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2011年12月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2011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：徐朝

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：罗瑞

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

董事长徐旭女士，中共党员，经济学博士。历任中国人保信托投资公司总裁助理、研究中心副主任，中国银河证券有限责任公司分红划部（党委宣传部）负责人、总经理、研究中心主任、总裁办主任兼党委办公室主任、机关党委委员。现任中国银河金融控股有限责任公司党委委员、董事会执行委员会委员。

董事刘澎湃先生，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，大学本科学历，历任中石油大连石化公司财务处副处长，中石油炼油与销售分公司高级会计师，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。

董事鲍人杰先生，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。

董事唐元明先生，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（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），四单支行负责人、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。现任银河基金管理有限公司总经理。

独立董事刘树义先生，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，深圳恒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。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。

监事长刘建先生，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汇林投资有限公司。现任深圳市达晨创业投资有限公司董事长。

监事吕红玲女士，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。

监事余川女士，中共党员，法学硕士。先后任职于华泰证券股份有限公司、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（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），四单支行负责人，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哈尔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），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，6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期并等工作。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。

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秦峰先生、股票投资部总监钱睿南先生、研究部总监刘风华女士。

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：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

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：尹 东

联系电话：010）6759 5003

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（股票代码：939）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股公司首发恒生指数，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2011 年3 月31 日，中国建设银行资产总额113,125.16 亿元，较上年末增加5,021.99 亿元，增长4.65%。2011年一季度，中国建设银行实现净利润472.33 亿元，较上年同期增长34.23%；年化平均资产回报率1.71%，年化加权平均净资产收益率26.19%；利息净收入716.30 亿元，较上年同期增长25.27%；净利差为2.58%，净利息收益率为2.69%，分别较上年同期提高0.28和0.30 个百分点；手续费及佣金净收入231.54 亿元，较上年同期增长37.29%。其中，结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长，收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科设有代表处。设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西宝塔建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司，会计已经运行自动柜员机（ATM）39,874台，拥有员工313,867人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年共获得100 多个国内外奖项，本集团在美国《银行家》杂志公布的 全球商业银行品牌十强”列第二 位，在 全球银行品牌500强”列第13位，并被评为2010年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的 Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三 位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为2010 年度 中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为 中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予 中国红十字杰出事献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队，涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，团队人员上130余人，自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70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，投资托管服务部副总经理（主持工作），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，投资托管服务部副总经理，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。

（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2011年6月30日，中国建设银行已托管195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，2010年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度 国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为 中国最佳次托管银行”。

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，严格监督，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。投资托管服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

投资托管服务部具备系统、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.收到基金管理人的划拨指令后，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、基金份额销售机构

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号中建大厦15楼（邮编：200122）

法定代表人：徐旭

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）38568519（机构服务专线）/ 021）38568507

传真交易电话：021）38568985

联系人：何坪，郑天桦，张鸿

（2）银河基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区月坛西街6号A-F座3楼（邮编：100045）

电话：010）68068788

传真：010）68017906

联系人：郭森慧

（3）银河基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市水荫路2号华信大厦东座9楼12房（邮编：510075）

电话：020）37602205

传真：020）37602384

联系人：李晓鸥

（4）银河基金管理有限公司深圳分公司

地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦1130室（邮编：518048）

电话：0755）82707511

传真：0755）82707599

联系人：史忠民

（5）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号恒运大厦四层（邮编：150001）

电话：0451）53902200

传真：0451）53905528

联系人：孙永林

（6）银河基金管理有限公司南京分公司

地址：江苏省南京市太平南路1号新世纪广场B座805室（邮编：210002）

电话：025）84671297

传真：025）84523725

联系人：牛大恒

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

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：肖钢

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：项俊波

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：上海市仙霞路18号

法定代表人：胡怀邦

联系人：蔡雪

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

联系人：邓炯鹏

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：孔丹

联系人：贾林英

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）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：顾伟国

电话：010）66568430

传真：010）66568536

联系人：田薇

客户服务电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

（13）海邦证券有限责任公司

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：姚文平

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.tebon.com.cn

（14）华龙证券有限责任公司

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东岗西路638号

法定代表人：李晓安

电话：0931）4890208

传真：0931）4890628

联系人：李昕田

客户服务电话：96668、4006898888

网址：www.hlzqgs.com

（15）汇海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

电话：（0451）82269280-225

传真：0451）82287211

联系人：张宇宏

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

（16）华宝证券有限责任公司

住所：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

法定代表人：陈林

电话：021-50122086

传真：021-50122398

联系人：宋歌

客户服务电话：400-820-9898

网址：www.cnhlstock.com

（17）华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦24层

法定代表人：马昭明

电话：0755）82492000

传真：0755）82492962

联系人：盛宗凌

客户服务电话：95513

网址：www.lhzq.com

（18）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）38676666

传真：021）38670666

联系人：芮敏祺

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

（19）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：4008-888-108

网址：www.csc108.com

（20）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

（21）华安证券有限责任公司

住所：安徽省合肥市长江中路357号

办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座24层-32层

法定代表人：李工

电话：0551）5161821

传真：0551）5161600

联系人：甘霖

客户服务电话：96618、400-80-96518

网址：www.hazq.com

（22）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：无锡市县前东街168号国联大厦703室

法定代表人：雷建辉

电话：0510）82831662

传真：0510）82830162

联系人：徐欣

客户服务热线：400-888-5288

网址：www.glsc.com.cn

（23）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351）8686703

传真：0351）8686619

联系人：张治国

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

（24）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：徐浩明

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

（25）湘财证券有限责任公司

住所：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼

法定代表人：收建波

电话：021）68634518

传真：021）68865680

联系人：钟康莺

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

（26）德邦证券股份有限公司

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）22319000

传真：021）22319100

联系人：金芸

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

（27）金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路36号证券大厦4楼

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层

法定代表人：陆涛

电话：0755）83025666@传真：0755）83025625

联系人：马骁清

客户服务电话：400-8888-228

网址：www.jyzq.cn

（28）申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：021）54033888

传真：021）64738844

联系人：李清恒

客户服务电话：021）962505

网址：www. sw2000.com.cn

（29）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

（30）广州证券有限责任公司

住所：广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼

法定代表人：吴志明

电话：020）87323735

传真：020）87325036

联系人：林洁茹

客户服务电话：020）961303

网址：www.gzs.com.cn

（31）华鲁证券有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李林

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

（32）宏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：牛延兴

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

（33）中航证券有限公司

住所：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

（34）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123号

法定代表人：凤良志

电话：0551）2207921

传真：0551）2207965

联系人：李霞

客户服务电话：400-888-8777、95578

网址：www.gyzq.com

（35）东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路59号投资广场18楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦11楼

法定代表人：朱科敏

电话：021）50586660

传真：021）50819897

联系人：李涛

客户服务电话：400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（36）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

（37）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

（38）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：林翠

客户服务电话：010）66045678

网址：www.txsec.com

（39）后达证券股份有限公司

住所：北京市西城区锦市口大街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

（40）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：张腾

客户服务电话：0591）96326

网址：www.hfzq.com.cn

（41）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：李剑阁

电话：010）65053695

传真：010）65058065

联系人：罗春蓉

客户服务电话：010）65051166

网址：www.cicc.com.cn

（42）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：崔海涛

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

（43）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：乔骏

客户服务电话：0571）96336（上海地区962336）

网址：www.ctsec.com

（44）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：0731）85832503

传真：0731）85832214

联系人：郭军瑞

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（45）华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

传真：025）51863323

联系人：万鸣

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（46）民生证券有限责任公司

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：赵明

客户服务电话：400-619-8888

网址：www.mszq.com

（47）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：0755-82570586

传真：0755-82960582

联系人：李珍

客户服务电话：400-102-2011

网址：www.zszq.com.cn

（48）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

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

（49）国海证券股份有限公司

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

（50）中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区香岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510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.zxwt.com.cn

（51）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

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路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：王肖东、朱振武

四、会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所

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、蒋燕华

电话：021）22228888

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

第五节 基金的投资

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。成份股发行或增发 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构建股票投资组合，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，期望较小的跟踪误差，获得较好的指数跟踪效果。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《投资组合策略》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形。

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。本基金对指数的拟合与复制，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分析、成份股流动性的分析和跟踪误差情况等因素，利用数量化模型，确定合理的建仓策略；

3 适步调整：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。

（2）调整条件

当出现股票投资组合需要进行调整的事件或情形时，如在建仓期、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时，或出现其他实际情况时，本基金将对股票投资组合进行调整。特殊情况包括但不限于第（四）节第1条《投资组合策略》中所列示的情形。

（3）调整步骤

1 计算投资组合目标权重：使用多因素最优化模型，求解使跟踪误差最小化的投资组合，作为目标组合，用以替代个股或复制指数；

2 计算投资组合实际权重与目标权重的差值，据此确定组合中买卖股票的品种、买卖方向，以及买卖比例或买卖数量；

3 根据确定的买卖品种、买卖方向、买卖比例或买卖数量，由基金经理发出交易指令，交易员执行交易指令，完成投资组合的调整。

6.投资组合的调整方法

1 定期调整

本基金将根据所跟踪的沪深300 价值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，对投资组合进行