

# 银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金

## 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 2015 年 11 月 24 日《关于准予银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】2702 号）以及 2017 年 8 月 3 日《关于银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函【2017】1938 号），进行募集。

基金管理人保证《银河智慧主题灵活配置混合型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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、本基金投资策略所特有的风险、投资股指期货、国债期货的特定风险和未知价风险等等。

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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。

## 银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新摘要）

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

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1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

## 银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新摘要）

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，中共党员，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

## 银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新摘要）

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。现任银河基金管理有限公司北京分公司总经理。

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。

## 银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新摘要）

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职业资格证书，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

袁曦女士, 硕士研究生学历, 14 年证券从业经历。曾就职于交通银行上海浦东分行, 2007 年 12 月加入银河基金管理有限公司, 主要研究金融、汽车和休闲服装行业, 历任研究员、资深研究员, 现担任基金经理。2015 年 12 月起担任银河蓝筹精选混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 12 月起担任银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 11 月起担任银河和美生活主题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。

原玢，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”。

### 四、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。

## 五、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

公司网站：[www.galaxyasset.com](http://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：徐佳晶、郑夫桦

###### (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

地址：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

地址：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

地址：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

地址：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、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](http://www.ccb.com)

（2）招商银行股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

客户服务热线：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

（3）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：400-888-8888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

（4）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：李玮

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](http://www.zts.com.cn)

（5）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 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](http://www.ebscn.com)

（6）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 400-889-5523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

（7）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

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：（010）84683893

传真：（010）84685560

客户服务电话：95558

网址：www.cs.ecitic.com

（8）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

（9）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

（10）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

（11）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

（12）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

（13）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](http://www.longone.com.cn)

（14） 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：400-888-8108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（15） 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

法定代表人：韩志谦

电话：（0991）2307105

传真：（0991）2301927

联系人：王怀春

客户服务电话：400-800-0562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

（16） 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/](http://www.txsec.com/) [jijin.txsec.com](http://jijin.txsec.com)

（17） 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

（18）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

（19）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：曹实凡

电话：（021）38637436

传真：（0755）82400862

客户服务电话：95511-8

联系人：周一涵

网址：stock.pingan.com

（20）东北证券股份有限公司

住所：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

（21） 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：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（22） 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

客户服务电话：95310

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：（028）86690057、（028）86690058

传真：（028）86690126

网址：www.gjzq.com.cn

（23） 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

客服中心：95358

官网地址：www.firstcapital.com.cn

（24） 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

（25）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

电话：(0755) 82130833

传真：(0755) 82133952

联系人：李颖

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（26）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

（27）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：蒋浩

客户服务电话：400-8888-228

网址：www.jyzq.cn

### 3、第三方销售机构

（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）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

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。

## 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

注册地址：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

名称：上海源泰律师事务所

地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：廖海、刘佳

### 四、会计师事务所

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：银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金

简称：银河智慧主题混合

基金类型：混合型基金

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

本基金主要投资于智慧主题相关行业中的优质上市公司，在控制风险、保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资比例为基金资产的 0-95%，其中，投资于本基金定义的智慧主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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、股指期货、国债期货等其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### （三）投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金管理人在大类资产配置过程中，结合定量和定性分析，从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素，综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势，重点分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系，在此基础上，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券的比例，以争取降低单一行业投资的系统性风险冲击。

本基金考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率，居民消费价格指数(CPI)，生

生产者价格指数(PPI)，货币供应量(M0，M1，M2)的增长率等指标。

本基金考虑的政策面因素包括但不限于货币政策、财政政策、产业政策的变化趋势等。

本基金考虑的市场因素包括但不限于市场的资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体 P/E、P/B 等指标相对于长期均值水平的偏离度等。

## 2、股票投资策略

本基金通过对本基金定义的智慧主题领域相关行业及其子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型股票的投资价值。

### （1）智慧主题的界定及涵盖

“智慧”理念，最早起源于 2008 年 IBM 发布的《智慧地球：下一代领导人议程》主题报告所提出的“智慧地球”，泛指把新一代信息技术充分运用在各行各业之中。伴随“智慧”理念的兴起，近年来世界各国在智慧城市、智慧医疗、智慧电网、智慧家居、智慧交通、智慧物流、智慧教育、智慧旅游、智慧农业、智慧工厂（智能制造）、智慧贸易等诸多产业的智慧化进程蓬勃发展。

本基金股票投资将主要投资于“智慧”主题相关行业及上市公司，并伴随其长期成长，获取良好的投资回报。本基金界定的“智慧”主题范畴主要包括：

1) 从事、布局移动互联网、大数据、云计算、物联网、空间地理信息集成等新一代信息技术的相关上市公司；

2) 应用移动互联网、大数据、云计算、物联网、空间地理信息集成等新一代信息技术的行业及上市公司，包括城市体系建设、政务管理、医疗、电力、能源、家居生活、交通、物流、教育、传媒、旅游、环保、制造业、农业、工商业等相关行业及上市公司通过运用新一代信息技术推动自身转型升级；

3) 为上述行业或领域提供服务、支持的相关受益行业及上市公司。

未来随着经济发展和技术进步，本基金将视实际情况调整上述对智慧主题相关股票的识别及认定。

### （2）精选个股策略

本基金采用定性与定量相结合的方式，对本基金定义的智慧主题相关行业及其子行业的上市公司的投资价值进行综合评估，精选具有较高成长性、较高盈利质量、合理估值水平、具有较强竞争优势的上市公司作为投资标的。

1) 定性分析

本基金将通过定性分析，深入分析相关行业、企业的基本面以及国家相关政策、人口结构变化等因素，确定具有比较竞争优势的上市公司。

①研发能力

研发能力的强弱关乎着本基金定义的智慧主题相关公司的长期生命力。本基金将重点投资具有明确的产品开发战略、良好的研发团队、有保障的研发开支和激励机制的上市公司。

②市场能力

本基金将重点考察上市公司是否建立相应的营销体系，公司的销售能力，市场占有率情况等。

③企业的产品线

公司是否有完善的产品线布局，能否推出具有高市场容量的品种并使短、中长期的产品有效衔接。

④公司治理结构

本基金将重点考察公司的法人治理结构，实际控制人的发展战略，关联交易等事项。

⑤公司管理

公司的管理团队是否和谐高效，能够在公司战略、作业与成本、质量与安全、营销等方面具有同业中居前的管理水平。

⑥政府政策

本基金将密切关注政府社会保障政策、行政管制等政策的调整对本基金定义的智慧主题各行业及其子行业的影响。

⑦人口及经济结构变迁

人口以及因经济发展而导致的人均收入水平的提高，都会对我国经济和产业的发展产生深远的影响。本基金将动态的跟踪这些变化，并分析其影响。经济结构调整升级将是本基金在投资中需要的重点考虑的因素。

2) 定量分析

本基金在定量指标方面，重点考察企业的成长性、盈利能力的估值水平，选择具有智慧主题属性的、公司财务健康、成长性好、估值合理的股票作为本基金

备选投资目标。

成长性指标方面，本基金主要考虑（不限于）主营业务收入、净利润增长率、经营性现金流量增长率及方向、主营业务利润增长率及其增长变动的方向和速率等指标，用以上指标对成长性进行研判。

盈利指标方面，本基金主要考虑（不限于）总资产报酬率、净利率、净资产收益率、盈利现金比率（经营现金净流量/净利润）等指标来研判盈利能力和质量。

价值指标方面，本基金采用适当的估值指标和估值模型，对公司股票价值进行评估，具体可采用的方法包括股息贴现模型、自由现金流贴现模型、市盈率法、市净率法、PEG、EV/EBITDA 等。本基金主要考虑 PE、PB、PEG、PS 等指标。

增长潜力方面，本基金在关注公司历史成长性的同时，更加注重其未来盈利的增长潜力。本基金将对上市公司未来一至三年的主营业务收入增长率、净利润增长率等指标进行预测研判。

### 3、债券投资策略

本基金债券投资以久期管理为核心，采取久期配置、利率预期、收益率曲线估值、类属配置、单券选择等投资策略。

本基金在对可转换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换债券定价模型进行估值，并结合市场流动性，投资具有较高预期投资价值的可转换债券。

### 4、股指期货投资策略

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的。基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例；再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约作为交易标的。

### 5、国债期货投资策略

本基金参与国债期货交易以套期保值为目的。在风险可控的前提下，通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资

组合的整体风险。具体而言，本基金的国债期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上，将审慎地获取相应的超额收益，通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加，以及国债期货与债券的多空比例调整，获取组合的稳定收益。

#### 6、权证投资策略

本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算，并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果，选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。采用的策略包括但不限于下列策略或策略组合：

本基金采取现金套利策略，兑现部分标的证券的投资收益，并通过购买该证券认购权证的方式，保留未来股票上涨所带来的获利空间。

根据权证与标的证券的内在价值联系，合理配置权证与标的证券的投资比例，构建权证与标的证券的避险组合，控制投资组合的下跌风险。同时，本基金积极发现可能存在的套利机会，构建权证与标的证券的套利组合，获取较高的投资收益。

#### 7、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

（1）本基金股票投资比例为基金资产的 0-95%，其中，投资于本基金定义的智慧主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）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%；

（5）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）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%；

（13）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；

（14）本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；

（15）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%；

（16）本基金参与股指期货交易和国债期货交易依据下列标准建构组合：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不

含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

（17）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资；

（18）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的采取定期开放方式运作的基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；

（19）本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

（20）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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；

（21）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；

（22）法律法规和中国证监会规定的其他投资比例限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符

合基金合同的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

除上述第（2）、（13）、（20）、（21）项以外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门对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，不需要经基金份额持有人大会审议。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。

## 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）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）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；
- （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述限制，则本基金投资不再受相关限制。

### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{中证800指数收益率} \times 70\% + \text{上证国债指数收益率} \times 30\%$

业绩比较基准选择理由：

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，由中证 500 和沪深 300 成份股

一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数，它的推出使我国证券市场股票、债券、基金三位一体的指数体系基本形成。

根据本基金的投资范围和投资比例约束，设定本基金的基准为中证 800 指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%，能客观反映本基金的风险收益特征。

随着市场环境的变化，或因指数编制及发布等方面的原因，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准无需召开基金持有人大会，但应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前在中国证监会指定的信息披露媒介上刊登公告。

#### **（六）风险收益特征**

本基金为权益类资产主要投资于智慧主题的混合基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。

#### **（七）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法**

- 1、有利于基金资产的安全与增值；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；
- 3、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。

#### **（八）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	265,667,492.19	86.40
	其中：股票	265,667,492.19	86.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,101,300.00	4.26
	其中：债券	13,101,300.00	4.26
	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	28,119,128.20	9.14
8	其他资产	603,075.98	0.20
9	合计	307,490,996.37	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

1) 报告期末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	-	-

银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新摘要）

C	制造业	23,370,409.30	8.08
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	7,042,371.36	2.43
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	80,132,687.41	27.69
J	金融业	111,206,269.36	38.43
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,677.76	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,909,077.00	15.17
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	265,667,492.19	91.81

2) 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。

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（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新摘要）

1	600763	通策医疗	373,394	26,324,277.00	9.10
2	002410	广联达	859,987	25,636,212.47	8.86
3	601336	新华保险	378,900	20,343,141.00	7.03
4	600570	恒生电子	227,000	19,876,120.00	6.87
5	300015	爱尔眼科	517,200	17,584,800.00	6.08
6	600837	海通证券	1,239,900	17,395,797.00	6.01
7	600030	中信证券	688,500	17,061,030.00	5.90
8	300253	卫宁健康	1,121,600	16,375,360.00	5.66
9	000001	平安银行	1,200,300	15,387,846.00	5.32
10	601688	华泰证券	591,196	13,248,702.36	4.58

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	13,001,300.00	4.49
	其中：政策性金融债	13,001,300.00	4.49
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）	100,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,101,300.00	4.53

**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	018005	国开1701	130,000	13,001,300.00	4.49
2	113531	百姓转债	1,000	100,000.00	0.03

**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。

**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。

**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。

**9. 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**

注：本基金报告期内未持有股指期货合约。

**2) 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金未对股指期货进行投资。

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 1) 本期国债期货投资政策

注：本基金未投资国债期货。

### 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。

### 3) 本期国债期货投资评价

注：本基金未投资国债期货。

## 11. 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受到调查以及处罚的情况的说明

新华保险：2018年10月，因存在欺骗投保人、编制虚假材料和未按照规定使用经批准或者备案的保险费率等行为，新华人寿被银保监会罚款110万元。

恒生电子 600570：

2018年7月8日

关于恒生电子股份有限公司（以下简称“恒生电子”或“公司”）高级副总裁廖章勇、副总裁沈志伟接受公安机关刑事传唤事项（见公司公告 2018-025 号），1、公司法务部门从相关公安机关口头获悉，廖章勇和沈志伟自接受公安机关刑事传唤于 2018 年 7 月 7 日稍晚时候已满 24 小时，目前二人已处于解除刑事传唤阶段。2、上述刑事传唤事项源于公司前期在内部审查过程中发现公司高管廖章勇、沈志伟涉嫌在外部以各种形式组织成立企业开展与恒生电子有竞争性的业务，公司内部调查发现二人涉嫌利用职务之便，盗取公司相关商业秘密，背信损害上市公司利益，公司基于此向相关公安机关进行了报案。上述事项目前仍处于公安机关的法律程序之中。

2018年7月21日

恒生电子股份有限公司关于控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司所

涉行政处罚事宜的进展公告，， 恒生网络被西城法院纳入了失信被执行人名单，同时，恒生网络及其法定代表人宗梅苓被下达了限制消费令。恒生网络系依法注册的有限责任公司，注册资金人民币 2 亿元。截至 2018 年 7 月 20 日，恒生网络已缴付《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（ [2016]123 号）所涉罚没款人民币 23,121,028.61 元， 尚未缴付人民币 416,346,462.07 元，货币资金余额为人民币 0 元（未经审计） ，截至 2017 年末净资产金额约为人民币-4.21 亿元。目前，恒生网络已无法正常持续运营，处于净资产不足以偿付《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（ [2016]123 号）所涉罚没款的状态。 目前，恒生网络部分银行账户已被冻结。

报告期内本基金投资的前十名证券的其余八只证券发行主体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。

## 2) 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

## 3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	110,166.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	489,754.13
5	应收申购款	3,155.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	603,075.98

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。

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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代表其未来表现。投资有风险，投资人申购基金时应认证阅读本招募说明书。有关业绩数据经托管人复核。（截止 2019 年 03 月 31 日）

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2017.12.01-2017.12.31	0.21%	0.01%	0.30%	0.54%	-0.09%	-0.53%
2018.01.01-2018.12.31	-22.40%	1.31%	-18.36%	0.94%	-4.04%	0.37%
2019.01.01-2019.03.31	29.55%	1.95%	20.61%	1.08%	8.94%	0.87%
自基金合同生效日起至今	0.74%	1.42%	-1.24%	0.95%	1.98%	0.46%

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。

## 第七节 基金的费用

### （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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼或仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户

路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、上述“（一）基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法律法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

## 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