银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式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2013年12月31日《关于核准银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金募集的批复》(证监许可【2013】1654号)的核准,进行募集。

基金管理人保证《银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式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做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。

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,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险,等等。

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2015年9月14日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30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:上海市浦东新区世纪大道1568号15层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1568号15层
法定代表人:许国平
成立日期:2002年6月14日
注册资本:2亿元人民币
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

董事长许国平先生,中共党员,经济学博士。2014年4月被选举为银河基金管理有限公司董事长。历任中国人民银行国际司处长、东京代表处代表、研究局调研员、金融稳定局体改处处长,中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任,中国银河投资管理有限公司总经理。现任中国银河金融控股有限责任公司董事、副总经理、党委委员。

董事刘立达先生,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。现任中国银河金融控股有限责任公司战略发展部总经理、综合管理部总经理。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,研究局金融市场处主任科员、货币政策处副调研员。2008年6月进入中国银河金控,曾任股权管理运营部总经理、银河保险经纪公司董事。

董事王志强先生,中共党员,工商管理硕士。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。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。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。

董事唐光明先生,中共党员,硕士研究生学历。2011年10月被选举为银河基金管理有限公司第三届董事会董事,第四届董事会连任。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。

董事卢丽平女士,中共党员,大学本科学历。2015年9月被选举为银河基金管理有限公司第四届董事会董事。历任中国石油天然气集团公司劳动工资局劳动组织处副处长、社会保险中心副主任,苏丹大尼罗河石油作业公司人力资源部高级主管,中油国际(苏丹)劳动工资部部门经理,中国石油天然气集团供公司人事劳资部劳动组织处处长、中国石油天然气集团公司资本运营部专职董事。

董事尤象都先生,中共党员,硕士研究生学历。2011年10月被选举为银河基金管理有限公司第三届董事会董事,第四届董事会连任。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、总经理。

尤象都先生因个人原因辞去总经理职务,经公司第四届董事会审议通过,由副总经理陈勇先生代为履行总经理职务。该事项已经于2015年8月21日对外公告。

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。2010年11月被选举为银河基金管理有限公司第三届董事会独立董事,第四届董事会连任。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。

监事朱洪先生,中共党员,经济学硕士,高级经济师。历任中国工商银行华融信托投资公司华东分部总经理、远东房地产公司总经理;银河证券上海总部党委书记、总经理、公司纪检委员;亚洲证券(银河证券党委派任)总裁、党委书记;银河保险经纪公司总经理、董事长等职,现任中国银河投资管理有限公司董事。

监事吴磊先生,中共党员,博士研究生学历。2013年8月被选举为银河基金管理有限公司第三届监事会监事。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。

副总经理陈勇先生(代为履行总经理职务),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,现兼任银河资本资产管理有限公司董事长、法定代表人。

原总经理尤象都先生因个人原因辞职,经公司第四届董事会审议通过,由副总经理陈勇先生代为履行总经理职务。该事项已经于2015年8月21日对外公告。

督察长董伯儒先生,中共党员,博士研究生学历。历任中国东方信托投资公司经理,中国银河证券有限责任公司基金部高级经理,银河基金管理有限公司支持保障部总监等职。现兼任银河基金管理有限公司监察部总监。

2、本基金基金经理

罗博先生,博士研究生学历,10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月起担任银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金的基金经理,2014年3月起担任银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金的基金经理。

3、投资决策委员会成员

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睿南先生,总经理助理兼市场部总监兼战略规划部总监吴磊先生,研究部总监刘凤华女士,股票投资部副总监王培先生,股票投资部基金经理张杨先生,股票投资部基金经理神玉飞先生,固定收益部总监助理韩晶先生。

上述人员之间均无亲属关系。

第二节 基金托管人

(一)基金托管人情况
1、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。中国建设银行于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)。于2014年末,中国建设银行市值约为2,079亿美元,居全球上市银行第四位。

于2014年末,本集团资产总额167,441.30亿元,较上年增长8.99%;客户贷款和垫款总额94,745.23亿元,增长10.30%;客户存款总额128,986.75亿元,增长5.53%。营业收入5,704.70亿元,较上年增长12.16%;其中,利息净收入增长12.28%,净利息收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入占营业收入比重为19.02%;成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86亿元,较上年增长6.89%;净利润2,282.47亿元,增长6.10%。资本充足率14.87%,不良贷款率1.19%,拨备覆盖率222.33%。

客户基础进一步夯实,全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增11万户和68万户,个人有效客户新增1,188万户。网点"三综合"覆盖面进一步扩大,综合性网点达到1.37万个,综合柜员占比达到80%,综合营销团队1.75万个,网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离,全行超过1.45万个营业网点30类柜面实时性业务产品实现总行集中处理,处理效率提高60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展,集团综合性、多功能优势逐步显现。

债务融资工具累计承销3,989.83亿元,承销额连续四年同业排名第一。以"养颐"为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富,养老金受托资产规模、账户管理规模分别新增188.32亿元和62.34万户。投资托管业务规模增幅38.06%,新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户数突破1万户,结算量达1.46万亿元。信用卡累计发卡量达6,593万张,消费交易额16,580.81亿元,多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进,客户数量增长14.18%,金融资产增长18.21%。

2014年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年"世界银行1000强排名"中,以一级资本总额位列全球第2;在英国《金融时报》全球500强排名第29位,新兴市场500强排名第3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位。此外,本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项,覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和信息科技等多个领域。

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、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220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。

2、主要人员情况

赵观甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行担任副行长,总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,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南通分行、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。

张军红,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。

张力铮,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,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,投资托管业务部副总经理,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。

3、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2015年6月末,中国建设银行已托管514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。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行"。

(二)基金托管人的内部控制制度

1、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。

2、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。

3、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

1、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。

2、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).收到基金管理人的划款指令后,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)基金份额发售机构
1、直销机构
(1)银河基金管理有限公司
地址:上海市浦东新区世纪大道1568号15层(邮编:200122)
法定代表人:许国平
公司网站:www.galaxyasset.com(支持网上交易)
客服热线:400-820-0860
直销业务电话:(021)38568981 / (021)38568507
传真交易电话:(021)38568985
联系人:郑夫桦、张鸿、赵冉
(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:孙妍
(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号锦绣联合商务大厦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:哈尔滨市南岗区果戈里大街206号
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)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:牛锡明
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(2)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
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com
(3)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
法定代表人:李国华
客户服务电话:95580
网址:www.psbc.com
(4)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:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn
(5)齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:(0531)68889155
传真:(0531)68889752
联系人:吴阳
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
(6)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
(7)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
客服电话:95523或4008895523
网址: www.swhysc.com
(8)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
(9)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
(10)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
法人代表: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
(11)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
(12)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
办公地址: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:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn
(13)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
(14)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
(15)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
(16)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
(17)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
网址:www.cicc.com.cn
(18)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
(19)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/www.jjjin.txsec.com
(20)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
(21)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18-19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:王一彦
客户服务电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn
(22)平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
电话:(0755)22626391
传真:(0755)82400862
客户服务电话:400-881-6168
联系人:郑舒丽
网址:www.pingan.com
(23)华龙证券有限责任公司
住所:甘肃省兰州市静宁路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:0931-4890100、0931-4890619
传真:0931-4890628
联系人:李昕田、杨晓天
客户服务电话:96668、4006898888
网址:www.hlzqgs.com
(24)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
(25)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:张宗瑞
客户服务电话:(0591)96326
网址:www.hfzq.com.cn
(26)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: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.zszq.com.cn
(27)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
(28)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路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:万建华
电话:(021)38676767
传真:(021)38670666
联系人:吴倩
客户服务电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com
(29)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:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invs.cn
客服电话:400-600-8008、95532
(30)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:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invs.cn
客户服务电话:400-600-8008、95532
(31)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:许建平
电话:010-88085858
传真:010-88085195
联系人:李巍
客户服务电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com
(32)上海证券有限责任公司
住所:上海市西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
联系人:许曼华
电话:(021)53519888
传真:(021)53519888
客户服务电话:4008918918、021-962518
网址:www.962518.com
(33)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
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)杭州数米基金销售有限公司
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、www.jjmmw.com
(5)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
公司网站:www.5ifund.com
(6)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
公司网站: www. leadfund.com.cn
(7)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
公司网站: www.rffund.com
(8)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
公司网站: fund.bundtrade.com
(9)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
公司网站: www.91fund.com.cn
(10)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
公司网站:www.myfund.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。
4、场内代销机构:
通过上海证券交易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海证券交易所会员。具体以上海证券交易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
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)律师事务所和经办律师
名称:上海源泰律师事务所
地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦14层(200120)
负责人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
经办律师:刘佳、张兰
(四)会计师事务所和经办注册会计师
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、濮晓达
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:银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金
基金简称:银河定投宝中证腾安指数
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

本基金为股票型指数基金,力求对中证腾安价值100指数进行有效跟踪,在严格控制跟踪偏离和跟踪误差的前提下追求跟踪误差的最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。

(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、债券、权证、股指期货、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(但须符合中国证监会相关规定)。股票投资包括中证腾安价值100指数成份股、备选成份股等。

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:本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%—95%,其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的90%、且占非现金资产的比例不低于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,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;权证、股指期货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)投资策略

1、股票投资策略

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,按照成份股在中证腾安价值100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及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等)导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将在拟替代成份股内选取替代成份股进行替代投资,并对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。

本基金将采用数量化模型,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。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。

2、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。

3、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、基差交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的,基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

(四) 标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数为:中证腾安价值100指数

本基金的业绩比较基准为:中证腾安价值100指数收益率*95% + 银行活期存款利率(税后)*5%

若本基金标的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更。如果今后法律法规发生变化,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,本基金管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。若变更业绩比较基准涉及本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业绩比较基准召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案并在指定媒体公告。若变更业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应于变更前在指定媒体上公告。

(五)风险收益特征

本基金为股票型指数基金,预期风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

(六)投资决策依据和投资程序

1、投资决策依据
(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
(2)国内外宏观经济发展状况、宏观经济政策导向、微观经济运行环境和证券市场发展态势;
(3)投资资产的预期收益率及风险水平等。

2、投资决策程序

(1) 研究与分析

本基金管理人内设研究部,通过对宏观经济状况、货币政策和证券市场情况的分析,制定投资策略和投资建议。

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对市场风险实施监控。市场部根据每日基金申购赎回的数据,提供分析报告,供基金经理参考。

(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,决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。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。

3、交易机制

基金经理在授权的范围内,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。中央交易室负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

(七)投资限制

1、组合限制

(1)本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%—95%,其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的90%、且占非现金资产的比例不低于80%;
(2)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,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;
(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%;
(5)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%;
(6)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%;
(7)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、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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定,即占基金资产的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%。
(8)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、标的指数成份股调整、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。法律法规或监管部门另有规定的从其规定。

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基金合同生效之日起开始。

如果法律法规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。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)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)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;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
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。

(八)基金管理人代表基金行使股东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;
4、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。

(九)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)基金投资组合报告(截止2015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	1,031,911,056.77	82.21
	其中:股票	1,031,911,056.77	82.21
2	固定收益投资	1,038,966.50	0.08
	其中:债券	1,038,966.50	0.08
	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	89,686,746.60	7.15
7	其他资产	132,518,050.64	10.56
8	合计	1,255,154,820.51	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	11,501,497.56	1.13
C	制造业	642,767,855.62	63.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,225,286.07	0.91
E	建筑业	28,654,306.22	2.82
F	批发和零售业	31,055,428.71	3.05
G	交通运输、仓储和邮政业	93,937,165.79	9.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,950,287.42	4.52
J	金融业	19,776,912.00	1.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,463,134.54	3.00
M	科学研究和技术服务业	13,930,327.95	1.37
N	水利、环境和公共设施管理业	18,665,208.44	1.84
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	51,555,703.36	5.07
S	综合	8,480,853.63	0.83
	合计	1,005,963,967.31	98.92

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	15,445,562.92	1.52
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	10,501,526.54	1.03
J	金融业	-	-
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	-	-
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	25,947,089.46	2.55

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	300113	顺网科技	299,315	16,043,284.00	1.58
2	002191	劲嘉股份	773,240	14,861,672.80	1.46
3	002449	国星光电	641,736	14,118,192.00	1.39
4	002398	建研集团	488,955	13,930,327.95	1.37
5	300079	数码视讯	473,395	13,155,647.05	1.29
6	600872	中炬高新	597,272	12,913,020.64	1.27
7	000830	鲁西化工	1,279,396	12,742,784.16	1.25
8	002543	万和电气	501,154	12,418,596.12	1.22
9	601238	广汽集团	809,262	12,381,708.60	1.22
10	002099	海翔药业	467,300	12,159,146.00	1.20

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	002226	江南化工	1,171,894	15,445,562.92	1.52
2	300047	天源迪科	437,746	10,501,526.54	1.03

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	1,038,966.50	0.10
8	其他	-	-
9	合计	1,038,966.50	0.10

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

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	110031	航信转债	7,150	1,038,966.50	0.10

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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:报告期内,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:报告期内,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:报告期内,未进行国债期货的投资。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期内,未进行国债期货的投资。

10.3本期国债期货投资评价

注:报告期内,未进行国债期货的投资。

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。

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。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	481,681.23
2	应收证券清算款	107,517,751.32
3	应收股利	-
4	应收利息	24,919.46
5	应收申购款	24,493,698.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	132,518,050.64

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

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	300113	顺网科技	16,043,284.00	1.58	重大事项停牌
2	002191	劲嘉股份	14,861,672.80	1.46	重大事项停牌
3	002398	建研集团	13,930,327.95	1.37	重大事项停牌
4	600872	中炬高新	12,913,020.64	1.27	重大事项停牌

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	002226	江南化工	15,445,562.92	1.52	重大事项停牌
2	300047	天源迪科	10,501,526.54	1.03	重大事项停牌

(十一)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
2014.03.14-2014.12.31	33.40%	0.88%	35.45%	1.12%	-2.05%	-0.24%
2015.01.01-2015.06.30	54.87%	2.25%	70.21%	2.19%	-15.34%	0.06%
自基金合同生效日至今	106.60%	1.54%	130.55%	1.61%	-23.95%	-0.07%

注:1.本基金业绩比较基准为中证腾安价值100指数收益率*95% + 银行活期存款利率(税后)*5%

2.本基金基金合同生效日为2014年3月14日。

第六节 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、销售服务费;
4、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费;
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
7、基金份额持有人大会费用;
8、基金的证券交易费用;
9、基金的银行汇划费用;
10、证券账户开户费用、银行账户维护费用;;
11、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)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times 0.5\%\div$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

基金管理费每日计算,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。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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times 0.15\%\div$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

基金托管费每日计算,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。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、销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金份额资产净值的0.25%的年费率计提。销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

销售服务费的计算方法如下:

$H=E\times 0.25\%\div$当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算,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。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。

4、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费

本基金《基金合同》生效后的标的指数许可使用费按照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的约定从基金财产中支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.02%的年费率计提,计算方法如下:

$H=E\times 0.02\%\div$当年天数

H为每日应计提的标的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费从《基金合同》生效日开始每日计算,逐日累计,按季支付。本基金标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币1万元,即标的指数季度许可使用费为当季度每日指数许可使用费的逐日累计值与收取下限之间的较大值。如计费期间不足一季度,则收取下限以每季度人民币1万元为基准根据实际天数按比例计算,即该计费期间标的指数许可使用费为实际计提金额与按比例计算的收取下限之间的较大值。

标的指数许可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,于每年1月、4月、7月、10月的前10个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。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。

上述"一、基金费用的种类中第5—11项费用",根据有关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。

(四)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。

(五)费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费或销售服务费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

基金管理人可根据指数使用许可协议和基金份额持有人的利益,对标的指数使用费的计提方式进行合理的变更,并按照《信息披露办法》的规定在指定媒体进行公告,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

第七节 对招募说明书更新部分的说明

银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式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》、《公开募集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《银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式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2015年9月14日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日(财务数据未经审计),定于2015年10月28日前公告。

2、"第三节 基金管理人"、"(二)主要人员情况" 原总经理尤象都先生因个人原因辞职,经公司第四届董事会审议通过,由副总经理陈勇先生代为履行总经理职务;董事、投资决策委员会成员情况根据实际情况进行了更新。

3、"第四节 基金托管人",根据最新资料对相关内容作了相应更新。

4、"第五节 相关服务机构",增加了相关代销机构,对原有销售机构进行了更新,相关事宜均已公告。

5、"第十节 基金的投资","基金投资组合报告"更新为数据截止日为2015年6月30日的报告,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。"基金的业绩"中对基金成立以来至2015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,但未经审计。

6、"第二十三节 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

二〇一五年十月二十八日