(上接B46版)

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。

A、基金投资组合的调整

① 定期调整

本基金将根据所跟踪的沪深300 成长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

1) 与指数相关的调整

当沪深300 成长指数成份股因增发、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 成长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。

2) 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。

3)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。

4)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。

5)特殊情况的调整。对成分股中有按照法律法规规定不能进行买卖、或有充分理由判定缺乏流动性、或因重大事件导致停牌、或财务风险较大、或面临重大的不利的司法诉讼、或有充分理由判定其市场价格被操纵等情况的股票，本基金将根据数学优化模型构造模拟组合来进行替代。

6)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。

B、股票替代原则

在股票调整需要进行替代时，本基金进行替换遵循的原则如下：从标的指数成份股及其备选成份股当中选择用以替换的股票；使用同一行业的股票进行替换；用以替换的股票具有较好的流动性；替换后，该成份股所在行业在基金股票资产组合中的权重与标的指数中该行业权重基本一致；用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考察期内收益率风险收益特征高度相关，能较好地代表被替代股票的收益率波动情况。

② 股票增强策略

本基金的增强型策略主要包括：A、成份股多因子量化α增强策略；B、非成份股优选增强策略。本基金的股票增强策略的核心是成份股多因子量化α增强策略。

1)成份股多因子量化α增强策略

成份股增强策略的量化选股模型包括但不限于以下指标：

1.1成长因子

成长性体现在企业的经营业绩的增长和股价的上升，业绩的增长是股价上涨的动力。因此寻找业绩增长的股票，是获得投资收益的有效途径。企业经营业绩成长性体现在收益和收入的提高，收益用以下两个指标来表示：

①最近一个季度归属于上市公司股东的净利润（扣除非经常性损益）同比增长率；②最近一个会计年度归属于上市公司股东的净利润（扣除非经常性损益）同比增长率；

公司通过降低成本或者减少在广告、研发以及其他方面的支出，可以使其收益膨胀数个季度，但是，要想有持续的收益增长，必须依靠高销售收入来支撑。收入的增长可以采用以下两个指标：①最近一个季度营业收入同比增长率；②最近一个会计年度营业收入同比增长率。

1.2营运能力因子

一个长期成长的公司，必须具有内生的增长力，企业不是仅依靠外来不断的资本投入来保持高增长，内生的现金产出就可以绝大部分满足企业成长的需要，所以要考察每股企业自由现金流量，同时企业的净资产收益率和投入资本回报率要保持在合理的水平。使用的指标有：①最近一个会计年度净资产收益率；②投入资本回报率；③每股现金流量。

1.3估值因子

①PE：指标，设定PE的最高域值；②PEG：考虑到企业估值情况，我们引入预测的PEG指标；③企业价值倍数：EV/EBITDA，又称企业价值倍数，是一种被广泛使用的公司估值指标；④PSR：指定日市销率，总市值/主营业务收入，市销率越低，说明该公司股票目前的投资价值越大；⑤PCF：指定日市现率，市值和经营性现金流的比值。

1.4技术因子

考虑股票的短期市场表现，引入技术指标，可以采用以下指标，在熊市、牛市、震荡市等不同的市场走势下，对技术因子使用的侧重点，做适当的调整。相对强弱指标、换手率、MACD指标等。

2)非成份股优选增强策略

本基金采用定性和定量相结合的方法，在非目标指数成份股中，优选景气行业或预期景气行业的中的优势企业进行投资。

在行业选择方面，本基金重点考察行业所处生命周期阶段、国家产业政策、行业竞争格局以及行业的整体估值水平，预期的营业利润增长情况等指标，对各行业做出评级，根据行业评级结果，进行行业配置。

对纳入配置的行业内的企业，本基金采用多因素的评估框架，从企业成长性、竞争优势、盈利能力、基本素质等方面分行业对纳入待选范围的股票进行综合排序，将行业内排序居前的股票列入投资备选对象。

在严格控制非成份股风险暴露度和组合跟踪误差的前提下，本基金通过适度投资于优选行业中的优势上市公司股票，获取一定的超额收益，增强整体投资组合的收益表现。

（二 ）跟踪误差的控制

1 .跟踪误差的控制目标

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%。本基金将定期分析基金跟踪误差变化情况及其原因，并给出优化跟踪误差的基金管理方案。

2 .跟踪误差的计算

在实际投资中，实行对跟踪误差的密切监控和预警。每个期末计算控制指标，设定预警阈值，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。每周、月、季度、半年、年、或根据需要来进行计算和调整。主要指标包括平均跟踪误差、跟踪偏离度、期间跟踪偏离度和拟合偏离度等。我们将计算基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差，现阶段基金的业绩比较基准是沪深300成长指数收益率*95% + 活期存款利率（税后）*5%。

3 .跟踪误差的模型控制

在基金运作过程中，对指数基金或指数化投资组合的跟踪误差进行分析、计算和控制（包括程度控制和概率控制），基本思路如下：

① 确定跟踪误差的控制值；

② 计算跟踪误差的实际值；

③ 将实际值与控制值进行比较，若符合条件，则维持组合；若不符合条件，则对资产组合进行调整。

4 .跟踪误差的其他控制手段

从量化选股策略上予以控制。量化选股选出的增强组合，其个股在增强组合中的权重，遵循个股在指数中的权重构造方法，按照分级靠档的流通市值权重来构建，这样就保证了跟踪误差不会出现大的偏离。

从业绩考核的角度予以引导。在增强型指数基金的考核办法中，我们要综合考虑跟踪误差和净值排名两类指标，从制度上引导基金经理既关注业绩排名，又重视基金的跟踪误差。

（三 ）债券投资策略

基于基金流动性管理和有效利用基金财产的需要，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。

（四 ）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为交易标的。

五、投资决策依据和决策程序

1 .决策依据

① 国家有关法律、法规和本（基金合同 ）的有关规定。

② 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。

③ 股资对象收益和风险的配比关系。

2 .投资程序

① 研究与分析

本基金管理人内设研究部，通过对宏观、政策、行业、公司、市场等方面的分析，制定投资策略建议和投资建议。

本基金管理人内设绩效与风险评估小组，运用风险模型及监测指标定期或根据需要对基金绩效进行评估，并向基金经理反馈。

② 构建投资组合

投资决策委员会在（基金合同 ）规定的投资框架下，审批确定基金资产配置和行业配置方案，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，参考研究部和绩效与风险评估小组的研究分析，制定基金的投资策略，在其权限范围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。绩效与风险评估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。在监察部和绩效与风险评估小组提供的绩效评估和风险分析报告的基础上，基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行反思，对基金投资组合不断进行调整和优化。

六、投资限制

（一)股资组合限制

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)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%，（但标的指数成分股和备选成份股不受此限制；

②)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%，（但标的指数成分股和备选成份股不受此限制；

③)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%；

④)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%；

⑤)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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

⑥)本基金股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于沪深 300成长指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。如法律法规允许，本基金可以将股票投资比例提高到基金资产净值的100%；

⑦)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；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%；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；

⑧)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；

⑨)本基金参与股指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%；

2)本基金在任何交易日日终，持有的买入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，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%；

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)应当占基金资产的90%-95%；

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%；

6)法律法规和中国证监会规定的其他比例限制。

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，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，则本基金在履行适当程序后投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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。除投资资产配置比例外，基金托管人对基金投资的监督和检查自（基金合同)生效之日起开始。

（二)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，但是法律法规或监管机关另有规定的除外；

(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、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构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。

七、标的指数

本基金的标的指数是沪深 300成长指数。

如果标的指数被停止编制及发布或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出、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，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，并及时公告。其中，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会核准或者备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

八、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

沪深300成长指数收益率*95% + 活期存款利率（税后)*5%。

沪深300成长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，样本股为沪深300指数成分股，由其中100只成长力值最高的股票构成。沪深300成长指数具有市场认可程度高、流动性强、成分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。

本基金标的指数变更的，基金管理人应及时告知基金托管人，业绩比较基准随之变更并公告。

九、风险收益特征

本基金为股票型指数基金，预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额看，银河沪深300成长优先份额具有低风险、收益相对稳定的特征；银河沪深300成长进取份额具有高风险、高预期收益的特征。

十、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1 .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；

2 .有利于基金财产的安全与增值；

3 .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。

4 .基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

十一、基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

十二、基金投资组合报告（截止2014年6月30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	44,426,800.16	91.50
	其中：股票	44,426,800.16	91.50
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,484,778.60	7.18
7	其他资产	642,807.15	1.32
8	合计	48,554,385.91	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,539,214.35	36.41
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	432,000.00	0.90
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	9,508,470.64	19.74
J	金融业	5,854,003.48	12.15
K	房地产业	1,189,374.67	2.47
L	租赁和商务服务业	936,855.84	1.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,278,649.91	2.65
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	280,900.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	37,019,468.89	76.85

2.2报告期末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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,572,135.85	9.49
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	288,261.56	0.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,010,123.68	2.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	475,200.00	0.99
L	租赁和商务服务业	318,480.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	487,830.18	1.01
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	255,300.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	7,407,331.27	15.38

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

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	600804	鹏博士	181,900	2,626,636.00	5.45
2	600036	招商银行	221,698	2,270,187.52	4.71
3	603000	人民网	50,200	1,967,338.00	4.08
4	002653	海思科	99,957	1,919,174.40	3.98
5	002065	东华软件	89,850	1,807,782.00	3.75
6	600703	三安光电	70,731	1,657,227.33	3.44
7	002456	欧菲光	74,723	1,601,313.89	3.32
8	600372	中航电子	60,765	1,377,542.55	2.86
9	002230	科大讯飞	45,000	1,197,000.00	2.48
10	600690	青岛海尔	77,868	1,149,331.68	2.39

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	002594	比亚迪	17,000	807,330.00	1.68
2	300072	三聚环保	39,915	797,900.85	1.66
3	300085	银之杰	44,812	775,695.72	1.61
4	300003	乐普医疗	30,000	627,000.00	1.30
5	300012	华测检测	24,902	487,830.18	1.01

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金依据基金合同的规定，以量化增强和控制跟踪误差相结合，现阶段未进行股指期货的投资。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金依据基金合同的规定，以量化增强和控制跟踪误差相结合，现阶段未进行股指期货的投资。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

注：本基金未投资国债期货。

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。

10.3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

11.1报告期内本基金投资的前十名证券的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。

11.2本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	36,375.74
2	应收证券清算款	604,905.28
3	应收股利	-
4	应收利息	1,526.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	642,807.15

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。

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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未存在流通受限情况。

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

7. 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	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
2014.1.1-2014.6.30	-10.45%	1.11%	-5.63%	1.02%	-4.82%	0.09%
自基金合同生效起至今	-10.98%	1.01%	-14.51%	1.20%	3.53%	-0.19%

注：1.本基金业绩比较基准为沪深300成长指数收益率*95% + 活期存款利率（税后)*5%。

2.本基金基金合同生效日为2013年3月29日。

8. 基金的费用与税收

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)生效后的标的指数使用费；

4、基金上市费用；

5、因基金的证券交易或结算而产生的费用；

6、（基金合同)生效以后的信息披露费用；

7、基金份额持有人大会费用；

8、（基金合同)生效以后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

9、基金的资金汇划费用；

10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

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

基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下：

H=E× 1.0%÷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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

H=E× 0.2%÷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，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。如遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、（基金合同)生效后的标的指数使用费

根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金标的的指数使用费年费率为0.016%。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的0.016%的年费率计提。

计算方法如下：

H=E×0.016%÷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

标的指数使用费从（基金合同)生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数使用费收取下限为每季度5万元（基金合同)生效当季按实际计提金额收取，不设下限)。标的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。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行，此项无需召开基金份额持有人大会。

4、本条第一款第4至第10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

三、不列入基金费用的项目

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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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。

四、基金管理费和基金托管费的调整

调高基金管理费率、基金托管费率（但根据法律法规的要求提高该等报酬费率标准的除外)，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

9. 对招募说明书更新部分的说明

银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金本次更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法规及《银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金基金合同》进行更新编写，更新的内容主要包括以下几部分：

1、重要提示"日期根据实际情况进行了相应更新，本招募说明书所载内容截止日为2014年9月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年6月30日（财务数据未经审计)，定于2014年11月12日前公告。

2、第三节 基金管理人"之"一、基金管理人概况"银河基金管理有限公司的法定代表人由尤象都先生（代行)更新为许国平先生。"二、主要人员情况"监事长由刘昼先生更新为李立生先生；督察长由李立生先生更新为董伯儒先生；其他董事、监事、经理及其他高级管理人员信息根据实际情况进行了更新。基金经理情况根据实际情况进行调整。

3、第四节 基金托管人"之"一、基金托管人情况"根据实际情况进行了相应更新。

4、第五节 相关服务机构"之"直销机构"银河基金管理有限公司直销中心法定代表人更新为许国平先生。"场外代销机构"和"第三方销售机构"根据实际情况进行更新。

5、第十三节 基金的投资"更新了"十二、基金投资组合报告"，本报告截止日为2014年6月30日，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但未经审计；更新了"十三、基金的业绩"，对基金成立以来至2014年6月30日的基金业绩表现进行了披露。该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。

6、 第二十七节 其他应披露事项"中列示了本报告期内本基金及本基金管理公司在指定报纸上披露的临时报告。

银河基金管理有限公司
2014年11月12日

（上接B47版）

(117) 晟视天下
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人：蒋煜
联系人：徐长征、崔乐乐
电话：01058170943、01058170949
传真：01058170800
客户服务电话：4008188866
公司网站：www.shengshiview.com
(118) 数米基金
注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：张裕
联系电话：021-60897840
客户服务电话：4000-766-123
传真：0571-26697013
网址：http://www.fund123.cn/
(119) 天天基金
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
联系电话：021-54509998
客户服务电话：400-1818-188
传真：021-64385308
网址：www.1234567.com.cn
(120) 同花顺
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：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人：凌顺平
联系人：胡璇
联系电话：0571-88911818
客户服务电话：0571-88920897，4008-773-772
传真：0571-88910240
网址：www.5ifund.com
(121) 万银财富
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院盘古大厦3201
法定代表人：王斐
联系人：戚亮
电话：010-59393923
传真：010-59393074
客服电话：400-081-6655
公司网站：http://www.wy-fund.com/
(122) 一路财富
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：段京璐
电话：010-88312877
传真：010-88312885
客户服务电话：400-001-1566
公司网站：www.yilucaifu.com
(123) 宜信普泽
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：程刚
电话：010-52855713
传真：010-85894285
客户服务电话：400-6099-200
公司网站：www.yixinfund.com
(124) 展恒基金
注册地址：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
联系人：崔飞飞
联系电话：010-62020088
客户服务电话：400-888-6661
传真：010-62020355
网址：www.myfund.com
(125) 增财基金
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人：罗智安
联系人：焦媛媛
电话：010-67000988
传真：010-67000988-6000
客户服务电话：400-001-8811
公司网站：www.zcvc.com.cn
(126) 中国国际期货
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
法定代表人：王兵
联系人：孟夏
电话：010-59539861
传真：010-59539806
客户服务电话：95162
公司网站：http://www.cifco.net/
(127) 中期资产
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层
法定代表人：路瑶
联系人：侯英建
电话：010-65807865
传真：010-65807864
客户服务电话：010-65087609
公司网站：www.cifcofund.com
(128) 众禄基金
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层J单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
客户服务电话：4006-788-887
公司网站：www.zlfund.cn　　www.jjmmw.com
（二)基金注册登记机构
名称：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
法定代表人：叶俊英
电话：4008818088
传真：020-38799249
联系人：余贤高
（三)律师事务所和经办律师
律师事务所：通力律师事务所
地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：吕武、黎明
联系人：黎明
（四)会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人：杨经信
联系电话：(021)23238888
传真：(021)23238800
经办注册会计师：薛竞、沈兆杰
联系人：沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。

七、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括上证中盘ETF、上证中盘指数成份股及备选成份股、新股、货币市场工具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。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。

本基金资产中投资于上证中盘ETF的比例不低于基金资产净值的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%。

八、基金的投资策略

本基金为上证中盘ETF的联接基金。上证中盘ETF是采用完全复制法实现对上证中盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于上证中盘ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、收益、成本等因素的基础上，决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行上证中盘ETF的买卖。

待指数衍生金融产品推出以后，基金管理人在履行适当程序后，本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。

九、基金的业绩比较基准

上证中盘指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

十、基金的风险收益特征

本基金为上证中盘ETF的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。本基金主要通过投资于上证中盘ETF追踪业绩比较基准，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。

十一、基金投资组合报告(未经审计)

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2014年10月26日复核了本报告的内容，保证复核内容