(上接B26版)

法定代表人:葛明
经办会计师:蒋燕华、骆文慧
电话:(021)22288888
传真:(021)22280000
联系人:蒋燕华

四、基金的历史沿革

本基金由银河通利分级债券型证券投资基金基金《基金合同》生效后2 年期届满,《基金合同》约定转换而来。

《银河通利分级债券型证券投资基金基金合同》于2012年4月25日生效,根据《基金合同》的有关规定,本基金《基金合同》生效后2 年期届满,本基金无需召开基金份额持有人大会,转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"银河通利债券型证券投资基金(LOF)"。银河通利A、银河通利B 的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)的份额,并办理基金的申购与赎回业务。本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,登记在证券登记结算系统的基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。

本基金银河通利A转为银河通利债券型证券投资基金(LOF)场外的C类份额,场外的银河通利B份额转为银河通利债券型证券投资基金(LOF)场外的A类份额,且均登记在注册登记系统下;本基金场内的银河通利B份额转为银河通利债券型证券投资基金(LOF)场内的A类份额,仍登记在证券登记结算系统下。

本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金的投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。

根据《基金合同》的有关规定,《基金合同》生效后2 年期届满,基金管理人向深圳证券交易所申请终止银河通利分级债券型证券投资基金之通利债B上市交易,并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》(深证上[2014]135号)的同意。对投资者认购或通过上市交易购买并持有到期的每一份银河通利A和银河通利B,自基金合同生效之日起2年届满日(即2014年4月25日),按照基金合同约定的资产及收益的计算规则计算银河通利A和银河通利B的基金份额净值,并以各自的份额净值为基础,分别转换为银河通利债券型证券投资基金(LOF)的不同类别份额(即转型后的通利债C和银河通利份额)。

2014年4月29日,基金管理人公告《银河通利分级债券型证券投资基金2年期届满基金份额转换结果的公告》,基金份额转换完成,基金名称变更为银河通利债券型证券投资基金(LOF)。转换详情具体请见基金管理人发布的相关转换公告。

五、基金的名称

基金名称:银河通利债券型证券投资基金(LOF)
基金简称:银河通利债券

六、基金的类型

基金类型:债券型
基金运作方式:契约型上市开放式基金(LOF)

七、基金的投资

(一)投资目标

在合理控制风险的前提下,力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

(二)投资理念

在有效管理风险的前提下,追求投资收益最大化与投资本金稳妥的和谐统一。

(三)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国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、可转换债券、可分离债券和回购、银行存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金也可投资于权益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可以参与A 股股票(包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票)的新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他权益类品种(但须符合中国证监会的相关规定)。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金应在其可交易之日起的30 个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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:投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,其中,投资于信用债的比例不低于基金资产净值的20%;投资于权益类资产的比例不高于基金资产的20%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金所指信用债券是指短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债(不含政策性金融债)、地方政府债、次级债、资产支持证券等除国债和央行票据之外的非国家信用的固定收益类金融工具。

本基金管理人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上述相关规定。

(四)投资策略

本基金以自上而下的分析方法为基础,根据国内外宏观经济形势、市场利率、汇率变化趋势、债券市场资金供求等因素分析研判债券市场利率走势,并对各固定收益品种收益率、流动性、信用风险、久期和利率敏感性进行综合分析,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的管理构建及调整固定收益投资组合。

债券资产配置策略

本基金在债券配置上将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略.

(1)久期偏离策略

久期偏离是根据对利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。

本基金通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断, 形成对未来市场利率变动方向的预期,主动地调整债券投资组合的久期,提高债券投资组合的收益水平。

本基金主要考虑的宏观经济政策因素包括:经济增长、就业、固定资产投资、市场销售、工业生产、居民收入等反映宏观经济运行态势的重要指标,银行信贷、货币供应和公开市场操作等反映货币政策执行情况的重要指标, 以及居民消费物价指数和工业品出厂价格指数等反映通货膨胀变化情况的重要指标等。

(2)收益率曲线策略

本基金通过对债券市场微观因素的分析判断,形成对未来收益率曲线形状变化的预期,相应地选择子弹型、哑铃型或梯形的短-中-长期债券品种的组合期限配置,获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。

本基金主要考虑的债券市场微观因素包括:收益率曲线、历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等。

(3)类属配置策略

本基金根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期,主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例, 降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例,获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

债券品种选择策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上,本基金根据债券市场收益率数据,运用利率模型对单个债券进行估值分析,并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

对于非国家信用债券的金融债、企业债、公司债、短期融资券、分离交易可转债等债券,本基金将深入分析其等发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平、债务水平、抵押物质量等因素,并结合内部信用评价模型进一步评价债券发行人的信用风险。为控制基金债券投资的信用风险,本基金投资的企业债券需经国内评估机构进行信用评估,要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级,本基金根据对债券发行人的信用风险分析,决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

动态增强策略

在以上债券投资策略的基础上,本基金还将根据债券市场的动态变化,采取多种灵活策略,获取超额收益,主要包括:

(1)骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着债券剩余期限缩短,债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下滑,获得资本利得收益。

(2)息差策略

息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作, 只要回购资金成本低于债券收益率,就可以达到杠杆放大的套利目标。

本基金将根据对市场回购利率走势的判断,适当地选择杠杆比率,谨慎地实施息差策略,提高投资组合的收益水平。

附权债券投资

附权债券指对债券发行体授予某种期权,或者赋予债券投资者某种期权,从而使债券发行体或投资者有了某种灵活的选择余地,从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性,也增强对各类投资者的吸引力。当前附权债券的主要种类有可转换公司债券、分离交易可转换公司债券以及含赎回或回售选择权的债券等。

(1)可转换公司债券投资策略

可转换公司债券不同于一般的企业(公司)债券,其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利,因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转换公司债内含期权价值,是一种既具有债性,又具有股性的混合债券产品,具有抵御价格下行风险,分享股票价格上涨收益的特点。

可转换公司债券可以按照约定价格转换为上市公司的股票,因此在日常交易过程中可能会出现可转换公司债券市场与股票市场之间的套利机会。本基金持有的可转换公司债券可以转换成股票。基金管理人在日常交易过程中,会密切关注可转换公司债券市场与股票市场之间的互动关系,恰当的选择时机进行套利。

(2)其它附权债券投资策略

本基金利用债券市场收益率数据,运用利率模型,计算含赎回或回售选择权的债券的期权调整利差(OAS),作为此类债券投资估值的主要依据。

分离交易可转换公司债券,是认股权证和公司债券的组合产品,该种产品中的公司债券和认股权证可在上市后分别交易, 即发行时是组合在一起的, 而上市后则自动拆分成公司债券和认股权证。本基金因认购分离交易可转换公司债券所获得的认股权证自可交易之日起30个交易日内全部卖出,分离交易可转换公司债券上市后分离出的公司债券的投资按照普通债券投资策略进行管理。

资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券的资产池的资产特征进行分析, 估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。本基金投资资产支持证券时,还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性,控制资产支持证券投资的风险,获取较高的投资收益。

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:

(1)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。

(2)本基金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,力争获取较高的投资风险回报。

新股申购策略

为保证新股发行成功,新股发行一级市场价格通常相对二级市场价格存在一定的折价。本基金根据新股发行人的基本情况,以及对认购中签率和新股上市后表现的预期,谨慎参与新股申购,获取股票一级市场与二级市场的价差收益,申购所得的股票在可上市交易后30个交易日内全部卖出。

(五)投资决策

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。

(六)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合全价指数。

该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券,综合反映了债券市场整体价格和回报情况。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子,每日计算债券市场整体表现,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。

该指数合理、透明、公开,具有较好的市场接受度,可以较好的体现本基金的投资特征与目标客户群的风险收益偏好。为此,本基金选取中债综合全价指数作为本基金的业绩比较基准。

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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,经基金管理人和基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

(七)风险收益特征

从基金资产整体运作来看,本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

从本基金所分离的两类基金份额来看,由于本基金资产及收益的分配安排,银河通利A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征;银河通利B份额则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

(八)投资限制

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点, 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%;

(2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的10%;

(3) 投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,其中,投资于信用债的比例不低于基金资产净值的20%;投资于权益类资产的比例不高于基金资产的20%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

(4) 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;

(5) 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%;

(6) 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20%;

(7) 同一基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过各类资产支持证券合计规模的10%;

(8) 本基金持有的全部资产支持证券,市值不超过本基金资产净值的20%;

(9) 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;

(10)本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%;

(11) 本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(12)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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。法律法规另有规定时,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本基金合同生效之日起开始。

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)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,但是国务院另有规定的除外;

(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)依照法律法规有关规定,由中国证监会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。

(九)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、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;

2、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;

3、有利于基金财产的安全与增值;

4、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。

(十)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(十一)基金投资组合报告(截止2017年9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。

1.1 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	–	–
	其中:股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	506,431,217.00	96.44
	其中:债券	506,431,217.00	96.44
	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	4,000,000.00	0.76
	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	7,604,686.79	1.45
8	其他资产	7,068,885.89	1.35
9	合计	525,104,789.68	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

1.2.2 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。

1.3 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

1.4 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	37,862,800.00	7.37
2	央行票据	–	–
3	金融债券	29,885,000.00	5.82
	其中:政策性金融债	29,885,000.00	5.82
4	企业债券	166,440,000.00	32.41
5	企业短期融资券	40,180,000.00	7.82
6	中期票据	210,124,000.00	40.92
7	可转债(可交换债)	21,939,417.00	4.27
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	506,431,217.00	98.61

1.5 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	041661024	16阳煤CP005	300,000	30,180,000.00	5.88
2	019557	17国债03	280,000	27,946,800.00	5.44
3	1280028	12镇江新区债	500,000	20,575,000.00	4.01
4	1280039	12渝粮债	200,000	20,326,000.00	3.96
5	101762016	17盐城交通MTN001	200,000	20,174,000.00	3.93

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

1.9.2 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。

1.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

1.10 投资组合报告附注

1.10.1

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。

1.10.2

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。

1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,882.39
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	7,058,893.50
5	应收申购款	1,110.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	7,068,885.89

1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	4,258,800.00	0.83
2	113009	广汽转债	1,900,650.00	0.37
3	113011	光大转债	1,671,300.00	0.33
4	110030	格力转债	1,475,255.00	0.29
5	110034	九州转债	1,458,351.60	0.28
6	132003	15清控EB	1,447,936.00	0.28
7	110032	三一转债	1,180,600.00	0.23
8	128010	顺昌转债	1,178,100.00	0.23
9	123001	蓝标转债	1,007,432.80	0.20
10	113010	江南转债	528,400.00	0.10

1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

1.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

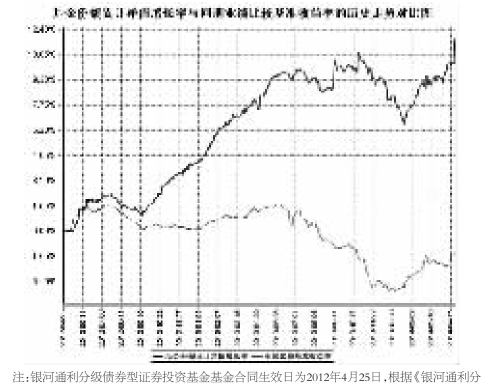
八、基金的业绩

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。(截止2017年9月30日)

转型前(银河通利债券型证券投资基金):

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
2012.04.25-2012.12.31	4.23%	0.09%	0.18%	0.06%	4.05%	0.03%
2013.01.01-2013.12.31	3.89%	0.16%	-3.75%	0.08%	7.64%	0.08%
2014.01.01-2014.03.31	1.05%	0.19%	1.62%	0.08%	-0.57%	0.11%
自基金合同生效起至2014.4.25	11.69%	0.15%	-1.47%	0.08%	13.16%	0.07%

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:银河通利分级债券型证券投资基金基金合同生效日为2012年4月25日,根据《银河通利分级债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金应自基金合同生效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规定。银河通利分级债券型证券投资基金已于2014年4月26日转型为银河通利债券型证券投资基金(LOF)。

转型后(银河通利债券型证券投资基金(LOF)

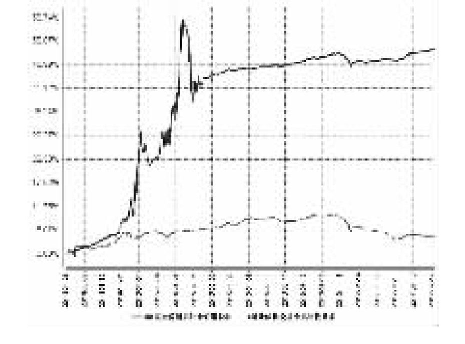
银河通利

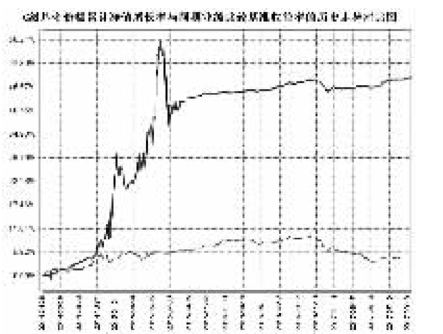
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014.04.26-2014.12.31	24.33%	0.62%	4.26%	0.12%	20.07%	0.50%
2015.01.01-2015-12.31	17.55%	0.83%	4.19%	0.08%	13.36%	0.75%
2016.01.01-2016.12.31	0.95%	0.06%	-1.63%	0.09%	2.58%	-0.03%
2017.01.01-2017.09.30	2.26%	0.05%	-2.26%	0.07%	4.52%	-0.02%
自基金合同生效起至今	50.88%	0.53%	4.44%	0.09%	46.44%	0.44%

通利债C

阶段	净值增长率①	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
2014.04.26-2014.12.31	23.91%	0.62%	4.26%	0.12%	19.65%	0.50%
2015.01.01-2015-12.31	17.21%	0.83%	4.19%	0.08%	13.02%	0.75%
2016.01.01-2016.12.31	0.55%	0.06%	-1.63%	0.09%	2.18%	-0.03%
2017.01.01-2017.09.30	2.00%	0.05%	-2.26%	0.07%	4.26%	-0.02%
自基金合同生效起至今	48.96%	0.53%	4.44%	0.09%	44.52%	0.44%

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:银河通利分级债券型证券投资基金基金合同生效日为2012年4月25日,于2014年4月26日正式转型为银河通利债券型证券投资基金(LOF),根据《银河通利分级债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金应自基金合同生效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规定。

九、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1.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)基金的销售服务费;

(4)基金财产拨划支付的银行费用;

(5)基金合同生效后的基金信息披露费用;

(6)基金份额持有人大会费用;

(7)基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

(8)基金的证券交易费用;

(9)基金上市初费和上市月费;

(10)依法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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

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×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3.基金的销售服务费

基金的销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

(1)本基金自《基金合同》生效之日起2年内的销售服务费

自基金合同生效之日起2 年内,银河通利A 基金份额收取销售服务费,年费率为 0.3%,银河通利B基金份额不收取销售服务费。

在通常情况下,销售服务费按前一日银河通利A基金资产净值的 0.3%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数
H 为银河通利A基金份额每日应计提的销售服务费
E为前一日银河通利A的基金份额参考净值与银河通利A的基金份额数的乘积

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中划出,由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(2)自《基金合同》生效之日起满2年后,本基金转换为银河通利债券型证券投资基金(LOF)的销售服务费

自本基金基金合同生效之日起满 2年后,本基金将转换为上市开放式基金银河通利债券型证券投资基金(LOF),其中A类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额收取销售服务费,年费率为 0.3%。

在通常情况下,销售服务费按前一日银河通利债券型证券投资基金(LOF)的C 类基金资产净值的 0.3%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数
H 为银河通利债券型证券投资基金(LOF)的C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为银河通利债券型证券投资基金(LOF)的C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中划出,由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

4.除管理费、托管费、基金销售服务费外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用,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

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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费、会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费,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2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十、对招募说明书更新部分的说明

本次银河通利债券型证券投资基金(LOF)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《银河通利分级债券型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2017年10月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日(财务数据未经审计),定于2017年12月7日前公告。

2、"三、基金管理人",根据实际情况更新基金管理人的相关信息。

3、"四、基金托管人",根据托管人提供的资料更新了的相关信息。

4、"五、相关服务机构" 部分,增加了相关代销机构,对原有销售机构进行了更新,各新增代销机构均在指定媒体上公告列示。

5、"十一、基金的投资" 之 "(十一)基金投资组合报告" 更新为截止日为2017年9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,未经审计。

6、"十二、基金的业绩" 中对基金成立以来至2017年9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。

7、"二十四、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公告。

银河基金管理有限公司
二〇一七年十二月七日

证券代码:000838　证券简称:财信发展　公告编号:2017-159

财信国兴地产发展股份有限公司第九届董事会第三十六次会议决议的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

财信国兴地产发展股份有限公司(以下简称"公司")董事会办公室于2017年11月25日以邮件的方式发出通知,决定召开第九届董事会第三十六次会议。2017年12月6日,公司第九届董事会第三十六次会议按照公司《章程》以通讯表决的方式如期召开。公司实有董事9人,参与通讯表决的董事9人。会议审议通过了如下议案:

1、审议通过了《关于投资设立财信蓝城(中国)地产开发有限公司的议案》

表决结果为:同意9票,反对0票,弃权0票。

同意公司与蓝城阳光建设管理有限公司(以下简称"蓝城阳光")共同投资设立财信蓝城(中国)地产开发有限公司(暂定名,以工商核准名为准),注册资本5,000万元人民币,其中公司以现金出资2,550万元,占注册资本的51%;蓝城阳光出资2,450万元,占注册资本的49%。

本议案详细内容参见刊载于巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)的《关于投资设立财信蓝城(中国)地产开发有限公司的公告》。

特此公告。

财信国兴地产发展股份有限公司
董事会
2017年12月7日

证券代码:000838　证券简称:财信发展　公告编号:2017-160

财信国兴地产发展股份有限公司关于投资设立财信蓝城(中国)地产开发有限公司的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、对外投资概述:

1、对外投资基本情况

根据公司业务发展需要,本着"优势互补、共同发展"的原则,经友好磋商,财信国兴地产发展股份有限公司(以下简称"公司")与蓝城阳光建设管理有限公司(以下简称"蓝城阳光")共同出资设立 "财信蓝城(中国)地产开发有限公司"(暂定名,以工商核准名为准,以下简称"财信蓝城公司"),注册资本为人民币5,000万元。公司以现金方式出资2,550万元,占注册资本的51%;蓝城阳光以现金方式出资2,450万元,占注册资本的49%,。

2、董事会审议情况

公司于2017年12月6日召开第九届董事会第三十六次会议,会议以9票同意、0票弃权、0票反对的表决结果审议通过了《关于投资设立财信蓝城(中国)地产开发有限公司的议案》。

3、投资行为生效所必需的审批程序

本次公司投资设立全资子公司事项已经公司董事会审议批准。根据法律法规及《公司章程》的相关规定,本次投资设立事项无须提交公司股东大会审议。本项对外投资不涉及关联交易。

二、交易对手方的基本情况

1、公司名称:蓝城阳光建设管理有限公司

2、法定代表人:宋卫平

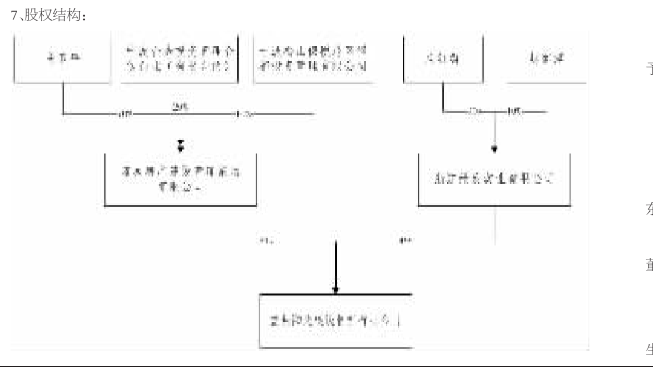
3、注册资本:5,000万元

4、类型:有限责任公司(外商投资企业与内资合资)

5、住所:浙江省杭州市西湖区三墩镇古墩路701号紫金广场B座1003室

6、经营范围:服务:建筑工程项目管理,工程造价咨询,投资咨询(除证券、期货,未经金融等监管部门批准,不得从事向公众融资存款、融资担保、代客理财等金融服务),企业管理咨询,房地产营销策划,房地产中介服务,建筑设计(凭资质证经营),景观设计,室内外装饰设计。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)

7、股权结构:



8、关联关系说明:与公司不存在关联关系

三、投资标的的基本情况

1、公司名称:财信蓝城(中国)地产开发有限公司(具体以工商核定为准)

2、注册资金:5,000万元

3、注册地址:杭州市(暂定)

4、企业类型:有限责任公司

5、股东及出资方式:

股东名称	出资方式	投资金额(万元)	持股比例
财信国兴地产发展股份有限公司	现金	2,550	51%
蓝城阳光建设管理有限公司	现金	2,450	49%

6、经营范围:房地产开发,房地产经营,物业管理,建筑装饰装修,建设管理、管理咨询、营销咨询、资产管理咨询等。(经营范围具体以工商核定为准)

四、《合作协议》的主要内容

甲方:财信国兴地产发展股份有限公司

乙方:蓝城房产建设管理集团有限公司

丙方:蓝城阳光建设管理有限公司

1、注册资本:5,000万元。

2、投资金额及出资方式:

双方可分期缴纳出资,根据资金需求经股东会决议后到位。出资按国家工商管理要求及公司章程规定予以缴纳。双方出资形式及出资比例如下:

(1)甲方以货币方式出资2,550万元,占股权比例51%;

(2)丙方以货币方式出资2,450万元,占股权比例49%。

3、经营管理机构

(1)股东会:由全体股东组成,股东会是公司的最高权力机构。股东会会议对有关事项作出决议时,股东按各自的股权比例行使表决权。

(2)董事会:董事会由3名董事组成,董事会成员均由股东会选举产生,甲方委派2名董事(其中1名担任董事长兼法定代表人);丙委派1名董事。

(3)总经理:由丙方提名人选,由董事会聘任或解聘。

(4)其他管理人员:由甲方推荐财务管理人员、市场拓展人员、前期管理人员,丙方推荐工程分管领导、生活服务总监、综管负责人、规划设计管理人员、成本管理人员、生活服务管理人员等(可兼职)。

(5)公司不设监事会,设监事1人,由甲方推荐人选。

4、违约责任

1、本协议签订后,甲丙双方均应严格履行,未经与对方协商一致,任何一方都不得擅自变更或解除协议。变更或解除本协议的,应达成书面协议。任何一方没有法律或合同依据单方擅自解除本协议的,应赔偿守约方的损失,该损失包括但不限于守约方的实际损失以及守约方为主张损失赔偿而产生的一切费用。

2、除本协议另有约定外,如果任何一方不完全履行或迟延履行本协议项下的义务,或任何一方在本协议项下的声明或承诺是不真实的或不准确的,则该方应被认定为违约。违约方应赔偿守约方由此受到的损害或损失,该损失包括但不限于守约方的实际损失以及守约方为主张损失赔偿而产生的一切费用。守约方有权选择终止履行合同或者继续履行合同。

3、如财信蓝城公司违反乙方及丙方关于蓝城品牌使用相关规定及要求,丙方有权提出整改要求,若整改不到位的,丙方有权要求财信蓝城公司停止相关业务并视违约情况终止本合同项下的合作事宜。

4、乙方、丙方认可由丙方参与投资或输出蓝城品牌并进行管理的项目有权使用蓝城品牌,若上述项目在依约合规使用蓝城品牌中被第三方追索商标侵权的,由乙丙方负责。

5、生效条件:本协议自甲乙丙三方签字盖章后生效,未尽事宜协商解决。

五、对外投资的目的和对公司的影响

1、对外投资的目的

公司与蓝城阳光共同投资设立财信蓝城公司,是双方响应政府"乡村振兴战略"和"试点集体建设用地建租赁住房"政策,基于在特色小镇及城市高品质住宅建设发展的美好愿景,本着"优势互补、共同发展"的原则,经友好磋商,为充分发挥双方各自优势,战略合作为主、全面合作长租公寓为辅的合作关系,共同组建的财信蓝城公司。

2、对公司的影响

本次投资不构成关联交易,对公司现有房地产业务的开展不存在重大影响,不会损害公司及股东的利益,对公司业务的独立性无影响。

六、备查文件

1、第九届董事会第三十六次会议决议;

2、《合作协议》。

特此公告。

财信国兴地产发展股份有限公司
董事会
2017年12月7日

证券代码:002366　证券简称:台海核电　公告编号:2017-094

台海玛努尔核电设备股份有限公司关于筹划重大资产重组的停牌公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、停牌事由及工作安排

台海玛努尔核电设备股份有限公司(以下简称"公司")拟筹划对外资产收购重大事项,经有关各方商讨和论证,公司初步确认本次筹划的重大事项构成重大资产重组。鉴于上述事项尚存在不确定性,为确保信息披露的公平性,保护广大投资者的合法权益,避免引起公司股票价格异常波动,根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《中小企业板信息披露业务备忘录第8号:重大资产重组相关事项》和《中小企业板信息披露业务备忘录第14号:上市公司停复牌业务》等相关规定,经公司向深圳证券交易所申请,公司股票(证券简称:台海核电,证券代码:002366)自2017年12月6日开市起停牌。

公司承诺争取停牌时间不超过1个月,即承诺争取于2018年1月5日前,披露符合《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 26 号—上市公司重大资产重组申请文件》要求的重大资产重组预案或者报告书。逾期未能披露重大资产重组预案或者报告书的,公司将根据重组推进情况确定是否向深圳证券交易所申请延期复牌。若公司未提出延期复牌申请或者延期复牌申请未获同意的,公司股票将于2018年1月5日开市起复牌,同时披露本次重大资产重组的基本情况、是否继续推进本次重大资产重组及相关原因。

如公司在停牌期限内终止筹划重大资产重组的, 公司将及时披露终止筹划重大资产重组相关公告并申请复牌。如果公司股票停牌时间累计未超过3个月的,公司承诺自公告之日起至少1个月内不再筹划重大资产重组;如公司股票停牌时间累计超过3个月的,公司承诺自公告之日起至少2个月内不再筹划重大资产重组。

二、停牌期间安排

公司将按照相关规定积极开展本次重大资产重组的各项工作,尽快履行必要的报批和审议程序,督促公司聘请的独立财务顾问、律师、审计机构、评估机构等中介机构加快开展尽职调查、审计、评估等各项工作,按照承诺的期限向交易所提交并披露符合相关规定要求的重组文件。

停牌期间,公司将根据相关事项进展情况,严格按照相关规定及时履行信息披露义务,至少每5个交易日发布一次重大资产重组进展公告。

三、必要风险提示

鉴于本次重大资产重组事项尚存在较大不确定性, 敬请广大投资者关注公司 后续公告并注意投资风险。

公司指定的信息披露媒体为《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn),公司所有信息均以在上述指定媒体披露的信息为准。

特此公告。

台海玛努尔核电设备股份有限公司 董事会
2017年12月6日

证券代码:600998　证券简称:九州通　公告编号:临2017-145
转债代码:110034　转债简称:九州转债

九州通医药集团股份有限公司关于2017年度第六期超短期融资券兑付完成的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

一、本次超短期融资券发行及兑付情况

九州通医药集团股份有限公司(以下简称"公司")于2017年11月2日发行了2017年度第六期超短期融资券(简称:17九州通SCP006,代码:011759101),发行总额为14亿元人民币,期限30天,发行利率为4.70%,本期起息日期为2017年11月6日,计息结束日期为2017年12月5日。

公司于2017年12月6日完成了该期超短期融资券的付息兑付工作,本次付息兑付总额为人民币1,405,408,219.18元,由银行间市场清算所股份有限公司代理划付至债券持有人。

二、本年度历次超短期融资券发行及兑付情况

2017年,公司已发行六期超短期融资券,发行及兑付情况如下:

简称	发行额度(人民币)	发行日	兑付日	兑付情况
17九州通SCP001	5亿元	2017年1月16日	2017年3月29日	已兑付
17九州通SCP002	5亿元	2017年2月27日	2017年3月31日	已兑付
17九州通SCP003	5亿元	2017年4月19日	2017年6月8日	已兑付
17九州通SCP004	8亿元	2017年8月10日	2017年12月29日	未兑付
17九州通SCP005	8亿元	2017年10月13日	2017年11月17日	已兑付
17九州通SCP006	14亿元	2017年11月2日	2017年12月6日	已兑付

截至本公告披露日,公司2017年度已发行的超短期融资券尚未兑付金额为8亿元人民币。

特此公告。

九州通医药集团股份有限公司董事会
2017年12月7日

证券代码:002626　证券简称:金达威　公告编号:2017-087

厦门金达威集团股份有限公司关于公司及全资子公司取得外观设计专利证书的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

厦门金达威集团股份有限公司(以下简称"公司")及全资子公司厦门金达威保健品有限公司(以下简称"金达威保健品")近日收到国家知识产权局颁发的一项外观设计专利证书,具体情况如下:

序号	外观设计名称	专利号	专利申请日	授权公告日	专利权期限	专利权人	证书号
1	标贴(舞昆纳豆酵素)	ZL201730260735.2	2017年6月22日	2017年11月21日	自申请日起算十年	金达威保健品、公司	第4378797号

该专利的取得不会对公司生产经营产生重大影响,但有利于公司充分发挥自主知识产权的优势,进一步完善知识产权保护体系,增强公司的核心竞争力。

特此公告。

厦门金达威集团股份有限公司
董事会
二〇一七年十二月六日

证券代码:603444　证券简称:吉比特　公告编号:2017-066

厦门吉比特网络技术股份有限公司关于公司监事会主席辞职的公告

本公司监事会及全体监事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

厦门吉比特网络技术股份有限公司(以下简称"公司")监事会于2017年12月5日收到监事会主席徐超先生递交的书面辞职报告。徐超先生因工作调整,申请辞去监事会主席一职,但仍在公司全资子公司厦门吉比特股权投资有限公司担任执行董事、总经理职务。鉴于徐超先生的辞职将导致监事会成员低于法定人数,根据《公司法》及《公司章程》的相关规定,徐超先生的辞职申请将于公司召开股东大会补选新任监事后生效。在此之前,徐超先生仍将履行监事会主席职务。

公司监事会对徐超先生任职期间做出的贡献表示衷心的感谢。

特此公告。

厦门吉比特网络技术股份有限公司
监事会
2017年12月7日

证券代码:600644　股票简称:乐山电力　编号:临2017-038

乐山电力股份有限公司关于控股子公司诉讼进展的补充公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

公司于2017年11月22日披露了《乐山电力股份有限公司关于控股子公司诉讼进展的公告》(详见公司在上海证券交易所网站和《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》上披露的"临2017-037"公告)。现将本次诉讼判决事项对公司当期利润影响情况补充公告如下:

经公司财务部门初步测算,根据本次判决结果,公司按照《企业会计准则》相关规定,将计提预计负债9000万元左右,减少当期利润,具体数据以公司年报审计机构审计确认的结果为准。

除上述补充内容外,原公告中其他内容不变。

特此公告。

乐山电力股份有限公司
2017 年12月7日

证券代码:603040　证券简称:新坐标　公告编号:2017-052

杭州新坐标科技股份有限公司关于董事辞职的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

杭州新坐标科技股份有限公司(以下简称"公司")董事会于 2017 年12月6日收到董事姚小杭女士的书面辞职报告,姚小杭女士因个人原因申请辞去公司第三届董事会董事职务。

姚小杭女士的辞职不会导致公司董事会成员低于法定人数的情形,根据《公司法》、《公司章程》规定,董事辞职自辞职报告送达董事会时生效,公司将尽快启动增补董事的工作。

姚小杭女士在担任公司董事期间,勤勉尽责、恪尽职守,为公司规范运作和持续发展发挥了积极作用,公司董事会对姚小杭女士在公司任职期间为公司所作出的贡献表示衷心的感谢!

特此公告

杭州新坐标科技股份有限公司
董事会
2017年12月7日