银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金之银河优先与银河进取基金份额上市交易公告书

基金管理人：银河基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2013年6月6日
公告日期：2013年6月3日

一、重要声明与提示

《银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金之银河优先与银河进取基金份额上市交易公告书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书（以下简称“本公告书”）所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅本基金管理人2013年2月20日登载于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》以及和银河基金管理有限公司网站(www.galaxyasset.com)的《银河沪深300成长增强指数分级基金基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、本基金的基金份额包括银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金份额（简称：“银河沪深300成长分级”，场内简称：“银河增强”，基金代码：161507，以下称“本基金”）、银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金之成长优先份额（场内简称：“银河优先”，交易代码：150121）和银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金之成长进取份额（场内简称：“银河进取”，交易代码：150122）。

银河沪深300成长分级份额可按照1:1的比例分拆为银河优先份额和银河进取份额，银河优先份额和银河进取份额也可以按照上述比例合并为银河沪深300成长分级份额。银河优先份额和银河进取份额的数量保持1:1的比例不变。

5、基金存续期限：不定期

6、根据银河优先份额和银河进取份额的基金份额比例，银河优先份额在场内基金初始总份额中的份额占比为50%，银河进取份额在场内基金初始总份额中的份额占比为50%。且两类基金份额的基金资产合并运作。

7、本基金通过场外、场内两种方式公开发售银河沪深300成长分级份额。投资者场内认购所得的份额，将按1：1的基金份额配比自动分离为银河优先份额和银河进取份额。投资者场内认购所得的银河沪深300成长分级份额的自动分离，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。投资者在场外认购的银河沪深300成长份额不进行分拆，其通过跨系统转托管至场内后，可选择将其持有的银河沪深300成长分级份额按1:1的比例分拆为银河优先份额和银河进取份额

8、《基金合同》生效后，场内的银河优先份额（场内简称：“银河优先”，交易代码：150121）和银河进取份额（场内简称：“银河进取”，交易代码：150122）将按照有关规定，以不同的交易代码同时申请在深圳证券交易所上市交易，但不接受投资者的申购赎回。银河沪深300成长分级份额（基金代码：161507）设置单独的基金代码，投资者可以通过场外或场内方式申购赎回银河沪深300成长分级份额但不上市交易。

9、银河沪深300成长分级份额的申购与赎回

投资者可以通过场外或场内方式申购赎回银河沪深300成长分级份额。银河优先份额和银河进取份额不接受投资者的申购赎回。

银河沪深300成长份额的场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点，银河沪深300成长份额的场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。

10、份额配对转换

份额配对转换是指根据《基金合同》约定，银河沪深300成长分级份额与银河优先份额和银河进取份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。分拆指根据《基金合同》约定，基金份额持有人将其持有的每2份银河沪深300成长分级份额按照1：1的份额配比转换成1份银河优先份额与1份银河进取份额的行为。合并指根据《基金合同》约定，基金份额持有人将其持有的每1份银河优先份额与1份银河进取份额按照1：1的基金份额配比转换成2份银河沪深300成长分级份额的场内份额的行为。场外的银河沪深300成长分级份额不进行份额配对转换。在场外的银河沪深300成长分级份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

11、基金份额折算

在银河沪深300成长分级份额、银河优先份额存续期内的每个会计年度（除《基金合同》生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照《基金合同》的相关规则进行基金的定期份额折算。除定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额的不定期折算，即：当银河沪深300成长分级份额的基金份额净值达到2.000元；当银河进取份额的基金份额净值达到0.250元。有关基金份额折算的约定，参见《基金合同》第二十一部分。定期折算基准日或不定期折算的基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

12、基金份额总额

截至2013年5月30日，本基金总份额414,991,791.49份，其中，银河沪深300成长分级份额为220,701,691.49份；银河优先份额为97,145,050 份；银河进取份额为97,145,050 份。

13、基金份额参考净值

截至2013年5月30日，银河沪深300成长分级的基金份额净值为1.015元，银河优先的基金份额净值为1.011元；银河进取的基金份额净值为1.019元。

14、本次上市交易的基金份额简称及交易代码

份额简称：银河优先，交易代码：150121

份额简称：银河进取，交易代码：150122

15、本次上市交易的基金份额（截至2013年5月30日）

银河优先：97,145,050 份

银河进取：97,145,050 份

16、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

17、上市交易日期：2013年6月6日

18、基金管理人：银河基金管理有限公司

19、基金托管人：兴业银行股份有限公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况

1、 本基金发售申请的核准文件：中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1594号

2、 发售日期：2013年2月25日至2013年3月22日

3、 发售面值：1.00元人民币

4、 发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售

5、 发售机构：

（1）场内发售机构

场内代销机构：具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

场外发售机构

1）直销机构：银河基金管理有限公司

2）代销机构：兴业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、国信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中航证券有限公司、德邦证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、江海证券有限公司、天相投资顾问有限公司、信达证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、平安证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司。

6、验资机构名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

7、认购资金总额及入账情况：

本基金首次发行募集基金共计为人民币414,991,791.49元，其中人民币414,979,443.85元（包括净认购资金本金人民币414,854,390.55元、基金场外有效认购款在募集期间产生的利息人民币111,300.94元和基金场内有效认购款在募集期间内产生的利息中已结算部分人民币13,752.36元）已于2013年3月28日划至在兴业银行股份有限公司开立的基金托管专户。

8、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《银河沪深300成长增强指数分级基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2013年3月29日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

9、基金合同生效日期：2013年3月29日

10、本基金合同生效日的总份额：414,991,791.49份。

(二)本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上〔2013〕182号

2、上市交易日期：2013年6月6日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、基金简称：银河优先、银河进取

5、交易代码：银河优先为150121、银河进取为150122

6、本次上市交易份额：银河优先为97,145,050 份 、银河进取为97,145,050 份（截至2013年5月30日）

7、基金资产净值及份额参考净值的披露

在开始办理银河沪深300成长分级申购或者赎回后或者银河优先份额和银河进取份额上市以后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒体，披露开放日的银河沪深300成长分级份额、银河优先份额、银河进取份额各自的份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和银河沪深300成长分级份额、银河优先份额、银河进取份额各自的份额净值。基金管理人应当在前款规定的最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、银河沪深300成长分级份额、银河优先份额、银河进取份额各自的份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

8、本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限公司提出申请，开通办理银河增强份额（代码：161507）的跨系统转托管业务。场外认购银河增强的基金份额持有人自2013年6月6日起可通过认购本基金的场外代销机构或本基金管理人直销机构申请办理本基金跨系统转托管业务，将基金份额转换至场内（证券登记结算系统）。跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。投资者可以拨打本基金管理人客户服务电话400-820-0860 或登录网站(www.galaxyasset.com)咨询相关信息。

9、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后，选择将银河沪深300成长分级份额拆分为银河优先和银河进取后，方可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

截至2013年5月30日基金份额持有情况：

银河沪深300成长分级基金份额持有人户数：3,333户，平均每户持有的基金份额：124,509.99份。银河优先份额持有人户数：826户，平均每户持有的场内基金份额：117,609.02份；银河进取份额持有人户数：826户，平均每户持有的场内基金份额：117,609.02份。

机构投资者持有的本次上市交易的银河优先与银河进取的基金份额分别为2,523,341份和2,523,342份，分别占本次银河优先与银河进取上市交易基金份额比例为2.5975%和2.5975%；个人投资者持有的本次上市交易的银河优先与银河进取的基金份额分别为94,621,709份和94,621,708份，分别占本次银河优先与银河进取上市交易基金份额比例为97.4025%和97.4025%。

本公司基金从业人员持有基金份额的总量为596,475.47份，占该只基金总份额的比例为0.14%；本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份（含）；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

截至2013年5月30日，本次上市交易的银河优先与银河进取的前十名持有人情况：

序号	银河优先持有人名称（仓称）	银河优先持有银河优先份额	占银河优先份额比例（%）	银河进取持有人名称（仓称）	持有银河进取额份额	占银河进取份额比例（%）
1	韩珊陡	5,000,437	5.15%	韩珊陡	5,000,437	5.15%
2	张月娥	2,500,413	2.57%	张月娥	2,500,413	2.57%
3	邓公新	2,500,364	2.57%	邓公新	2,500,365	2.57%
4	田应秀	2,500,364	2.57%	田应秀	2,500,365	2.57%
5	杨水生	2,500,316	2.57%	杨水生	2,500,315	2.57%
6	段波	1,750,153	1.80%	段波	1,750,153	1.80%
7	袁野	1,605,202	1.65%	袁野	1,605,203	1.65%
8	施安绵	1,150,101	1.18%	施安绵	1,150,100	1.18%
9	许芳	1,002,165	1.03%	许芳	1,002,166	1.03%
10	江苏恒生工贸实业有限公司	1,000,214	1.03%	杨中洲	1,000,214	1.03%
合计	–	97,145,050	22.12%	–	97,145,050	22.12%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人概况

1、基本情况

名称：银河基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦15楼

设立日期：2002年6月14日

法定代表人：徐旭

总经理：尤象都

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦15楼

联系人：罗琼

电话：（021）38568888

注册资本：1.5亿元人民币

公司设立批文号：证监基金字[2002]21号

工商登记注册的法人营业执照文号：100000000036786

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

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	7,500	50%
中国石油天然气集团公司	1,875	12.5%
上海市城市建设投资开发总公司	1,875	12.5%
首都机场集团公司	1,875	12.5%
湖南电广传媒股份有限公司	1,875	12.5%
合 计	15,000	100%

2、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

董事长徐旭女士，中共党员，经济学博士。历任中国人保信托投资公司总裁助理、研究中心副主任，中国银河证券有限责任公司企划部(党委宣传部)负责人、总经理、研究中心主任、总裁办主任兼党委办公室主任、机关党委委员。现任中国银河金融控股有限责任公司党委委员、董事会执行委员会委员。

董事刘澎湃先生，中共党员，大学本科学历。历任中国人民银行总行副司长，珠海市人民政府副市长，中国保险监督管理委员会办公室主要负责人，中国银河证券有限责任公司副总裁，中国银河金融控股有限责任公司党委副书记、董事会执行委员会委员。

董事张国臣先生，中共党员，工商管理硕士。历任中石油大连石化公司财务处副处长，中石油炼油与销售分公司高级会计师，中石油股份有限公司资本运营部股权管理处副处长。现任中国石油天然气集团公司资本运营部专职监事。

董事王志强先生，中共党员，工商管理硕士。历任上海机电（集团）公司科长、处长、总会计师，上海久事公司计财部副总，上海市城市建设投资开发总公司计财部副总经理、副总会计师等职，现任上海市城市建设投资开发总公司副总经理。

董事熊人杰先生，大学本科学历。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有限公司副总裁。

董事唐光明先生，中共党员，硕士研究生学历。历任中国船舶工业总公司综合计划司投资一处科员，金飞民航经济发展中心项目经理，首都机场集团公司业务经理。现任首都机场集团公司资本运营部副总经理。

董事尤象都先生，中共党员，硕士研究生学历。历任国家经济体制改革委员会宏观司财税处、投资处副处长，中信实业银行北京分行（后为总行营业部）办公室副主任（主持工作）、信贷部副总经理兼综合处处长、资产保全部副总经理、 支行管理处副处长（主持工作）、西单支行负责人，财政部综合司综合处副处长、处长，兴业银行北京分行月坛支行行长，中国银河金融控股有限责任公司投资部负责人，银河基金管理有限公司副总经理。现任银河基金管理有限公司总经理。

独立董事孙树义先生，中共党员，大学本科学历。历任电子工业部处长，国家体改委副司长、司长，中央财经领导小组办公室副主任，国家人事部副部长、党组成员，中央企业工委副书记等职。

独立董事王福山先生，大学本科学历，高级工程师。历任北京大学教师，国家地震局副司长，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。

独立董事沈祥荣先生，中共党员，硕士，工程师。历任国家计委、经委、国务院办公厅副处长、处长、副局长，中国华诚集团董事长，第十届上海市政协委员。现任上海黄金交易所党委书记、理事长。

独立董事樊纲先生，经济学博士，教授。长期在中国社会科学院经济研究所从事宏观经济研究工作。现任中国经济体制改革委员会副会长，兼任北京国民经济研究所所长、中国（深圳）综合开发研究院院长等职。

监事长刘昱先生，先后任职于湖南省木材公司、湖南省广播电视厅、湖南省广电总公司及湖南省汇林投资有限公司。现任深圳市达晨创业投资有限公司董事长。

监事吕红玲女士，硕士研究生学历。先后任职中国华融信托投资公司证券总部，中国银河证券有限责任公司财务资金总部会计核算部副经理、经理，中国银河金融控股有限责任公司财务组负责人。现任中国银河金融控股有限责任公司财务部负责人。

监事俞川女士，中共党员，法学硕士。先后任职于华泰证券股份有限公司、银河基金管理有限公司。现为银河基金管理有限公司员工。

总经理尤象都先生，中共党员，硕士研究生学历。历任国家经济体制改革委员会宏观司财税处、投资处副处长，中信实业银行北京分行（后为总行营业部）办公室副主任（主持工作）、信贷部副总经理兼综合处处长、资产保全部副总经理、支行管理处副处长（主持工作）、西单支行负责人，财政部综合司综合处副处长、处长，兴业银行北京分行月坛支行行长，中国银河金融控股有限责任公司投资部负责人，银河基金管理有限公司副总经理等职。

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、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、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（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），中国银河金融控股有限责任公司战略发展部执行总经理。

督察长李立生先生，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、产品规划部总监等职。

2）基金经理

罗博先生，博士研究生学历，7年证券行业从业经历。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月起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。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。

王培先生，硕士研究生学历，6年证券从业经历。曾就职于国泰君安证券股份有限公司研究所，从事石化化工行业的研究分析工作。2009年7月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2011年6月起担任银河创新成长股票型证券投资基金的基金经理，2013年5月起兼任银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金的基金经理。

3）投资决策委员会成员

总经理尤象都先生、副总经理陈勇先生，总经理助理兼固定收益部总监索峰先生、股票投资部总监钱睿南先生、研究部总监刘凤华女士。

上述人员之间均无近亲属关系。

3、内部组织结构及职能

股票投资部：负责公司公募基金的投资管理工作；

固定收益部：负责固定收益类产品的研究与投资管理工作；

研究部：负责宏观、策略、行业和公司研究；

中央交易室：负责投资交易和风险控制；

专户投资部：负责特定客户资产管理业务；

监察部：负责监察、风控、法务和信息披露；

市场部：负责营销策划、基金销售、电子商务和客户服务等工作；

产品规划部：负责产品开发、研发合适的基金品种；

支持保障部：负责基金运营和信息技术等工作；

人力资源部：负责人力资源规划与管理；

财务部：负责公司财务计划与管理；

办公室：负责文秘、行政后勤等；

哈尔滨分公司、北京分公司、南京分公司、销售服务部、广州分公司、深圳分公司：负责所在辖区的业务拓展工作。

4、人员情况：

截至2012年12月31日，公司共有员工122人，其中76人具有硕士及以上学历，占员工总数的62%，拥有本科及以上学历的员工共110人，占员工总数的90%。

(二)基金托管人概况

1、基本情况

基金托管人名称：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

办公地址：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

注册资本：107.86亿元人民币

专门基金托管部门的负责人：吴若曼

信息披露负责人：张志永

电话：（021）62677777-212004

传真：(021）62535823

基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号

2、基金托管人人员情况

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、养老金管理中心等处室，共有员工80余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

3、基金托管业务经营情况

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。基金托管业务批准文号：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。

4、基金托管业务经营情况

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。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截止2011年12月31日，兴业银行已托管开放式基金14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、民生加银内需增长股票型证券投资基金、中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全保本混合型证券投资基金，托管基金财产规模289.19亿元。

（三）基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：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

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼。

法定代表人：葛明

经办会计师：徐艳、蒋燕华

电话：（021）22288888

传真：（021）22280000

联系人：蒋燕华

六、基金合同摘要

基金合同内容摘要详见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金2013年5月30日资产负债表如下：

资　产	2013年5月30日
资 产：	
银行存款	52,150,528.26
结算备付金	5,716,520.82
存出保证金	46,505.30
交易性金融资产	63,232,754.95
其中：股票投资	63,232,754.95
债券投资	
资产支持证券投资	
基金投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	300,000,000.00
应收证券清算款	
应收利息	626,605.63
应收股利	5,354.78
应收申购款	
其他资产	12,826.78
资产合计：	421,791,096.52
负债和所有者权益	
负债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	
应付赎回款	
应付管理人报酬	343,784.55
应付托管费	68,756.87
应付销售服务费	
应付交易费用	109,993.72
应付税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	86,107.97
负债合计	608,643.11
所有者权益：	
实收基金	414,991,791.49
未分配利润	6,190,661.92
所有者权益合计	421,182,453.41
负债与持有人权益总计：	421,791,096.52

八、基金投资组合

截至2013年5月30日，银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金的投资组合如下：

（一）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	63,232,754.95	14.99
	其中：股票	63,232,754.95	14.99
2	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	300,000,000.00	71.13
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	57,867,049.08	13.72
6	其他资产	691,292.49	0.16
7	合计	421,791,096.52	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合。

指数投资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	0.00	0.00
B	采矿业	421,547.22	0.10
C	制造业	32,304,683.13	7.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	432,291.07	0.10
E	建筑业	2,722,827.46	0.65
F	批发和零售业	827,697.48	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	293,056.38	0.07
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
J	金融业	14,222,114.75	3.38
K	房地产业	3,389,450.30	0.80
L	租赁和商务服务业	832,357.70	0.20
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,359,531.10	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	2,295,673.79	0.55
	合计	59,101,230.38	14.03

积极投资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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	1,081,300.00	0.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	826,000.00	0.20
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	265,057.50	0.06
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,959,167.07	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	4,131,524.57	0.98

（三）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细。

指数投资按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600519	贵州茅台	23,444	4,694,661.00	1.11
2	600016	民生银行	399,377	4,197,452.27	1.00
3	601328	交通银行	791,648	3,752,411.52	0.89
4	000651	格力电器	120,424	3,236,997.12	0.77
5	600887	伊利股份	87,179	2,493,319.40	0.59
6	600048	保利地产	185,087	2,374,666.21	0.56
7	600036	招商银行	162,622	2,208,406.76	0.52
8	600256	广汇能源	105,909	2,163,720.87	0.51
9	600000	浦发银行	203,170	2,141,411.80	0.51
10	601818	光大银行	610,296	1,922,432.40	0.46

积极投资按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	000826	桑德环境	29,925	1,114,706.25	0.26
2	300070	碧水源	21,974	844,460.82	0.20
3	600886	国投电力	200,000	826,000.00	0.20
4	002048	宁波华翔	70,000	686,700.00	0.16
5	002255	海陆重工	20,000	394,600.00	0.09
6	300047	天源迪科	29,950	265,057.50	0.06
7	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–

（四）按券种分类的债券投资组合。

截至2013年5月30日，本基金未持有债券。

（五）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细。

截至2013年5月30日，本基金未持有债券。

（六）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

截至2013年5月30日，本基金未持有资产支持证券。

（七）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

截至2013年5月30日，本基金未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	46,505.30
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	5,354.78
4	应收利息	626,605.63
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	12,826.78
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	691,292.49

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2013年5月30日，本基金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

截至2013年5月30日，本基金持有前十名股票中未存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

本基金发售后至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

根据《基金法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，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、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，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确认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。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、备查文件目录

备查文件包括：

（一）中国证监会核准银河沪深300成长增强指数分级基金募集的文件

（二）《银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金基金合同》

（三）《银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金托管协议》

（四）《银河基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

（七）基金托管人业务资格批件和营业执照

（八）中国证监会要求的其他文件

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所和营业场所，投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。投资人可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

附件 基金合同摘要内容

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

投资者自依《基金合同》、《招募说明书》取得基金份额即成为基金份额持有人和《基金合同》当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即