

银河沪深 300 价值指数证券投资基金（银河沪深 300 价值指数 C 类份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2025 年 1 月 10 日

送出日期：2025 年 2 月 10 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

|         |                  |                |                  |
|---------|------------------|----------------|------------------|
| 基金简称    | 银河沪深 300 价值指数    | 基金代码           | 519671           |
| 下属基金简称  | 银河沪深 300 价值指数 C  | 下属基金交易代码       | 013074           |
| 基金管理人   | 银河基金管理有限公司       | 基金托管人          | 中国建设银行股份有限公司     |
| 基金合同生效日 | 2009 年 12 月 28 日 | 上市交易所及上市日期     | -                |
| 基金类型    | 股票型              | 交易币种           | 人民币              |
| 运作方式    | 普通开放式            | 开放频率           | 每个开放日            |
| 基金经理    | 罗博               | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2009 年 12 月 28 日 |
|         |                  | 证券从业日期         | 2001 年 04 月 02 日 |

注：本基金自 2021 年 7 月 26 日起增设 C 类份额。

二、基金投资与净值表现

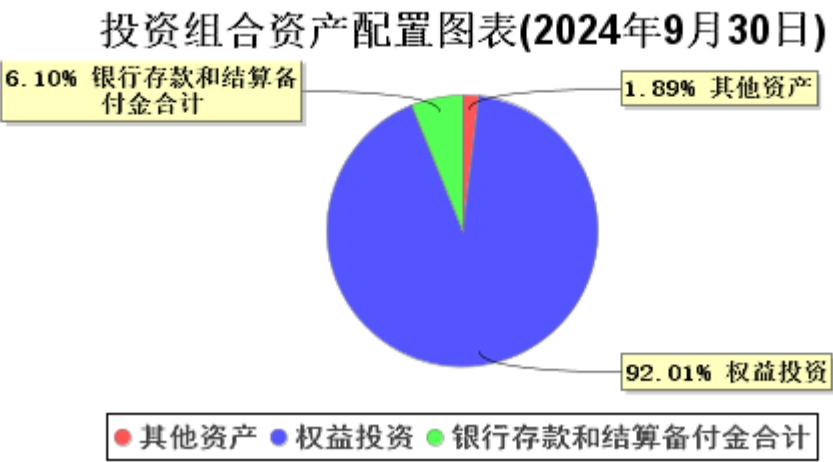
(一) 投资目标与投资策略

投资者阅读《银河沪深 300 价值指数证券投资基金招募说明书》第十章了解详细情况

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 通过严格的投资程序约束、数学模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段，追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 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、上市的股票和存托凭证、债券、央行票据、现金等，以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资包括沪深 300 价值指数成份股和备选成份股、新股（首次发行或增发）等。<br>以后如有法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种（包括股指期货、股指期权等金融衍生产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并依法进行投资管理。<br>本基金跟踪标的指数的股票投资组合资产（包括标的指数成份股和备选成份股）不低于基金资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。 |
| 主要投资策略 | 本基金采用被动式指数投资策略，原则上采取以完全复制为目标的指数跟踪方法，按照成份股在沪深 300 价值指数中的基准权重构建股票投资组合，并原则上根据标的指                                                                                                                                                                                                                                                                            |

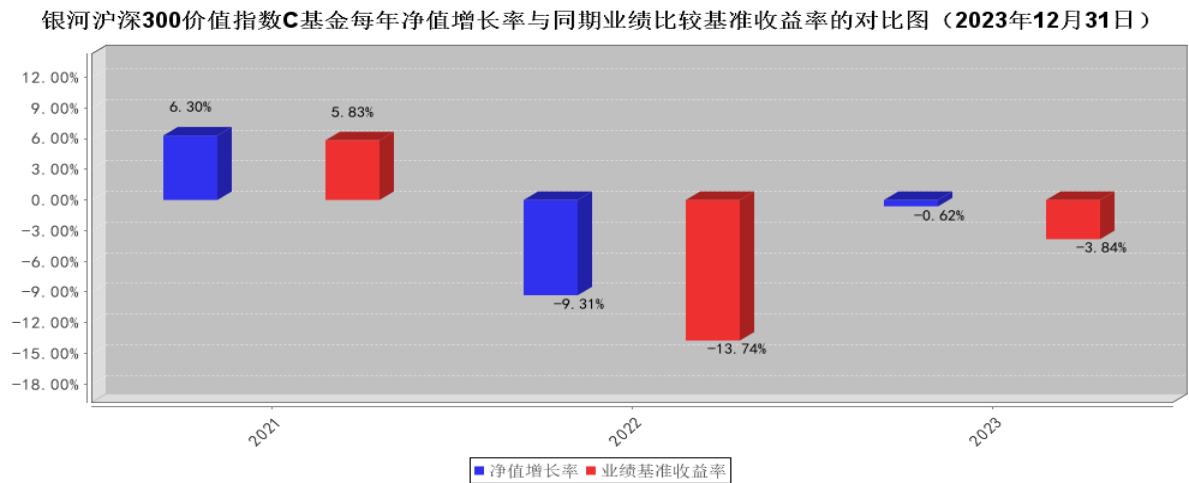
|        |                                                                                                                                                                       |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 数成份股的变化或其权重的变动而进行相应调整。本基金将利用数量化模型，对跟踪误差及其相关指标进行动态管理，根据结果对基金投资组合进行相应调整；并将定期或不定期对数量化模型进行优化改善，力求减少跟踪误差，期望改进指数跟踪效果。本基金跟踪误差的风险控制目标为：力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年平均跟踪误差不超过 4%。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 价值指数收益率*95%+银行活期存款收益率(税后)*5%                                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金，属于证券投资基金中高风险高收益的品种，其预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金。                                                                                                              |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



注：本基金自 2021 年 7 月 26 日起增设 C 类份额

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的对比图



注：1、本基金自 2021 年 7 月 26 日起增设 C 类份额

2、业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型 | 份额（S）或金额（M）<br>/持有期限（N） | 收费方式/费率 |
|------|-------------------------|---------|
| 赎回费  | N<7 天                   | 1.5%    |
|      | N≥7 天                   | 0%      |

注：本基金仅 A 类份额收取申购费；C 类份额收取销售服务费，不收取申购费。

## （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别    | 收费方式/年费率或金额                                                                 |       |                    | 收取方        |
|---------|-----------------------------------------------------------------------------|-------|--------------------|------------|
| 管理费     | 0.50%                                                                       |       |                    | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费     | 0.15%                                                                       |       |                    | 基金托管人      |
| 销售服务费   | 0.10%                                                                       |       |                    | 销售机构       |
| 审计费用    | 45,000.00 元                                                                 |       |                    | 会计师事务所     |
| 信息披露费   | 120,000.00 元                                                                |       |                    | 规定披露报刊     |
| 指数许可使用费 | 标的指数使用费的收取下限为每季度人民币 50,000 元，计算期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。                        | 0.02% | 年下限金额：200,000.00 元 | 指数编制公司     |
| 其他费用    | 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用按实际发生额从基金资产扣除。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。 |       |                    | 相关服务机构     |

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费用、指数许可使用费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

## （三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

银河沪深 300 价值指数 C

|      | 基金运作综合费率（年化） |
|------|--------------|
| 持有期间 | 0.78%        |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

## 1. 本基金有关指数投资风险

(1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

### (2) 标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治、经济、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：1) 标的指数调整成份股或变更编制方法。2) 标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化。3) 成份股派发现金红利、新股市值配售收益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。4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生的跟踪偏离度和跟踪误差；或由于法律法规限制无法进行买卖的成份股，必须实施替代的情况下产生的跟踪偏离度和跟踪误差。5) 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。6) 在本基金指数化投资过程中，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，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。7) 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；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

### (4) 标的指数变更的风险

基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

### (5) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年平均跟踪误差不超过 4%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

### (6) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自相关情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

### (7) 成份股停牌或退市的风险

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，当标的指数成份股停牌或发生明显负面事件面临退市时，可能出现导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差扩大的风险。

## 2. 开放式股票型基金共有的风险

包括投资组合的风险（市场风险、流动性风险、信用风险）、管理风险、合规性风险、操作风险、流动性风险、投资存托凭证的风险以及其他风险。

3. 当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

## （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新。其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告、定期报告等。

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：[www.cgf.cn](http://www.cgf.cn)][客服电话：400-820-0860]

1. 《银河沪深 300 价值指数证券投资基金基金合同》、《银河沪深 300 价值指数证券投资基金托管协议》、《银河沪深 300 价值指数证券投资基金招募说明书》及其更新
2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料

## 六、其他情况说明

无。