

---

浙商沪深 300 指数分级证券投资基金  
更新招募说明书  
(2016 年第 2 期)

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

## 重要提示

本基金的募集申请经中国证监会证监许可【2012】91号文核准。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。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。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资有风险，投资人在投资本基金前，应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金投资人根据所持有的份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：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；由于基金投资人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；本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中的特定风险等。本基金为跟踪指数的股票型基金，属证券投资基金中的较高风险、较高收益品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

本基金场外单笔认/申购最低金额为10元。场内单笔认购最低份额为50,000份，场内单笔申购最低金额为50,000元。

基金管理人建议基金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。

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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本次招募说明书的更新内容中与托管相关的信息已经本基金托管人复核。所载内容截止日为2016年11月7日，投资组合报告为2016年3季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、	绪言.....	5
二、	释义.....	6
三、	基金管理人.....	12
四、	基金托管人.....	21
五、	相关服务机构.....	24
六、	基金份额的分类与净值计算规则.....	41
七、	基金的募集.....	45
八、	基金合同的生效.....	46
九、	浙商沪深 300 份额的申购与赎回.....	47
十、	浙商稳健份额与浙商进取份额的上市交易.....	57
十一、	基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记等其他相关业务.....	59
十二、	基金的份额配对转换.....	61
十三、	基金的投资.....	63
十四、	基金的财产.....	76
十五、	基金资产的估值.....	77
十六、	基金的收益与分配.....	83
十七、	基金的费用与税收.....	84
十八、	基金份额折算.....	87
十九、	浙商稳健份额与浙商进取份额的终止运作.....	95
二十、	基金的会计和审计.....	97
二十一、	基金的信息披露.....	98
二十二、	风险揭示.....	103
二十三、	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	110
二十四、	基金合同的内容摘要.....	114
二十五、	托管协议的内容摘要.....	115
二十六、	对基金份额持有人的服务.....	116
二十七、	其他应披露事项.....	118
二十八、	招募说明书的存放及查阅方式.....	126
二十九、	备查文件.....	127

## 一、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》”）、《公开募集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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“合同”或“基金合同”）编写。

本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。本招募说明书由本基金管理人解释。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。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指浙商沪深 300 指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人或本基金管理人：指浙商基金管理有限公司
- 3、基金托管人或本基金托管人：指华夏银行股份有限公司
- 4、基金合同或基金合同：指《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额发售公告》
- 8、上市交易公告书：指《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额与浙商进取份额上市交易公告书》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时做出的修订
- 10、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、业务规则：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及代销机构业务规则等相关业务规则和实施细则

15、中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

18、沪深 300 指数：指由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的指数，以综合反映 A 股市场整体走势。沪深 300 指数由中证指数有限公司编制并发布

19、基金份额分级：指本基金的基金份额，包括浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额、浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“浙商稳健份额”）与浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之积极进取类份额（即“浙商进取份额”）。浙商稳健份额、浙商进取份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变

20、浙商沪深 300 份额：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额。投资者在场外认/申购的浙商沪深 300 份额不进行基金份额自动分离/分拆；投资者在场内认购的浙商沪深 300 份额将自动进行基金份额分离；投资者在场内申购的浙商沪深 300 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

21、浙商稳健份额：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金按基金合同约定规则所自动分离或分拆的稳健收益类份额

22、浙商进取份额：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金按基金合同约定规则所自动分离或分拆的积极进取类份额

23、浙商稳健份额的本金：除非基金合同文义另有所指，对于浙商稳健份额而言，指 1.000 元

24、浙商稳健份额的约定年基准收益率：浙商稳健份额的约定年基准收益率为“一年期银行定期存款利率（税后）+3%”。计算该约定年收益率的一年期银行定期存款利率是指基金合同生效日或生效后次年起的每年 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利率。相应的利息税率按照国务院规定进行调整。当“一年期银行定期存款利率（税后）+3%”大于 12%的时候，约定年收益率按 12%计算

25、基金合同当事人：指受基金合同约定，根据基金合同享有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

26、个人投资者：指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

27、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

28、合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场（不包括台湾地区、香港、澳门）并取得国家外汇管理局外汇额度批准的中国境外的机构投资者

29、投资人：指个人投资者、机构投资者和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人的合称

30、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

31、基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

32、销售机构：指直销机构和代销机构

33、直销机构：指浙商基金管理有限公司

34、代销机构：指符合《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了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金场内销售业务的机构必须具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

35、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

36、场外：指以交易所开放式基金交易系统以外的方式、通过销售机构办理基金销售业务的场所

37、场内：指以交易所开放式基金交易系统的方式办理基金销售业务的场所

38、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户或深圳证券账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业



务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等

39、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为浙商基金管理有限公司或接受浙商基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

40、注册登记系统：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注册登记系统

41、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证券登记结算系统

42、基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户，投资人通过场外销售机构办理基金份额的认购、申购和赎回等业务时需持有基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

43、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

44、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户，投资人通过深圳证券交易所交易系统办理场内认购、场内申购、场内赎回和上市交易等业务时需持有深圳证券账户，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

45、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

46、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

47、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

48、存续期：指基金合同生效后合法存续的期限。本基金的存续期间为不定期

49、日/天：指公历日

50、月：指公历月

- 51、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 52、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日
- 53、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
- 54、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 55、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 56、发售：指在基金募集期内，销售机构向投资人销售浙商沪深 300 份额的行为
- 57、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定通过场外或场内申请购买浙商沪深 300 份额的行为
- 58、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定通过场外或场内申请购买浙商沪深 300 份额的行为
- 59、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人根据基金合同和招募说明书的规定要求通过场外或场内将浙商沪深 300 份额兑换为现金的行为
- 60、份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的浙商沪深 300 份额与浙商稳健份额、浙商进取份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆与合并两个方面
- 61、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份浙商沪深 300 份额的场内份额申请转换成 1 份浙商稳健份额与 1 份浙商进取份额的行为
- 62、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份浙商稳健份额与 1 份浙商进取份额进行配对申请转换成 2 份浙商沪深 300 份额的场内份额的行为
- 63、会员单位：指深圳证券交易所会员单位
- 64、上市交易：指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖浙商稳健份额、浙商进取份额的行为
- 65、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作。转托管包括系统内转托管和跨系统转登记
- 66、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（交易单元）之间进行转托管的行为

67、跨系统转登记：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登记的行为

68、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

69、定期定额投资计划：指投资人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人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

70、巨额赎回：指本基金单个开放日，浙商沪深 300 份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额）的 10%

71、元：指人民币元

72、基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额

73、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

74、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

75、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

76、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

77、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

78、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

基金管理人：浙商基金管理有限公司

住所：杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室

办公地址：杭州市西湖区教工路 18 号世贸丽晶城欧美中心 B 座 507 室

法定代表人：肖风

成立日期：2010 年 10 月 21 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可【2010】1312 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：3 亿元人民币

存续期间：持续经营

股权结构：浙商证券股份有限公司、浙江浙大网新集团有限公司、通联资本管理有限公司、养生堂有限公司分别占公司注册资本的 25%

联系人：何萍

联系电话：021-60350835

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

肖风先生，董事长，1961 年生，中共党员，博士生学历。历任深圳证券管理办公室副处长、处长、证券办副主任；博时基金管理有限公司总裁。现任中国万向控股有限公司副董事长、民生人寿保险股份有限公司副董事长、万向信托有限公司董事长、民生通惠资产管理有限公司董事长、通联支付网络服务股份有限公司董事长、通联数据股份公司董事长。

高玮女士，董事，1968 年生，浙江大学数学系博士，高级工程师。历任财通证券股份有限公司电脑中心副经理、市场管理总部经理、稽核部经理、职工监事；浙商基金管理有限公司董事长；上海聚潮资产管理有限公司执行董事。现任浙商证券股份有限公司合规总监；浙商期货有限公司董事；浙江浙商资本管理有限公司董事、浙江浙商证券资产管理有限公司董事兼合规风控总监。

耿小平先生，董事，1948 年生，华东政法学院法律专业毕业，中欧国际工商管理学院 EMBA，高级经济师。历任浙江省人民检察院副检察长；浙江省高速公路指挥部副指挥；浙江沪杭甬高速公路股份有限公司董事长兼总经理；浙江省交通投资集团有限公司总经理；浙商证券股份有限公司党委书记；浙商证券股份有限公司顾问。现任华北高速公路股份有限公司独立董事。

李志惠先生，董事，1967 年生，经济学博士。历任深圳市住宅局房改处主任科员、助理调研员，深圳市委政策研究室城市处助理调研员、综合处副处长。2004 年 9 月加入博时基金管理有限公司，历任行政及人力资源部副总经理、总裁办公室总经理兼董事会秘书、公司副总裁。现任浙商基金管理有限公司总经理、上海分公司总经理；上海聚潮资产管理有限公司执行董事。

钟睽睽先生，董事，1954 年生，大专。历任养生堂有限公司执行董事兼总经理、董事、董事长；农夫山泉股份有限公司董事长。现任农夫山泉股份有限公司董事长兼总经理。

周一烽先生，董事，1962 年生，复旦大学经济系学士、上海社会科学院经济学硕士、美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院 EMBA。历任上海市社会科学院宏观经济研究室副主任、上海企业发展研究所副所长；广联（南宁）投资有限公司总经理特别助理及证券投资业务负责人；上海广联投资有限公司总经理；中泰信托投资有限责任公司副总裁；大成基金管理有限公司副总经理兼投资总监；浙商基金管理有限公司总经理。

章晓洪先生，独立董事，1973 年生，西南政法大学法学硕士、博士。历任浙江天健会计师事务所注册会计师，现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人。

刘纪鹏先生，独立董事，1956 年生，中国社会科学院研究生院工业经济系硕士，高级研究员，高级经济师，注册会计师。历任中国社会科学院工业经济研究所助理研究员；中信国际研究所经济研究室主任；海南航空公司高级经济顾问、首席经济学家；首都经济贸易大学教授、公司研究中心主任。现任中国政法大学资本研究中心主任、教授、博士生导师；财政部财政科学研究所硕士生导师；中国企业改革与发展研究会副会长。

金雪军先生，独立董事，1958 年生，南开大学经济学硕士。历任浙江大学经济学院副院长等，享受国务院政府特殊津贴。现任浙江大学教授、博士生导师；浙江大学公共政策研究院执行院长，浙江省国际金融学会会长；大地期货有限公司独立

董事：新湖中宝股份有限公司独立董事；浙江伟星实业发展股份有限公司独立董事；浙江东方集团股份有限公司独立董事；哈尔滨高科技（集团）股份有限公司独立董事；浙商期货有限公司独立董事。

肖幼航女士，独立董事，1963 年生，上海财经大学硕士，高级会计师，注册会计师。历任杭州市审计局副局长科员；浙江天健会计师事务所五部副经理、综合部经理；浙江南都电源动力股份有限公司财务总监；浙江中秦房地产开发有限公司副总经理。现任上海龙力能源投资有限公司总裁助理。

## 2、监事会成员

王平玉先生，监事长，1951 年生，大专，经济师。历任建设银行杭州分行科长、支行行长、党组副书记、副行长。现任养生堂有限公司总经济师。

赵琦女士，监事，1971 年生，大学本科，注册会计师。曾担任通联资本管理有限公司副总裁。现任中国万向控股有限公司财务管理部执行总经理。

谢志强先生，职工监事，1981 年生，厦门大学金融学专业学士、硕士，特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM）。历任浙江证监局稽查处副主任科员、主任科员，曾借调中国证监会稽查处工作。现任浙商基金管理有限公司监察稽核部总经理。

高远女士，职工监事，1986 年生，复旦大学经济学系学士。曾任安永华明会计师事务所审计员，2009 年加入浙商基金管理有限公司，现任综合管理部总经理。

## 3、公司高管人员

李志惠先生，总经理，简历同上。

聂挺进先生，副总经理，1979 年生，南开大学世界经济专业硕士。历任招商局国际有限公司项目经理；博时基金管理有限公司投资总监、基金经理。

沈阳女士，副总经理，1979 年生，南开大学 EMBA。历任恒生投资管理有限公司研究员、博时基金管理有限公司机构理财部总经理。

郭乐琦女士，督察长，1980 年生，南开大学法学硕士。曾任北京中伦律师事务所上海分所律师、平安信托投资有限责任公司中台风控、北京市柳沈律师事务所律师、上海嘉路律师事务所主任律师及合伙人、平安集团投资管理委员会投资管理中心、CIO 办公室 PE 投资管理经理。

## 4、本基金基金经理

查晓磊先生，1982 年生，曾任香港中文大学中国金融发展与改革研究中心核心

研究员，博时基金博士后工作站研究员博时基金管理有限公司投资策略及大宗商品分析师兼投资经理助理。现任浙商基金管理有限公司衍生品及量化投资部总经理，浙商沪深 300 指数分级证券投资基金、浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

聂挺进先生，投资决策委员会主席，简历同上。

唐桦先生，投资决策委员会委员，1980 年生，上海财经大学国际金融硕士。历任博时基金管理有限公司研究员、基金经理。现任浙商基金管理有限公司股票投资部总经理，浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金基金经理。

黄颖峰先生，投资决策委员会委员，1978 年生，上海财经大学经济学硕士。历任华宸未来基金管理有限公司投研部交易总监、高级研究员。现任浙商基金管理有限公司中央交易室交易总经理。

查晓磊先生，投资决策委员会委员，简历同上。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

#### （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；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照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收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、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者实施其他法律行为；

12、法律法规和中国证监会规定的或基金合同约定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行的发生。

2、基金管理人承诺防止下列行的发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其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）违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏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）除按基金管理人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）违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（11）贬损同行，以抬高自己；

（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。

#### 4、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。

#### (五) 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、不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏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、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (六) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的目标

(1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展；

(3) 确保基金、公司财务及其他信息真实、准确、完整、及时；

(4) 建立和健全法人治理结构，形成合理的决策、执行和监督机制。通过完善

的公司治理结构和风险控制流程，保护基金持有人利益不受侵犯。

## 2、内部控制的原则

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司所有部门、岗位业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每位员工；

(2) 独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；

(3) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

(4) 有效性原则：用科学合理的内控程序和方法，建立合理的内控程序，保证内控制度的有效执行；

(5) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(6) 适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司的经营战略、经营目标等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

(7) 防火墙原则：公司基金投资、交易、研究、评估、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到防范风险的目的。对因业务需要知悉内部信息的人员，应制定严格的批准程序和监督措施；

(8) 成本效益原则：公司通过科学有效的经营管理方法降低各种成本，提高经营效益，通过控制成本实现最佳经济效益，从而达到最佳内控效果。

## 3、内部控制的组织机构

公司内部控制的组织机构可以划分为监督系统、决策与业务执行两大系统，均有明确的层次分工和畅通的监督与执行通道，并建立完善的报告与反馈机制。

### (1) 监督系统

公司监事会、合规与风险控制委员会、监察稽核部为公司不同层面的监督机构，构成相互独立的监督系统。

监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。董事会下设合规与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金资产运作的合法、合规性进行审查、分析和评估。合规与风险控制委员会独立行使职责。监察稽核部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。督察长由董事会聘任，根据董事会的授权对公司的经营活动进行监督。

## （2）决策和执行系统

股东会、董事会、管理层及职能部门构成公司决策与业务执行系统。

股东会是公司的最高权力机构，依照法律和公司章程行使职权。股东会选举董事组成董事会。董事会依照法律和公司章程行使职权。独立董事对公司事项发表不受任何人干预的独立意见并参与表决。董事会聘任公司总经理，由总经理负责公司的日常经营管理。

公司根据独立性、防火墙以及相互制约、互为衔接的原则，设立满足公司经营运作必需的机构、部门及岗位。各部门在分工合作的基础上，明确各岗位相应的责任和职权，建立相互配合、相互制约、相互促进的工作关系。通过制定规范的岗位责任制、合理的工作标准和严格的操作程序，使各项工作规范化、程序化、标准化。

### 4、内部控制的制度体系

公司制定合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程，是公司经营管理遵循的最高文件；第二个层面是公司内部控制大纲，是公司制定各项基本管理制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度，公司日常运作的有针对性并较为具体的行为要求与规范；第四个层面是公司各部门根据业务的需要制定的各种规章及实施细则等。上述不同层面的控制制度的制定、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，较高层面的制度与较低层面的制度有机联系，前者的内容指导和制约后者内容，后者的内容体现和细化前者的内容。

公司章程的修改须经股东会审议通过，监管部门核准后生效。公司内部控制大纲、公司基本管理制度的制订与修改由公司总经理提出议案，经董事会审议通过后实施。各部门的规章及实施细则由相关部门依据公司章程和内部控制大纲提出议案，经公司总经理办公会议审议通过后实施。

监察稽核部对公司基本管理制度、各部门规章及实施细则的执行情况进行日常性的检查和评价，并报公司总经理和督察长。总经理和督察长向有关部门提出改进意见由相关部门负责落实，并由监察稽核部跟踪落实情况并继续检查评估。各部门定期或不定期对涉及到本部门的公司管理制度的执行情况进行自查，并负责落实相关事项。

### 5、内部控制的层次体系

公司内部控制的层次体系共分四层：建立一线岗位的第一道监控防线，属于单人、单岗处理业务的，必须有相应的后续监督机制；建立相关部门、相关岗位之间相互制约的工作程序作为第二道监控防线，建立业务文件在公司与托管银行之间、相关部门和相关岗位之间传递的标准，明确文字签字的授权；成立独立的监察稽核部，对各部门、各岗位各项业务全面实行监督反馈，必要时对有关部门进行不定期突击检查，形成第三道防线；董事会合规与风险控制委员会和公司风险控制委员会形成公司的第四道防线。

#### 6、基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

成立时间：1992 年 10 月 14 日

法定代表人：吴建

组织形式：股份有限公司

注册资本：10,685,572,211 元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391 号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号

联系人：徐昊光

联系电话：（010）85238982

传真：（010）85238680

### （二）主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险管理室和运营室 4 个职能处室。资产托管部共有员工 35 人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

### （三）基金托管业务经营情况

华夏银行于 2005 年 2 月 23 日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神，始终遵循“安全保管基金资产，提供优质托管服务”的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验，严格履行法律和托管协议所规定的各项义务，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至 2016 年 6 月末，本公司托管证券投资基金、券商集合计划、银行理财、信托、保险等各类产品合计 671 只，托管规模 16,109.54 亿元，实现托管手续费收入 3.92 亿元。

#### （四）基金托管人的内部风险控制制度说明

##### 1、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。

##### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会负责华夏银行股份有限公司的风险管理与内部控制工作，总行审计部对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管部内部专门设置了风险管理室，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的职权和能力。

##### 3、内部风险控制的原则

1) 合法性原则：必须符合国家及监管部门的法律法规和各项制度并贯穿于托管业务经营管理活动的始终；

2) 完整性原则：一切业务、管理活动的发生都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部门、岗位和人员；

3) 及时性原则：托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度；

4) 审慎性原则：必须实现防范风险、审慎经营，保证基金财产的安全与完整；

5) 有效性原则：必须根据国家政策、法律及华夏银行经营管理的发展变化进行适时修订；必须保证制度的全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外；

6) 独立性原则：资产托管部内部专门设置了风险管理室，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的职权和能力。

##### 4、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理办法、实施细则、岗位职责、业务操作流程等，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；专门设置业务操作区，封闭管理，实施音像监控；指定专人负责受托资产的信息披露工作，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （五）基金托管人对本基金管理人进行监督的方法和程序

托管人根据《基金法》、《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同的规定，对基金投资范围、投资对象、投资比例、融资比例、基金投资禁止行为、基金资产净值计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、相关信息披露等进行监督。

1、基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同规定的行为，应及时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确认。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。

2、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事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

3、基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，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。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### 1) 浙商基金管理有限公司直销中心

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

电话：021-60350857

传真：021-60350836

联系人：邹均乐

##### 2) 浙商基金管理有限公司网上直销

公司网址：<http://www.zsfund.com>

客服电话：400-067-9908（免长途话费）；021-60359000

#### 2、代销机构

##### 1) 华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系电话：010-85238667

传真：010-85238680

联系人：陈秀良

客服电话：95577

公司网址：<http://www.hxb.com.cn>

##### 2) 中国工商银行股份有限公司

客服电话：95588

公司网址：<http://www.icbc.com.cn>

##### 3) 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：蒋超良



联系电话：010-85108227

传真：010-85109219

联系人：刘一宁

客服电话：95599

公司网址：<http://www.abchina.com>

4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客服电话：95559

公司网址：<http://www.bankcomm.com>

5) 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系电话：010-58560666

传真：010-57092611

联系人：董云巍

客服电话：95568

公司网址：<http://www.cmbc.com.cn>

6) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：倪苏云、虞谷云

客服电话：95528

公司网址：<http://www.spdb.com.cn>

7) 浙商银行股份有限公司

住所：浙江杭州庆春路 288 号

办公地址：浙江杭州庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

联系电话：0571-87659546

传真：0571-87659188

联系人：毛真海

客服电话：95527

公司网址：<http://www.czbank.com>

8) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：<http://www.ebscn.com>

9) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号

办公地址：南京市中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

联系电话：025-83290979

传真：025-51863323

联系人：万鸣

客服电话：95597

公司网址：<http://www.htsc.com.cn>

10) 华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24 层-32 层

法定代表人：李工

联系电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

联系人：甘霖

客服电话：96518、400-80-96518

公司网址：<http://www.hazq.com>

11) 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

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：唐静

客服电话：400-800-8899

公司网址：<http://www.cindasc.com>

12) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系电话：021-63325888

传真：021-63326173

联系人：吴宇

客服电话：95503

公司网址：<http://www.dfzq.com.cn>

13) 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

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏琪

客服电话：95521

公司网址：<http://www.gtja.com>

14) 民生证券有限责任公司

住所：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

联系电话：010-85127999

传真：010-85127917

联系人：赵明

客服电话：4006198888

公司网址：<http://www.msza.com>

15) 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

法定代表人：王开国

联系电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：李笑鸣

客服电话：95553

公司网址：<http://www.htsec.com>

16) 上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区西藏中路 336 号

办公地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

联系电话：021-53519888

传真：021-63608300

联系人：张瑾

客服电话：4008918918（全国）、021-962518

公司网址：<http://www.962518.com>

17) 财通证券有限责任公司

住所：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系电话：0571-87925129

传真：0571-87818329

联系人：乔骏

客服电话：0571-96336（上海地区：962336）

公司网址：<http://www.ctsec.com>

18) 国海证券股份有限公司

住所：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3F

法定代表人：张雅锋

联系电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

客服电话：95563

公司网址：<http://www.ghzq.com.cn>

19) 申万宏源证券股份有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：邓寒冰

客服电话：021-33389888

公司网址：<http://www.swhysc.com>

20) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

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：刘化军

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：<http://www.longone.com.cn>

21) 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

办公地址：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

联系电话：95511-8

传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽

客服电话：95511

公司网址：<http://www.pingan.com>

22) 浙商证券股份有限公司

住所：杭州市杭大路 1 号黄龙世纪 A 区 6-7 楼

办公地址：杭州市杭大路 1 号黄龙世纪 A 区 6-7 楼

法定代表人：吴承根

联系电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：谢项辉

客服电话：0571-967777

公司网址：<http://www.stocke.com.cn>

23) 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

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系电话：010-66568430

传真：010-66568536

联系人：田薇

客服电话：4008-888-888

公司网址：<http://www.chinastock.com.cn>

24) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层

法定代表人：王东明

联系电话：010-84588888

传真：010-84865560

联系人：张于爱

客服电话：95558

公司网址：<http://www.cs.ecitic.com>

25) 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  
(266061)

法定代表人：杨宝林

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：0532-96577

公司网址：<http://www.zxwt.com.cn>

26) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

联系电话：0571-85783737

联系人：王霏霏

客服电话：0571-95548

公司网址：<http://www.bigsun.com.cn>

## 27) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路 758 号 23 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：郭林

联系电话：021-32229888

传真：021-021-68728703

联系人：陈敏

客服电话：021-63340678

公司网址：<http://www.ajzq.com>

## 28) 中航证券有限公司

住所：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

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

联系电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

客服电话：400-8866-567

公司网址：<http://www.avicsec.com/>

## 29) 广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河区天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：<http://www.gf.com.cn>

## 30) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣



联系电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

客服电话：95562

公司网址：<http://www.xyzq.com.cn>

31) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客服电话：95538

公司网址：<http://www.qlzq.com.cn>

32) 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

联系电话：010-85130588

传真：010-65182261

联系人：权唐

客服电话：4008888108

公司网址：<http://www.csc108.com>

33) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市益田路江苏大厦 38—45 层

办公地址：深圳市益田路江苏大厦 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

联系人：林生迎

客服电话：95565、4008888111

公司网址：<http://www.newone.com.cn>

34) 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

办公地址：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

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

公司网址：<http://www.guosen.com.cn>

35) 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 邮编：100032

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层 邮编：100088

法定代表人：林义相

联系电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：尹伶

客服电话：010-66045678

公司网址：<http://www.txsec.com>

36) 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

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

联系电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

联系人：张玉静

客服电话：4006-788-887

公司网址：<http://www.zlfund.cn> 及 <http://www.jjmmw.com>

37) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：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

联系电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

联系人：敖玲

客服电话：400-089-1289

公司网址：<http://www.erichfund.com>

38) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系电话：021-54509998

传真：021-64385308

联系人：潘世友

客服电话：4001818188

公司网址：<http://www.1234567.com.cn>

39) 杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系电话：0571-28829790, 021-60897869

传真：0571-26698533

联系人：周嫵旻

客服电话：4000-766-123

公司网址：<http://www.fund123.cn>

40) 上海好买基金销售有限公司

住所：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

联系电话：021-58870011

传真：021-68596919

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

公司网址：<http://www.ehowbuy.com>

41) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系电话：021-38602377

传真：021-38509777

联系人：方成

客服电话：400-821-5399

公司网址：<http://www.noah-fund.com>

42) 万银财富(北京)基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

法定代表人：李招弟

联系电话：010-59393923

传真：010-59393074

联系人：高晓芳

客服电话：400-808-0069

公司网址：<http://www.wy-fund.com>

43) 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 1 号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

联系电话：0571-88920897

传真：0571-86800423

联系人：杨翼

客服电话：4008-773-772

公司网址：<http://www.5ifund.com>

44) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系电话：010-57418829

传真：010-57569671

联系人：魏争

客服电话：400-678-5095

公司网址：<http://www.niuji.net>

45) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 号

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

联系电话：021-50583533-8081

传真：021-50583633

联系人：叶雪飞

客服电话：400-067-6266

公司网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

46) 深圳宜投基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街 1 号深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心 2405

法定代表人：华建强

联系电话：0755-23919681

传真：0755-88603185

联系人：马文静

客服电话：4008-955-811

公司网址：<http://www.yitfund.com>

## 47) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层

法定代表人：于婷婷

联系人：董浩

客服电话：400-068-1176

公司网址：[www.jimufund.com](http://www.jimufund.com)

## 48) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三楼

法定代表人：徐刚

存续期间：永续经营

联系电话：075-22119700

联系人：彭莲

客服电话：95564

公司网址：[www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

## 49) 联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市福泉北路 518 弄 8 座 3 楼

法定代表人：燕斌

联系人：凌秋艳

客服电话：4000-466-788

公司网址：[www.91fund.com.cn](http://www.91fund.com.cn)

## 50) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系电话：33323999-8048

传真：33323830

联系人：李栋

客服电话：400-821-3999

公司网址：tty.chinapnr.com

51) 中大期货有限公司

注册地址：杭州市中山北路 310 号五矿大厦 3 层 12 层东

办公地址：浙江省杭州市中山北路 310 号五矿大厦 3 楼

法定代表人：颜亮

客服电话：400-8810-999

公司网址：www.zdqh.com

52) 日发资产管理（上海）有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 33 楼

3301 室

办公地址：东亚银行大厦 33 楼 3301 室

法定代表人：周泉恭

客服电话：400-021-1010

公司网址：www.rffund.com

53) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-818-8000

公司网址：www.myfund.com

54) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区双井乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

客服电话：4008-980-618

公司网址：www.chtfund.com

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

联系电话：010-59378839

传真：010-59378907

联系人：朱立元

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

机构名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层

办公地址：上海南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法定代表人：姚建华

电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：王国蓓

经办注册会计师：王国蓓、黄超



## 六、基金份额的分类与净值计算规则

### （一）基金份额结构

本基金的基金份额包括浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额（即“浙商沪深 300 份额”）、浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“浙商稳健份额”）与浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“浙商进取份额”）。其中，浙商稳健份额、浙商进取份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变。

### （二）基金份额的自动分离与分拆规则

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，投资人在场外认购的全部基金份额将确认为浙商沪深 300 份额；场内认购的全部基金份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即浙商稳健份额和浙商进取份额。

根据浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额比例，浙商稳健份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，浙商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，浙商沪深 300 份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。浙商稳健份额与浙商进取份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

投资人可在场内申购和赎回浙商沪深 300 份额，投资人可选择将其场内申购的浙商沪深 300 份额按 1:1 的比例分拆成浙商稳健份额和浙商进取份额。投资人可按 1:1 的配比将其持有的浙商稳健份额和浙商进取份额申请合并为场内的浙商沪深 300 份额后赎回。

投资人可在场外申购和赎回浙商沪深 300 份额。场外申购的浙商沪深 300 份额不进行分拆，但基金合同另有规定的除外。投资人可将其持有的场外浙商沪深 300 份额跨系统转登记至场内并申请将其分拆成浙商稳健份额和浙商进取份额后上市交易。

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“二十一、基金份额折算”），其所产生的浙商沪深 300 份额不进行自动分拆。

投资人可选择将上述折算产生的浙商沪深 300 份额按 1:1 的比例分拆为浙商稳健份额和浙商进取份额。

### （三）浙商稳健份额和浙商进取份额的净值计算规则

根据浙商稳健份额和浙商进取份额的风险和收益特性不同，本基金份额所分离的两类基金份额浙商稳健份额和浙商进取份额具有不同的净值计算规则。

在本基金存续期内，浙商稳健份额和浙商进取份额的净值计算规则如下：

#### 1、浙商稳健份额的约定收益率为“一年期银行定期存款利率（税后）+3%”

计算浙商稳健份额约定收益率的一年期银行定期存款利率（税后）是指基金合同生效日或生效后次年起的每年 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利率。

“封顶条款”：当[一年期银行定期存款利率（税后）+3%]大于 12%的时候，约定年收益率按 12%计算。

2、本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对浙商稳健份额和浙商进取份额分别进行净值计算。浙商稳健份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额，本基金净资产优先确保浙商稳健份额的本金及约定应得收益；浙商进取份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金在优先确保浙商稳健份额的本金及约定应得收益后，将剩余净资产计为浙商进取份额的净资产。

3、每 2 份浙商沪深 300 份额所代表的资产净值等于 1 份浙商稳健份额和 1 份浙商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，则浙商稳健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，则浙商稳健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次日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证浙商稳健份额的基金份额持有人的约定收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，浙商稳健份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

### （四）基金份额净值的计算公式

本基金作为分级基金，按照浙商稳健份额和浙商进取份额的净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值：

#### 1、浙商沪深 300 份额的基金份额净值计算公式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日浙商沪深 300 的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金的基金份额余额（包括浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额、浙商进取份额）总数

设 T 日为基金份额净值计算日， $NAV_{\text{沪深300}}$  为 T 日每份浙商沪深 300 份额的基金份额净值； $NAV_{\text{稳健}}$  为 T 日浙商稳健份额的基金份额参考净值； $NAV_{\text{进取}}$  为 T 日浙商进取份额的基金份额参考净值。

例：假设 T 日为 2012 年 7 月 2 日，闭市后，本基金的基金资产净值约为 61.38 亿元，浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额的基金份额分别为 24 亿份、18 亿份与 18 亿份，则浙商沪深 300 份额的基金份额净值计算如下：

$$NAV_{\text{沪深300}} = 61.38 / (24 + 18 + 18) = 1.023 \text{ 元}$$

#### 2、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值计算公式

$$NAV_{\text{稳健}} = 1 + R \times (t / \text{基金份额参考净值计算日所在年实际天数})$$

$$NAV_{\text{进取}} = 2 \times NAV_{\text{沪深300}} - NAV_{\text{稳健}}$$

R 为浙商稳健份额的约定年收益率。浙商稳健份额的约定年收益率为“一年期银行定期存款利率（税后）+3%”。 $t = \text{Min}\{\text{自该会计年度年初至 T 日，基金合同生效日至 T 日，最近的不定期份额折算日次日至 T 日}\}$ 。

“封顶条款”：当[一年期银行定期存款利率（税后）+3%]大于 12%的时候，约定年收益率按 12%计算。

例：假定 T 日为 2012 年 11 月 1 日，闭市后，浙商沪深 300 份额的基金份额净值为 1.356 元，浙商稳健份额的基金份额参考净值为 1.058 元，则浙商进取份额的基金份额参考净值计算如下：

$$NAV_{\text{进取}} = 2 \times 1.356 - 1.058 = 1.654 \text{ 元}$$

浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值的计算，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。

### 3、浙商稳健份额和浙商进取份额的份额参考净值公告

浙商稳健份额和浙商进取份额的份额参考净值在当天收市后计算，并在下一日内与浙商沪深 300 份额的基金份额净值一同公告。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。

#### （五）浙商稳健份额与浙商进取份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，浙商稳健份额与浙商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持有人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浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

## 七、基金的募集

本基金的募集申请经中国证监会证监许可【2012】91 号文核准，募集期自 2012 年 3 月 28 日起至 2012 年 4 月 27 日止。募集期内，本基金的有效认购份额为 354,249,853.79 份，利息结转的基金份额为 113,748.38 份，两项合计共 354,363,602.17 份基金份额。

## 八、基金合同的生效

### （一） 基金合同生效

本基金基金合同于 2012 年 5 月 7 日生效。

### （二） 基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

## 九、浙商沪深 300 份额的申购与赎回

基金合同生效后，投资人可通过场外或场内两种方式对浙商沪深 300 份额进行申购与赎回。浙商稳健份额、浙商进取份额只上市交易，不接受申购与赎回。

### （一）浙商沪深 300 份额申购和赎回的场所

投资人办理浙商沪深 300 份额场外申购与赎回业务的场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理浙商沪深 300 份额场外申购、赎回业务。

投资人办理浙商沪深 300 份额场内申购与赎回业务的场所为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理浙商沪深 300 份额场内申购、赎回业务。

本基金场外、场内代销机构名单将由基金管理人在发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

投资人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浙商沪深 300 份额的申购与赎回。若基金管理人或其委托的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行浙商沪深 300 份额的申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

本基金已于 2012 年 7 月 13 日起开始办理日常申购、赎回业务。基金投资者在开放日申请办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### （三）浙商沪深 300 份额申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即浙商沪深 300 份额申购、赎回价格以申请当日收市后计算的浙商沪深 300 份额的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即浙商沪深 300 份额的申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、浙商沪深 300 份额持有人在场外销售机构赎回浙商沪深 300 份额时，遵循“先进先出”原则，即注册登记确认日期在前的浙商沪深 300 份额先赎回，注册登记确认日期在后的浙商沪深 300 份额后赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率；

4、当日浙商沪深 300 份额的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日业务办理时间结束后不得撤销；

5、投资人办理浙商沪深 300 份额场外申购、赎回应使用基金账户，办理浙商沪深 300 份额场内申购、赎回应使用深圳证券账户；

6、投资人办理浙商沪深 300 份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。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场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可依法更改上述原则，但应在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （四）浙商沪深 300 份额申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出浙商沪深 300 份额申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构和深圳证券交易所规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的浙商沪深 300 份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人委托中国证券登记结算有限责任公司作为注册登记机构代为办理注册登记业务。注册登记机构应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，注册登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，如投资人未进行前述查询，因申请未得到注册登记机构的确认而造成的损失，由投资人自行承担。基金销



售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

在法律法规允许的范围内，本基金注册登记机构可根据业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

### 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，基金管理人或基金管理人委托的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### 4、申购与赎回的登记结算

(1) 投资人 T 日申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理登记结算手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

(2) 投资人 T 日赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的登记结算手续。

(3) 在法律法规允许的范围内，本基金注册登记机构可对上述登记结算办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照《信息披露办法》有关规定予以公告。

### (五) 浙商沪深 300 份额申购和赎回的数额和价格

#### 1、申购金额、赎回份额及余额的处理方式

(1) 投资人办理浙商沪深 300 份额场内申购时，单笔申购最低金额为 50,000 元人民币。投资人办理浙商沪深 300 份额场外申购时，单笔申购最低金额为 10 元人民币（含申购费）。通过直销中心单笔申购最低金额为 10,000 元人民币（含申购费）。通过本基金管理人网上交易系统办理浙商沪深 300 份额申购业务的单笔申购最低金额为 10 元（含申购费）。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

(2) 浙商沪深 300 份额持有人赎回时，单笔赎回份额无最低限制，但通过场内申请赎回的单笔份额必须是整数份。浙商沪深 300 份额持有人因赎回、转换等原因导致其单个基金账户内剩余的浙商沪深 300 份额低于 100 份时，注册登记系统将不对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

2、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前 2 日依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

### 3、浙商沪深 300 份额的申购份额计算

浙商沪深 300 份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。注册登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。计算公式如下：

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

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

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

申购费用以四舍五入方式保留到小数点后两位。通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担；通过场内方式进行申购的，申购份额计算结果采用截位法保留至整数位，不足 1 份部分对应的申购资金将返还给投资人。

例一：某投资人通过场外投资 50,000 元申购浙商沪深 300 份额，对应费率为 1.2%，假设申购当日浙商沪深 300 份额的基金份额净值为 1.128 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 1.2\%) = 49,407.11 \text{ 元}$$

申购费用=50,000-49,407.11=592.89 元

申购份数=净申购金额/T 日基金份额净值=49,407.11/1.128=43,800.63 份

即：该投资人通过场外投资 50,000 元申购浙商沪深 300 份额，假设申购当日浙商沪深 300 份额的基金份额净值为 1.128 元，则可得到 43,800.63 份浙商沪深 300 份额。

例二：某投资人通过场内投资 100,000 元申购浙商沪深 300 份额，对应的申购费率为 1.2%，假设申购当日浙商沪深 300 份额的基金份额净值为 1.025 元，则其中申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额=100,000/(1+1.2%)=988,14.23 元

申购手续费=100,000-988,14.23=1,185.77 元

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值=988,14.23/1.025=96,404.13 份

因场内申购份额计算结果采用截位法保留至整数份，故投资人申购所得份额为 96,404 份，不足 1 份部分对应的申购资金将返还给投资人。

#### 4、浙商沪深 300 份额的赎回金额计算

投资人在赎回浙商沪深 300 份额时需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

赎回总金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费=赎回份额×T 日基金份额净值×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费

赎回金额单位为元，计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

例三：某浙商沪深 300 份额持有人持有 10,000 份浙商沪深 300 份额一年后（未满 2 年）决定从场外赎回，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日浙商沪深 300 份额的基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.25%=28.70 元

净赎回金额=11,480-28.70=11,451.30 元

即：该浙商沪深 300 份额持有人持有 10,000 份浙商沪深 300 份额一年后（未满 2 年）从场外赎回，假设赎回当日浙商沪深 300 份额的基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,451.30 元。

例四：某浙商沪深 300 份额持有人从场内赎回 10,000 份浙商沪深 300 份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日浙商沪深 300 份额的基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.5%=57.40 元

净赎回金额=11,480-57.40=11,422.60 元

即：该浙商沪深 300 份额持有人从深圳证券交易所场内赎回 10,000 份浙商沪深 300 份额，假设赎回当日浙商沪深 300 份额的基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

#### 5、浙商沪深 300 份额的基金份额净值计算

浙商沪深 300 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，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。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。

#### （六）浙商沪深 300 份额申购与赎回的费用

1、浙商沪深 300 份额的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售等各项费用。浙商沪深 300 份额的赎回费用由赎回基金份额的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。

2、根据基金合同的规定，浙商沪深 300 份额的申购费率不超过 5%，赎回费率不超过 5%。

3、浙商沪深 300 份额的场外申购费率如下：

单笔申购金额	场外申购费率
M<100 万	1.2%
100 万≤M<200 万	0.8%
200 万≤M<500 万	0.4%
M≥500 万	1000 元/笔

（注：M：申购金额；单位：元）

浙商沪深 300 份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

4、浙商沪深 300 份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减，场外赎回的实际执行的费率如下：

持有时间	场外赎回费率
$Y < 1$ 年	0.5%
$1 \text{ 年} \leq Y < 2$ 年	0.25%
$Y \geq 2$ 年	0

（注：Y：持有时间，其中 1 年为 365 日，2 年为 730 日）

浙商沪深 300 份额的场内赎回费率为固定值 0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。

从场内转托管至场外的浙商沪深 300 份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

5、基金管理人可以在不违反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，针对以特定交易方式（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必要手续后，基金管理人可以适当调低浙商沪深 300 份额的申购费率和赎回费率。

6、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 2 日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （七）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者对浙商沪深 300 份额的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请。
- 2、证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 4、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的技术保障等异常情况发生导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

5、基金管理人合理判断认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他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利益的情形。

7、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（除第 5 项外），并且基金管理人决定拒绝或暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

#### （八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的浙商沪深 300 份额赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例支付给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。

#### （九）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的浙商沪深 300 份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额（包括浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额）的 10%，即为巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。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。

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或认为因支付投资人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金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基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，按照投资人在提交赎回申请时事先选择的延期赎回或取消赎回区别处理，选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 暂停赎回：浙商沪深 300 份额连续 2 日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受浙商沪深 300 份额的赎回申请；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进行公告。

## 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

### (十) 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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应在指定媒体上刊登浙商沪深 300 份额重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

#### （十一）基金转换

在法律法规及监管机构允许且相关注册登记机构业务规则允许的情况下，本基金管理人可以开展浙商沪深 300 份额与其它基金之间的转换业务，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。

#### （十二）定期定额投资计划

本基金已于 2012 年 7 月 13 日起开始办理定期定额投资计划。投资人在办理浙商沪深 300 份额定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。



## 十、浙商稳健份额与浙商进取份额的上市交易

### （一）上市交易的基金份额

基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请浙商稳健份额与浙商进取份额的上市交易。

本基金份额上市后，登记在登记结算系统中浙商稳健份额与浙商进取份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的浙商沪深 300 份额通过办理跨系统转登记业务转至登记结算系统并成功分拆后，方可上市交易。

### （二）上市交易的地点

深圳证券交易所

### （三）上市交易的时间

2012 年 7 月 13 日

### （四）上市交易的规则

- 1、浙商稳健份额、浙商进取份额分别采用不同的交易代码上市交易；
- 2、浙商稳健份额、浙商进取份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日的基金份额参考净值；
- 3、浙商稳健份额、浙商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；
- 4、浙商稳健份额、浙商进取份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 5、浙商稳健份额、浙商进取份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 6、浙商稳健份额、浙商进取份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。

### （五）上市交易的费用

浙商稳健份额、浙商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。

### （六）上市交易的行情揭示

浙商稳健份额、浙商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基金份额参考净值。

### （七）上市交易的注册登记

投资人 T 日买入成功后，注册登记机构在 T 日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自 T+1 日（含该日）后有权卖出该部分基金；投资人 T 日卖出成功后，注册登记机构在 T 日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

（八）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

浙商稳健份额、浙商进取份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

（九）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内容进行调整的，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，但应在本基金更新的招募说明书中列示。

（十）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，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 十一、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记等其他相关业务

### （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、申购或通过跨系统转登记从场内转入场外的浙商沪深 300 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；浙商稳健份额、浙商进取份额以及场内认购、申购或通过跨系统转登记从场外转入场内的浙商沪深 300 份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人的深圳证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的浙商沪深 300 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浙商稳健份额和浙商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 比例申请合并为浙商沪深 300 份额后再申请场内赎回。

3、登记在注册登记系统中的浙商沪深 300 基金份额既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转登记后通过跨系统转登记转至证券登记结算系统，经过基金份额持有人进行申请按 1:1 比例分离为浙商稳健份额和浙商进取份额后在深圳证券交易所上市交易。

### （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（交易单元）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理浙商沪深 300 份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有浙商沪深 300 份额的系统内转托管。

3、基金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浙商稳健份额、浙商进取份额上市交易或浙商沪深 300 份额场内赎回的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4、基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

### （三）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的浙商沪深 300 份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、浙商沪深 300 份额跨系统转登记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。

3、基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### （四）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

#### （五）基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

（六）如遇法律法规及注册登记机构、证券交易所相关规则等发生变动，上述（四）、（五）规则等相应进行调整。

## 十二、基金的份额配对转换

基金合同生效后，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

（一）份额配对转换是指本基金的浙商沪深 300 份额与浙商稳健份额、浙商进取份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。

1、分拆。基金份额持有人将其持有的每 2 份浙商沪深 300 份额的场内份额申请转换成 1 份浙商稳健份额与 1 份浙商进取份额的行为。

2、合并。基金份额持有人将其持有的每 1 份浙商稳健份额与 1 份浙商进取份额进行配对申请转换成 2 份浙商沪深 300 份额的场内份额的行为。

（二）份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见基金管理人届时发布的相关公告。

投资人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的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、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）份额配对转换的业务办理时间

浙商 300 份额与浙商稳健份额和浙商进取份额之间的份额配对转换业务自 2012 年 6 月 11 日起开始开通办理。

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），具体业务办理时间见基金管理人届时发布的相关公告，在公告规定时间之外不办理份额配对转换业务。

若深圳证券交易所交易时间、交易规则或注册登记机构规则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、申请进行“分拆”的浙商沪深 300 份额的场内份额必须是偶数。

3、申请进行“合并”的浙商稳健份额与浙商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两者的比例为 1:1。

4、浙商沪深 300 份额的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转登记为浙商沪深 300 份额的场内份额后方可进行。

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、基金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，并在正式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。

#### （五）份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

#### （六）暂停份额配对转换的情形

1、基金管理人认为继续接受份额配对转换可能损害基金份额持有人利益时决定暂停份额配对转换的情形。

2、深圳证券交易所、注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务的情形。

3、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。

发生前述情形的，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。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，并依照有关规定在至少一家指定媒体公告。

#### （七）份额配对转换的业务办理费用

投资人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佣金，具体见相关业务办理机构公告。

## 十三、基金的投资

### （一）投资目标

本基金采用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。

### （二）投资理念

指数化投资可以以较低的成本获取良好的长期市场回报，通过跟踪中国股票市场具有代表性的指数，使投资人充分分享中国经济增长和证券市场发展的成果。

### （三）投资范围

本基金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（包括中小板股票、创业板股票以及中国证监会允许基金投资的其他股票）、债券、货币市场工具、股指期货、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，但需符合中国证监会的相关规定。

### （四）投资策略

本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以股指期货等金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

## 1、资产配置策略

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）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标，本基金将注重仓位管理，积极防范由于申购、赎回等因素产生的跟踪误差。

## 2、股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据沪深300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。

### （1）股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，按照沪深 300 指数的权重对其逐步买入，构建本基金的股票投资组合。当遇到成分股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依照指数权重购买某成分股及预期标的指数成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场判断，结合研究分析，对基金资产进行适当的调整，力争在风险可控的情况下，以便实现对跟踪误差的有效控制。

### （2）股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据沪深 300 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，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，对其进行适时调整。此外需要指出的是，基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法进行适当的替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，此时基金将会采用合理方法进行适当的替代。

#### ① 定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，及时进行跟踪调整。

#### ② 不定期调整

A. 若出现标的指数成份股临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。



B. 跟踪标的指数成份股及其备选成份股公司信息，包括股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌，以及其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合的每日交易策略。

C. 根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略以应对基金的申购赎回，从而有效跟踪标的指数。

D. 本基金将参与一级市场新股认购和上市公司增发或配股，由此得到的股票将在其规定持有期之后的10个交易日内全部卖出，其中标的指数成份股及其备选成份股和将要成为成份股或备选股的除外。

E. 因本基金基金合同约定的基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人将在10个交易日内进行调整，以符合有关限制规定。

### ③ 特殊情形下的调整

本基金在某些特殊情形下将选择其他股票或股票组合对目标指数中的成份股票加以替换，这些情形包括：A. 法律法规的限制；B. 标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股；C. 本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；D. 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼等；E. 标的指数成份股为与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或有其他重大利害关系的公司发行的股票。在选择替代股票时，为尽可能的降低跟踪误差，本基金将采用定性与定量相结合的方法，在对替代与被替代股票上市企业主营业务、价格走势等指标相关性分析的基础上，优先从标的指数成份股及备选成份股中选择基本面良好、流动性充裕的股票，搭配买入非成份股等方法进行适当的替代。

### 3、风险预估和控制

为有效地控制基金的跟踪误差，本基金将根据基金投资组合相对业绩比较基准的资产配置暴露度、行业配置暴露度和个股投资比例暴露度，对基金的跟踪误差进行估计和控制，预先防范基金收益表现偏离业绩比较基准过大的风险。

开放式指数基金跟踪误差的来源包括对受限成份股的替代投资、成份股调整时的交易策略以及基金每日现金流入/流出的建仓/变现策略、成份股股息的再投资策略等。基金管理人将通过对这些因素的有效管理，追求实现正的跟踪偏离。

$$\text{日均跟踪误差} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (r_i - \bar{r})^2}{n-1}} \quad \text{其中}$$

$r_i$  = 第  $i$  日基金份额净值收益率 - 第  $i$  日业绩比较基准收益率;

$$\bar{r} = \frac{\sum_{i=1}^n r_i}{n}, \quad n \text{ 为考察的天数。}$$

年跟踪误差 = 日均跟踪误差  $\times \sqrt{K}$ , 其中  $K$  为一年的实际交易天数。

#### 4、债券投资策略

本基金根据流动性管理的需要, 选取到期日在一年以内的央票、国债、政策性金融债等进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略, 根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化, 并利用债券定价技术, 进行个券选择。

#### 5、金融衍生产品投资策略

基金管理人可运用股指期货, 以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 参与股指期货的投资, 以管理投资组合的系统性风险, 改善组合的风险收益特性。此外, 本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理, 如预期大额申购赎回等, 以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组, 授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项, 同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外, 基金管理人还将做好培训和准备工作。

此外, 本基金还将参与风险低且可控的债券回购等投资, 以增加收益。如未来法律法规或中国证监会允许, 本基金还可投资于期权、期货、ETF 以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品, 适当利用金融衍生产品组合的持有收益覆盖一定的基金固定费用, 并利用其衍生产品的杠杆作用, 减少现金及债券对跟踪指数的拖累, 从而使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。

### (五) 标的指数与业绩比较基准

#### 1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证指数有限公司发布的沪深 300 指数。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数, 覆盖了沪深市场六成左右的市值, 具有良好的市场代表性。它是中国第一条由权威机构编制、发布的全市场指数, 流动性高, 可投资性强, 能够反映 A 股市场总体发展趋势。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

如果沪深 300 指数被停止编制及发布，或沪深 300 指数由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他代表性更强，更合适投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益的前提下，履行适当程序后，更换本基金的标的指数；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。标的指数单纯更名或者调整指数编制方法的，该等变更无需召开基金份额持有人大会。

## 2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。

如果今后法律法规发生变化，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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。

本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

## （六）风险收益特征

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，浙商稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征；浙商进取份额具有高风险、高预期收益的特征。

## （七）投资决策与投资管理流程

### 1、投资决策依据

以《基金法》和本基金基金合同等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

### 2、投资决策流程

本基金采用投资决策委员会指导下的基金经理负责制。

（1）每日跟踪分析：本基金跟踪指数，因此指数跟踪的偏离度和风险分析尤为重要。投研部行业研究员对基准指数成份股中基本面变化、流动性变化的企业情况提供及时的风险分析报告。运营保障部每日提供基金申购赎回的数据分析，供基金经理投资决策参考。

(2) 基金经理根据风险分析和申购赎回分析报告, 在追求跟踪误差最小化的目标下, 控制股票组合与指数的偏差风险、流动性风险, 降低交易成本。

(3) 中央交易室依据基金经理的指令, 负责在投资指令规定的时间、投资规模和价格范围内执行交易指令, 及时反馈指令执行情况, 并按照有关规定整理和存档交易记录。中央交易室须按时向基金经理反馈交易执行情况, 遇有异常情况要及时向投资总监反映。

(4) 监察稽核部负责对投资过程进行日常监督和实时风险监控。

(5) 基金经理定期或不定期对组合进行评价, 根据评价的结果决定是否进行组合调整。对需要调整的组合, 基金经理应根据投资流程及时调整, 对不需要调整的组合持续跟踪。

(6) 在确保基金持有人利益的前提下, 公司有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。

## (八) 投资限制

### 1、基金投资组合比例限制

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) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的3%;

(2) 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%;

(3) 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%;

(4) 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%;

(5) 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%;

(6) 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 10%;

(7) 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 10%;

(8) 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；

(9) 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；

(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%；

(11) 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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(12) 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 100%。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；

(13) 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）不低于基金资产的 85%；

(14) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(15) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

若法律法规或监管部门对上述约定的投资组合比例限制规定进行变更的，以变更后的规定为准。若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 2、禁止行为

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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

(九) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、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；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、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。

(十) 基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(十一) 基金投资组合报告

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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据基金合同规定，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	51,367,496.06	93.72
	其中：股票	51,367,496.06	93.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,431,169.18	6.26
8	其他各项资产	10,660.71	0.02
9	合计	54,809,325.95	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	56,681.30	0.10
B	采矿业	1,904,202.59	3.50
C	制造业	17,070,883.13	31.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,293,930.49	4.22
E	建筑业	1,749,498.29	3.22
F	批发和零售业	1,128,279.90	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,762,420.40	3.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,437,663.58	4.48
J	金融业	18,617,389.31	34.23
K	房地产业	2,255,770.85	4.15

L	租赁和商务服务业	667,905.88	1.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	347,808.49	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	93,168.40	0.17
R	文化、体育和娱乐业	799,498.11	1.47
S	综合	182,395.34	0.34
	合计	51,367,496.06	94.46

(2) 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

(1) 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	64,228	2,194,028.48	4.03
2	600016	民生银行	140,615	1,302,094.90	2.39
3	601166	兴业银行	79,145	1,263,945.65	2.32
4	600036	招商银行	67,336	1,212,048.00	2.23
5	601328	交通银行	164,416	909,220.48	1.67
6	600519	贵州茅台	2,977	886,878.07	1.63
7	600000	浦发银行	51,577	850,504.73	1.56
8	600837	海通证券	48,309	768,596.19	1.41
9	600030	中信证券	46,869	755,528.28	1.39
10	601288	农业银行	228,708	715,856.04	1.32

(2) 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合



本基金本报告期期末未持有债券。

5、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

本基金本报告期期末未持有债券。

6、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

本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期期末未持有贵金属。

8、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

本基金本报告期期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

(2) 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。

(3) 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,156.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	628.36
5	应收申购款	1,875.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	10,660.71
---	----	-----------

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资的前十名股票不存在流通受限的情况。

2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

(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资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

(十二) 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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(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
2012.5.7-2012.12.31	-3.60%	1.08%	-6.69%	1.14%	3.09%	-0.06%
2013.1.1-2013.12.31	-6.68%	1.31%	-7.14%	1.32%	0.46%	0.01%
2014.1.1-2014.12.31	48.35%	1.14%	48.72%	1.15%	-0.37%	-0.01%
2015.1.1-2015.12.31	4.44%	2.36%	5.72%	2.36%	-1.28%	0.00%
2016.1.1-2016.6.30	-15.36%	1.80%	-14.65%	1.75%	-0.71%	0.05%
2016.7.1-2016.9.30	4.79%	0.74%	3.01%	0.76%	1.78%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配

置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

(2) 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 5 月 7 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间已满一年。图示日期为 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 9 月 30 日。

2、本基金建仓期为 6 个月，从 2012 年 5 月 7 日至 2012 年 11 月 6 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## 十四、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金的基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和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）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及基金合同约定的其他费用。基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十五、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场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。

### （二）估值方法

#### 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估值方法估值；

（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估值方法估值；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、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。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、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。

5、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。

6、股指期货品种将按照相关规定进行估值。

7、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。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算、基金份额净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，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、基金份额净值的计算结果对外予以公布。

### (三) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。

### (四) 估值程序

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。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) 基金份额净值的计算

本基金作为分级基金，按照浙商稳健份额和浙商进取份额的净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值：

### 1、浙商沪深 300 份额的基金份额净值计算公式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日浙商沪深 300 的基金份额净值=T 日闭市后的基金资产净值/T 日本基金（包括浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额、浙商进取份额）的基金份额余额总数

设 T 日为基金份额净值计算日， $NAV_{\text{沪深300}}$  为 T 日每份浙商沪深 300 份额的基金份额净值； $NAV_{\text{稳健}}$  为 T 日浙商稳健份额的基金份额参考净值； $NAV_{\text{进取}}$  为 T 日浙商进取份额的基金份额参考净值。

### 2、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值计算公式

$$NAV_{\text{稳健}} = 1 + R \times (t / \text{基金份额参考净值计算日所在年实际天数})$$

$$NAV_{\text{进取}} = 2 \times NAV_{\text{沪深300}} - NAV_{\text{稳健}}$$

R 为浙商稳健份额的约定年收益率。浙商稳健份额的约定年收益率为“一年期银行定期存款利率（税后）+3%”。 $t = \text{Min}\{\text{自该会计年度年初至 T 日，基金合同生效日至 T 日，最近的不定期份额折算日次日至 T 日}\}$ 。

“封顶条款”：当[一年期银行定期存款利率（税后）+3%]大于 12%的时候，约定年收益率按 12%计算。

浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值的计算，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。

### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 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、或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责

任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿。

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不能预见、不能避免、不能克服，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人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，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；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）差错的责任方对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财产损失时，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财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差



错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，由责任方承担；但若经诉讼或仲裁的终局裁判，基金财产未获得补偿的部分可列入基金费用项下的相关科目，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、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直接损失。

(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。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### (七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它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；

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人的利益，已决定延迟估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （八）基金净值的确认

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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### （九）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 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、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十六、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、公允价值变动损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损益后的余额。

### （二）基金期末可供分配利润

基金期末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止日）基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）收益分配原则

本基金（包括浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额、浙商进取份额）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，如果终止浙商稳健份额与浙商进取份额的运作，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原则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 十七、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许可使用费；
- 4、基金财产划拨支付的银行费用；
- 5、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费；
- 10、基金上市初费和上市月费；
- 11、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （三）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

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：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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。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、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值

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，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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、基金合同生效后的标的指数许可使用费

标的指数许可使用费即标的指数许可使用基点费，标的指数许可使用基点费的计费时间从基金合同生效日开始计算；标的指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的 0.02%/年，基金合同生效当年，不足 3 个月的，按照 3 个月收费。标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取）。

在通常情况下，标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率与收取下限的日均摊销数额两者孰高的原则进行计提。标的指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：收取下限的日均摊销数额=5 万/季度\*4 季度/年÷当年天数（365 天或 366 天）≈550 元/天

$$H = \text{Max} (E \times 0.02\% / \text{当年天数}, 550)$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十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上一季度的标的指数许可使用基点费。

4、除管理费、托管费、标的指数许可使用费和前述（一）所列之外的基金费用，由基金托管人与基金管理人协商后，根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### （四）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十八、基金份额折算

### （一）定期份额折算

在浙商稳健份额、浙商沪深 300 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。

#### 1、定期份额折算的折算日

每个会计年度第一个工作日。

#### 2、定期份额折算的折算对象

基金份额定期折算日登记在册的浙商稳健份额、浙商沪深 300 份额。浙商进取份额不参与定期折算，除非定期折算时同时满足不定期折算的条件。

#### 3、定期份额折算的折算频率

每年折算一次。

#### 4、定期份额折算的折算方式

浙商稳健份额和浙商进取份额按照基金合同“基金份额的分类与净值计算规则”中规定的净值计算规则进行净值计算，对浙商稳健份额的约定应得收益进行定期份额折算，每 2 份浙商沪深 300 份额将按 1 份浙商稳健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，浙商稳健份额和浙商进取份额的份额配比保持 1:1 的比例。

对于浙商稳健份额期末的约定收益，即浙商稳健份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内浙商沪深 300 份额分配给浙商稳健份额持有人。浙商沪深 300 份额持有人持有的每 2 份浙商沪深 300 份额将按 1 份浙商稳健份额获得新增浙商沪深 300 份额的分配。持有场外浙商沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外浙商沪深 300 份额的分配；持有场内浙商沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内浙商沪深 300 份额的分配。

经过上述份额折算，浙商稳健份额的基金份额参考净值和浙商沪深 300 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日，本基金将对浙商稳健份额和浙商沪深 300 份额进行已实现的约定收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行浙商稳健份额上一年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

(1) 浙商沪深 300 份额折算

$$NAV_{\text{沪深300}}^{\text{后}} = NAV_{\text{沪深300}}^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000)$$

浙商沪深 300 份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 =

$$0.5 \times NUM_{\text{沪深300}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000) / NAV_{\text{沪深300}}^{\text{后}}$$

定期份额折算后浙商沪深 300 份额的份额数 = 定期份额折算前浙商沪深 300 份额的份额数 + 浙商沪深 300 份额持有人新增的浙商沪深 300 份额的份额数

其中：

$NAV_{\text{沪深300}}^{\text{前}}$ ：折算前浙商沪深 300 份额的基金份额净值，下同

$NAV_{\text{沪深300}}^{\text{后}}$ ：折算后浙商沪深 300 份额的基金份额净值，下同

$NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ ：折算前浙商稳健份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{\text{沪深300}}^{\text{前}}$ ：折算前浙商沪深 300 份额的份额数，下同

持有浙商沪深 300 份额的场外份额的持有人将按上述折算方式获得新增浙商沪深 300 份额的场外份额的分配；持有浙商沪深 300 份额的场内份额的持有人将按上述折算方式获得新增浙商沪深 300 份额的场内份额的分配。

浙商沪深 300 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；浙商沪深 300 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) 浙商稳健份额折算

定期份额折算后浙商稳健份额的基金份额参考净值 = 1.000 元

定期份额折算后浙商稳健份额的份额数 = 定期份额折算前浙商稳健份额的份额数

浙商稳健份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 =

$$[NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000)] / NAV_{\text{沪深300}}^{\text{后}}$$

其中：

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ ：折算前浙商稳健份额的份额数，下同



浙商稳健份额折算成浙商沪深 300 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

### （3）浙商进取份额折算

浙商进取份额不进行份额折算，其基金份额参考净值和份额数保持不变。

### （4）折算后浙商沪深 300 份额的总份额数

折算后浙商沪深 300 份额的总份额数 = 定期份额折算前浙商沪深 300 份额的份额数 + 浙商沪深 300 份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 + 浙商稳健份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数。

## 5、举例

假设基金份额折算日折算前浙商沪深 300 份额的基金份额净值为 1.356 元，上会计年度末浙商稳健份额的基金份额参考净值为 1.058 元，浙商进取份额的基金份额参考净值为 1.654 元，投资人甲持有浙商沪深 300 份额的场内份额 100,000 份，投资人乙持有浙商稳健份额 60,000 份，投资人丙持有浙商进取份额 80,000 份，则：

份额折算后浙商沪深 300 份额的基金份额净值 =  $1.356 - 0.5 \times (1.058 - 1.000) = 1.327$  元，浙商稳健份额的基金份额参考净值 = 1.000 元

投资人甲新增的浙商沪深 300 份额数 =  $[0.5 \times 100,000 \times (1.058 - 1.000)] / 1.327 = 2185$  份（场内份额取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金财产）

投资人乙新增的浙商沪深 300 份额数 =  $[60,000 \times (1.058 - 1.000)] / 1.327 = 2,622$  份（场内份额取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金财产）

即：份额折算后，投资人甲共持有浙商沪深 300 份额的场内份额 102,185 份，投资人乙共持有浙商稳健份额 60,000 份及浙商沪深 300 份额的场内份额 2,622 份，投资人丙仍持有浙商进取份额 80,000 份。

## 6、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浙商稳健份额与浙商进取份额的上市交易和浙商沪深 300 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。

## 7、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》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 8、特殊情形的处理

若在定期份额折算日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，将按照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下进行份额折算，即：当浙商沪深 300 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元；当浙商进取份额的基金份额参考净值小于或等于 0.270 元。

#### 1、当浙商沪深 300 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时

##### （1）不定期份额折算的折算日

浙商沪深 300 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，基金管理人即可确定折算日。

##### （2）不定期份额折算的折算对象

基金份额折算日登记在册的浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额。

##### （3）不定期份额折算的折算频率

不定期。

##### （4）不定期份额折算的折算方式

当浙商沪深 300 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对浙商稳健份额、浙商进取份额和浙商沪深 300 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保浙商稳健份额和浙商进取份额的比例为 1:1，份额折算后浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值、浙商沪深 300 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

#### ① 浙商沪深 300 份额折算

浙商沪深 300 份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 =

$$\left[ NUM_{\text{沪深300}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{沪深300}}^{\text{前}} - 1.000) \right] / 1.000$$

浙商沪深 300 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；浙商沪深 300 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 浙商稳健份额折算

折算后浙商稳健份额的份额数保持不变，即： $NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} = NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$

浙商稳健份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 =

$$\left[ NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000) \right] / 1.000$$

其中，

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}}$ ：折算后浙商稳健份额的份额数，下同

浙商稳健份额折算成浙商沪深 300 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

### ③ 浙商进取份额折算

折算后浙商进取份额的份额数保持不变，即： $NUM_{\text{进取}}^{\text{后}} = NUM_{\text{进取}}^{\text{前}}$

浙商进取份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 =

$$\left[ NUM_{\text{进取}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{进取}}^{\text{前}} - 1.000) \right] / 1.000$$

其中，

$NUM_{\text{进取}}^{\text{前}}$ ：折算前浙商进取份额的份额数，下同

$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}$ ：折算后浙商进取份额的份额数，下同

$NAV_{\text{进取}}^{\text{前}}$ ：折算前浙商进取份额的份额参考净值，下同

浙商进取份额折算成浙商沪深 300 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

### ④ 折算后浙商沪深 300 份额的总份额数

折算后浙商沪深 300 份额的总份额数 = 不定期份额折算前浙商沪深 300 份额的份额数 + 浙商沪深 300 份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 + 浙商稳健份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 + 浙商进取份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数

### (5) 举例

某投资人持有浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额各 10,000 份，在本基金的不定期份额折算日，三类份额的基金份额净值如下表所示，折算后浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值	基金份额	基金份额净值	基金份额
浙商沪深 300 份额	2.020000000 元	10,000 份	1.000 元	20,200 份浙商沪深 300 份额
浙商稳健份额	1.030000000 元	10,000 份	1.000 元	10,000 份浙商稳健份额 + 新增 300 份浙商沪深

				300 份额的场内份额
浙商进取份额	3.010000000 元	10,000 份	1.000 元	10,000 份浙商进取份额+新增 20,100 份浙商沪深 300 份额的场内份额

(6) 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浙商稳健份额与浙商进取份额的上市交易和浙商沪深 300 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。

(7) 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》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果，并报中国证监会备案。

2、当浙商进取份额的基金份额参考净值小于或等于 0.270 元时

(1) 不定期份额折算的折算日

浙商进取份额的基金份额参考净值小于或等于 0.270 元，基金管理人即可确定折算日。

(2) 不定期份额折算的折算对象

基金份额折算日登记在册的浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额。

(3) 不定期份额折算的折算频率

不定期。

(4) 不定期份额折算的折算方式

当浙商进取份额的基金份额参考净值小于或等于 0.270 元时，本基金将分别对浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额进行份额折算，份额折算后浙商稳健份额和浙商进取份额的比例仍保持 1:1 不变。份额折算后浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额的份额数将得到相应的缩减。

① 浙商沪深 300 份额折算

$$NUM_{\text{沪深300}}^{\text{后}} = (NUM_{\text{沪深300}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{沪深300}}^{\text{前}}) / 1.000$$

浙商沪深 300 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；浙商沪深 300 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 浙商进取份额折算

$$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}} = (NUM_{\text{进取}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{进取}}^{\text{前}}) / 1.000$$

浙商进取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。

③ 浙商稳健份额折算

折算后浙商稳健份额和浙商进取份额的份额配比保持 1:1 不变，即：

$$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} = NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}$$

浙商稳健份额持有人新增的场内浙商沪深 300 份额数 =

$$(NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} \times 1.000) / 1.000$$

浙商稳健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。浙商稳健份额折算成浙商沪深 300 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

④ 折算后浙商沪深 300 份额的总份额数

折算后浙商沪深 300 份额的总份额数 = 不定期份额折算后浙商沪深 300 份额的份额数 + 浙商稳健份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数

(5) 举例

某投资人持有浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额各 10,000 份，在本基金的不定期份额折算日，三类份额的基金份额净值如下表所示，折算后，浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额基金份额净值均调整为 1.000 元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值	基金份额	基金份额净值	基金份额
浙商沪深 300 份额	0.614000000 元	10,000 份	1.000 元	6,140 份浙商沪深 300 份额
浙商稳健份额	1.030000000 元	10,000 份	1.000 元	1,980 份浙商稳健份额 + 新增 8,320 份浙商沪深 300 份额的场内份额
浙商进取份额	0.198000000 元	10,000 份	1.000 元	1,980 份浙商进取份额

#### （6）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浙商稳健份额与浙商进取份额的上市交易和浙商沪深 300 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。

#### （7）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》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 十九、浙商稳健份额与浙商进取份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，浙商稳健份额与浙商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浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自的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。

浙商稳健份额与浙商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，浙商稳健份额、浙商进取份额将全部转换成浙商沪深 300 份额的场内份额。

### （一）份额转换基准日

浙商稳健份额与浙商进取份额终止运作日（如该日为非交易日，则顺延至下一个交易日）。

### （二）份额转换方式

在转换基准日日终，以浙商沪深 300 份额的基金份额净值为基准，浙商稳健份额、浙商进取份额按照各自的基金份额参考净值转换成浙商沪深 300 份额的场内份额。

浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额持有人持有的转换后浙商沪深 300 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

浙商稳健份额（或浙商进取份额）的转换比例 = 份额转换基准日浙商稳健份额（或浙商进取份额）的基金份额参考净值 / 份额转换基准日浙商沪深 300 份额的基金份额净值。

浙商稳健份额（或浙商进取份额）基金份额持有人持有的转换后浙商沪深 300 份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前浙商稳健份额（或浙商进取份额）的份额数 × 浙商稳健份额（或浙商进取份额）的转换比例。

### （三）份额转换后的基金运作

浙商稳健份额与浙商进取份额全部转换为浙商沪深 300 份额的场内份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回。

### （四）份额转换的公告

浙商稳健份额与浙商进取份额进行份额转换结束后，基金管理人应在 2 日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。



## 二十、基金的会计和审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，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，经通报基金托管人，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《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。

## 二十一、基金的信息披露

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。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，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。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露。

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份额发售机构；
- 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。

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。

公开披露的基金信息包括：

### （一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 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，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证

监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

## （二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## （三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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报刊和网站上。

## （四）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## （五）基金份额上市交易公告书

浙商稳健份额和浙商进取份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在浙商稳健份额和浙商进取份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## （六）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1、本基金的基金合同生效后，在浙商稳健份额和浙商进取份额两类份额开始上市交易或者浙商沪深 300 份额开始办理申购赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额与浙商进取份额各自的基金份额参考净值；

2、在浙商稳健份额与浙商进取份额两类份额上市交易或者本基金开始办理基金份额申购或者赎回后，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介，披露开放日的浙商沪深 300 份额的基金份额净值和基金份额累计净值、浙商稳健份额与浙商进取份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计参考净值；

3、基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额与浙商进取份额各自的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值以及浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额与浙商

进取份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计参考净值登载在指定报刊和网站上。

#### （七）浙商沪深 300 份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明浙商沪深 300 份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （八）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1、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报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2、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报刊上；

3、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报刊和网站上；

4、基金合同生效不足 2 个月的，本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；

5、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。

#### （九）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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事件时，有关信息披露义务人应当按照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，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中国证监会派出机构备案：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议；
- 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 50%；
- 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 30%；
- 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、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加或减少代销机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、浙商沪深 300 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、本基金暂停接受申购、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份额配对转换申请；
- 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、浙商稳健份额与浙商进取份额终止运作；
- 30、浙商稳健份额与浙商进取份额终止运作后浙商稳健份额与浙商进取份额的份额转换；
- 31、基金推出新业务或服务；
- 32、中国证监会或基金合同规定的其他事项。

(十) 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。

#### （十一）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。

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

#### （十二）中国证监会规定的其他信息

#### （十三）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 二十二、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、市场风险

本基金为证券投资基金，证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此，宏观经济因素、国家政策、市场变动、行业与个股业绩的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

##### （1）经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，国家经济、微观经济、行业及上市公司的盈利水平也可能呈周期性变化，从而影响到证券市场及行业的走势。

##### （2）政策风险

因国家的各项政策，如财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等发生变化，导致证券市场波动而影响基金投资收益，产生风险。

##### （3）利率风险

由于利率发生变化和波动使得证券价格和证券利息产生波动，从而影响到基金业绩。

##### （4）信用风险

当证券发行人不能够实现发行时所做出的承诺，按时足额还本付息的时候，就会产生信用风险。信用风险主要来自于发行人和担保人。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其他债券的信用风险可根据专业机构的信用评级确定。当证券的信用等级发生变化时，可能会产生证券的价格变动，从而影响到基金资产。

##### （5）再投资风险

再投资获得的收益又被称做利息的利息，这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

##### （6）购买力风险

基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降。

### （7）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如经营决策、技术变革、新产品研发、竞争加剧等风险。如果基金所投资的上市公司基本面或发展前景产生变化，可能导致其股价的下跌，或者可分配利润的降低，使基金预期收益产生波动。虽然基金可以通过分散化投资来减少风险，但不能完全规避。

## 2、管理风险

### （1）管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、手段和技术等因素，而影响基金收益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如资产配置、类属配置不能达到预期收益目标；也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

### （2）新产品创新带来的风险

随着中国证券市场不断发展，各种国外的投资工具也将被逐步引入，这些新的投资工具在为基金资产提供保值增值功能的同时，也会产生一些新的风险，例如利率期货带来的期货投资风险，期权产品带来的定价风险等。同时，基金管理人也可能因为对这些新的投资产品的不熟悉而发生投资错误，产生投资风险。

## 3、估值风险

本基金采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示利率风险，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估基金资产净值。基金管理人和基金托管人将共同协商，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，使调整后的基金资产净值更公允地反映基金资产价值。

## 4、流动性风险

本基金面临的流动性风险主要表现在几个方面：建仓成本控制不力，建仓时效不高；基金资产变现能力差，或变现成本高；在投资人大额赎回时缺乏应对手段；证券投资中个券和个股的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是：

### （1）市场整体流动性问题

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响，在不同状况下，其流动性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本基金的操



作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。这种风险在发生大额申购和大额赎回时表现尤为突出。

#### (2) 市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本基金在进行投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加基金投资成本。这种风险在出现个股和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

### 5、指数投资的特有风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，标的指数为沪深 300 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

本基金为跟踪指数的股票型基金，基金资产主要投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股，因此沪深 300 指数的市场表现将影响到基金业绩的表现，当沪深 300 指数出现收益变动、波动提高时，本基金的收益可能会受到影响。

#### (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回报率可能存在偏离。

#### (4) 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。

### 6、分级结构运作的特有风险

本基金为分级基金，浙商稳健份额和浙商进取份额的运作有别于普通的开放式基金和封闭式基金，投资于本基金还将面临以下基金运作特有的风险：

### （1）上市交易的风险

本基金在基金合同生效后，浙商稳健份额和浙商进取份额在深圳证券交易所挂牌上市交易。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基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险。

### （2）杠杆机制风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，浙商稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征；浙商进取份额具有高风险、高预期收益的特征。

由于浙商进取份额内含杠杆机制的设计，浙商进取份额的净值变动幅度将大于浙商沪深 300 份额和浙商稳健份额的净值变动幅度，即浙商进取份额的净值波动性将高于其他两类基金份额。

### （3）折/溢价交易风险

浙商稳健份额和浙商进取份额上市交易后，由于受市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额净值可能发生偏离而出现折/溢价交易风险。尽管份额配对转换机制有助于将折/溢价交易风险降低至较低水平，但浙商稳健份额和浙商进取份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于份额配对转换机制的影响，浙商稳健份额和浙商进取份额的交易价格可能会相互影响。

### （4）风险收益特征变化风险

根据本基金份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施基金份额折算后，浙商稳健份额持有人或浙商进取份额持有人将会获得一定比例的浙商沪深 300 份额的场内份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

当浙商稳健份额和浙商进取份额终止运作后，浙商稳健份额和浙商进取份额将全部转换成浙商沪深 300 份额的场内份额，基金份额持有人所持有的基金份额也将面临风险收益特征出现变化的风险。

### （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在场内通过上市交易买入浙商稳健份额或浙商进取份额的一部分投资人可能面临的风险。由于在二级市场办理基金份额上市交易的证券公司并不全部具备中国证监会核准的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许为投资人办理基金份额赎回。因此，如果投资人通过不具备基金代销资格的证券公司买入浙商稳健份额或浙商进取份额，在其参与份额折算后，则折算新增的浙商沪深 300 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浙商稳健份额或浙商进取份额卖出，或者将新增的浙商沪深 300 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，在浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商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浙商沪深 300 份额与浙商稳健份额、浙商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浙商稳健份额和浙商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

在存续期内，本基金（包括浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额和浙商进取份额）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浙商沪深 300 份额和浙商稳健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。

7、投资股指期货的风险

(1) 股指期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。

(2) 股指期货合约到期时，基金账户仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割，因此无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

(3) 持仓组合品种变现时，由于市场流动性严重不足或头寸持有集中度过大导致未在合理价位成交，存在变现损失风险。

(4) 股指期货设置了涨跌停板限制，基金账户中股指期货持仓可能无法平仓，存在流动性风险。

(5) 交易所设置了持仓限制，基金账户中股指期货持仓超过限制比例，会被交易所或期货公司强行平仓，存在强行平仓风险。

(6) 交易所设置了强制减仓限制，基金账户中股指期货持仓符合交易所强制减仓范围的，存在强制减仓的风险。

(7) 基金托管人调拨资金不及时，无法向期货公司缴足交易保证金，会被期货公司强行平仓，存在资金流动性风险。

## 8、其他风险

### (1) 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、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

### (2) 大额申购/赎回风险

本基金是开放式基金，基金规模将随着投资人对基金单位的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量申购而导致基金管理人在短期内被迫持有大量现金；或由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售所持有的证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

### (3) 顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资人在赎回基金单位时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

### (4) 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金代销机构可能因不可抗力无法正常工作，从而产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## （二）声明

本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。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。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，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，由于基金投资人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，本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中的特定风险等。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

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。

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- （1）转换基金运作方式；
- （2）变更基金类别；
- （3）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （4）变更基金份额持有人大会程序；
- （5）更换基金管理人、基金托管人；
- （6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）终止浙商稳健份额与浙商进取份额的运作；
- （9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- （10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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变更后公布，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- （2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （3）因相应的法律法规、证券交易所和注册登记机构的业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；
- （4）在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；
- （5）基金推出新业务或服务；
- （6）基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规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) 标的指数更名或调整指数编制方法；  
(8) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；  
(9) 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；  
(10) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体公告。

### (二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、中国证监会规定的其他情况。

### (三) 基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算；

(2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员；

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼或仲裁；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；

(4) 根据基金合同终止日浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额与浙商进取份额各自的基金份额参考净值分别计算浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的浙商稳健份额与浙商进取份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。



## 6、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。

## 二十四、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。

## 二十五、托管协议的内容摘要

托管协议的内容摘要见附件二。

## 二十六、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目及内容。主要服务内容如下：

### （一）公开信息披露服务

- 1、披露公司（基金管理人）信息；
- 2、披露基金信息；
- 3、其他信息的披露。

### （二）基金份额持有人交易记录查询服务

基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

### （三）基金份额持有人交易对账单寄送服务

一般情况下通过书面或电子形式向投资人提供定期或不定期对账单。

### （四）定期定额投资计划

基金管理人利用代销机构网点为投资人提供定期定额投资的服务。通过定期投资计划，投资人可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。具体实施时间和业务规则另行公告。

### （五）资讯定制服务

#### 1、手机短信服务

基金份额持有人可以通过本基金管理人网站和客户服务热线人工应答预留手机号码，按需要定制短信内容并选择发送频率，我们将根据定制要求提供相应服务。

#### 2、电子邮件服务

基金份额持有人可以在本基金管理人网站注册，登录定制所需要的各类公开信息。如果留下个人邮箱，将会收到定制的信息。

### （六）客户服务中心项目

#### 1、客户服务电话

投资人如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打客户服务热线：400-067-9908（免长途话费）；021-60359000。

#### 2、互联网站及电子信箱

公司网址：<http://www.zsfund.com>

电子信箱：[services@zsfund.com](mailto:services@zsfund.com)

#### （七）客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供客户服务电话、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。

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。

## 二十七、其他应披露事项

序号	公告事项	披露日期
1	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金上网发售提示性公告	2012-3-28
2	浙商基金管理有限公司关于新增中信建投证券股份有限公司等为浙商沪深 300 指数分级证券投资基金代销机构的公告	2012-4-5
3	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同生效公告	2012-5-8
4	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	2012-5-14
5	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	2012-5-21
6	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	2012-5-28
7	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	2012-6-4
8	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金开通跨系统转托管与份额配对转换业务的公告	2012-6-7
9	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	2012-6-11
10	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	2012-6-18
11	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	2012-6-25
12	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	2012-7-2
13	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	2012-7-9
14	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额与浙商进取份额上市交易公告书	2012-7-10
15	浙商基金管理有限公司关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金参与部分代销机构基金费率优惠活动的公告	2012-7-11
16	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资的业务公告	2012-7-11
17	浙商基金管理有限公司关于新增交通银行股份有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2012-7-13
18	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额和浙商进取份额上市交易提示性公告	2012-7-13
19	浙商基金管理有限公司关于新增深圳众禄基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2012-7-20
20	浙商基金管理有限公司关于新增浙商银行股份有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2012-7-27
21	浙商基金管理有限公司关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金代	2012-9-4

	销机构并参加费率优惠活动的公告	
22	浙商基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2012-9-4
23	浙商基金管理有限公司关于新增杭州数米基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2012-10-23
24	浙商基金管理有限公司关于新增上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2012-10-23
25	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2012 年第 3 季度报告	2012-10-24
26	浙商基金管理有限公司关于新增诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	2012-11-8
27	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2012-12-5
28	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书(2012 年第 1 期)	2012-12-18
29	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要(2012 年第 1 期)	2012-12-18
30	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告	2012-12-25
31	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	2012-12-26
32	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	2012-12-27
33	关于浙商稳健份额定期份额折算后次日前收盘价调整的提示公告	2012-12-27
34	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2012-12-28
35	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额 2013 年度约定年基准收益率的公告	2013-1-4
36	浙商基金 2012 年度最后一个交易日基金资产净值等公告	2013-1-4
37	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间浙商稳健份额停牌的公告	2013-1-7
38	关于浙商稳健定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	2013-1-8
39	关于浙商沪深 300 指数分级基金定期折算结果及恢复交易的公告	2013-1-8
40	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2012 年第 4 季度报告	2013-1-22
41	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金调整场外单笔申购最低金额的公告	2013-3-6
42	浙商基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司开展的“金融@家”电子银行申购开放式基金产品费率优惠活动的公告	2013-3-29

43	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2012 年年度报告摘要	2013-3-30
44	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2012 年年度报告	2013-3-30
45	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2013 年第 1 季度报告	2013-4-19
46	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司基金定投业务及定投费率优惠活动的公告	2013-4-25
47	浙商基金管理有限公司关于网上直销平台新增通联支付股份有限公司相关银行卡支付业务的公告	2013-5-31
48	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2013 年第 1 期）	2013-6-20
49	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2013 年第 1 期）	2013-6-20
50	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	2013-6-29
51	浙商基金 2013 年度半年度最后一个自然日基金资产净值等公告	2013-7-2
52	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2013 年第 2 季度报告	2013-7-17
53	浙商基金关于网上直销平台增加通联支付系统温州银行卡及恢复交通银行卡支付业务的公告	2013-7-25
54	浙商基金管理有限公司关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金参加华夏银行股份有限公司定投申购费率优惠活动的公告	2013-7-29
55	浙商基金管理有限公司关于旗下基金掌趣科技股票（300315）估值调整的公告	2013-8-7
56	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2013 年半年度报告	2013-8-28
57	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2013 年半年度报告摘要	2013-8-28
58	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持招商地产（000024）股票估值调整的公告	2013-9-11
59	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持省广股份（002400）股票估值调整的公告	2013-9-17
60	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2013 年第 3 季度报告	2013-10-25
61	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持长园集团（600525）股票估值调整的公告	2013-10-30
62	浙商沪深 300 指数分级更新招募说明书	2013-12-20
63	浙商沪深 300 指数分级更新招募说明书摘要	2013-12-20
64	浙商沪深 300 指数分级基金办理定期份额折算业务的提示性公告	2013-12-25
65	关于浙商沪深 300 指数分级基金办理定期份额折算业务的公告	2013-12-27
66	关于浙商稳健份额 2014 年度约定年收益率的公告	2014-1-2
67	关于浙商沪深 300 指数分级基金办理定期份额折算业务期间浙商稳健份额停牌的公告	2014-1-3
68	关于浙商沪深 300 指数分级基金定期折算结果及恢复交易的公告	2014-1-6



69	浙商基金管理有限公司关于新增万银财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2014-1-13
70	浙商沪深 300 指数分级基金 2013 年第 4 季度报告	2014-1-21
71	浙商基金管理有限公司关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2014-2-25
72	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2013 年年度报告	2014-3-28
73	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	2014-4-19
74	关于新增北京钱景财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2014-6-16
75	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2014 年第 1 期）（摘要）	2014-6-19
76	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2014 年第 1 期）	2014-6-19
77	关于旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司手机银行渠道费率优惠活动的公告	2014-7-1
78	关于旗下基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	2014-7-1
79	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年第 2 季度报告	2014-7-21
80	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年半年度报告摘要	2014-8-27
81	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年半年度报告	2014-8-27
82	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年第 3 季度报告	2014-10-25
83	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持物产中大（600704）股票估值调整的公告	2014-11-28
84	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持信雅达（600571）股票估值调整的公告	2014-11-29
85	浙商基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司开展的“金融@家”电子银行申购开放式基金产品费率优惠活动的公告	2014-12-12
86	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2014 年第 2 期）	2014-12-12
87	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2014 年第 2 期）（摘要）	2014-12-12
88	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持广田股份（002482）股票估值调整的公告	2014-12-16
89	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	2014-12-29
90	浙商基金 2014 年度最后一个交易日基金资产净值等公告	2015-01-05
91	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额 2015 年度约定年基准收益率的公告	2015-01-05
92	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 办理定期份额折算业务期间浙商稳健份额停复牌的公告	2015-01-06
93	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 定期折算结果及恢复交易的公告	2015-01-07

94	关于浙商稳健定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	2015-01-07
95	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	2015-01-20
96	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告	2015-03-27
97	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告摘要	2015-03-27
98	浙商基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司开展的“金融@家”电子银行申购开放式基金产品费率优惠活动的公告	2015-03-31
99	浙商基金管理有限公司关于旗下基金调整 交易所固定收益品种估值方法的公告	2015-03-31
100	浙商基金管理有限公司关于增聘浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理的公告	2015-03-31
101	浙商基金管理有限公司关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理变更的公告	2015-04-04
102	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	2015-04-22
103	浙商基金管理有限公司关于新增上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	2015-05-06
104	关于旗下基金所持城投控股（600649）股票估值调整的公告	2015/5/21
105	关于旗下基金所持中国南车（601766）股票估值调整的公告	2015/5/22
106	关于旗下基金所持中颖电子（300327）股票估值调整的公告	2015/5/22
107	关于旗下基金所持中炬高新（600872）股票估值调整的公告	2015/5/23
108	关于旗下基金所持西藏药业（600211）股票估值调整的公告	2015/5/26
109	浙商基金新增深圳宜投基金为旗下基金代销机构的公告	2015/5/29
110	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持维尔利（300190）股票估值调整的公告	2015/6/3
111	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 期）	2015/6/19
112	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 期）(摘要)	2015/6/19
113	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持长城汽车（601633）股票估值调整的公告	2015/6/27
114	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持华东医药（000963）股票估值调整的公告	2015/6/27
115	浙商基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	2015/6/30
116	浙商基金 2015 年半年度最后一个交易日基金资产净值等公告	2015/7/1
117	浙商基金关于公司、高级管理人员及基金经理投资旗下基金的公告	2015/7/9
118	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持长江电力（600900）股票估值调整的公告	2015/7/9
119	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持上海家化（600315）股票估值调整的公告	2015/7/9
120	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持益生股份（002458）股票估值调整的公告	2015/7/10
121	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持景峰医药（000908）股票估值调整的公告	2015/7/15
122	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持大连圣亚（600593）股票估值调整的公告	2015/7/18
123	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	2015/7/20

124	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持天龙集团（300063）股票估值调整的公告	2015/7/30
125	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加数米基金网费率优惠活动的公告	2015/8/5
126	浙商基金管理有限公司关于增聘浙商沪深 300 指数分级证券投资基金经理的公告	2015/8/13
127	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加天天基金网费率优惠活动的公告	2015/8/25
128	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持五粮液（000858）股票估值调整的公告	2015/8/26
129	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	2015/8/26
130	浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告	2015/8/26
131	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持电广传媒（000917）股票估值调整的公告	2015/8/28
132	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持国投电力（600886）股票估值调整的公告	2015/8/28
133	浙商基金新增联讯证券为旗下基金代销机构的公告	2015/9/1
134	浙商基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	2015/9/2
135	浙商基金管理有限公司关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理的公告	2015/9/8
136	浙商基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金最低申购金额的公告	2015/9/10
137	浙商基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在天天基金销售平台申购金额下限的公告	2015/9/10
138	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持雅本化学（300261）股票估值调整的公告	2015/9/17
139	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持铜陵有色（000630）股票估值调整的公告	2015/9/26
140	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持西藏药业（600211）股票估值调整的公告	2015/10/16
141	浙商基金旗下部分基金参加平安证券申购费率优惠活动的公告	2015/10/20
142	浙商基金新增上海联泰资产管理有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2015/10/20
143	浙商聚潮新思维混合型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	2015/10/23
144	浙商基金新增积木基金为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告	2015/10/28
145	浙商基金旗下基金投资资产支持证券的公告	2015/11/7
146	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加好买基金网费率优惠活动的公告	2015/11/11
147	浙商基金新增上海汇付金融服务有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2015/11/24
148	浙商基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2015/11/24
149	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京乐融多源投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	2015/11/25

150	浙商基金管理有限公司关于新增上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2015/11/30
151	浙商基金管理有限公司关于新增北京展恒基金销售股份有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2015/12/14
152	浙商基金管理有限公司关于新增北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2015/12/14
153	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级更新招募说明书 2015 年第 2 期</a>	2015/12/21
154	浙商沪深 300 指数分级更新招募说明书摘要 2015 年第 2 期	2015/12/21
155	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加利得基金费率优惠活动的公告	2015/12/23
156	浙商基金管理有限公司关于新增日发资产管理（上海）有限公司为旗下基金代销机构的公告	2015/12/24
157	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	2015/12/25
158	浙商基金管理有限公司关于新增中大期货有限公司为旗下基金代销机构的公告	2015/12/28
159	<a href="#">关于浙商沪深 300 指数分级基金办理定期份额折算业务的公告</a>	2015/12/29
160	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行费率优惠活动的公告	2015/12/31
161	浙商基金管理有限公司关于新增深圳众禄金融控股股份有限公司为旗下基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2015/12/31
162	浙商基金管理有限公司关于新增北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	2015/12/31
163	浙商基金管理有限公司关于旗下基金调整开放时间的公告	2015/12/31
164	<a href="#">浙商基金 2015 年度最后一个交易日基金资产净值等公告</a>	2016/01/01
165	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额 2016 年度约定年基准收益率的公告	2016/01/04
166	浙商基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	2016/01/04
167	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间浙商稳健份额停复牌的公告	2016/01/05
168	浙商基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	2016/01/06
169	关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金定期折算结果及恢复交易的公告	2016/01/06
170	关于浙商稳健定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	2016/01/06
171	浙商基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开	2016/01/07

	放时间的公告	
172	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持万科 A（000002）股票估值调整的公告	2016/01/09
173	关于浙商基金管理有限公司旗下部分基金净值揭示异常的提示	2016/01/13
174	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年第 4 季度报告</a>	2016/01/22
175	<a href="#">浙商基金关于旗下部分基金在平安证券开通定期定额投资的公告</a>	2016/02/22
176	浙商基金管理有限公司关于旗下基金所持泰格医药（300347）股票估值调整的公告	2016/02/29
177	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年年度报告</a>	2016/03/25
178	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年年度报告摘要</a>	2016/03/25
179	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司开展的电子银行基金申购费率优惠活动的公告	2016/04/01
180	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年第 1 季度报告</a>	2016/04/21
181	<a href="#">浙商基金管理有限公司关于旗下基金 所持雷鸣科化（600985）股票估值调整的公告</a>	2016/05/12
182	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级更新招募说明书 2016 年第 1 期</a>	2016/06/20
183	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要 2016 年第 1 期</a>	2016/06/20
184	<a href="#">浙商基金关于旗下部分基金 在陆金所开通定期定额投资并参与费率优惠活动的公告</a>	2016/06/24
185	<a href="#">浙商基金 2016 年半年度最后一个交易日 基金资产净值等公告</a>	2016/07/01
186	<a href="#">浙商基金管理有限公司关于旗下基金 所持格力电器（000651）股票估值调整的公告</a>	2016/07/08
187	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年第 2 季度报告</a>	2016/07/19
188	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告</a>	2016/08/24
189	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告摘要</a>	2016/08/24
190	<a href="#">浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳宜投基金销售有限公司率优惠的公告</a>	2016/08/25
191	<a href="#">浙商基金管理有限公司 关于参加交通银行股份有限公司手机银行渠道费率优惠公告</a>	2016/09/19
192	<a href="#">浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年第三季度报告</a>	2016/10/25

## 二十八、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十九、备查文件

- (一) 中国证监会核准浙商沪深 300 指数分级证券投资基金募集的文件；
- (二) 《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》；
- (三) 《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》；
- (四) 关于申请募集浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之法律意见书；
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照；
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照；
- (七) 中国证监会要求的其他文件。

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

## 附一：基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### （一）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- 1、自基金合同生效之日起，依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产；
- 2、依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 3、发售基金份额；
- 4、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 5、在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管等业务的规则，在法律法规和基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- 6、根据基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 7、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理浙商沪深 300 份额的申购和赎回申请；
- 8、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、融券；
- 9、自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 10、选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- 11、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；
- 12、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 13、依法召集基金份额持有人大会；
- 14、法律法规和基金合同规定的其他权利。



## （二）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- 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；
- 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、勤勉尽责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，确保所管理的基金财产和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、计算并公告基金资产净值、浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额与浙商进取份额的基金份额参考净值、浙商稳健份额与浙商进取份额终止运作后的份额转换比例和浙商沪深 300 份额的申购、赎回价格；
- 9、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；
- 10、按规定受理浙商沪深 300 份额的申购、赎回申请和配对转换，及时、足额支付赎回款项；
- 11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 13、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；
- 14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

15、按照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收益；

16、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；

17、依据《基金法》等的规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18、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者实施其他法律行为；

19、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；

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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23、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；

24、执行生效的基金份额持有人大会决议；

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26、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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### （三）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1、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；

2、监督基金管理人对本基金的投资运作；

3、自基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4、在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5、根据基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

- 6、依法召集基金份额持有人大会；
- 7、按规定取得基金份额持有人名册资料；
- 8、法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### （四）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- 1、安全保管基金财产；
- 2、设立专门的基金托管部，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、对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- 4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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；
- 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应予保密，不得向他人泄露；
- 8、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；
- 9、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 10、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；
- 11、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 12、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额与浙商进取份额的基金份额参考净值、浙商稳健份额与浙商进取份额终止运作后的份额转换比例和浙商沪深 300 份额的申购、赎回价格；
- 13、按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

15、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；

16、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

17、因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18、基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19、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；

20、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业监督管理机构，并通知基金管理人；

21、执行生效的基金份额持有人大会决议；

22、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23、建立并保存基金份额持有人名册；

24、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### （五）基金份额持有人的权利

投资人购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，投资人自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。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。

浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。但本基金依据基金合同第二十一部分之规定对浙商稳健份额与浙商进取份额进行份额折算计算时，持有浙商沪深 300 份额的基金份额持有人将被视作其同时持有按 1:1 的比例分拆的浙商稳健份额和浙商进取份额，并将分别按视为分拆后的浙商稳健份额和浙商进取份额数享有并行行使份额折算的权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

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、依法转让其持有的浙商稳健份额与浙商进取份额，依法申请赎回其持有的浙商沪深 300 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或仲裁；
- 9、法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### （六）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- 1、遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2、提供基金管理人和监管机构要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；
- 3、交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 4、在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；
- 5、不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- 6、执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 7、返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- 8、法律法规和基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表在授权范围内有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。基金份额持有人大会的审议事项应分别由浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额、浙商进取份额的基金份额持有人独立进行表决。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。

#### （二）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、单独或合计持有浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%，下同）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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）变更基金类别；
- （4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外）；
- （5）变更基金份额持有人大会程序；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- （8）本基金与其他基金的合并；
- （9）终止浙商稳健份额与浙商进取份额的运作；
- （10）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- （11）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同或其他相关法律文件，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- （2）在法律法规和基金合同规定的范围内调整浙商沪深 300 份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率；
- （3）因相应的法律法规、证券交易所和注册登记机构的业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；
- （4）在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，增加新的收费方式；
- （5）基金推出新业务或服务；
- （6）基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规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）标的指数更名或调整指数编制方法；

- (8) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- (9) 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；
- (10) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

1、除法律法规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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、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，应当自行召集。

3、单独或合计持有浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项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，单独或合计持有浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自基金份额 10%以上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。

4、单独或合计持有浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自基金份额 10%以上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，单独或合计持有浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5、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。

### (四) 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、基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和出席方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议形式；
- （4）议事程序；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- （6）代理投票的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；
- （7）表决方式；
- （8）会务常设联系人姓名、电话；
- （9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （10）召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，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、书面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，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人经有效通知而拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （五）基金份额持有人出席会议的方式

##### 1、会议方式

（1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规和监管机关允许的其他方式。

（2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。



(3) 通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前提交至召集人指定的地址或系统。通讯方式开会应按照基金合同的相关规定以召集人通知的非现场方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定，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。

## 2、召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

A. 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额应占权益登记日各自基金份额的 50% 以上（含 50%，下同）；

B. 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

A. 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

B. 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

C. 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经有效通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

D. 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额占权益登记日各自基金份额的 50% 以上；

E. 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

（3）在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

#### （六）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容为基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自基金份额 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就召开事由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。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人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。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其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。

（4）单独或合并持有权益登记日浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自基金份额 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，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。法律法规另有规定的除外。

(5) 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，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

## 3、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。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1、浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应的份额级别内享有平等的表决权。

### 2、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

一般决议须经出席会议的浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额的基金份额持有人（或其代理人）各自所持浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额表决权的 50%以上通过方为有效，除下列（2）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

特别决议须经出席会议的浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额的基金份额持有人（或其代理人）各自所持浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止浙商稳健份额与浙商进取份额的运作、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会决定的事项，应当在五日内依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4、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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面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，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6、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。

## （八）计票

### 1、现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、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。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决议。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。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。

(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 三、基金合同的变更终止与基金财产的清算

### (一) 基金合同的变更

1、基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

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

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 终止浙商稳健份额与浙商进取份额的运作；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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变更后公布，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

(3) 因相应的法律法规、证券交易所和注册登记机构的业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；

(5) 基金推出新业务或服务；

(6) 基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规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) 标的指数更名或调整指数编制方法；

(8) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(9) 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；

(10) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体公告。

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算组

（1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （3）对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行估价和变现；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （6）聘请律师事务所出具法律意见书；
- （7）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （8）参加与基金财产有关的民事诉讼或仲裁；
- （9）公布基金财产清算结果；
- （10）对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；

(4) 根据基金合同终止日浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额与浙商进取份额各自的基金份额参考净值分别计算浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的浙商稳健份额与浙商进取份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6、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。

## 四、争议的处理

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。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供基金投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 附二：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

名称：浙商基金管理有限公司

住所：杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室

办公地址：杭州市西湖区教工路 18 号世贸丽晶城欧美中心 B 座 507 室

邮政编码：310012

法定代表人：肖风

成立日期：2010 年 10 月 21 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可【2010】1312 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：3 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### （二）基金托管人

名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

法定代表人：吴建

电话：（010）85238667

传真：（010）85238680

联系人：徐昊光

成立时间：1992 年 10 月 14 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：10,685,572,211 元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391 号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；外汇票据的承兑和贴现；自营或代客外汇买卖；买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；发行或代理发行股票以外的外币有价证券；外币兑换；外汇担保；外币租赁；贸易、非贸易结算；资信调查、咨询、见证业务；证券投资基金托管；社保基金托管；保险资金托管；委托资产托管业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金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（包括中小板股票、创业板股票以及中国证监会允许基金投资的其他股票）、债券、货币市场工具、股指期货、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，但需符合中国证监会的相关规定。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- 1、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%；
- 2、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%；

- 3、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%；
- 4、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%；
- 5、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%；
- 6、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 10%；
- 7、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 10%；
- 8、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；
- 9、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；
- 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%；
- 11、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，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- 12、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 100%。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；
- 13、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）不低于基金资产的 85%；
- 14、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；
- 15、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

若法律法规或监管部门对上述约定的投资组合比例限制规定进行变更的，以变更后的规定为准。若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失

先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券（指经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券），应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1、本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行股票，也不得预付任何形式的保证金。

2、基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎

回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3、本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4、基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5、基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6、相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

(六) 基金托管人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、终止运作后的份额转换比例、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。

(七) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定, 应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函, 就基金托管人的疑义进行解释或举证, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 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。基金管理人对于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。

(八) 基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示, 基金管理人应在规定时间内答复并改正, 或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律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项, 基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定, 或者违反基金合同约定的, 应当立即通知基金管理人, 由此造成的损失由基金管理人承担。

(十) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 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。基金管理人无正当事由, 拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权, 或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督, 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

(一) 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基金份额净值、终止运作后的份额转换比例、根据基金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。

(二) 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、未执行或无故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、本协议及其他有关规定时, 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并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。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。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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、基金财产的保管

##### （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。
- 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，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产，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账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。
- 7、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）基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间募集的资金应存于专用账户。该账户由基金管理人或基金管理人委托的注册登记机构开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，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，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、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等事宜。

### （三）基金银行账户的开立和管理

1、基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2、基金银行账户的开立和使用，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假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4、在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，仅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或未经对方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账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4、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开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。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。

5、若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证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、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，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。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由基金管理人、基金托管人保管。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包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人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以加密方式或双方同意的其他方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

## 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值，经基金托管人复核，按规定公告。

浙商沪深 300 份额的基金份额净值、浙商稳健份额和浙商进取份额的基金份额参考净值的计算，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。

## 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3、根据有关法律法规，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。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，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，仍无法达成一致意见的，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。

### (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。

#### 2、估值方法

##### a、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。

b、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估值方法估值；

(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估值方法估值；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。

c、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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

d、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。

e、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。

f、股指期货品种将按照相关规定进行估值。

g、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。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

### 3、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第 e 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

### （三）基金份额净值错误的处理方式

1、当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额任一类份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额任一类份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

2、当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

（1）本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的直接损失，由基金管理人负责赔付。

（2）若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人直接损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人各自承担相应的责任。

（3）如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

（4）由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的直接损失，由基金管理人负责赔付。

3、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、

基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

4、基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

5、前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。

#### （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

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；

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人的利益，已决定延迟估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人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。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3、财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 60 日内

完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，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。

## （2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应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分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。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，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，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，仲裁地点为北京市，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。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本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、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，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或备案后生效。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

- 1、基金合同终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- 4、发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

（1）基金合同终止时之日起 30 个工作日内，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

#### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （3）对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行估价和变现；

- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼或仲裁；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；

(4) 根据基金合同终止日浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自的基金份额净值分别计算浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不得分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的浙商稳健份额与浙商进取份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6、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。