

# 银河沪深 300 价值指数证券投资基金

## 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2020 年 8 月 20 日

送出日期：2020 年 8 月 20 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
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	2009-12-28	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	2009-12-28
		证券从业日期	2001-04-02

### 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《招募说明书》第十章了解详细情况

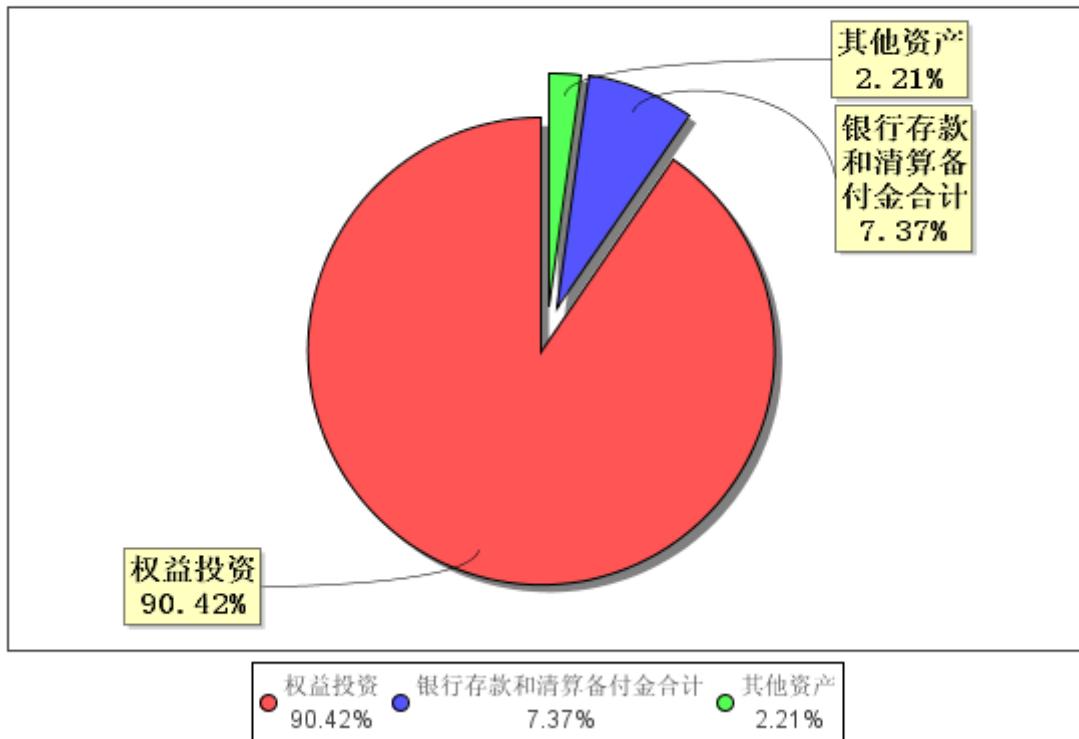
投资目标	通过严格的投资程序约束、数学模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段，追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、央行票据、现金等，以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资包括沪深300价值指数成份股和备选成份股、新股（首次发行或增发）等。以后如有法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种（包括股指期货、股指期权等金融衍生产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并依法进行投资管理。 本基金跟踪标的指数的股票投资组合资产（包括标的指数成份股和备选成份股）不低于基金资产的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，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。

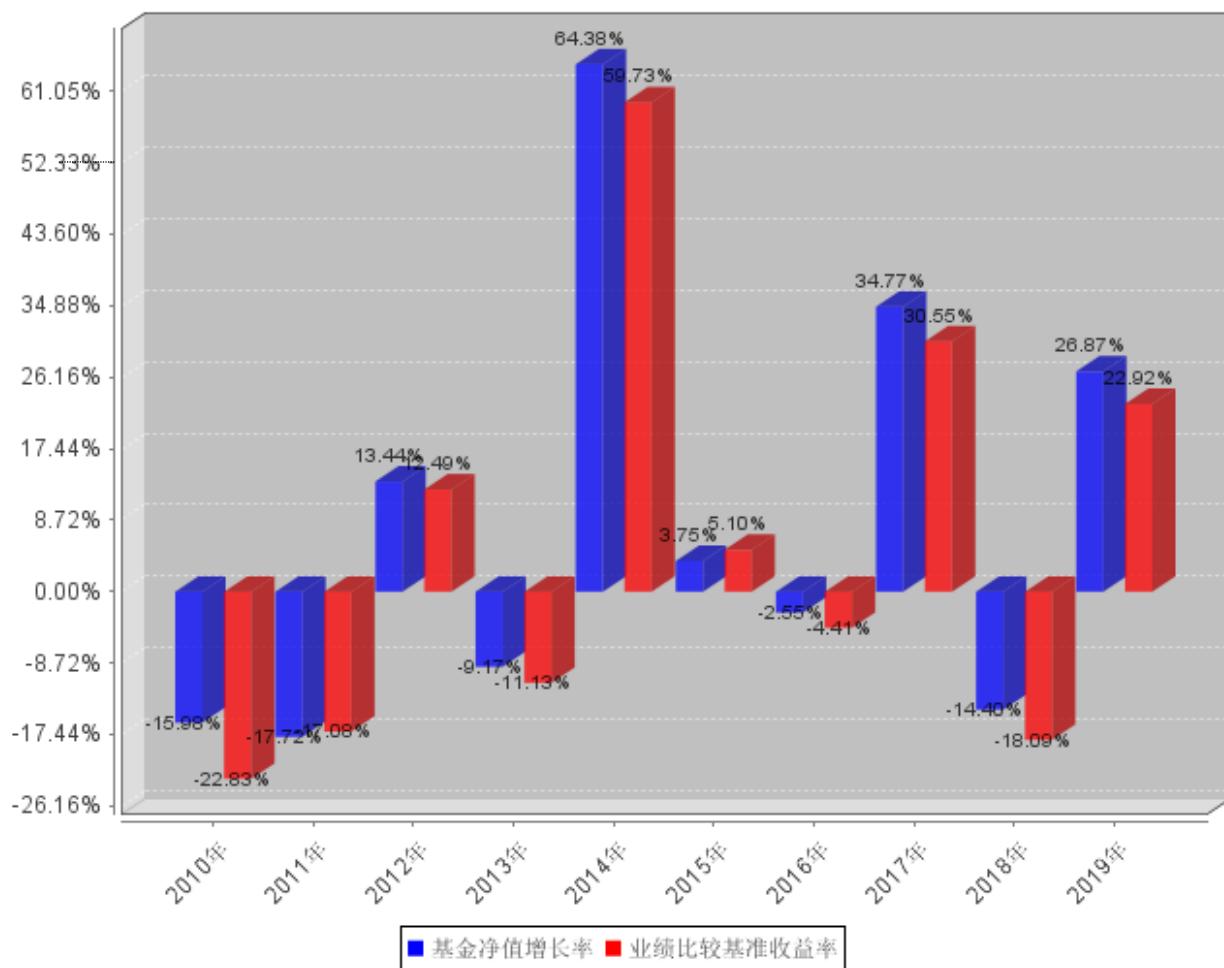
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

**投资组合资产配置图表**  
**数据截止日期：2020年6月30日**



## (三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

## 最近十年（孰短）基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：业绩表现截止日期2019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)/持有限期(N)	收费方式/费率	备注
认购费	M < 500000	1.0%	—
	500000 ≤ M < 2000000	0.6%	—
	2000000 ≤ M < 5000000	0.2%	—
	M ≥ 5000000	1000.0元	—
申购费（前收费）	M < 500000	1.2%	—
	500000 ≤ M < 2000000	0.8%	—
	2000000 ≤ M < 5000000	0.4%	—
	M ≥ 5000000	1000.0元	—
赎回费	N < 7天	1.5%	—
	7天 ≤ N < 365天	0.5%	—
	365天 ≤ N < 730天	0.4%	—
	730天 ≤ N < 1095天	0.2%	—

$N \geqslant 1095$ 天	0. 0%	-
----------------------	-------	---

## （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
管理费	0. 50%
托管费	0. 15%
销售服务费	-
指数使用费	0. 02%

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

2、通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的0. 02%的年费率计提，且收取下限为每季度人民币5万元。

## 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) 标的指数组合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组合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。

#### 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、流动性风险以及其他风险。

### （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。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.galaxyasset.com] [ 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》
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

---