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。

本招募说明书所载内容截止日为2013年12月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年12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。

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：上海市世纪大道1568号中建大厦15楼

办公地址：上海市世纪大道1568号中建大厦15楼

法定代表人：尤象都（代行）

成立日期：2002年6月14日

注册资本：1.5亿元人民币

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	7500	50%
中国石油天然气集团公司	1875	12.5%
上海市城市建设投资开发总公司	1875	12.5%
首都机场集团公司	1875	12.5%
湖南电广传媒股份有限公司	1875	12.5%
合 计	15000	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

总经理尤象都先生（代为履行董事长职务）、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（住持工作）、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（住持工作）、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。

原董事长徐旭女士因组织安排调职，经公司第三届董事会审议通过，由总经理尤象都先生代为履行董事长职务。

董事刘新海先生、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。历任中石油大庆石化公司财务处副处长、中石油唐山炼油厂财务分公司高级会计师、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，金飞鹏航空发展中心项目经理，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（住持工作）、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（住持工作）、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。

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。

独立董事冯祥荣先生、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湘江林投资有限公司。现任深圳市达晨创业投资有限公司董事长。

监事闫红玲女士、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。

监事吴磊先生、中共党员、博士研究生学历。先后任职于中融基金管理有限公司、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（住持工作）、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（住持工作）、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热介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、本基金基金经理

罗博先生，博士研究生学历，9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，2013年3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、总经理助理兼股票投资部总监钱音南先生、研究部总监刘凤华女士。

上述人员之间均无近亲属关系。

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：王洪章

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

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行《资料证明》939号于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2013年6月30日，中国建设银行资产总额148,592.14亿元，较上年末增长6.34%。2013年上半年，中国建设银行实现净利润1,199.64亿元，较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%，年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元，较上年同期增长10.59%，净利差为2.54%，较上年同期提高0.01个百分点，净利息收益率为2.71%，与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元，较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有1,4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有10家一级海外分行，拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等3家全资子公司，海外机构已覆盖到全球14个国家和地区，基本实现应企业核心客户金融中心的网络布局。24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家，拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年“世界银行1000强排名”中位列第5，较上年上升1位；在美国《财富》世界500强排名第50位，较上年上升27位；在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2，较上年提升11位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、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、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队，上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工225人。自2007年起，托管职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

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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

张军在，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资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，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。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2013年6月30日，中国建设银行已托管311只证券投资基金。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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《金融时报》评为“中国最佳托管银行”，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网2011年度和2012年度“最佳资产托管银行”奖、和凤凰财经媒体《每日经济观察》2012年度“最佳基金托管银行”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。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

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

（二）监督流程

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

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

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

4.通过技术或半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：上海市浦东新区世纪大道1568号15层

法定代表人：尤象都（代行）

公司网站：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：郑天祥、张鸿

②银河基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区西直门外大街1号西环广场T3座15楼B5（邮编：100044）

电话：010 58301616

传真：010 58301156

联系人：孙研

③银河基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市越秀区天河路1号锦扬联合商务大厦25楼2515室（邮编：510075）

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：哈尔滨市南岗区花园街310号苏宁电器5层银河基金（邮编：150001）

电话：0451 53928808

传真：0451 53905578

联系人：崔勇

⑤银河基金管理有限公司南京分公司

地址：南京市太平南路1号新世纪广场B座805室（邮编：210002）

电话：025 84671299

传真：025 84523725

联系人：李晓玲

⑥银河基金管理有限公司深圳分公司

地址：深圳市福田区景田西路17号赛格景苑2楼（邮编：518048）

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：王洪章

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：田国立

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：姜建清

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：蒋超良

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：牛锦刚

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：傅育宁

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：董文标

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8号富华大厦C座

法定代表人：常振明

客服服务电话：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：唐双宁

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：吴建

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：闫冰竹

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

⑫宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市鄞县东路700号

法定代表人：陆智强

客户服务电话：95561，或按打当地咨询电话

网址：www.nbcb.com.cn

⑬东莞农村商业银行股份有限公司

住所：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

办公地址：东莞市东城区鸿福东路2号东莞农商银行大厦

客户服务电话：961122

网址：www.dnrcbank.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：陈有安

电话：010 66568430

传真：010 66568990

联系人：田薇

客户服务电话：400-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

⑯海通证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：杨文军

电话：021 68761616

传真：021 68767981

联系人：罗芳

客户服务电话：400-888-8128

网址：www.htbom.com.cn

⑰长龄证券有限责任公司

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岷县路638号

法定代表人：李晓安

电话：0931 8490100、0931 4890619

传真：0931 8490628

联系人：李昕田、杨晓天

客户服务电话：96668、4006898888

网址：www.hlzqgs.com

⑱长江证券有限公司

住所：武汉市江岸区江汉路85号长江证券大厦

法定代表人：尤小平

电话：027 65799999

传真：027 85481900

联系人：李良

客户服务电话：4008-888-108

网址：www.cjsc.com

⑲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：广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

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

网址：www.gf.com.cn

⑳华安证券有限责任公司

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：汪燕

客户服务电话：96518（安徽）、4008096518（全国）

网址：www.huaxi.com

㉑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

客户服务热线：95570

网址：www.glsc.com.cn

㉒长江证券股份有限公司

住所：武汉市江汉区淮海路70号

办公地址：武汉市江汉区淮海路70号长江证券大厦

法定代表人：尤伟

电话：027 65799999

传真：027 85481900

联系人：李良

客户服务电话：4008-888-108

网址：www.cjsc.com.cn

㉓平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦22-25层

办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国风险投资大厦

法定代表人：谢黎

电话：0755 82832550

传真：0755 82558355

联系人：朱静

客户服务电话：4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

㉔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

㉕国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

电话：0551 2207921

传真：0551 2207965

联系人：李燕

客户服务电话：400-888-8777、95578

网址：www.gyzq.com

㉖东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路59号投资广场18-19楼

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：朱科敏

电话：021 20333333

传真：021 50498851

联系人：王一彤?

客户服务电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

㉗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：胡运钊

电话：027 65799999

传真：027 85481900

联系人：李良

客户服务电话：4008-888-999或95579

网址：www.95579.com

㉘东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：王益民

电话：021 63325888

传真：021 63326173

联系人：吴宇

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

㉙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

㉚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：高冠江

电话：010 63081000

传真：010 63080978

联系人：唐静

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

㉛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：0591 87841160

传真：0591 87841150

联系人：张宗端

客户服务电话：0591 96326

网址：www.hfzq.com.cn

㉜中国国际金融有限公司

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：010 65051166

网址：www.cicc.com.cn

㉝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

㉞财通证券有限责任公司

住所：杭州市解放路111号金钱大厦

法定代表人：沈继宁

电话：0571 87925129

传真：0571 87828042

联系人：徐轶清

客户服务电话：0571 96336（上海地区 962336）

网址：www.ctsec.com

㉟万正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法人代表：雷杰

电话：010 85398059

传真：010 85398058

联系人：刘丹

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

㊱开泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025 83290979、0755 82569143

传真：025 84579763、0755 82492962

联系人：孔晓君

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

㊲民生证券股份有限责任公司

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：赵阳

客户服务电话：400-619-8888

网址：www.mszq.com

㊳中山证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路6009号新世界中山29层

法人代表人：吴永良

电话：0755 82943755

传真：0755 82940511

联系人：刘军

客户服务电话：400-102-2011

网址：www.zsxq.com.cn

㊴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

㊵招商证券股份有限公司

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

㊶中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（0507-1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532 85022326

传真：0532 85022605

客户服务电话：0532-96577

网址：www.cwtf.com.cn

㊷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

㊸中信证券（浙江）有限责任公司

住所：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

电话：0571-87112510

传真：0571-85783771

联系人：丁思聪

客户服务电话：95558

网址：www.cs.ecitic.com

㊹东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

客户服务电话：4006-000-686

网址：www.nesc.cn

3、第三方独立销售机构

①上海天天基金销售有限公司

注册地址：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

注册地址：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杭州数米基金销售有限公司

注册地址：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

注册地址：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.jimmw.com

⑤上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：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

注册地址：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：400-920-0022021-20835588

网址：licaike.hexun.com

⑦深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：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：jrj.com.cn

⑧诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：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

⑨天天基金销售有限公司

注册地址：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

网址：www.pyfund.cn

⑩北京万银财富投资有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内

法定代表人：李技奶

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

注册地址：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，并及时公告。

3、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。

本基金管理人可根据市场情况增加、减少或变更代销机构。

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 58598839

传真：010 58598907

联系人：朱立元

三、律师事务所

名称：北京市天银律师事务所

地址：北京市海淀区高梁桥斜街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：王自乐、朱振武

四、会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

法定代表人：葛明

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

经办会计师：徐艳、燕燕华

电话：021 22288888

传真：021 22280000

联系人：蒋燕华

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

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%。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和股票投资组合，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《投资投资策略》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。本基金跟踪的拟合与复制，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流动性、交易成本、冲击成本等因素，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