(上接B26版)

(19)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所: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
(20)济安财富(北京)资本管理有限公司
住所:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法定代表人:杨健
客户服务电话:400-075-6663
网址:www.pjfortune.com
(21)上海陆金所资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
客户服务电话:4008-219-031
网址:www.lufunds.com
(22)深圳富济财富管理有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
客户服务电话:(0755)83999913
网址:www.jinqianwo.cn
(23)上海凯石财富基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
客户服务电话:4000-178-000
网址:www.lingxianfund.com
(24)大泰金石投资管理有限公司
住所:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
法定代表人:袁顾明
客户服务电话:400-928-2266
网址:www.dtfunds.com
(25)北京乐融多源投资咨询有限公司
住所:北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
法定代表人:董浩
客户服务电话:400-068-1176
网址:www.jimufund.com
(26)奕丰金融服务(深圳)有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A 栋 201 室
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1116室
法定代表人:TAN YIK KUAN
客户服务电话:400-6846-500
网址:www.ifastps.com.cn
(27)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲一号环球财讯中心A座5层
法定代表人:彭运年
客户服务电话:(010)59336512
网址:www.jnlc.com
(28)浙江金观诚财富管理有限公司
住所:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室
法定代表人:徐黎云
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.jincheng-fund.com
(29)泛华普益基金销售有限公司
住所: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
(30)北京钱景财富投资管理有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
法定代表人:赵荣春
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.niuji.net
(31)厦门市鑫鼎盛控股有限公司
住所:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
法定代表人:陈洪生
客户服务电话:400-6980-777
网址:www.xds.com.cn
(32)北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号嘉盛中心30层
法定代表人:梁越
客户服务电话:4008-980-618
网址:www.chtfund.com
(33)北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
法定代表人:王伟刚
客户服务电话:400-6199-059
网址:www.fundzone.cn
(34)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
住所:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A座303
法定代表人:王岩
客户服务电话:400-8199-868
网址:www.tdyhfund.com
(35)北京懒猫金融信息服务有限公司
住所:北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119
法定代表人:许现良
客户服务电话:4001-500-882
网址:www.lanmao.com
(36)武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
法定代表人:陶捷
客户服务电话:(027)87006003
网址:www.buyfunds.cn
(37)上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室
办公地址:上海市昆明路518号北美广场A栋1002室
法定代表人:王翔
客户服务电话:(021)65370077
网址:www.jiyufund.com.cn
(38)凤凰金信(银川)投资管理有限公司
住所:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法定代表人:程刚
客户服务电话:400-810-5919
网址:www.fengfd.com
(39)杭州科地瑞富基金销售有限公司
住所:杭州市下城区武林时代商务中心1604室
法定代表人:陈刚
客户服务电话:(0571)86655920
网址:www.cd121.com
(40)北京广源达信投资管理有限公司
住所:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
法定代表人:齐剑辉
客户服务电话:400-623-6060
网址:www.niuniufund.com
(41)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
住所:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人:陈超
客户服务电话:95118、400-098-8511
网址:jr.jd.com
(42)上海华夏财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人:李一梅
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
(43)中民财富管理(上海)有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路100号07层
法定代表人:弭洪军
客户服务电话:400-876-5716
网址:www.cmiwm.com
(44)北京格上富信投资顾问有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
客户服务电话:400-066-8586
网址:www.igesafe.com
(45)北京蛋卷基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层
法定代表人:钟斐斐
客户服务电话:4000-618-518
网址:danjuanapp.com
(46)上海万得投资顾问有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人:王廷富
客户服务电话:400-821-0203
网址:www.520fund.com.cn
(47)上海挖财金融信息服务有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02/03室
法定代表人:胡燕亮
客户服务电话:400-025-6569
网址:www.wacaijijin.com
(48)金惠家保险代理有限公司
住所:北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部
法定代表人:夏予柱
客户服务电话:400-855-7333
网址:www.jhjfund.com
(49)民商基金销售(上海)有限公司
注册地址:上海黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A31室
办公地址:上海市浦东新区张扬路707号生命人寿大厦32楼
法定代表人:贲惠琴
客户服务电话:021-50206003
网址:www.msftec.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:

场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,具体以深圳证券交易所最新公布名单为准。

(二)基金注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所: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:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市黄浦区延安东路222号30楼
办公地址:上海市黄浦区延安东路222号30楼
法定代表人:曾顺福
联系电话:+86 21 61418888
传真:+86 21 63350177
经办注册会计师:胡小骏、冯适
联系人:胡小骏

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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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%;

(4)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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(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%;

(7) 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%;

(8) 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%;

(9) 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%;

(10) 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;

(11)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%;

(12) 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;

(13) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;

(14)本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(15) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%;

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(17)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。

除上述第(4)、(10)、(15)、(16)项以外,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2018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	530,595,788.99	96.27
	其中:债券	530,595,788.99	96.27
	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	-	-
	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	10,656,258.10	1.93
8	其他资产	9,902,393.90	1.80
9	合计	551,154,440.99	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	30,030,000.00	5.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,697,400.00	5.53
	其中:政策性金融债	29,697,400.00	5.53
4	企业债券	125,389,700.00	23.35
5	企业短期融资券	80,733,000.00	15.03
6	中期票据	251,213,000.00	46.78
7	可转债(可交换债)	13,532,688.99	2.52
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	530,595,788.99	98.80

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	101800384	18普洛斯洛华MTN002	300,000	30,318,000.00	5.65
2	180010	18附息国债10	300,000	30,030,000.00	5.59
3	018005	国开1701	210,000	21,126,000.00	3.93
4	101800374	18金茂控股MTN001	200,000	20,346,000.00	3.79
5	101800331	18浏阳城建MTN002	200,000	20,226,000.00	3.77

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	17,707.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,884,386.95
5	应收申购款	299.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,902,393.90

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	113011	光大转债	4,334,400.00	0.81
2	123009	星源转债	1,714,365.45	0.32
3	128029	太阳转债	913,725.54	0.17
4	128038	利欧转债	385,066.00	0.07
5	128027	崇达转债	262,746.00	0.05
6	113019	玲珑转债	179,428.80	0.03
7	110042	航电转债	66,720.00	0.01
8	113009	广汽转债	12,247.20	0.00

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。

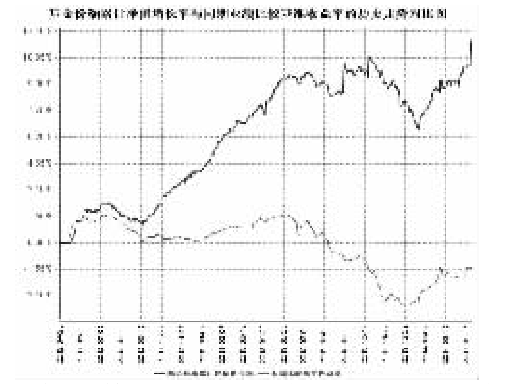
八、基金的业绩

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2018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)

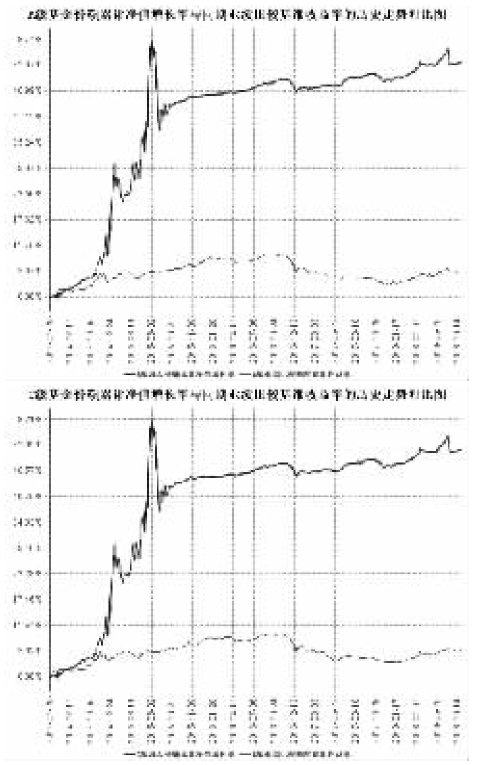
银河通利

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%
2017.01.01-2017.12.31	1.23%	0.05%	-3.38%	0.06%	4.61%	-0.01%
2018.01.01-2018.09.30	2.89%	0.15%	2.74%	0.07%	0.15%	0.08%
自基金合同生效起至今	53.66%	0.47%	6.06%	0.09%	47.60%	0.38%

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%
2017.01.01-2017.12.31	1.00%	0.06%	-3.38%	0.06%	4.38%	0.00%
2018.01.01-2018.09.30	2.61%	0.15%	2.74%	0.07%	-0.13%	0.08%
自基金合同生效起至今	51.35%	0.47%	6.06%	0.09%	45.29%	0.38%

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2018年10月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日(财务数据未经审计),定于2018年12月6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2018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2018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
二〇一八年十二月六日

证券代码:603138 证券简称:海量数据 公告编号:2018-066

北京海量数据技术股份有限公司关于控股股东及实际控制人部分股份质押的公告

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。

2018年12月5日,北京海量数据技术股份有限公司(以下简称"公司")收到控股股东及实际控制人之一朱华威女士通知,获悉朱华威女士将其持有的部分公司限售流通股质押给安信证券股份有限公司,相关质押登记手续已在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理完毕,现将相关情况公告如下:

一、本次股份质押的具体情况

朱华威女士将其持有的公司限售流通股11,390,000股(占公司总股本的7.57%)质押给安信证券股份有限公司,用于办理股票质押式回购交易业务,初始交易日为2018年12月4日,购回交易日为2020年5月12日。

截至本公告披露日,朱华威女士持有公司股份48,583,080股,占公司总股本的32.29%;本次质押后,朱华威女士累计质押11,390,000股,占其所持有公司股份总数的23.44%,占公司总股本的7.57%。

朱华威女士及陈志敏先生合计持有公司股份94,676,400股,占公司总股本的62.93%;本次质押后,陈志敏先生及朱华威女士合计累计质押43,922,000股,占其所持有公司股份总数的46.39%,占公司总股本的29.19%。

二、本次股份质押的其他情况

本次股份质押为朱华威女士个人资金需要。朱华威女士资信状况良好,并具备资金偿还能力,不存在可能引发平仓风险或被强制平仓的情形,不会导致公司实际控制权发生变更,后续如出现平仓风险,朱华威女士将采取包括但不限于补充质押、提前还款等措施应对上述风险。上述股份质押事项若出现其他重大变动情况,公司将按照相关规定及时披露。

特此公告。

北京海量数据技术股份有限公司董事会
2018年12月6日

证券代码:603081 证券简称:大丰实业 公告编号:2018-067

浙江大丰实业股份有限公司
关于公开发行可转债申请文件反馈意见回复的公告

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。

近日,中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")下发《中国证监会行政许可项目审查一次反馈意见通知书》(181568号)(以下简称 "反馈意见") 依法对公司提交的《浙江大丰实业股份有限公司上市公司发行可转换为股票的公司债券核准》 行政许可申请材料进行了审查,要求公司及相关中介机构就有关问题作出书面说明和解释,并在30天内向中国证监会行政许可受理部门提交书面回复意见。

按照中国证监会的要求,公司会同相关中介机构对《反馈意见》所列问题进行了认真研究和逐项答复,现对反馈意见回复进行公开披露,具体内容详见同日刊登在上海证券交易所网站的《浙江大丰实业股份有限公司关于发行可转债申请文件反馈意见的回复》。公司将于上述反馈意见回复披露后2个工作日内向中国证监会报送反馈意见回复材料。

公司本次公开发行可转换为股票的公司债券事项尚需获得中国证监会核准,能否获得核准存在不确定性。公司将根据中国证监会审核进展情况及时履行信息披露义务。敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

浙江大丰实业股份有限公司
董事会
2018年12月5日

股票代码:603218 证券简称:日月股份 公告编号:2018-077

日月重工股份有限公司
关于增加注册资本并修改公司章程的公告

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。

日月重工股份有限公司(以下简称"公司")于2018年12月5日以现场结合通讯表决方式召开了第四届董事会第十一次会议,本次会议应出席会议董事9名,实际出席会议董事9名,本次表决结果以9票同意,0票反对和0票弃权,审议通过了《关于增加注册资本并修改公司章程的议案》。相关事项说明如下:

根据公司《2018年限制性股票激励计划》的规定,公司向160名激励对象授予限制性股票623.00万股,并于2018年11月29日完成首次授予的限制性股票登记手续。本次激励计划限制性股票首次授予登记完成后,公司股本由40,100万股增至40,723万股,注册资本相应由40,100万元增至40,723万元。根据公司2018年第一次临时股东大会的授权,经公司第四届董事会第十一次会议审议通过,公司决定就本次增加注册资本事宜修订公司章程有关条款。

本次公司章程修订的具体内容如下:

原条款	修改后条款
第六条 公司注册资本为人民币40,100万元。	第六条 公司注册资本为人民币40,723万元。
第十九条 公司首次公开发行股票后股本总数为40,100万股,均为普通股。每股1元人民币。	第十九条 公司股份总数为40,723万股,均为普通股,每股面值人民币 1元。

除上述条款外,《公司章程》其他条款不变。修订后的《公司章程》详见上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)。

特此公告。

日月重工股份有限公司
董事会
2018年12月6日

证券代码:603990 证券简称:麦迪科技 公告编号:2018-067

苏州麦迪斯顿医疗科技股份有限公司
关于公司控股股东一致行动人部分股份解除质押的公告

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。

苏州麦迪斯顿医疗科技股份有限公司(以下简称"公司")近日接到公司控股股东翁康先生一致行动人严黄红女士的通知,获悉严黄红女士将其所持有的本公司部分股份办理了解除质押手续,具体事项如下:

一、股东股份解除质押的基本情况

股东名称	解除质押股份	质押开始日期	解除质押日期	质权人	本次解除质押占其所持股份比例	本次解除质押占其及其一致行动人所持股份比例
严黄红	2,450,000股	2017年12月7日	2018年12月4日	中信证券股份有限公司(中信证券宁波银行股票质押定向资产管理计划之管理人)	31.78%	12.41%

二、控股股东及其一致行动人累计质押的情况

控股股东翁康先生直接及间接持有公司股份12,038,856股、一致行动人严黄红女士持有公司股份7,710,000股,控股股东及其一致行动人合计持有公司股份19,748,856股,占公司股份总数的24.49%。

截止本公告日,公司控股股东及其一致行动人累计质押17,278,000股公司股份,占其持有本公司股份总数的87.49%,占公司股份总数的21.43%。

特此公告。

苏州麦迪斯顿医疗科技股份有限公司董事会
2018年12月6日