（上接C59版）

(42)长城证券股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人：黄耀华
联系人：刘阳
电话：(0755)83516289
传真：(0755)83515567
网址：www.cgws.com
客户服务电话：400-666-6888
(43)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
客户服务电话：4008-888-993
网址：www.dxzq.net
(44)广发证券股份有限公司
住所：广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼
办公地址：广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼
法定代表人：林治海
电话：(020)87555888
传真：(020)87555305
联系人：黄岚
客户服务电话：95575
网址： www.gf.com.cn
(45)中银国际证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
法定代表人：宁敏
电话：(021)20328000
传真：(021)58883554
联系人：王炜哲
客户服务电话：400-620-8888
网址：www.bocichina.com
(46)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：周杨
客户服务热线：95536
网址：www.guosen.com.cn
(47)华泰证券股份有限公司
住所：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场
法定代表人：周易
电话：(0755)82492193
传真：(0755)82492962
联系人：庞晓芸
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
(48)西南证券有限责任公司
住所：重庆市江北区桥北苑 8 号
办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦
法定代表人：王珠林
客户服务电话：4008-096-096
网址：www.swsc.com.cn
(49)方正证券股份有限公司
住所：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717
办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 40 层
法定代表人：高利
电话：(010)59355807
传真：(010)56437013
联系人：程博怡
客户服务电话：95571
网址：www.foundersc.com
(50)华鑫证券有限责任公司
住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元
法定代表人：俞洋
电话：(021)54967552
传真：(021)54967293
联系人：杨莉娟
客户服务电话：95323，400-109-9918
网址： www.cfsc.com.cn
(51)南京证券股份有限公司
住所：南京市江东中路 389 号
办公地址：南京市江东中路 389 号
法人代表：步国旬
电话：(025)58519523
传真：(025)83369725
联系人：王万君
客户服务电话：95386
网址：www.njzq.com.cn
3、第三方销售机构
(1)上海天天基金销售有限公司
住所：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)浙江同花顺基金销售有限公司
住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室
办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼
法定代表人：凌顺平
客户服务电话：4008-773-772
网址：www.5ifund.com
(3)深圳众禄基金销售有限公司
住所：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
网址： www.zlfund.cn，www.jjmmw.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
(二)基金登记结算机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人：周明
电话：(010)50938839
传真：(010)50938907
联系人：朱立元
(三)律师事务所和经办律师
名称：上海源泰律师事务所
地址：上海市浦东南路 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、徐莘
(四)会计师事务所和经办注册会计师：
名称：德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
办公地址：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
法定代表人：曾顺福
联系电话：+86 21 61418888
传真：+86 21 63350177
经办注册会计师：胡小骏、冯适

第四节 基金概况

基金名称：银河量化优选混合型证券投资基金
基金简称：银河量化优选混合
基金类型：混合型基金
基金运作方式：契约型开放式

第五节 基金的投资

(一)投资目标
本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资，在严格控制风险的前提下，力求基金资产长期、稳定的增值。
(二)投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单)、权证、股指期货以及法律法规或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相关规定)。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资占基金资产的比例为 60%-95%，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，现金或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、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。
如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
(三)投资策略
本基金在投资中将以基金的权益类资产和固定收益类资产配置作为基础，采用量化选股模型，并将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。
1、资产配置策略
本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法，综合分析宏观经济面、政策面、市场面等多种因素以及证券市场的演化趋势，评估股票、债券等各类资产的预期收益和风险，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的比例。
本基金考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率，居民消费价格指数(CPI)，生产者价格指数(PPI)，货币供应量(M0，M1，M2)的增长率等指标；政策面因素包括但不限于货币政策、财政政策、产业政策的变化趋势等；市场因素包括但不限于市场的资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体 P/E、P/B 等指标相对于长期均值水平的偏离度等。
2、股票投资策略
本基金将运用量化选股模型，以量化多因子选股、事件驱动选股策略为主，辅以量化行业配置、套利策略等多个策略，力求寻找基本面良好，并能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。同时，本基金也将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。主要包括但不限于以下投资策略：
(1)多因子选股策略
根据对国内证券市场运行特征的长期研究、投资研究团队的长期投资实践和大量历史数据的实证检验，基金管理人量化投资团队开发了多因子选股模型。多因子选股模型的基本原理是采用一系列的优选因子作为选股标准，从多个因子维度对个股进行打分，据此筛选出满足条件的投资组合。
一般情况下，多因子模型的构建主要可以归结为以下几个步骤：
a.因子的筛选
基金管理人量化投资团队在多年研究积累的基础上，对市场上存在的有效因子进行深入研究，通过全面的数据分析及多维度的测算，优选出符合逻辑、超额收益相较明显以及相对稳定的因子作为构建多因子组合的备选因子。本基金多因子选股模型因子池的构建现阶段主要考虑成长、估值、盈利能力等多个维度大类因子及其项下的各细分小类因子。
b.因子权重确定
本基金结合各因子历史具体表现对其权重在不同市场环境下进行动态调整，力求准确把握市场环境。
c.因子的定期调整
在覆盖主流有效选股因子的前提下，本基金将优选历史环境相似的行情因子配置，动态优选表现优异因子，剔除表现不佳的因子，自动适应市场环境变化带来因子失效问题。
(2)事件驱动策略
事件驱动策略是指在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上，通过充分把握事件机会获取超额投资回报的交易策略。事件驱动策略中的事件是指具有较为明确的时间和内容，能够对部分投资者的投资行为产生一定的影响，从而决定股价短期波动的因素的事件，如高送转事件、资产重组事件、定向增发事件以及股票回购事件等。
本基金将尽力发掘和深入分析可能为个股带来超额收益的事件，对本基金事件驱动模型中所采用的事件进行优选，充分把握事件驱动策略为股票投资带来的超额投资回报，可能采取的事件驱动策略包括但不限于业绩预增策略、股东增持策略等。
(3)股票投资组合的风险控制
在风险控制方面，本基金将通过组合优化模型实现对相对风险和相对回撤的有效控制。相关性较低的多策略相结合也可有效降低组合风险，动态优化组合收益，有利于基金资产的长期稳定增值。
3、固定收益类资产投资策略
(1)利率预期及久期配置策略
本基金通过研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线变化趋势。
本基金将根据对未来市场利率走向的预测，动态调整组合的目标久期。在预期利率处于上升通道时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险；在预期利率处于下降通道时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益。
本基金根据对收益率曲线形状变动的预期，建立或改变组合期限结构，并动态调整。
(2)类属配置策略
类属配置是指对各市场、各种类的固定收益类金融工具之间的比例进行适时、动态的分配和调整，确定最能符合本基金风险收益特征的资产组合。
在市场配置层面，本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据交易所市场和银行间市场等固定收益类金融工具的到期收益率变化、流动性变化和市场规模等情况，相机调整不同市场中固定收益类金融工具所占的投资比例。
在品种选择层面，本基金依据宏观经济层面的信用风险周期和代表性行业的信用风险结构变化，做出信用风险收缩或扩张的基本判断。本基金将在信用利差水平较高时较多的配置信用债券，在信用利差水平较低时较多的配置国债、央行票据等利率债品种，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。
(3)信用债券投资策略
根据经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券、公司债券的信用风险利差，挖掘并投资于信用风险相对较低、信用利差相对较大的优质品种。
债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息，同时需要考虑企业的经营环境等外部因素，着重分析企业未来的偿债能力，评估其违约风险水平。
(4)可转换债券投资策略
本基金着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究，同时兼顾其债券价值和转换期权价值。本基金基于对可转换债券对应的基础股票的行业景气度、成长性、核心竞争力等基本面分析，并参考同类公司的估值水平，研判发行公司的投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。
(5)资产支持证券投资策略
本基金通过对资产支持证券的资产池的资产特征进行分析，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。本基金投资资产支持证券时，还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，获取较高的投资收益。
4、金融衍生品投资策略
(1)股指期货投资策略
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。
(2)权证投资策略
本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算，并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果，选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。根据权证与标的证券的内在价值联系，合理配置权证与标的证券的投资比例，构建权证与标的证券的避险组合，控制投资组合的下跌风险。同时，本基金积极发现可能存在的套利机会，构建权证与标的证券的套利组合，获取较高的投资收益。
(四)投资限制
1、组合限制
(1)本基金股票资产投资占基金资产的比例为 60%-95%；
(2)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，现金或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；
(3)本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
(5)本基金总资产不超过基金净资产的 140%；
(6)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%；
(7)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%；
(8)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%；
(9)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
(10)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
(11)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
(12) 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%；
(13)本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
(14)本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；
(15) 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，债券回购到期后不得展期；
(16)本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资；
(17)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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；
3)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%；
4)本基金在任何交易日日终，持有的买入股指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；
5)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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；
(18) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；
(19) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
(20) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；
因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
(21) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
(22)法律法规和中国证监会规定的其他投资比例限制。
除上述第(2)、(13)、(20)、(21)项以外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。
基金管理人应当自基金合同生效之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约定。期间，基金的投资范围应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人与基金托管人协商一致，并且基金管理人在履行适当程序后则本基金投资不再受相关限制。如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，基金管理人与基金托管人协商一致，并且基金管理人在履行适当程序后以变更后的规定为准。
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)违反规定向他人贷款或者提供担保；
(3)从事承担无限责任的投资；
(4)向其基金管理人、基金托管人出资；
(5)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；
(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。
如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。
(五)业绩比较基准
本基金的业绩比较基准：
中证 500 指数收益率×80% + 中证综合债券指数收益率×20%
中证 500 指数编制方法和程序透明、客观，能较好的反映市场的真实情况，在市场代表性、可投资性以及周转率方面能够满足本基金的要求。
根据本基金的投资范围和投资比例约束，基金管理人以中证 500 指数收益率×80% + 中证综合债券指数收益率×20%作为业绩比较基准，与本基金的投资风格基本一致，可以用来客观公正地衡量本基金的风险收益特征。
如果上述基准指数停止编制及发布、更改名称，或者因指数编制及发布等方面原因导致上述业绩比较基准不适用本基金，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准无需召开基金份额持有人大会，但应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整实施前在中国证监会指定媒介上刊登公告。
(六)风险收益特征
本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
(七)基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法
1、有利于基金资产的安全与增值；
2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；
3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。
(八)基金投资组合报告(截止于 2018 年 9 月 30 日)
本投资组合报告已经基金托管人复核，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告中所列财务数据未经审计。
1.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	44,344,954.05	83.18
	其中：股票	44,344,954.05	83.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,018,000.00	5.66
	其中：债券	3,018,000.00	5.66
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,660,213.50	6.87
8	其他资产	2,291,987.40	4.30
9	合计	53,315,154.95	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,184,671.00	2.24
B	采矿业	3,288,046.00	6.23
C	制造业	27,219,309.00	51.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,832,242.00	3.47
G	交通运输、仓储和邮政业	744,285.00	1.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,412,822.00	8.36
J	金融业	1,517,562.00	2.87
K	房地产业	2,356,741.05	4.46
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	813,788.00	1.54
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	975,488.00	1.85
S	综合	-	-
	合计	44,344,954.05	84.01

2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。
3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600585	海螺水泥	29,000	1,066,910.00	2.02
2	600596	新安股份	67,600	1,065,376.00	2.02
3	600801	华新水泥	50,100	1,009,014.00	1.91
4	600031	三一重工	106,600	946,608.00	1.79
5	000050	深天马 A	77,400	940,410.00	1.78
6	600963	岳阳林纸	198,000	938,520.00	1.78
7	000425	徐工机械	234,900	927,855.00	1.76
8	000528	柳工	84,900	927,108.00	1.76
9	002380	科远股份	75,700	925,054.00	1.75
10	601717	郑煤机	130,900	920,227.00	1.74

1.4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,018,000.00	5.72
	其中：政策性金融债	3,018,000.00	5.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,018,000.00	5.72

2.5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开 1701	30,000	3,018,000.00	5.72

3.6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
4.7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
注：本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。
6.9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1)1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注：本基金报告期末未持有股指期货合约
2)2)本基金投资股指期货的投资政策
本基金未对股指期货进行投资。
7.10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1)1)本期国债期货投资政策
本基金不参与国债期货投资。
2)2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注：本基金不参与国债期货投资。
3)3)本期国债期货投资评价
本基金不参与国债期货投资。
8.11.投资组合报告附注
1)1)
本基金投资的前十名证券中，没有发行主体被监管部门立案调查的情形，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情形。
2)2)
报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
3)3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,354.81
2	应收证券清算款	2,222,933.39
3	应收股利	-
4	应收利息	55,502.16
5	应收申购款	197.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,291,987.40

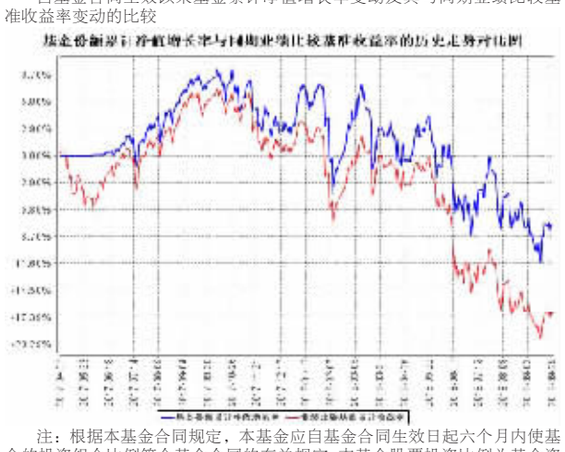
4)4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5)5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
6)6)投资组合报告附注的其他文字描述部分
因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

第六节 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人申购基金时应认证阅读本招募说明书。有关业绩数据经托管人复核，但未经审计。
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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017.04.27-2017.12.31	3.34%	0.65%	1.24%	0.78%	2.10%	-0.13%
2018.01.01-2018.09.30	-10.44%	1.26%	-17.93%	1.11%	7.49%	0.15%
自基金合同生效起至今	-7.45%	1.01%	-16.92%	0.97%	9.47%	0.04%

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：根据本基金合同规定，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：本基金股票投资比例为基金资产的 60-95%；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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。报告期末仍处于建仓期。

第七节 基金的费用

(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》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券、期货交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、基金的相关账户的开户及维护费用；
9、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。
(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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H=E×1.5%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H=E×0.25%÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
3、上述“一、基金费用的种类”中第 3-9 项费用，根据有关法律法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
(三)不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
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；
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。

第八节 对招募说明书更新部分的说明

银河量化优选混合型证券投资基金本次更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法规及《银河量化优选混合型证券投资基金基金合同》进行更新编写，更新的内容主要包括以下几部分：
1、“重要提示”日期根据实际情况进行了相应更新，本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 10 月 27 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)，定于 2018 年 12 月 8 日前公告。
2、“三、基金管理人”部分，根据实际情况更新基金管理人的相关信息。
3、“四、基金托管人”部分，根据托管人提供的资料更新了的相关信息。
4、“五、相关服务机构”部分，增加了相关代销机构，对原有销售机构进行了更新，各新增代销机构均在指定媒体上公告列示。
5、“十、基金的投资”之“(八)基金投资组合报告”更新为截止日为 2018 年 9 月 30 日的报告，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，未经审计。“(九)基金的业绩”中对基金成立以来至 2018 年 9 月 30 日的基金业绩表现进行了披露。该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。
6、“二十四、其他应披露事项”中列示了本报告期内本基金及本基金管理公司在指定报纸上披露的公告。

银河基金管理有限公司
二〇一八年十二月八日