司

住所：浦东新区峨山路613号6幢551室

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

（2）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-8850-099

网址： www.howbuy.com

(3) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市江南大道3588号

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：400-0766-123

网址： www.fund123.cn

(4) 深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：400-6788-887

网址： www.zlfund.cn 或 www.jjmmw.com

(5) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-089-1289

网址： www.erichfund.com

(6) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦1002室

办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场18层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022/(021) 20835588

网址： licaike.hexun.com

(7) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址: 北京市西城区金融大街35号国企大厦C座9层

法定代表人: 马令海

客户服务电话: 400-850-7771

网址: t.jrj.com.cn

(8) 北京展恒基金销售有限公司

住所: 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址: 北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人: 闫振杰

客户服务电话: 400-888-6661

网址: www.myfund.com

(9) 北京增财基金销售有限公司

住所: 北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

法定代表人: 王昌庆

客户服务电话: 400-001-8811

网址: www.zcvc.com.cn

(10) 众升财富(北京)基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内

法定代表人: 李招弟

客户服务电话: 400-808-0069

网址: www.wy-fund.com

(11) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址: 浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人: 凌顺平

客户服务电话: 4008-773-772

网址: www.5ifund.com

(12) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所: 北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人: 赵荣春

联系人: 魏争

联系人电话: (010) 57418829

传真: (010) 57569671

网址: www.niuji.net

客户服务电话: 400-678-5095

(13) 一路财富(北京)信息科技有限公司

住所: 北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室

法定代表人: 吴雪秀

客户服务电话: 400-001-1566

网址: www.yilucaifu.com

(14) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法定代表人: 汪静波

客户服务电话: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

(15) 济安财富(北京)资本管理有限公司

住所: 北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层

法定代表人: 杨健

客户服务电话: 400-075-6663

网址: www.pjfortune.com

(16) 上海利得基金销售有限公司

住所: 上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址: 上海市浦东新区东方路989号中达广场201室

法定代表人: 盛大

客户服务电话: 400-067-6266

网址: www.leadfund.com.cn

(17) 日发资产管理(上海)有限公司

住所：上海市陆家嘴花园石桥路66号东亚银行大厦1307室

法定代表人：周泉恭

客户服务电话：(021)61600500

网址： www.rffund.com

(18) 上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路100号19层

办公地址：上海市虹梅路1801号凯科国际大厦7层

法定代表人：冯修敏

客户服务电话：400-820-2819

网址： fund.bundtrade.com

(19) 上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼

法定代表人：燕斌

客户服务电话：4000-466-788

网址： www.91fund.com.cn

(20) 上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

全国统一客服电话：4008-219-031

网址： www.lufunds.com

(21) 深圳富济财富管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室

法定代表人：齐小贺

客户服务电话：(0755)83999913

网址： www.jinqianwo.cn

(22) 海银基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元

法定代表人：刘惠

客户服务电话：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

（23）珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（24）上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

客户服务电话：4000-178-000

网址：www.lingxianfund.com

（25）大泰金石投资管理有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

法定代表人：袁顾明

客户服务电话：400-928-2266

网址：www.dtfunds.com

（26）北京乐融多源投资咨询有限公司

住所：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

法定代表人：董浩

客户服务电话：400-068-1176

网址：www.jimufund.com

（27）奕丰金融服务（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1116 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

客户服务电话：400-6846-500

公司网站： www.ifastps.com.cn

（28）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲一号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：彭运年

客户服务电话：010-59336512

公司网站： www.jnlc.com

（29）浙江金观诚财富管理有限公司

住所：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人：徐黎云

客户服务电话：400-001-8811

公司网站： www.jincheng-fund.com

（30）泛华普益基金销售有限公司

住所：四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：于海锋

客户服务电话：400-8878-566

公司网站： www.pyfund.cn

（31）北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号嘉盛中心 30 层

法定代表人：梁越

客户服务电话：4008-980-618

公司网站： www.chtfund.com

（32）武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

客户服务电话: (027)87006003

(33) 北京懒猫金融信息服务有限公司

住所: 北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

法定代表人: 许现良

客户服务电话: 4001-500-882

网址: www.lanmao.com

(34) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所: 厦门市思明鹭江道 2 号第一广场 15 楼

法定代表人: 陈洪生

客户服务电话: 400-6980-777

网址: www.xds.com.cn

(35) 杭州科地瑞富基金销售公司

住所: 杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

法定代表人: 陈刚

客户服务电话: (0571)86655920

网址: www.cd121.com

(36) 北京广源达信投资管理有限公司

住所: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人: 齐剑辉

客户服务电话: 400-623-6060

网址: www.niuniufund.com

(37) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所: 北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

法定代表人: 陈超

客户服务电话: 95118/400-098-8511

网址: jr.jd.com

(38) 北京汇成基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室

法定代表人: 王伟刚

客户服务电话: 400-6199-059

网址: www.fundzone.cn

(39) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

住所: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址: 北京朝阳区亮马桥路 40 号二十一世纪大厦 A 座 303

法定代表人: 王岩

客户服务电话: 400-8199-868

公司网站: www.tdyhfund.com

(40) 上海基煜基金销售有限公司

住所: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室

办公地址: 上海市昆明路 518 号北美广场 A 栋 1002 室

法定代表人: 王翔

客户服务电话: (021)65370077

网址: www.jiyufund.com.cn

(41) 凤凰金信(银川)投资管理有限公司

住所: 宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402

办公地址: 北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人: 程刚

客户服务电话: 400-810-5919

网址: www.fengfd.com

(42) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所: 上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法定代表人: 李一梅

客户服务电话: 400-817-5666

网址: www.amcfortune.com

(43) 中民财富管理(上海)有限公司

住所: 上海市黄浦区中山南路 100 号 07 层

法定代表人: 弭洪军

客户服务电话：400-876-5716

网址：www.cmiwm.com

（44）北京格上富信投资顾问有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

客户服务电话：400-066-8586

网址：www.igesafe.com

（45）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：4000-618-518

网址：danjuanapp.com

（46）上海万得投资顾问有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

（47）上海挖财金融信息服务有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02/03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02/03 室

法定代表人：胡燕亮

客户服务电话：400-025-6569

网址：www.wacaijijin.com

（48）金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市海淀区东升园公寓 1 号楼 1 层南部

办公地址：北京市海淀区东升园公寓 1 号楼 1 层南部

法定代表人：夏予柱

客户服务电话：400-855-7333

网址：www.jhjfund.com

（49）民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张扬路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

客户服务电话：021-50206003

网址：www.msftec.com

（50）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

法定代表人：林卓

客户服务电话：400-0411-001

网址：www.taichengcaifu.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，并在基金管理人网站公示。

（47）上海挖财金融信息服务有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02/03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02/03 室

法定代表人：胡燕亮

客户服务电话：400-025-6569

网址公司网站：www.wacaijijin.com

（48）金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市海淀区东升园公寓 1 号楼 1 层南部

办公地址：北京市海淀区东升园公寓 1 号楼 1 层南部

法定代表人：夏予柱

客户服务电话：400-855-7333

网址公司网站：www.jhjfund.com

4、场内代销机构：

通过上海证券交易所（以下简称“上证所”）开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上证所会员。具体以上证所最新公布名单为准。

（二）基金登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：(010)50938839

传真：(010)50938907

联系人：朱立元

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市天银律师事务所

地址：北京市海淀区高粱桥斜街路 59 号中坤大厦 15 层

负责人：朱玉栓

电话：(010) 62159696

传真：(010) 88381869

经办律师：王肖东、朱振武

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

办公地址：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

法定代表人：曾顺福

联系电话：(021) 61418888

传真：(021) 63350177

经办注册会计师：胡小骏、冯适

联系人：胡小骏

第四节 基金概况

基金名称：银河沪深 300 价值指数证券投资基金

基金简称：银河沪深 300 价值指数

基金类型：股票型指数基金

基金运作方式：契约型开放式

第五节 基金的投资

一、投资目标

通过严格的投资程序约束、数学模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段，追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。

二、投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、央行票据、现金等，以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资包括沪深300 价值指数成份股和备选成份股、新股（首次发行或增发）等。

以后如有法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种（包括股指期货、股指期权等金融衍生产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并依法进行投资管理。

本基金跟踪标的指数的股票投资组合资产（包括标的指数成份股和备选成份股）不低于基金资产的 90%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

三、投资理念

本基金以拟合、跟踪沪深300 价值指数为原则，进行被动式指数化长期投资，力求获得该指数所代表的价值型股票市场的平均收益率，为投资者提供一个投资沪深300 价值指数的有效投资工具，使投资者可以分享中国经济中长期增长的稳定收益。

四、投资策略

本基金采用被动式指数投资策略，原则上采取以完全复制为目标的指数跟踪方法，按照成份股在沪深300 价值指数中的基准权重构建股票投资组合，并原则上根据标的指数成份股的变化或其权重的变动而进行相应调整。本基金将利用数量化模型，对跟踪误差及其相关指标进行动态管理，根据结果对基金投资组合进行相应调整；并将定期或不定期对数量化模型进行优化改善，力求减少跟踪误差，期望改进指数跟踪效果。本基金跟踪误差的风险控制目标为：力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年平均跟踪误差不超过4%。

在建仓期，或遇有特殊情况，或在一定时间内的跟踪误差或其相关指标超过相应的控制目标值，或出现其他实际情况导致本基金不能投资或无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据情况，对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。特殊情况包括但不限于第（四）节第1条《股票投资策略》中所列示的情形。

1、股票投资策略

为保证对标的指数的有效跟踪，本基金跟踪标的指数的股票投资组合资产（包括标的指数成份股和备选成份股）不低于基金资产的90%。股票投资组合的复制原则上采用完全复制的方式，特殊情况下将对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。特殊情况包括但不限于下列情形：

- (1) 建仓期；
- (2) 因分红导致投资组合的变化；
- (3) 因申购赎回导致投资组合的变化；
- (4) 成份股因异常事件停牌；

- (5) 成份股发生公司行为（包括增发、分红、配股、拆分、合并或其他行为等）；
- (6) 指数调整成份股（新增或剔除股票）；
- (7) 按照法律法规规定不能进行买卖的成份股；
- (8) 一定时间内的跟踪误差或其相关指标超过相应的控制目标值；
- (9) 遵从法律法规或监管机构的规定，需要调整投资组合以符合投资比例的限制；
- (10) 其他需要调整投资组合的情况。

2、股票投资组合的构建

(1) 构建原则

基金管理人原则上按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，根据标的指数成份股的变化或其权重的变动或跟踪误差的情况而进行相应调整。

如因标的指数成份股调整、股票停牌限制、股票流动性不足、基金申购或赎回、以及依照法律法规的规定不能进行买卖等各种基金管理人之外的因素，致使

基金无法依指数权重购买某成份股、投资不符合前述规定比例时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整。本基金对指数的拟合与复制，在投资股票数量上可能与指数成份股数量有较小偏离，但应保证投资组合收益率与指数高度相关，并寻求跟踪误差的最小化。

(2) 构建方法：

基金管理人构建股票投资组合的过程主要分为3步：

1) 确定目标组合：基金管理人原则上主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资目标组合；

2) 确定建仓策略：基金经理根据对成份股的分析、成份股流动性的分析和跟踪误差情况等因素，利用数量化模型，确定合理的建仓策略；

3) 逐步调整：通过不断的优化最终确定目标组合之后，基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数的要求。

3、股票投资组合的管理

基金管理人通过定期对成份股公司行为信息、标的指数变化、申购赎回情况、

投资组合头寸和流动性、投资操作、跟踪误差以及标的指数的编制规则和调整公告等进行跟踪分析，利用数量化分析模型，制定并将投资组合调整到目标组合的优化方案，力求最大限度地降低跟踪误差，以实现基金的投资目标。

4、跟踪误差的计算和控制

在基金运作过程中，对指数基金的跟踪误差进行分析、计算和控制，基本思路如下：

(1) 确定跟踪误差及其相关指标的控制目标值；

(2) 计算跟踪误差及其相关指标的实际值：每周、月、季度、半年、年、或根据需要计算一定时间内的跟踪误差及其相关指标的具体指标值，如达到或超过预警阈值，将发出警戒信号，提示基金经理关注和调整；

(3) 将跟踪误差及其相关指标的实际值与控制目标值进行比较，若符合条件，则维持组合；若不符合条件，则对投资组合进行调整。

5、股票投资组合的调整

(1) 调整原则

本基金指数化投资组合原则上将根据标的指数成份股变化或其权重的变动进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行调整，以保证基金净值增长率与基准指数收益率之间的高度正相关，寻求跟踪误差最小化。

(2) 调整条件

当出现股票投资组合需要进行调整的事件或情形时，如在建仓期、或遇有特殊情况、或在一定时间内的跟踪误差或其相关指标超过相应的控制目标值时，或出现其他实际情况时，本基金将对股票投资组合进行调整。特殊情况包括但不限于第（四）节第1条《股票投资策略》中所列示的情形。

(3) 调整步骤

1) 计算投资组合目标权重：使用多因素最优化模型，求解使跟踪误差最小化的投资组合，作为目标组合，用以替代个股或复制指数；

2) 计算投资组合实际权重与目标权重的差值，据此确定组合中买卖股票的品种、买卖方向，以及买卖比例或买卖数量；

3) 根据确定的买卖品种、买卖方向、买卖比例或买卖数量，由基金经理发出

交易指令，交易员执行交易指令，完成投资组合的调整。

（4）调整方法

1) 定期调整

本基金将根据所跟踪的沪深300 价值指数对其成份股及其权重的定期调整方案，结合本基金投资组合的构造原则和权重，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

2) 不定期调整

a. 与指数相关的调整

当沪深300 价值指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据沪深300 价值指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

b. 根据跟踪误差的情况调整

在实际投资中，本基金实行对跟踪误差的密切监控和预警。定期或根据需要计算基金组合跟踪误差及其相关指标，如达到或超过设定的预警阈值，将发出警戒信号，提示基金经理进行相应调整。

c. 限制性调整

当投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过法律法规或监管机构对基金投资比例规定限制时，本基金将对其进行实时的被动性卖出调整，并相应地对其他资产类别或个股进行微调，以保证基金合法规范运行。

d. 大额赎回调整

当发生大额赎回超过最高现金保有比例5%时，本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整，以保证基金正常运行。

e. 特殊情况的调整

对成份股中有按照法律法规规定不能进行买卖、或因重大事件导致停牌、或财务风险较大、或面临重大不利的司法诉讼等情况的股票，本基金将根据数学优化模型构造模拟组合来进行替代。

f. 其他调整

本基金将参与一级市场新股认购，得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

6、债券投资策略

基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于到期日在一年以内的国债、央行票据等债券，所投资的债券的信用评级级别应在 BBB 以上（含 BBB）。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。

五、投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

- (1) 有关法律法规、基金合同的相关规定；
- (2) 标的指数的编制规则和调整方案；
- (3) 经济发展状况和证券市场发展态势。

2、投资决策程序

(1) 研究与分析

本基金管理人内设研究部和数量分析小组，将定期或不定期地开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、成份股流动性分析、跟踪误差及其相关指标的计算监控和分析等工作，并结合市场部门提供的申购赎回数据，进行投资组合的流动性分析，提供分析报告，供基金经理参考。

(2) 投资组合的构建和日常管理

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，对基金的操作进行指导，确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下，参考研究部和数量分析小组提供的分析报告，制定基金的投资策略。在追求跟踪误差最小化的前提下，在其权限范围内进行基金的日常投资组合管理工作。

(3) 交易

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(4) 组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况。监察部对基金投资

进行日常监督。研究部和数量分析小组定期对基金投资进行绩效评估和风险分析，并通过监察部呈报给合规审查与风险控制委员会及督察长办公室、投资决策委员会、基金经理及相关人员。在监察部和数量分析小组提供的绩效评估和风险分析报告的基础上，基金经理定期对投资操作、组合状况、跟踪误差情况等进行总结，重点分析基金的跟踪偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等，并对基金投资组合进行相应调整。

六、业绩比较基准

沪深300 价值指数收益率*95% +银行活期存款收益率（税后）*5%。

沪深300价值指数是中证指数公司开发的沪深300风格指数系列中的子指数。该指数以沪深300指数样本股为样本空间，由其中100只价值Z值最高的股票构成。该指数由中证指数有限公司于2008年1月21日正式发布，以2004年12月31日为基期，基点为1000点。根据沪深300价值指数的编制方案，价值Z值的计算方法为：首先计算出样本空间每只样本股的四个价值因子——股息收益率（D/P）、每股净资产与价格比率（B/P）、每股净现金流与价格比率（CF/P）、每股收益与价格比率（E/P），然后对所有股票的四个变量值进行标准化z分处理。一个公司股票的价值Z值是四个价值因子变量Z值的均值。沪深300价值指数具有市场认可程度高、市场代表性好、流动性强、成份股调整频率低等特点，适合作为指数基金的跟踪标的。同时考虑到基金资产净值中有不低于5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，因此选择上述业绩比较基准。

如果沪深 300 价值指数被停止编制及发布或由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 价值指数不适用于本基金，不宜继续作为业绩比较基准，或证券市场有其他代表性更强、更适合本基金投资策略的指数推出时，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数和业绩比较基准，并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定媒介上公告。

七、风险收益特征

本基金为股票型指数基金，属于证券投资基金中高风险高收益的品种，其预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金。

八、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) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (2) 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%；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%；
- (3) 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%；
- (4) 本基金跟踪标的指数的股票投资组合资产（包括标的指数成份股和备选成份股）不低于基金资产的 90%；
- (5) 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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (6) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的债券；
- (7) 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；
- (8) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；
因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (9) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- (10) 法律法规以及监管机构规定的其他投资限制；
- (11) 以后如有法律法规或监管机构允许基金投资的其他品种（包括股指期货、股指期权等金融衍生产品），投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

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。

除上述第（5）、（8）、（9）项以外，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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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。

九、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

十、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

十一、基金投资组合报告（截止于 2019 年 3 月 31 日）

本投资组合报告已经基金托管人复核，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告中所述财务数据未经审计。

1.1 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	621,322,049.85	87.47
	其中：股票	621,322,049.85	87.47
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	978,000.00	0.14
	其中：债券	978,000.00	0.14
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	85,745,136.23	12.07
8	其他资产	2,281,112.24	0.32
9	合计	710,326,298.32	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	20,344,309.43	3.08
C	制造业	103,148,447.69	15.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,853,958.24	4.66
E	建筑业	43,499,137.69	6.58

F	批发和零售业	4,370,984.80	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	22,384,479.53	3.38
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	335,433,519.86	50.71
K	房地产业	59,223,534.11	8.95
L	租赁和商务服务业	1,499,580.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	—	—
	合计	620,757,951.35	93.85

1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	—	—
C	制造业	340,703.31	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,902.94	0.00
J	金融业	134,343.00	0.02
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	56,149.25	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	-	-
	合计	564,098.50	0.09

1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

1.3 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

1.3.1 报告期末指数投资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	1,183,896	91,278,381.60	13.80
2	600036	招商银行	1,099,420	37,292,326.40	5.64
3	601166	兴业银行	1,395,067	25,348,367.39	3.83
4	601328	交通银行	3,154,655	19,685,047.20	2.98
5	600016	民生银行	2,855,093	18,101,289.62	2.74
6	000001	平安银行	1,371,466	17,582,194.12	2.66
7	601288	农业银行	4,351,898	16,232,579.54	2.45
8	000002	万科A	520,343	15,984,936.96	2.42
9	600000	浦发银行	1,334,046	15,048,038.88	2.28
10	601668	中国建筑	2,413,302	14,769,408.24	2.23

1.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002958	青农商行	17,700	134,343.00	0.02
2	300762	上海瀚讯	1,233	82,475.37	0.01
3	300765	新诺威	1,412	74,821.88	0.01
4	603379	三美股份	2,052	66,546.36	0.01

5	002951	金时科技	1,675	57,653.50	0.01
---	--------	------	-------	-----------	------

1.4 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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	978,000.00	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	978,000.00	0.15

1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	110053	苏银转债	9,780	978,000.00	0.15

1.6 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资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金未进行贵金属投资。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。



1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金根据契约不投资股指期货。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未投资国债期货。

1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

1.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未投资国债期货。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

兴业银行——2018 年 5 月，兴业银行因 12 项违法违规事实被银保监会处以 5870 万元罚款。

本基金投资的前十名中其余九只证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责，处罚的情形。

1.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外

的股票。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	82,016.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,597.71
5	应收申购款	2,181,497.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,281,112.24

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

1.11.5.2 报告期末积极投资前五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	603379	三美股份	66,546.36	0.01	新股锁定

1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。



第六节 基金的业绩

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。有关业绩数据经托管人复核，但未经审计。

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
2010-01-01至 2010-12-31	-15.98%	1.45%	-22.83%	1.55%	6.85%
2011-1-1至 2011-12-31	-17.72%	1.24%	-17.08%	1.24%	-0.64%
2012-1-1至 2012-12-31	13.44%	1.09%	12.49%	1.11%	0.95%
2013-1-1至 2013-12-31	-9.17%	1.44%	-11.13%	1.43%	1.96%
2014-1-1至 2014-12-31	64.38%	1.24%	59.73%	1.27%	4.65%
2015-1-1至 2015-12-31	3.75%	2.37%	5.10%	2.33%	-1.35%
2016-1-1至 2016-12-31	-2.55%	1.19%	-4.41%	1.13%	1.86%
2017-1-1至 2017-12-31	34.77%	0.66%	30.55%	0.67%	4.22%
2018-1-1至 2018-12-31	-14.40%	1.23%	-18.09%	1.26%	3.69%
2019-1-1至 2019-3-31	19.31%	1.36%	19.49%	1.38%	-0.18%
自基金合同生效 起至今	63.10%	1.39%	38.21%	1.41%	24.89%

第七节 基金的费用

一、与基金运作有关的费用

1、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) 基金的指数使用费；
- (8) 基金的证券交易费用；
- (9) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

3、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 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 0.15% 年费率计提。计

算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

（3）基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02%（2 个基点）的年费率计提，且收取下限为每季度人民币 5 万元。计算方法如下：

$$H = E \times \text{指数使用费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计；基金设立当年不足 3 个月的，按照 3 个月收费。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

如果指数使用费的计算方法和费率等需要调整，本基金将在履行适当程序后变更本基金的指数使用费率或费率计算方法，基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介进行公告。

（4）上述“1、基金费用的种类”中（3）到（9）项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。

4、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。

5、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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

二、与基金销售有关的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中“（六）本基金的初始面值、认购价格及计算公式、认购费用”中的相关规定。

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“八、基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管”中的“（六）申购和赎回的价格、费用及其用途”中的相关规定。

第八节 对招募说明书更新部分的说明

根据 2019 年 9 月 1 日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。

银河基金管理有限公司

二〇一九年十一月二十九日