

**银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金  
招募说明书**

**2013 年 11 月**

## 目录

1.	绪言.....	4
2.	释义.....	5
3.	基金管理人.....	12
4.	基金托管人.....	21
5.	相关服务机构.....	25
6.	基金份额的分级和净值计算规则.....	40
7.	基金的募集.....	44
8.	《基金合同》的生效.....	48
9.	银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的上市交易 .....	49
10.	银河沪深 300 成长基金份额的申购和赎回.....	51
11.	基金份额的登记、转托管、非交易过户、冻结与解冻.....	61
12.	基金场内份额配对转换.....	63
13.	基金的投资.....	66
14.	基金的财产.....	81
15.	基金资产估值.....	82
16.	基金的收益与分配.....	89
17.	基金份额折算.....	90
18.	银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的终止运作 .....	98
19.	基金的费用与税收.....	100
20.	基金的会计与审计.....	103
21.	基金的信息披露.....	104
22.	风险揭示.....	110
23.	《基金合同》的变更、终止和基金财产的清算.....	115
24.	《基金合同》摘要.....	118
25.	基金托管协议的内容摘要.....	143
26.	基金份额持有人服务.....	154
27.	其他应披露事项.....	156
28.	招募说明书存放及其查阅方式.....	158
29.	备查文件.....	159

## 重要提示

本基金经中国证监会 2012 年 11 月 28 日证监许可[ 2012 ] 1594 号文核准募集。

基金管理人保证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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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，由于基金投资者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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金的银河沪深 300 成长增强指数基金份额，其预期收益与风险较高，一般而言，其预期收益与风险高于混合型、债券型与货币市场基金份额。从银河沪深 300 成长增强指数基金（场内）份额当中分离出来的银河沪深 300 成长优先份额，其风险收益特性为低风险、预期收益稳定，但在本基金资产出现极端损失的情况下，银河沪深 300 成长优先份额仍可能面临无法取得约定收益乃至本金受损的风险；银

河沪深 300 成长进取份额的风险收益特性为风险较高、预期收益较高；由于本基金的资产及收益将按照约定收益优先分配给银河沪深 300 成长优先的份额持有人，在本基金资产出现损失的情况下，则银河沪深 300 成长进取份额将首先面临本金损失。

投资人认购本基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》，本基金单笔认/申购金额不低于五万元人民币。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为 2013 年 9 月 29 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2013 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。

## 1. 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、以及《银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的《基金合同》编写，并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依《基金合同》取得基金份额，即成为基金份额持有人和本《基金合同》的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅《基金合同》。

## 2. 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

本合同、《基金合同》	《银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充
中国	中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》
元	中国法定货币人民币元
基金或本基金	依据《基金合同》所募集的银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金
招募说明书	《银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金招募说明书》，即用于公开披露涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的文件，及其定期的更新
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	《银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
上市交易公告书	指《银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金之银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长

	进取份额上市交易公告书》
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金份额持有人	根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
基金代销机构	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构，其中深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有中国证监会认可的证券经营资格且具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位
销售机构	基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	银河基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
《基金合同》当事人	受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托

	管人和基金份额持有人
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办 法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机 构、保险公司、证券公司以及其他机构投资者
投资者	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的总称
《基金合同》生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
募集期	自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限
基金存续期	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
日/天	公历日
月	公历月
工作日	上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购	在本基金募集期内，投资者购买本基金基金份额的行为
发售	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金



	份额的行为
申购	《基金合同》生效后，投资人根据《基金合同》和《招募说明书》的规定申请购买本基金基金份额的行为
赎回	《基金合同》生效后，基金投资者根据基金销售网点规定的手续，要求基金管理人将其持有的基金份额兑换成现金的行为
巨额赎回	在单个开放日，银河沪深 300 成长份额的净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日本基金总份额（包括银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额）的 10% 时的情形
上市交易	《基金合同》生效后投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额的行为
系统内转托管	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
跨系统转托管	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为
会员单位	指深圳证券交易所的会员单位
场内	指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统进行基金份额认购、申购、赎回以及上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

场外	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回
注册登记系统	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统
证券登记结算系统	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统
基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金份额的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统
证券账户	指注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户或证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统
交易账户	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户
标的指数	沪深 300 成长指数
银河沪深 300 成长份额	指本基金的基础份额部分。投资者在场外认/申购的银河沪深 300 成长份额不进行基金份额分拆；投资者在场内认购的银河沪深 300 成长份额将自动进行基金份额分离；投资者在场内申购的银河沪深 300 成长份额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆
银河沪深 300 成长 优先份额	指按照《基金合同》约定规则所自动分离或分拆的

	<p>稳定收益类基金份额，是本基金两类分级份额中的一类</p>
银河沪深 300 成长 进取份额	<p>指按照《基金合同》约定规则所自动分离或分拆的积极进取类基金份额，是本基金两类分级份额中的另一类</p>
份额配对转换	<p>指银河沪深 300 成长份额与银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并</p>
自动分离	<p>投资者在场内认购的全部银河沪深 300 成长份额在发售结束后按照 1:1 的比例自动转换为一份银河沪深 300 成长优先份额和一份银河沪深 300 成长进取份额的行为</p>
分拆	<p>指根据《基金合同》约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份银河沪深 300 成长份额的场内份额按照 1:1 的配比分拆成 1 份银河沪深 300 成长优先份额和 1 份银河沪深 300 成长进取份额的行为</p>
合并	<p>指根据《基金合同》约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份银河沪深 300 成长优先份额和 1 份银河沪深 300 成长进取份额按照 1:1 的配比合并成 2 份银河沪深 300 成长份额的场内份额的行为</p>
定期定额投资计划	<p>投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式</p>
基金利润	<p>基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额</p>
基金资产总值	<p>基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息</p>

	和本基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的价值
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
指定媒体	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
不可抗力	本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 3. 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：徐旭

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	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	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企划部(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，工商管理硕士。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经理，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。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。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）、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。现任银河基金管理有限公司总经理。

独立董事孙树义先生，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，国家地震局副局长，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。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。

监事长刘昼先生，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。

监事吴磊先生，中共党员，博士研究生学历。先后任职于中融基金管理有限公司公司、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）、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，8 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。

### 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索峰先生，总经理助理兼股票投资部总监钱睿南先生，研究部总监刘风华女士。

上述人员之间均无亲属关系。

## 三、基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

2、办理基金备案手续；

3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报



告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按法律法规规定的年限保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

23、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

24、建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

25、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 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、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 六、基金经理承诺

- 1、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 七、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理

方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是对各项基本管理制度的总揽和指导,内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

## 2、内部控制原则

**健全性原则。**内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

**有效性原则。**通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内部控制制度的有效执行。

**独立性原则。**公司各机构、部门、和岗位在职能上应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

**相互制约原则。**公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡,并通过切实可行的措施来实行。

**成本效益原则。**公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性,运用科学化的方法尽量降低经营运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、主要内部控制制度

### (1) 内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责,并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报

销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

### （2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

### （3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名，董事会聘任，并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外，督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要，有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议，有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况；检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

## 4. 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

注册日期：1988 年 7 月 20 日

注册资本：127.02 亿元人民币

托管部门联系人：周频

电话：021-62677777-212017

传真：021-62159217

#### （二）发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，注册资本 127.02 亿元。开业二十三年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2012 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达到 32,509.75 亿元，归属于母公司股东权益 1695.77 亿元，不良贷款比率为 0.43%，全年实现归属于母公司股东的净利润 347.18 亿元。在英国《银行家》杂志本月最新发布的 2013 年全球银行 1000 强排名中，兴业银行按一级资本排名第 55 位，按资产总额排名第 50 位。美国《财富》杂志公布了 2013 年《财富》世界 500 强排行榜，兴业银行（601166）入围并居榜单第 428 位。

#### （三）托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处和养老金管理中心等处室，共有员工 90 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

#### （四）基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业



务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截止 2013 年 9 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金 20 只——兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全保本混合型证券投资基金、中邮战略新兴产业证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金、工银瑞信金融地产股票型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强证券投资基金，托管基金财产规模 337.03 亿元。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，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

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，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。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### （三）内部风险控制原则

1、全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

2、独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

3、相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

4、定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

5、防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

6、有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

7、审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；

8、责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

#### （四）内部控制制度及措施

1、制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

5、人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

6、应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 三、基金托管人对基金管理人进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金



法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

## 5. 相关服务机构

### (一) 销售机构

#### 1、直销机构

##### (1) 银河基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层

法定代表人：徐旭

网址：[www.galaxyasset.com](http://www.galaxyasset.com)（支持网上交易）

客户服务电话：400-820-0860

直销业务电话：(021)38568981/ 38568507

传真交易电话：(021)38568985

联系人：赵冉、郑夫桦、张鸿

##### (2) 银河基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区西直门外大街 1 号西环广场 T3 座 15 楼 B5(邮编：100044)

电话：(010) 58301616

传真：(010) 58301156

联系人：郭森慧

##### (3) 银河基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区珠江新城临江大道 39 号碧海湾 D 区三楼银河证券内(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：哈尔滨市南岗区花园街 310 号苏宁电器 5 层银河基金(邮编：150001)

电话：(0451) 53928808

传真：(0451) 53905578

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) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(2) 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：蒋超良

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(3) 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](http://www.bankcomm.com)

(4) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(5) 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

(6) 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

(7) 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

(8) 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) 54038844

联系人：李清怡

客户服务电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn

(9) 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

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

(10) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：(0755) 82130833

传真：(0755) 82133952

联系人：齐晓燕

客户服务热线：95536

网址：www.guosen.com.cn

(11) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 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

(12)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

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

(13) 中信证券股份有限公司

注所：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 层经纪业务管理部

法定代表人：王东明

电话：(010) 84683893

传真：(010) 84685560

联系人：陈忠

客服电话：95558

网址：www.cs.ecitic.com

(14) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 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

电话：(0532) 85022326

传真：(0532) 85022605

联系人：吴忠超

客户服务电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

(15) 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

(16) 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

(17) 德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：4008888128

网址：www.tebon.com.cn

(18) 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 17 楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19 楼

法定代表人：刘东

电话：(020)88836999

传真：(020)88836654

联系人：林洁茹

客户服务电话：020-961303

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(19) 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)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](http://www.hlzqgs.com)

(20) 华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

电话：(0551)65161666

传真：(0551)5161600

联系人：甘霖

客户服务电话：96518（安徽），4008096518（全国）

网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(21) 东海证券有限责任公司

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](http://www.longone.com.cn)

(22) 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：北京市朝阳区门内大街 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

(23) 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：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号

法定代表人：雷建辉

电话：(0510)82831662

传真：(0510)82830162

联系人：沈刚

客户服务热线：95570

网址：www.glsc.com.cn

(24) 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

(25) 江海证券有限公司

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

(26) 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/ jijin.txsec.com

(27) 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

(28) 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

(29) 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、武明明

客户服务电话：010-65051166

网址：www.cicc.com.cn

(30) 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

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

网址：www.pingan.com

(31) 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

(32) 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

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中山 29 层

法定代表人：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](http://www.zszq.com.cn)

(33) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号

法人：吴万善

办公地址：南京市中山东路 90 号

电话：025-83290979；0755-82569143

传真：025-84579763；0755-82492962

联系人：孔晓君

客户服务电话：95597

网址：<http://www.htsc.com.cn/>

(34) 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

办公地址：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：021-68778079

传真：021-5012 2398

联系人：李曼

客户服务电话：400-820-9898

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

(35) 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、4008888111

网址：<http://www.newone.com.cn>

(36) 方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

办公地址：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：010-57398059

传真：010-57398058

联系人：刘丹

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（37）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

（38）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

法人：矫正中

办公地址：长春市自由大路 1138 号

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

（39）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

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、第三方销售机构：

#### (1) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：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

注册地址：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：400-700-9665

公司网站：www.howbuy.com

#### (3) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市江南大道 3588 号

办公地址：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

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、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 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：400-6788-887

公司网站：www.zlfund.cn 或 www.jjmmw.com

#### (5) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-089-1289

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(6)和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 1002 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 18 层

法定代表人：王莉

全国统一客服电话：400-920-0022/ 021-20835588

公司网站：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(7)北京展恒基金销售有限公司

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

全国统一客服电话：400-888-6661

公司网站：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

3、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) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区太平桥大街 17 号

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：上海源泰律师事务所

地址：浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

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

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、蒋燕华

电话：(021)22288888

传真：(021)22280000

联系人：蒋燕华



## 6. 基金份额的分级和净值计算规则

### 一、基金份额的结构

本基金的基金份额包括银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额。

银河沪深 300 成长份额可按照 1:1 的比例分拆为银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额，银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额也可以按照上述比例合并为银河沪深 300 成长份额，银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的数量保持 1:1 的比例不变。

### 二、基金的基本运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售银河沪深 300 成长份额。投资者场外认购所得的份额，不进行分拆。投资者场内认购所得的份额，将按 1:1 的基金份额配比自动分离为银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额。投资者场内认购所得的银河沪深 300 成长份额的自动分离，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。

根据银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的基金份额比例，银河沪深 300 成长优先份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，银河沪深 300 成长进取份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，且两类基金份额的基金资产合并运作。

2、《基金合同》生效后，银河沪深 300 成长份额将根据《基金合同》约定分别开放场外和场内申购、赎回，但不上市交易。在满足上市条件的情况下，银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额将申请上市交易，但是不开放申购和赎回等业务。

3、《基金合同》生效后，基金管理人申请银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额上市交易，办理银河沪深 300 成长份额与银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额之间的份额配对转换业务。

4、投资者可在场内申购和赎回银河沪深 300 成长份额，也可选择将其持有的银河沪深 300 成长份额的场内份额按 1:1 的比例分拆成银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额后进行二级市场交易。

5、投资者可在二级市场买入或卖出银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额，也可以将其持有的上述两类份额按照 1:1 的配比合并为银河沪深 300 成长份额后进行赎回。

6、投资者可在场外申购和赎回银河沪深 300 成长份额。场外认购和申购的银河沪深 300 成长份额不进行份额配对转换，但《基金合同》另有规定的除外。场外的银河沪深 300 成长份额可以通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的银河沪深 300 成长份额配对转换规则进行操作。

7、无论是定期份额折算，还是不定期份额折算（有关本基金的份额折算详见《基金合同》“21. 基金份额折算”），其所产生的银河沪深 300 成长份额不进行自动分离。投资者可选择将上述折算产生的银河沪深 300 成长份额按 1: 1 的比例分拆为银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额。

### 三、银河沪深 300 成长份额的份额净值计算规则

T 日银河沪深 300 成长份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数。

其中：

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

本基金 T 日基金份额总数为银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额数量的总和。

### 四、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的净值计算规则

银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额具有不同的净值计算规则，即银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的风险和收益特征不同。

在基金的存续期内，基金将在每个工作日按照《基金合同》约定的净值计算规则对银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额分别进行基金份额净值计算。

基金净资产优先分配银河沪深 300 成长优先份额的本金及银河沪深 300 成长优先份额的约定收益，银河沪深 300 成长优先份额为低风险且预期收益相对稳定

的基金份额；本基金在优先分配银河沪深 300 成长优先份额的本金及银河沪深 300 成长优先份额的约定收益后的剩余净资产分配予银河沪深 300 成长进取份额，银河沪深 300 成长进取份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。

在基金存续期内，银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的净值计算规则如下：

1、银河沪深 300 成长优先份额的约定收益率为“一年期银行定期存款年利率（税后）+3.5%”。其中计算银河沪深 300 成长优先份额约定收益率的一年期银行定期存款年利率（税后）是指《基金合同》生效日或生效后每年 1 月 1 日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期存款基准年利率，年基准收益以 1.00 元为基准进行计算。

2、基金每个工作日对银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额进行净值计算。在进行银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额各自的净值计算时，基金净资产优先确保银河沪深 300 成长优先份额的本金及银河沪深 300 成长优先份额累计约定应得收益，之后的剩余净资产计为银河沪深 300 成长进取份额的净资产。银河沪深 300 成长优先份额累计约定应得收益，由银河沪深 300 成长优先份额约定每日收益率乘以截至计算日银河沪深 300 成长优先份额应计收益的天数进行单利计算确定；银河沪深 300 成长优先份额约定每日收益率=银河沪深 300 成长优先份额约定年收益率/当年天数。

3、每 2 份银河沪深 300 成长份额所代表的资产净值等于 1 份银河沪深 300 成长优先份额和 1 份银河沪深 300 成长进取份额的资产净值之和。

4、在本基金的《基金合同》生效日所在会计年度或存续的某一完整会计年度内，若未发生《基金合同》规定的不定期份额折算，则银河沪深 300 成长优先份额在净值计算日应计收益的天数按自《基金合同》生效日至计算日或该会计年度年初至计算日的实际天数计算；若发生《基金合同》规定的不定期份额折算，则银河沪深 300 成长优先份额在净值计算日应计收益的天数应按照最近一次该会计年度内不定期份额折算日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证银河沪深 300 成长优先份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在某一会计年度内本基金财产出现极端损失情况下，银河沪深 300 成长优先份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

五、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的净值计算依据银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的净值计算规则。按照下述的公式分别计算并公告 T 日银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值：

$$NAV_{\text{银河沪深300成长优先}} = 1 + \frac{R * t}{\text{当年天数}}$$

$$NAV_{\text{银河沪深300成长进取}} = \frac{NAV_{\text{银河沪深300成长}} - 0.5NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}}{0.5}$$

R 银河沪深 300 成长优先份额约定年收益率；

设 T 日为基金份额净值计算日，T=1, 2, 3...N；N 为当年实际天数；t=min{自年初至 T 日，自《基金合同》生效日至 T 日，自最近一次会计年度内份额折算日至 T 日}；

$NAV_{\text{银河沪深300成长}}$  为 T 日每份银河沪深 300 成长份额的基金份额净值；

$NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}$  为 T 日银河沪深 300 成长优先份额的基金份额净值；

$NAV_{\text{银河沪深300成长进取}}$  为 T 日银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值。

银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 7. 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会[2012]1594号文批准募集。

本基金为契约型开放式基金。基金存续期限为不定期。

### 一、募集期

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

### 二、发售对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### 三、发售方式和销售渠道

本基金将通过场外和场内两种方式公开发售。场外将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点发售，场内将通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位发售，具体名单详见发售公告或相关业务公告。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的上市交易。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者人自行承担。

#### 四、认购费用

- 1、基金份额初始面值：每份基金份额初始面值为人民币 1 元
- 2、认购价格：初始面值
- 3、投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。本基金场内、场外采用相同的认购费率，具体如下：

场内/场外	认购
M<50 万	1.0%
50 万≤M<200 万	0.6%
200 万≤M<500 万	0.2%
M≥500 万	1000 元/笔

#### 五、认购期利息的处理方式

《基金合同》生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，不得动用。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

#### 六、基金认购份额的计算

##### （一）场外认购份额的计算

1、基金场外认购采用“金额认购、份额确认”的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额面值}$$

例：某投资者投资 10 万元认购本基金，该笔认购产生利息 50 元。则其可得到的认购份额为：

$$\text{净认购金额} = 100,000 / (1 + 1.0\%) = 99,009.90 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000 - 99,009.90 = 990.10 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (99,009.90 + 50) / 1.00 = 99,059.90 \text{ 份}$$

2、场外认购份额的计算中，涉及基金份额和金额的计算结果均按四舍五入



方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后部分舍去，余额计入基金财产。

## （二）场内认购份额的计算

1、基金场内认购采用“份额认购、份额确认”的方式，计算公式为：

净认购金额 = 认购份额 × 挂牌价格

认购费用 = 认购份额 × 挂牌价格 × 认购费率

认购金额 = 净认购金额 + 认购费用

认购利息结转份额 = 认购利息 / 挂牌价格

实得认购份额 = 认购份额 + 认购利息结转份额

例：某投资者通过场内认购本基金 100,000.00 份，且认购期利息为 50.50 元，则其可得到的认购份额为：

净认购金额 = 100,000.00 × 1.00 = 100,000.00 元

认购费用 = 100,000.00 × 1.00 × 1.0% = 1000.00 元

认购金额 = 100,000.00 × 1.00 + 1000 = 101,000.00 元

认购利息结转份额 = 50.50 / 1.00 = 50 份

实得认购份额 = 100,000.00 + 50 = 100,050 份

2、认购期内本基金份额的面值为 1.00 元，挂牌价格为基金份额初始面值。

3、场内认购金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额采用截位法保留至整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

## 七、基金认购金额的限制

投资者通过直销机构和场外代销机构首次认购银河沪深 300 成长基金份额单笔认购金额不得低于 50,000 元，追加认购银河沪深 300 成长基金份额单笔最低限额为人民币 50,000 元。

投资者通过场内认购银河沪深 300 成长基金份额单笔认购份额不得低于 50,000 份，超过 50,000 份的须为 1,000 份的整数倍，且每笔认购最大不超过

99,999,000 份基金份额。

#### 八、基金份额的认购和持有限额

基金管理人不对每个账户的认购和持有基金份额进行限制。



## 8. 《基金合同》的生效

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内,在基金募集份额总额不少于 2 亿份,基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金份额持有人人数不少于 200 人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在 10 日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起 10 日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

《基金合同》生效时,认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归基金份额持有人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### 二、《基金合同》不能生效时募集资金的处理方式

如果《基金合同》不能生效,基金管理人应当承担下列责任:

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息。
- 3、如《基金合同》不能生效,基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续 20 个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

## 9. 银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的上市交易

一、银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的上市与交易

《基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额将分别申请在深圳证券交易所上市交易，交易代码不同。

二、上市交易的地点

深圳证券交易所。

银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额上市后，登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司场内证券登记结算系统中的银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在中国证券登记结算有限责任公司注册登记系统中的银河沪深 300 成长份额通过办理跨系统转托管业务转至场内证券登记结算系统并分拆成银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额后，方可上市交易。

三、上市交易的时间

本《基金合同》生效后三个月内，银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额将申请在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒体上刊登银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额上市交易公告书。

四、上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定，包括但不限于：

1、银河沪深 300 成长份额所分离的银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额以不同的交易代码上市交易，两类基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日两类基金份额的净值；

2、银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；

3、银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；

4、银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；

5、银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

#### 五、上市交易的费用

银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额上市交易的费用，按照深圳证券交易所的有关规定办理，从基金财产中列支。

#### 六、上市交易的行情揭示

银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值。

#### 七、上市交易的停复牌、暂停上市交易、恢复上市交易和终止上市

银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的停复牌、暂停上市交易、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。

八、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定进行调整的，本基金《基金合同》相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 10. 银河沪深 300 成长基金份额的申购和赎回

《基金合同》生效后，投资者可以通过场外或场内方式申购赎回银河沪深 300 成长份额。银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额不接受投资者的申购赎回。

### 一、申购与赎回场所

银河沪深 300 成长份额的场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点，银河沪深 300 成长份额的场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位，具体销售网点和会员单位的名单将由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

银河沪深 300 成长份额的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

银河沪深 300 成长份额申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

若出现新的证券市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人不得在《基金合同》约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在《基金合同》约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换的价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即银河沪深 300 成长份额的申购、赎回价格以申请当日收市后计算的银河沪深 300 成长份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即银河沪深 300 成长份额的申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、场外赎回遵循“先进先出”原则，即基金份额持有人在场外销售机构赎回银河沪深 300 成长份额时，按照基金份额持有人场外认购、申购确认的先后次序进行顺序赎回；亦即对该基金份额持有人在该场外销售机构托管的基金份额进行处理时，认购、申购确认日期在先的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、银河沪深 300 成长份额当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5、投资者通过场外申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司开立的深圳开放式基金账户，通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的证券账户（人民币普通股票账户或证券投资基金账户）；

6、银河沪深 300 成长份额的申购、赎回等业务，按照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

7、基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

### 四、申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购银河沪深 300 成长份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的银河沪深 300 成长份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

### 2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整并公告。

### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整并公告。

## 五、申购与赎回的数额限制

### 1、基金申购的限制

银河沪深 300 成长基金份额场外首次申购和追加申购的最低金额均为 10 元、场内的首次申购和追加申购的最低金额均为 50,000 元，基金代销机构另有规定的，以基金代销机构的规定为准；

### 2、基金赎回的限制



每次赎回的基金份额不得低于 10 份,场外赎回的最低份额为 10 份基金份额;场内赎回时,赎回的最低份额为 10 份基金份额,同时赎回份额必须是整数份额,并且单笔赎回最多不超过 99,999,999 份基金份额。

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。若某投资者托管的基金份额不足 10 份或其某笔赎回导致该持有人托管的基金份额不足 10 份的,投资者在赎回时需一次全部赎回,否则将自动赎回。

3、本基金不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制;

4、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 六、申购费用和赎回费用

1、本基金场内、场外采用相同的申购费率:

场内/场外	申购
M<50 万	1.2%
50 万≤M<200 万	0.8%
200 万≤M<500 万	0.4%
M≥500 万	1000 元/笔

申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、本基金赎回费率如下表所示:

场外	赎回
n<1 年	0.5%
1 年≤n<2 年	0.2%
n≥2 年	0

场内	赎回
固定	0.5%

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其



他必要的手续费。

3、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 八、申购份额与赎回金额的计算

### 1、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

例：某投资者投资 10 万元申购本基金，对应费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.016 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.016 = 97,258.10 \text{ 份}$$

### 2、基金赎回金额的计算

赎回金额的计算公式为：

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

例 1：某投资者赎回场外本基金 10 万份基金份额，持有期为 1 年两个月，对应的赎回费率为 0.2%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 =  $100,000 \times 1.016 \times 0.2\% = 203.20$  元

赎回金额 =  $100,000 \times 1.016 - 203.2 = 101,396.8$  元

例 2：某投资者赎回场内本基金 10 万份基金份额，持有期为 1 年两个月，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 =  $100,000 \times 1.016 \times 0.5\% = 508.00$  元

赎回金额 =  $100,000 \times 1.016 - 508.00 = 101,092.00$  元

### 3、基金份额净值的计算

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 4、申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算。场外申购涉及金额、份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内申购涉及金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；场内申购涉及份额的计算结果采用截位法保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

### 5、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准来计算并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 九、申购和赎回的注册登记

1、银河沪深 300 成长份额采用分系统登记的原则。场外申购的银河沪深 300 成长份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内申购的银河沪深

300 成长份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2、登记在注册登记系统和证券登记结算系统中的银河沪深 300 成长份额可通过基金销售机构申请赎回，但不可卖出。

3、投资者申购银河沪深 300 成长份额成功后，在正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分银河沪深 300 成长份额。

4、投资者赎回银河沪深 300 成长份额成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

5、本基金申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

6、基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 十、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

出现如下情形之一时，基金管理人可以暂停或拒绝基金投资者对银河沪深 300 成长份额的申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （3）发生本《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况。
- （4）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （5）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- （6）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，基金管理人决定暂停接受申购申请的，应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

## 十一、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

出现如下情形之一时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人对银河沪深 300 成长份额的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- (1) 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- (2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 发生本《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况。
- (4) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- (5) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（4）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒体上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在指定媒体上公告。

## 十二、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，银河沪深 300 成长份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日本基金总份额（包括银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额，下同）的 10%时，即认

为发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的场外处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日本基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 暂停赎回：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上公告。

(4) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒体刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

## 3、巨额赎回的场内处理方式

对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤销，深圳证券交易所或注册登记机构另有规定的除外。巨额赎回业务的场内处理，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

## 十三、其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准或备案。

基金管理人应当在指定媒体刊登暂停公告。

#### 十四、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应及时向中国证监会备案，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒体上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### 十五、基金的转换

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

#### 十六、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。



## 11. 基金份额的登记、转托管、非交易过户、冻结与解冻

### 一、基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的银河沪深 300 成长份额，登记在注册登记系统中持有人的开放式基金账户下；场内认购、申购的银河沪深 300 成长份额，或上市交易的银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额，登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的银河沪深 300 成长份额，可以直接申请场内赎回，但不在深圳证券交易所上市交易，登记在证券登记结算系统中的银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按 1: 1 的份额数配比申请合并为银河沪深 300 成长份额后，再申请场内赎回。

3、登记在注册登记系统中的银河沪深 300 成长份额，既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后，转至证券登记结算系统，由基金份额持有人申请，按 1: 1 的份额数配比分拆为银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额，在深圳证券交易所上市。

### 二、系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、本基金系统内转托管按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。处于募集期内的基金份额不能办理系统内转托管。

3、银河沪深 300 成长份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4、银河沪深 300 成长份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（席位）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。



5、基金销售机构可以按照相关规定，向基金份额持有人收取转托管费。

### 三、跨系统转托管

1、跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的银河沪深 300 成长份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2、银河沪深 300 成长份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。基金销售机构可以按照相关规定，向基金份额持有人收取转托管费。

3、处于募集期内的基金份额不能办理跨系统转托管。

四、注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻、质押等业务，并收取一定的手续费用。

## 12. 基金场内份额配对转换

《基金合同》生效后，本基金将根据《基金合同》约定，办理银河沪深 300 成长份额与银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额之间的份额配对转换业务。

### 一、份额配对转换

1、份额配对转换：指根据《基金合同》约定，银河沪深 300 成长份额与银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。

#### 2、分拆

分拆指根据《基金合同》约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份银河沪深 300 成长份额的场内份额按照 1：1 的份额配比转换成 1 份银河沪深 300 成长优先份额与 1 份银河沪深 300 成长进取份额的行为。

#### 3、合并

合并指根据《基金合同》约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份银河沪深 300 成长优先份额与 1 份银河沪深 300 成长进取份额按照 1：1 的基金份额配比转换成 2 份银河沪深 300 成长份额的场内份额的行为。

4、场外的银河沪深 300 成长份额不进行份额配对转换。在场外的银河沪深 300 成长份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

### 二、业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。基金投资者应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、基金注册登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

### 三、业务办理时间

份额配对转换自银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额上

市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

#### 四、份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请分拆为银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的银河沪深 300 成长份额的场内份额必须是偶数。

3、申请合并为银河沪深 300 成长份额的银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。

4、场外的银河沪深 300 成长份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为场内的银河沪深 300 成长份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前在指定媒体上公告。

#### 五、业务办理程序

场内份额配对转换程序，遵循深圳证券交易所、注册登记机构的最新业务规则，具体见相关业务公告。

#### 六、暂停场内份额配对转换的情形

1、深圳证券交易所、注册登记机构、业务办理机构因异常情况无法办理该业务的情形。

2、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情况之一的，基金管理人应在指定媒体上予以公告。在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照

有关规定在指定媒体上公告。

#### 七、业务办理费用

投资者申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可酌情收取一定的费用或佣金，具体规定见相关业务办理机构公告。

## 13.基金的投资

### 一、投资目标

本基金为增强型股票指数基金，力求对沪深 300 成长指数进行有效跟踪，在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。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 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。

### 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、权证、央行票据、现金、股指期货等，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（但须符合中国证监会得相关规定）。股票投资包括沪深 300 成长指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）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，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%。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。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%，此项调整无需召开基金份额持有人大会。

### 三、投资理念

以指数化投资，为投资者提供一个投资沪深 300 成长指数的有效投资工具，以增强型策略提高指数化投资效率，以使投资者可以更有效地分享中国经济中长期增长的成果。

### 四、投资策略

本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在有效复制目标指数的基础上，在一定程度上调整个股在投资组合中的权重，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。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，改进指数跟踪效果。

### （一）股票投资策略

本基金股票资产投资采用指数增强复制策略，即根据沪深 300 成长指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整；同时，在严格控制跟踪误差前提下，本基金将采用量化增强及其他辅助增强策略，对投资组合进行进一步调整，剔除或低配部分标的指数成份股，以期达到增强投资的目的。

#### （1）指数复制策略

本基金通过指数复制策略进行指数化投资。通常情况下，指数复制策略是指根据标的指数成份股在指数中的权重来确定成份股的买卖数量。在买卖成份股的过程中，尤其在基金建仓期间，本基金可采取适当方法，以降低交易成本。

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  $\alpha$  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  $\alpha$  增强策略。

##### 1) 成份股多因子量化 $\alpha$ 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作为交易标的。

## 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) 投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）投资组合限制

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它比例限制。

(10) 法律法规以及监管机构规定的其它投资限制；

(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 Z 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



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。

本基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2013 年 06 月 30 日，本报告所列数据未经审计。

#### (一) 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	115,578,059.11	59.13
	其中：股票	115,578,059.11	59.13
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	25,000,000.00	12.79
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	54,605,658.26	27.93
6	其他资产	291,923.58	0.15
7	合计	195,475,640.95	100.00

#### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 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	699,917.89	0.42
C	制造业	62,002,375.19	37.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	812,858.76	0.49
E	建筑业	5,109,438.01	3.07
F	批发和零售业	1,396,466.56	0.84
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	745,454.90	0.45

J	金融业	25,954,836.29	15.58
K	房地产业	5,310,415.76	3.19
L	租赁和商务服务业	1,661,472.02	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,398,683.54	1.44
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	4,848,569.12	2.91
	合计	110,940,488.04	66.62

## 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	1,934,900.00	1.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	676,000.00	0.41
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	233,011.00	0.14
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	1,793,660.07	1.08
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	4,637,571.07	2.78

(三) 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

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	600519	贵州茅台	51,656	9,937,064.72	5.97
2	601328	交通银行	1,771,108	7,208,409.56	4.33
3	600016	民生银行	796,577	6,826,664.89	4.10
4	000651	格力电器	268,924	6,739,235.44	4.05
5	600256	广汇能源	354,489	4,594,177.44	2.76
6	600036	招商银行	363,378	4,215,184.80	2.53
7	601818	光大银行	1,365,296	3,945,705.44	2.37
8	000538	云南白药	44,815	3,764,908.15	2.26
9	600000	浦发银行	453,970	3,758,871.60	2.26
10	600048	保利地产	359,987	3,567,471.17	2.14

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	600315	上海家化	30,000	1,349,700.00	0.81
2	000826	桑德环境	29,925	965,679.75	0.58
3	300070	碧水源	21,974	827,980.32	0.50
4	600886	国投电力	200,000	676,000.00	0.41
5	002048	宁波华翔	70,000	585,200.00	0.35

(四) 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

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证

### （八）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 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。

#### 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。

### （九）投资组合报告附注

1.云南白药股份有限公司于 2012 年 12 月 25 日公告：公司产品云南白药胶囊在四川泸州药检所抽检中被发现水分项不合格，公司已对相关产品进行召回，召回金额占公司上年度收入的万分之 1.19，公司公告其生产经营情况正常。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

根据 2013 年 2 月 23 日贵州茅台股份有限公司公告，公司于 2013 年 2 月 22 日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》（黔价处[2013]1 号）。该决定书认为：贵州茅台酒销售有限公司对全国经销商向第三人销售茅台酒的最低价格进行限定，违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。为此，根据《中华人民共和国反垄断法》第四十六条、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条的规定给予处罚，限贵州茅台酒销售有限公司自收到该决定书之日起十五日内将罚款二亿四千七百万人民币上交国库。贵州茅台股份公司已针对该处罚决定进行了整改，取消了对经销商向第三人销售茅台酒的最低限价要求。本基金管理人认为贵州茅台股份公司受此处罚决定的负面影响已基本消化。本基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

报告期内本基金投资的前十名证券中的其余八名股票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。

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。

#### 3.其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	62,095.79
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	133,194.32
4	应收利息	39,951.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	56,682.38
8	其他	-
9	合计	291,923.58

#### 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

#### 5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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不存在流通受限情况

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不存在流通受限情况

## 14.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预示其未来表现。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 2013 年 6 月 30 日）

### 1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金合 同生效起 至今	-1.90%	0.55%	-10.22%	1.41%	8.32%	-0.86%

注：2013 年 03 月 29 日本基金成立，根据《银河沪深 300 成长增强指数分级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。截止本报告期末，本基金成立未满一年。

## 15.基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 16.基金资产估值

### 一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的银河沪深 300 成长份额的基金份额净值，是计算银河沪深 300 成长份额申购与赎回价格以及计算银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值的基础。

### 二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常工作日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证、央行票据、现金、股指期货等资产及负债。

### 四、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式发送给基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，以双方认可的方式发送给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### 五、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交



易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、股票指数期货合约估值方法：股票指数期货合约以结算价格进行估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 六、基金份额净值的计算

### 1、银河沪深 300 成长份额净值的计算

T 日银河沪深 300 成长份额净值 = T 日基金资产净值 / T 日基金份额总数

其中：

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

本基金 T 日基金份额总数为银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额数量的总和。

### 2、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的净值计算

依据银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的净值计算规则。按照下述的公式分别计算并公告 T 日银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值：

$$NAV_{\text{银河沪深300成长优先}} = 1 + \frac{R * t}{\text{当年天数}}$$

$$NAV_{\text{银河沪深300成长进取}} = \frac{NAV_{\text{银河沪深300成长}} - 0.5NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}}{0.5}$$

R 银河沪深 300 成长优先份额约定年收益率；

设 T 日为基金份额净值计算日，T=1, 2, 3...N；N 为当年实际天数；t=min{自年初至 T 日，自《基金合同》生效日至 T 日，自最近一次会计年度内份额折算日

至 T 日}；

$NAV_{\text{银河沪深300成长}}$  为 T 日每份银河沪深 300 成长份额的基金份额净值；

$NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}$  为 T 日银河沪深 300 成长优先份额的基金份额净值；

$NAV_{\text{银河沪深300成长进取}}$  为 T 日银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值。

银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 七、基金份额净值的确认和估值错误的处理

银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额任一类别基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额任一类别基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错责任方应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同

行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错责任方追偿。

(6) 如果出现差错责任方未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决

对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 基金管理人及基金托管人对银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额任一类别基金份额净值计算错误偏差达到各自类别的基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人对银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额任一类别基金份额净值计算错误偏差达到各自类别的基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

## 八、暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人不能出售基金资产或无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；

4、中国证监会认定的其他情形。

## 九、特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。



## 17.基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

在存续期内，本基金（包括银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。



## 18. 基金份额折算

### 一、定期份额折算

在银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额存续期内的每个会计年度（除《基金合同》生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### （一）基金份额折算基准日

每个会计年度第一个工作日。

#### （二）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额。

#### （三）基金份额折算频率

每年折算一次。

#### （四）基金份额折算方式

银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额按照《基金合同》第四部分“基金份额的分类与净值计算规则”进行净值计算，对银河沪深 300 成长优先份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份银河沪深 300 成长份额将按 1 份银河沪深 300 成长优先份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

对于银河沪深 300 成长优先份额期末的约定应得收益，即银河沪深 300 成长优先份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出 1.000 元部分，将折算为场内银河沪深 300 成长份额分配给银河沪深 300 成长优先份额持有人。银河沪深 300 成长份额持有人持有的每 2 份银河沪深 300 成长份额将按 1 份银河沪深 300 成长优先份额获得新增银河沪深 300 成长份额的分配。持有场外银河沪深 300 成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外银河沪深 300 成长份额的分配；持有场内银河沪深 300 成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内银河沪深 300 成长份额的分配。

经过上述份额折算，银河沪深 300 成长份额和银河沪深 300 成长优先份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对银河沪深 300 成长份额和银河沪深 300 成长优先份额进行应得收益的定期份额折算。

### 1、银河沪深 300 成长份额

$$NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{后}} = NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}} - 1.000)$$

$$\text{银河沪深 300 成长份额持有人新增的银河沪深 300 成长份额} = \frac{0.5 \times NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前银河沪深 300 成长份额净值

$NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后银河沪深 300 成长份额净值

$NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前银河沪深 300 成长优先份额净值

$NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前银河沪深 300 成长份额的份额数

银河沪深 300 成长份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；银河沪深 300 成长份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

### 2、银河沪深 300 成长进取份额

每个会计年度的定期份额折算不改变银河沪深 300 成长进取份额净值及其份额数。

### 3、银河沪深 300 成长优先份额

定期份额折算后银河沪深 300 成长优先份额的基金份额净值=1.000 元

定期份额折算后银河沪深 300 成长优先份额的份额数 = 定期份额折算前银河沪深 300 成长优先份额的份额数

银河沪深 300 成长优先份额持有人新增的场内银河沪深 300 成长份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后银河沪深 300 成长份额净值

$NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前银河沪深 300 成长优先份额净值

$NUM_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前银河沪深 300 成长优先份额的份额数

4、定期份额折算后银河沪深 300 成长份额的份额数 = 定期份额折算前银河沪深 300 成长份额的份额数 + 银河沪深 300 成长份额持有人新增的银河沪深 300 成长份额的份额数 + 银河沪深 300 成长优先份额持有人新增的银河沪深 300 成长份额的份额数

#### （五）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的上市交易和银河沪深 300 成长份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （六）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

#### （七）特殊情形的处理

若在某一会计年度最后一个工作日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

## 二、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当银河沪深 300 成长份额的基金份额净值达到 2.000 元；当银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值达到 0.250 元。

（一）当银河沪深 300 成长份额的基金份额净值达到 2.000 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

### 1、基金份额折算基准日

银河沪深 300 成长份额的基金份额净值达到 2.000 元，基金管理人可根据市

场情况确定折算基准日。

## 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额和银河沪深 300 成长份额。

## 3、基金份额折算频率

不定期。

## 4、基金份额折算方式

当银河沪深 300 成长份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额和银河沪深 300 成长份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的比例为 1:1，份额折算后银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额和银河沪深 300 成长份额的基金份额净值均调整为 1 元。

当银河沪深 300 成长份额的份额净值达到 2.000 元后，银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额、银河沪深 300 成长份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

(1) 银河沪深 300 成长优先份额份额折算原则：

① 份额折算前银河沪深 300 成长优先份额的份额数与份额折算后银河沪深 300 成长优先份额的份额数相等；

② 银河沪深 300 成长优先份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1 元以上的净值部分全部折算为场内银河沪深 300 成长份额。

银河沪深 300 成长优先份额持有人新增的场内银河沪深 300 成长份额的份

$$\text{份额数} = \frac{NUM_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}} \times (\text{NAV}_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$\text{NAV}_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前银河沪深 300 成长优先份额净值

$NUM_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前银河沪深 300 成长优先份额的份额数

(2) 银河沪深 300 成长进取份额份额折算原则：

① 份额折算后银河沪深 300 成长进取份额与银河沪深 300 成长优先份额的

份额数保持 1: 1 配比;

② 份额折算前银河沪深 300 成长进取份额的资产净值与份额折算后银河沪深 300 成长进取份额的资产净值及新增场内银河沪深 300 成长份额的资产净值之和相等;

③ 份额折算前银河沪深 300 成长进取的持有人在份额折算后将持有银河沪深 300 成长进取份额与新增场内银河沪深 300 成长份额。

银河沪深 300 成长进取份额持有人新增的场内银河沪深 300 成长份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中:

$NUM_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{前}}$  : 份额折算前银河沪深 300 成长进取份额的份额数

$NAV_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{前}}$  : 份额折算前银河沪深 300 成长进取份额净值

(3) 银河沪深 300 成长份额份额折算原则:

场外银河沪深 300 成长份额持有人份额折算后获得新增场外银河沪深 300 成长份额, 场内银河沪深 300 成长份额持有人份额折算后获得新增场内银河沪深 300 成长份额。

银河沪深 300 成长份额持有人份额折算后新增的银河沪深 300 成长份额

$$= \frac{NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

.. 其中:

$NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}}$  : 份额折算前银河沪深 300 成长份额净值

$NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}}$  : 份额折算前银河沪深 300 成长份额的份额数

## 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作, 基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的上市交易和银河沪深 300 成长份额的申购或赎回等相关业务, 具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后, 基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体和基

金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

(二) 当银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值达到 0.250 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

1、基金份额折算基准日

银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值达到 0.250 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额、银河沪深 300 成长份额。

3、基金份额折算频率

不定期。

4、基金份额折算方式

当银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值达到 0.250 元后，本基金将分别对银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额和银河沪深 300 成长份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的比例为 1:1，份额折算后银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值均调整为 1 元。

当银河沪深 300 成长进取份额净值达到 0.250 元后，银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额、银河沪深 300 成长份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

(1) 银河沪深 300 成长进取份额份额折算原则：

份额折算前银河沪深 300 成长进取份额的资产净值与份额折算后银河沪深 300 成长进取份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{后}}$ ：份额折算后银河沪深 300 成长进取份额的份额数



$NUM_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{前}}$  : 份额折算前银河沪深 300 成长进取份额的份额数

$NAV_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{前}}$  : 份额折算前银河沪深 300 成长进取份额净值

(2) 银河沪深 300 成长优先份额份额折算原则:

①份额折算前后银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的份额数始终保持 1: 1 配比;

②份额折算前银河沪深 300 成长优先份额的资产净值与份额折算后银河沪深 300 成长优先份额的资产净值及新增场内银河沪深 300 成长份额的资产净值之和相等;

③份额折算前银河沪深 300 成长优先的持有人在份额折算后将持有银河沪深 300 成长优先份额与新增场内银河沪深 300 成长份额。

$$NUM_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{后}} = NUM_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{后}}$$

$$NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{场内}} = \frac{NUM_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}} - NUM_{\text{银河沪深300成长A}}^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中:

$NUM_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{后}}$  : 份额折算后银河沪深 300 成长优先份额的份额数

$NUM_{\text{银河沪深300成长进取}}^{\text{后}}$   
 : 份额折算后银河沪深 300 成长进取份额的份额数

$NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{场内}}$  : 份额折算前银河沪深 300 成长优先份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内银河沪深 300 成长份额的份额数

$NUM_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}}$  : 份额折算前银河沪深 300 成长优先份额的份额数

$NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}^{\text{前}}$  : 份额折算前银河沪深 300 成长优先份额净值

(3) 银河沪深 300 成长份额份额折算原则:

份额折算前银河沪深 300 成长份额的资产净值与份额折算后银河沪深 300 成长份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}}}{1.000}$$



其中：

$NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{后}}$ ：份额折算后银河沪深 300 成长份额的份额数

$NUM_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}}$ ：份额折算前银河沪深 300 成长份额的份额数

$NAV_{\text{银河沪深300成长}}^{\text{前}}$ ：份额折算前银河沪深 300 成长份额净值

#### 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的上市交易和银河沪深 300 成长份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 19. 银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的终止运作

(一) 经基金份额持有人大会决议通过，银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

(二) 银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额终止运作后的份额折算

银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额将全部折算成场内的银河沪深 300 成长份额。

### 1、份额折算基准日

份额折算基准日为分级份额终止运作日，即银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

### 2、份额折算方式

分级份额终止运作日，银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额按届时各自份额净值与银河沪深 300 成长份额净值之比折算为场内的银河沪深 300 成长份额。

银河沪深 300 成长优先份额折算为银河沪深 300 成长份额的数量=

$$\text{折算前银河沪深 300 成长优先份额的数量} \times \frac{NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}}{NAV_{\text{银河沪深300成长}}}$$

银河沪深 300 成长进取份额折算的银河沪深 300 成长份额的数量=

$$\text{折算前银河沪深 300 成长进取份额的数量} \times \frac{NAV_{\text{银河沪深300成长进取}}}{NAV_{\text{银河沪深300成长}}}$$

$NAV_{\text{银河沪深300成长}}$ ：分级份额终止运作日日银河沪深 300 成长份额的份额净值

$NAV_{\text{银河沪深300成长优先}}$ ：分级份额终止运作日银河沪深 300 成长优先份额的份额

净值

$NAV_{\text{银河沪深300成长进取}}$ ：分级份额终止运作日银河沪深 300 成长进取份额的份额

净值

上述涉及银河沪深 300 成长份额数量的计算采用截位法保留至整数位(最小单位为 1 份), 小数部分余额计入基金财产。

### 3、份额折算后的基金运作

银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额全部折算为银河沪深 300 成长份额后, 本基金转型为银河沪深 300 成长增强指数证券投资基金, 其份额将上市交易并接受场外与场内申购和赎回。

### 4、份额折算的公告

基金管理人应不迟于银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额终止运作日前 2 日, 就分级份额终止运作及份额折算事宜, 在指定媒体上公告。银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额进行份额折算结束后, 基金管理人应在 2 日内在指定媒体上公告, 并报中国证监会备案。

## 20.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：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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：

$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$

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、基金托管费率，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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 21.基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通知基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在指定媒体上公告并报中国证监会备案。



## 22. 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过指定媒体披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金代销机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

1、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

2、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。

### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

### （四）银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额上市交易公告书

本基金银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额获准在证券交易所上市交易后，基金管理人将在上市交易日前 3 个工作日，将银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额上市交易公告书登载在指定媒体上。

### （五）基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理银河沪深 300 成长份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的份额净值。

在开始办理银河沪深 300 成长申购或者赎回后或者银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额上市以后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒体，披露开放日的银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的份额净值。基金管理人应当在前款规定的最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

#### （六）银河沪深 300 成长份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明银河沪深 300 成长份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### （八）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额的基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；

- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金注册登记机构；
- 21、银河沪深 300 成长份额开始办理申购、赎回；
- 22、银河沪深 300 成长份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、银河沪深 300 成长份额暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、本基金开始办理或暂停接受配对转换申请；
- 27、本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
- 28、本基金实施基金份额折算；
- 29、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额终止运作；
- 30、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额终止运作后的份额折算；
- 31、基金推出新业务或服务；
- 32、中国证监会规定的其他事项。

#### （九）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （十）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### （十一）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒体上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 15 年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

基金份额持有人基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；

- 4、出现基金基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；

- 4、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；

- 5、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。



## 23. 风险揭示

本基金的主要风险在于以下几方面：

### 一、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

- 1、政策风险。因国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。
- 2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。
- 3、利率风险。利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，也影响着企业的融资成本和利润，基金收益水平会受到利率变化的影响。
- 4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。
- 5、信用风险。基金所投资企业债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于企业债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。
- 6、购买力风险。因为通货膨胀的影响而导致货币购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### 二、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### 三、技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、登记结算系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。



#### 四、本基金特有风险

##### 1. 指数投资风险

本基金为股票型指数基金，投资标的为沪深 300 成长指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

###### （1）系统性风险

本基金为股票型基金，重点投资于沪深 300 成长指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中，本基金可能面临沪深 300 成长指数成份股以及备选股所具有的特有风险，也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。当指数下跌时，基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

###### （2）投资替代风险

因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代，由此可能对基金产生不利影响。

###### （3）标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资人还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

###### （4）跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

①基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。

②指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

③当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

④投资人申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成

份股停牌、摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

⑤在基金进行指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。

⑥其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

#### （5）标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数的回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

## 2.基金运作的特有风险

### （1）上市交易风险

银河沪深 300 成长优先与银河沪深 300 成长进取份额在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额产生流动性风险。

### （2）杠杆机制风险

本基金为复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，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。

由于银河沪深 300 成长进取份额内含杠杆机制的设计，银河沪深 300 成长进取份额参考净值的变动幅度将大于银河沪深 300 成长份额和银河沪深 300 成长优先份额净值的变动幅度，即银河沪深 300 成长进取份额参考净值变动的波动性要高于其他两类份额。

### （3）折/溢价交易风险

银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能出现偏

离并出现折/溢价风险。尽管份额配对转换套利机制的设计已将银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的折/溢价风险降至较低水平，但是该制度不能完全规避该风险的存在。

#### （4）风险收益特征变化风险

由于基金份额折算的设计，在银河沪深 300 成长份额净值达到 2.000 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原银河沪深 300 成长进取份额持有人将会获得一定比例的银河沪深 300 成长份额，因此原银河沪深 300 成长进取份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于基金份额折算的设计，在银河沪深 300 成长进取份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原银河沪深 300 成长优先份额持有人将会获得一定比例的银河沪深 300 成长份额，因此，原银河沪深 300 成长优先份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于对银河沪深 300 成长优先份额在会计年度初，把约定收益折算为场内银河沪深 300 成长份额的设计，使原银河沪深 300 成长优先份额持有人将会获得一定比例的银河沪深 300 成长份额，因此，原银河沪深 300 成长优先份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

#### （5）份额折算风险

①在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。

②份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

新增份额可能面临无法赎回的风险是指在场内购买银河沪深 300 成长优先份额或银河沪深 300 成长进取份额的一部分投资人可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证券监督管理委员会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资人赎回基金份额。因此，如果投资人通过不具备基金代销资格的证券公司购买银河沪深 300 成长优先份额或银河沪深 300 成长进取份额，在其参与份额折算后，则折算新增的银河

沪深 300 成长份额并不能被赎回。此风险需要引起投资人注意，投资人可以选择在份额折算前将银河沪深 300 成长优先份额或银河沪深 300 成长进取份额卖出，或者将新增的银河沪深 300 成长份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

#### （6）份额配对转换业务中存在的风险

基金合同生效后，在银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的存续期内，基金管理人将根据基金合同的约定办理银河沪深 300 成长份额与银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

#### （7）基金的收益分配风险

在存续期内，本基金（包括银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额）将不进行收益分配。

在每个会计年度年（除成立当年外）的第一个工作日，基金管理人将根据基金合同的约定对本基金银河沪深 300 成长份额和银河沪深 300 成长优先份额实施定期份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资人可通过卖出或赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资人通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资人不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

### 五、其他风险

- 1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 2、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- 3、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 4、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 5、其他风险。

## 24. 《基金合同》的变更、终止和基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- (1) 更换基金管理人；
- (2) 更换基金托管人；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (5) 变更基金类别；
- (6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金份额持有人大会召开程序；
- (9) 终止《基金合同》；
- (10) 终止银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的运作；
- (11) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整银河沪深 300 成长份额的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 经中国证监会允许，基金管理人、代销机构、深圳证券交易所、注册登记机构在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎



回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(7) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》生效之日起在指定媒体上公告。

## 二、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止情形之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

5、基金财产清算程序：

- (1) 出现《基金合同》终止情形后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；



- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公布；
- (7) 对基金财产进行分配。

#### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额各自的应计分配比例，按银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的基金份额持有人持有的基金份额比例及该类基金份额净值进行分配。

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止情形发生并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 25. 《基金合同》摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

投资者自依《基金合同》、《招募说明书》取得基金份额即成为基金份额持有人和《基金合同》当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的完全承认和接受。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

每份基金份额在各自份额类别内具有同等的合法权益。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (3) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

- (4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 在符合有关法律规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费率及托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

(13) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(14) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

(15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按法律法规规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (23) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (24) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基

金份额持有人名册；

(25) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，



保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人或基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿

责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额分别进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或者单独或合计持有银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自份额的 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

- (10) 终止银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的运作；
- (11) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (12) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

依据《基金合同》享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、新任基金管理人和基金托管人提名权的“单独或合计持有本基金份额 10% 以上（含 10%）基金份额持有人”或类似表述均指“单独或合计持有银河沪深 300 成长份额达到该类份额 10% 以上（含 10%）且银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额亦达到该类份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人。”

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整银河沪深 300 成长份额的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 经中国证监会允许，基金管理人、代销机构、深圳证券交易所、注册登记机构在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (7) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
- (8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基

金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、单独或合计持有银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自份额的 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自份额的 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、单独或合计持有银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自份额的 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自份额的 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### (三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在指定媒体上公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开或法律法规和监管机关允许的其他方式。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时



符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自份额的 50%（含 50%）。即银河沪深 300 成长份额达到该类份额 50%（含 50%）且银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额亦达到该类份额 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人约定的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在表决截止日前公布 2 次提示性公告；

(2) 召集人按《基金合同》规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自份额的 50%（含 50%），即银河沪深 300 成长份额达到该类份额 50%（含 50%）且银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额亦达到该类份额 50%（含 50%）。；

(4) 上述第（3）项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具



的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

3、在法律法规或监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式由基金份额持有人对其代表进行授权或召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会或通讯开会。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合计持有权益登记日银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自份额的 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 30 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

(1) 关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会

审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

(2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合计持有权益登记日银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自份额的 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额的各自基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委

托人姓名（或单位名称）等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的运作、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## （七）计票

### 1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### (一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

#### (二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### (三) 基金收益分配原则

在存续期内，本基金（包括银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### (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：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H=E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

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、基金托管费率，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。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）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、权证、央行票据、现金、股指期货等，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（但须符合中国证监会得相关规定）。股票投资包括沪深 300 成长指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）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，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%。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。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%，此项调整无需召开基金份额持有人大会。

### （二）投资限制

#### 1、投资组合限制

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%，但标的指数成份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发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成份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。

## 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。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《基金合同》生效后，在开始办理银河沪深 300 成长份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的份额净值。

在开始办理银河沪深 300 成长申购或者赎回后或者银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额上市以后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒体，披露开放日的银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的份额净值。基金管理人应当在前款规定的最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

### （一）《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止《基金合同》；

(10)终止银河沪深 300 成长优先份额与银河沪深 300 成长进取份额的运作；

(11) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整银河沪深 300 成长份额的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(6) 经中国证监会允许，基金管理人、代销机构、深圳证券交易所、注册登记机构在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(7) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》生效之日起在指定媒体上公告。

## (二)《基金合同》的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## (三) 基金财产的清算



1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止情形之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

5、基金财产清算程序：

(1) 出现《基金合同》终止情形后，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公布；

(7) 对基金财产进行分配。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额各自的应计分配比例，按银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额和银河沪深 300 成长进取份额的基金份额持有人持有的基金份额比例及该类基金份额净值进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止情形发生并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

### 九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 26.基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

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：徐旭

成立日期：2002 年 6 月 14 日

注册资本：1.5 亿元人民币

#### (二) 基金托管人

基金托管人：兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：福建省福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

成立日期：1988 年 8 月

成立日期：1988 年 8 月

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行福建省分行闽银 1988 第[271]号

组织形式：股份有限公司

注册资本：107.86 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

电话：(021)62677777-212035

联系人：周频

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

#### (一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

(二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(三) 基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对,并以书面形式向基金托管人发出回函,进行解释或举证。

在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》约定的,应当立即通知基金管理人,并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,必须在规定时间内答复基金托管人并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基

金管理人计算的基金资产净值和银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予以协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知并有义务配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

6、除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的银河基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应督促本基金的基金注册登记机构将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

## （三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义开设资产托管专户，保管基金财产的银行存款。该资产托管专户同时也是基金托管人在法人集中清算模式下，代表所托管的包括本基金财产在内的所有托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂



行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行监管机构的其他规定。

#### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金托管人以基金托管人名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立托管人结算备付金账户，用于所托管产品的证券资金清算。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方书面同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

#### （五）定期存款账户

基金财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴经各方商议后预留。对于任何的定期存款投资，基金管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议须使用基金托管人提供的版本或者经过基金托管人审核，该协议作为划款指令附件，对于协议未经基金托管人审核的划款指令，基金托管人有权不予执行。在取得存款证实书后，基金托管人保管证实书正本或者复印件。基金管理人负责控制流动性风险，即在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若因基金管理人控制不力而造成的损失，基金托管人不承担责任。基金管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本基金已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由基金管理人和基金托管人双方协商解决。定期存款资金的支取必须回流到基金财产在基金托管人开立的资产托管专户内，不得划入其他账户。

基金财产投资定期存款的，基金管理人还需按照法规规定，与基金托管人、存款机构签订相关书面协议。

#### （六）债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行债券和资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人共同代表本基金签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### （七）期货结算账户的开立和管理

1、基金托管人、基金管理人应当代表本基金，按照相关规定开立期货结算账户、期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货结算账户名称、期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照规定设立。

2、本基金的基金管理人授权基金托管人选择具有期货保证金存管资格的商业银行办理相关银期转账业务。未来如果基金托管人取得期货保证金存管银行资格以后，本基金的期货结算账户应在基金托管人下属网点开立，并将相关业务一并转移至基金托管人下属网点，同时应该终止由其他银行提供的本基金期货保证金转账服务。在本基金的期货结算账户转移过程中，对本基金财产造成的任何损失由基金托管人承担。

#### （八）其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （九）基金财产投资的有关实物证券的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的实物证券不承担保管责任。

#### （十）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制的除外。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在 5 个工作日内将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算

##### 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。本基金分别计算银河沪深 300 成长份额、银河沪深 300 成长优先份额、银河沪深 300 成长进取份额各自的基金份额净值。基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （二）基金资产估值方法

#### （三）估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

#### （四）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，

对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （五）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起 45 日内，基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上，并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后 60 日内完成半年报告编制并公告；在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后，需盖章确



认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。基金管理人和基金托管人应按照法律法规规定的年限和方法分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人根据法律法规规定的年限以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的



仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更和终止

### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议在履行适当程序后终止：

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 27. 基金份额持有人服务

基金管理人树立并倡导“以客户为中心”的服务理念以及“基金份额持有人利益至上”的企业价值观，致力于为基金份额持有人提供完善的理财服务解决方案和卓越的服务体验实践。基金管理人通过完善服务过程，为基金份额持有人创造价值，为基金份额持有人提供专业和优质的理财服务体验。基金管理人根据基金份额持有人需求、业务发展和技术变迁，不断完善服务内容，提升服务品质。

对于基金份额持有人的共性需求，基金管理人主要利用两个公共接触点：公司网站和呼叫中心（Call Center）来提供公共服务；对于基金份额持有人的个性化需求与隐性需求，基金管理人采用服务定制的方式以及通过专业的理财顾问团队与基金份额持有人接触拜访、沟通和交流的机制，提供个性化服务。

基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改相关服务项目，并将持续完善服务。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

#### 1、对账单服务

基金管理人根据基金份额持有人需求向发生交易的基金份额持有人以纸质或电子文件形式定期寄送对账单。

#### 2、其他相关的信息资料。

### （二）基金转换服务

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

### （三）网站及呼叫中心服务

场外投资者通过基金账户号、身份证号等开户证件号码和查询密码登录基金管理人网站（[www.galaxyasset.com](http://www.galaxyasset.com)），可享有基金交易查询、账户查询和基金信息查询服务；场外投资者可通过基金管理人网站“网上交易”系统办理本基金的

开户、认购/申购、定投、赎回及信息查询等业务；有关基金网上交易的具体业务规则请参见基金管理人网站相关公告。场内投资者可通过交易网点提供的网站进行网上交易。

基金管理人为基金份额持有人预设基金查询密码，预设的基金账户查询的缺省密码为基金持有人开户证件号码的后六位（若开户证件号码的后六位包含特殊字符或中文，该位字符以“0”替换）；为了维护基金份额持有人账户的安全和隐私权不受侵犯，请基金份额持有人在其知晓基金账号后，及时拨打基金管理人呼叫中心全国统一客服电话 400-820-0860 或登录基金管理人网站 [www.galaxyasset.com](http://www.galaxyasset.com) 修改基金查询密码。

基金份额持有人通过基金管理人网站可以得到各种网上在线服务。

基金管理人呼叫中心（400-820-0860）自动语音系统提供 7\*24 小时账户余额、交易等信息的查询；呼叫中心人工坐席提供 5\*8 小时的人工服务，为基金份额持有人提供业务咨询、账户信息查询、资料修改、投诉受理等服务。

基金份额持有人可以通过基金管理人网站和呼叫中心全国统一客服电话进行服务定制。

#### （四）投诉和建议受理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和代销机构所提供的服务进行投诉或提出建议。基金份额持有人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

## 28.其他应披露事项

本报告期内，本基金在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登公告如下：

1. 银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金合同生效公告(2013.3.30)
2. 关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方法的提示性公告(2013.4.9)
3. 银河基金管理有限公司关于调整上海家化股票估值的公告（2013.5.15）
4. 关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方法的提示性公告(2013.5.17)
5. 关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告(2013.5.28)
6. 银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金之银河优先与银河进取基金份额上市交易公告书(2013.6.3)
7. 银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金开放日常申购和赎回公告(2013.6.3)
8. 银河基金管理有限公司关于调整网上直销定投旗下部分基金的最低金额的公告(2013.6.6)
9. 银河基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购的最低金额、追加投资的最低金额和最低持有份额的公告(2013.6.6)
10. 银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金之银河优先与银河进取基金份额上市交易提示性公告(2013.6.6)
11. 关于银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告(2013.6.6)
12. 银河基金管理有限公司关于中信银行股份有限公司直销账户银行账户信息变更的公告(2013.6.17)
13. 关于旗下基金持有的“九龙电力”股票估值调整的公告(2013.6.19)
14. 关于旗下基金持有的“新华医疗”股票估值调整的公告(2013.6.27)
15. 关于旗下基金持有的“中国重工”股票估值调整的公告(2013.6.28)
16. 关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告（2013.7.5）
17. 银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金 2013 年 2 季报(2013.7.17.)

18. 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构及申购费率优惠的公告（2013.7.17）
19. 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构及申购费率优惠的公告（2013.7.17）
20. 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳众禄基金销售有限公司为代销机构及申购费率优惠的公告（2013.7.17）
21. 关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告(2013.7.18)
22. 关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告(2013.7.19)
23. 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构及申购费率优惠的公告(2013.7.23)
24. 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海天天基金销售有限公司为代销机构及申购费率优惠的公告(2013.7.23)
25. 银河基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回份额的公告(2013.7.24)
26. 银河基金管理有限公司关于新增东北证券股份有限公司为代销机构的公告(2013.7.30)
27. 银河基金管理有限公司关于新增东北证券股份有限公司为代销机构的公告(2013.7.30)
28. 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京展恒基金销售有限公司为代销机构及申购费率优惠的公告(2013.8.1)
29. 关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告(2013-8-10)
30. 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为代销机构及申购费率优惠的公告(2013.8.27)
31. 银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金 2013 年半年报(2013.8.28.)
32. 关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告(2013.9.10)
33. 银河基金管理有限公司关于旗下基金在东莞农村商业银行股份有限公司开通基金定期定额投资业务的公告(2013.9.16)

## 29. 招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、基金销售机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。



### 30. 备查文件

- 1、中国证监会核准本基金成立的文件；
- 2、《银河沪深 300 成长增强指数分级股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《银河沪深 300 成长增强指数分级股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《银河沪深 300 成长增强指数分级股票型证券投资基金登记结算服务协议》
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、《银河基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

银河基金管理有限公司

2013 年 11 月 12 日