

# 关于浙商汇金精选定增集合资产管理计划变更为浙商汇金先进制造混合型证券投资基金及法律文件变更的公告

根据《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》、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》(证监会公告[2018]39号)等法律法规的规定以及中国证监会《关于准予浙商汇金精选定增集合资产管理计划变更注册的批复》,浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“本公司”)作为浙商汇金精选定增集合资产管理计划(以下简称“浙商汇金精选定增”)的管理人,经与托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,拟将浙商汇金精选定增变更为浙商汇金先进制造混合型证券投资基金(以下简称“浙商汇金先进制造混合基金”),并按照《浙商汇金精选定增集合资产管理合同》(以下简称“《资产管理合同》”)、《浙商汇金精选定增集合资产管理计划说明书》有关约定履行法律文件变更程序。

浙商汇金精选定增变更为浙商汇金先进制造混合基金涉及法律文件全文变更,即由原浙商汇金精选定增法律文件变更为浙商汇金先进制造混合基金的法律文件,包括《浙商汇金先进制造混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)、《浙商汇金先进制造混合型证券投资基金托管协议》、《浙商汇金先进制造混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”)等,上述法律文件均已同步公开在本公司指定网站(<http://www.stocke.com.cn>)披露,敬请投资者仔细阅读。

本次浙商汇金精选定增变更为浙商汇金先进制造混合基金涉及主要变更要点和具体流程说明如下:

## 一、主要变更要点

### (一) 产品名称变更

产品名称由“浙商汇金精选定增集合资产管理计划”变更为“浙商汇金先进制造混合型证券投资基金”。

### (二) 产品类型变更

产品类型由“非限定性集合资产管理计划”变更为“混合型、公开募集证券投

资基金”。

### (三) 产品运作方式及开放期变更

由“自本集合计划 2018 年 3 月开放期后，本集合计划每满 1 个计划月度开放一次”变更为“契约型开放式”。

关于开放期具体条款如下：

浙商汇金精选定增	浙商汇金先进制造混合基金
<p>本集合计划自成立之日起 30 个计划月度为首个封闭期，封闭期满后 5 个工作日内为首个开放期，开放期内委托人可申请参与和退出集合计划。</p> <p>此后，本集合计划每满 18 个计划月度开放一次，每次开放期为 10 个工作日（若遇法定节假日、休息日等，则开放期顺延）。其中，前 5 个工作日内，委托人可办理参与和退出业务；次 5 个工作日内，委托人仅可办理参与业务，不可办理退出业务。</p> <p>本集合计划自 2017 年 6 月至 2018 年 3 月每月开放一次，开放期为前述每月 26 日（包含当日，若遇法定节假日、休息日等顺延）起的 2 个工作日，开放期内委托人可办理参与和退出业务。</p> <p>自本集合计划 2018 年 3 月开放期后，本集合计划每满 1 个计划月度开放一次，每次开放期为本集合计划成立日月度对应日后的首 2 个工作日（若遇法定节假日、休息日等顺延），开放期内委托人可办理参与和退出业务。</p>	<p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理基金份额的申购、赎回业务，具体业务办理时间在申购、赎回开始公告中规定。</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p>

### (四) 调整申购及赎回相关条款

1、调整申购的数额限制及增加单一投资者持有基金份额比例限制，具体变更对照如下

浙商汇金精选定增	浙商汇金先进制造混合基金
<p>首次参与的最低金额为人民币 100,000 元，追加参与的最低金额为人民币 1,000 元，超过最低参与金额的部分必须为 1,000 元的整数倍。</p>	<p>投资人通过其他销售机构申购本基金的，每个基金账户首次申购的单笔最低金额为人民币 1,000 元（含申购费），追加申购的单笔最低金额为人民币 1,000 元（含申购费）。投资人通过直销机构（含直销柜台和直销网上交易平台）首次申购的单笔最低限额为人民币 1,000 元（含申购费），追加申购单笔最低限额为人民币 1,000 元（含申购费）。各销售机构对最低申购限额及交易级差有</p>

	其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。投资者选择将现金红利自动转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。
无	投资者可多次申购，对单个投资人累计持有的基金份额不设上限限制。但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外）。

## 2、调整申购费率

原浙商汇金精选定增的参与费率为：

资金规模（M）	参与费率
M < 50 万	1.0%
50 万 ≤ M < 200 万	0.7%
200 万 ≤ M < 500 万	0.4%
M ≥ 500 万	按笔收取，1,000 元/笔

变更为浙商汇金先进制造混合基金的申购费率为：

单笔申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	1.50%
100 万元 ≤ M < 200 万元	1.00%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.50%
M ≥ 500 万元	1000 元/每笔

因红利再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

## 3、增加申购份额的计算方法

变更为浙商汇金先进制造混合基金，新增申购份额的计算方法的条款如下：

“本基金申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。申购本基金基金份额的计算公式为：

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

$$\text{或，净申购金额} = \text{申购金额} - \text{固定申购费金额}$$

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

$$\text{或，申购费用} = \text{固定申购费金额}$$

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

## 4、调整赎回费率

原浙商汇金精选定增的退出费率为0%，份额退出时以退出申请日份额单位净值作为计价基准，按扣除业绩报酬以后的实际金额支付。

变更为浙商汇金先进制造混合基金的赎回费率为：

持有期限 (T)	赎回费率
T < 7 日	1.50%
7 日 ≤ T < 30 日	0.75%
30 日 ≤ T < 365 日	0.50%
365 日 ≤ T < 730 日	0.25%
T ≥ 730 日	0

新增“本基金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。对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费，将按赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费，将按赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，将按赎回费总额的25%归入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费等相关手续费。”

#### 5、调整赎回份额的数额限制

调整赎回的数额限制，具体变更对照如下

浙商汇金精选定增	浙商汇金先进制造混合基金
本集合计划每次退出份额必须是 1 万份的整数倍。如退出完成后委托人在某一推广机构剩余的集合计划份额低于 1 万份时，则管理人自动将该委托人在该推广机构的全部份额退出给委托人；本集合计划不设退出次数限制。	基金份额持有人在直销机构和其他销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 100 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 100 份的，余额部分基金份额在赎回时须同时全部赎回。

#### 6、调整巨额赎回的情形及处理方式

在浙商汇金先进制造混合基金的基金合同中新增加如下条款：

“（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赎回申请有困难或认为因支付投资人的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，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 10%,基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理,而对该单个基金份额持有人 10%以内(含 10%)的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述“(1)全额赎回”或“(2)部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并处理。”

(3) 暂停赎回:连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;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,并应当在规定媒介上进行公告。”

#### (五) 调整投资的相关条款

在投资目标方面,根据变更为浙商汇金先进制造混合基金后的产品投资策略特征补充相应投资目标。

在投资范围方面,根据公开募集证券投资基金相关法律法规规定对原浙商汇金精选定增的投资范围予以调整,删除了证券投资基金、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划等,并细化了债券类、股票类及货币市场工具类的具体投资标的品种,同时细化金融衍生品为股指期货、国债期货、股票期权投资品种。

在关联交易方面,对原浙商汇金精选定增的关联方证券定义、投资比例限制及履行程序等内容,按照公开募集证券投资基金相关法律法规规定进行相应调整。

在投资比例方面,根据变更为浙商汇金先进制造混合基金后的基金类型为偏股混合型,从而调整权益类资产的投资比例,由原浙商汇金精选定增的“权益类资产:占计划资产总值的 0-95%,”变更为“本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%”,同时产品采用“先进制造”主题类,新增“投资于本基金所界定的先进制造主题股票的比例不低于非现金资产的 80%”,并按公募基金相关法规调整原浙商汇金精选定增对固定收益类资产的比例、调整现金类资产比例内容的表述。

在投资策略方面,结合本公司对变更为浙商汇金先进制造混合基金后的投资

理念、投资目标及投资范围，补充说明资产配置策略、股票投资策略（包括先进制造主题相关行业范畴界定、个股选择等方面）、债券等固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略相关内容。

在业绩比较基准方面，结合变更为浙商汇金先进制造混合基金后的股票资产投资比例，相应新增“沪深 300 指数收益率 × 60%+中债总财富指数（总值）收益率 × 40%”作为业绩比较基准。

在风险收益特征方面，新增“本基金为混合型基金，一般市场情况下，长期风险收益特征高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。”

涉及上述内容的主要条款对照如下：

内容	浙商汇金精选定增	浙商汇金先进制造混合基金
投资目标	无	本基金通过积极调整仓位、精选先进制造主题的优质上市公司进行投资，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资范围	本集合计划投资范围包括但不限于中国境内依法发行的权益类金融产品、固定收益类金融产品、现金类资产、金融衍生品类资产； <u>证券投资基金</u> ；债券正回购； <u>保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划</u> 以及中国证监会认可的其他投资品种。 <u>本集合计划暂不参与融资融券交易。</u>	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
关联交易	委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于 <u>管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券，但其投资比例不得超过资产净值的 7%</u> 。交易完成 5 个工作日内，管理人应书面通	基金管理人运用基金财产买卖 <u>基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券</u> ，或者从事其他重大关联交易的，应当符

	<p>知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。</p>	<p>合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。<u>相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</u></p>
<p>投资比例</p>	<p><u>(1) 固定收益类资产：占计划资产总值的 0-95%；包括但不限于国债、金融债（含政策性金融债）、企业债、公司债、非公开发行公司债券、短期融资券、中期票据、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、央行票据、资产支持受益凭证等。</u></p> <p><u>(2) 权益类资产：占计划资产总值的 0-95%；包括中国境内依法发行的一级市场新股、二级市场股票、上市公司非公开发行股票（即定向增发股票）、权证等。单个定向增发股票投资比例不超过计划资产净值的 30%。</u></p> <p><u>(3) 现金类资产：不低于计划资产总值的 5%；包括但不限于现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金、不超过 7 天的债券逆回购、到期日在 1 年内的政府债券等。</u></p> <p><u>(4) 参与债券正回购融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%。</u></p> <p><u>(5) 金融衍生品类资产：占计划资产总值的 0-95%；包括但不限于股指期货等。在任一时点，持有股指期货等金融衍生品的风险敞口不得超过计划资产净值的 100%；在任一时点，本集合计划持有的权益类证券市值和买入股指期货合约等其他金融衍生品的价值总额的合计应不超过计划资产净值的 100%。</u></p> <p><u>(6) 其他资产：占计划资产总值的 0-95%；包括但不限于证券投资基金（交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF 基金以及开放式证券投资基金）、保证收益及保本浮动收益商业银</u></p>	<p><u>本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%，其中投资于本基金所界定的先进制造主题股票的比例不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</u></p>

	<p>行理财计划以及中国证监会认可的其他投资品种。</p>													
<p>投资策略</p>	<p>1、资产配置策略</p> <p>本计划采用定量分析和定性分析相结合的方式，并基于对宏观经济指标、盈利预测指标、市场流动性指标等相关因素的综合分析，形成对各类资产风险收益特征的预期和判断，进而动态调整各类资产的配置比例，以降低本计划资产的风险水平，提高本计划资产的收益水平。</p> <p>表 1: 浙商汇金精选定增集合计划资产配置比例</p> <table border="1" data-bbox="363 728 794 1064"> <thead> <tr> <th>资产类别</th> <th>配置下限</th> <th>配置上限</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>权益类产品</td> <td>0%</td> <td>95%</td> </tr> <tr> <td>固定收益证券</td> <td>0%</td> <td>95%</td> </tr> <tr> <td>现金类资产</td> <td>5%</td> <td>100%</td> </tr> </tbody> </table> <p>2、股票投资策略</p> <p>本计划主要以二级市场股票为主，同时兼顾定向增发、可转债、新股申购等其他投资机会。管理人将通过调研深入了解投资股票的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息精选行业和个股，在进行全面和深入研究的基础上做出投资决定，在控制风险的基础上力求获取较高的收益。</p>	资产类别	配置下限	配置上限	权益类产品	0%	95%	固定收益证券	0%	95%	现金类资产	5%	100%	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为混合型基金，股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%，以追求基金资产收益长期增长为目标，在本基金的投资范围内对各类别资产进行灵活的比例配置调整，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，结合各项宏观经济指标和微观经济数据，及时把握货币政策和财政政策，通过对宏观经济指标、盈利预测指标、市场流动性指标等相关因素的综合分析，预估市场未来的趋势变化，评估上市公司业绩和股票价格联动的方式。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 先进制造主题相关行业范畴界定</p> <p>先进制造主题相关行业是指在追求高质量发展的过程中，能够提高生产效率，提升生活质量，具有工程师红利和一定国际竞争力的制造业。这些行业一般具有技术含量高、创新力强、附加值高、竞争力强、低污染等特点。</p> <p>具体相关行业包括：申银万国一级行业分类标准中的计算机、通信、电子、医药、机械设备、汽车、电气设备、国防军工、轻工制造、家电行业、化工、建筑材料、有色金属、食品饮料以及申银万国二级行业分类标准中的环保工程及服务。</p> <p>未来由于经济增长方式转变、产业结构升级、人口红利变化等因素，从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大，基金管理人按照监管部门要求在履行适当程序后，本基金视实际情况对上述界定进行调整和修订。</p> <p>(2) 个股选择</p> <p>本基金的股票投资将采用自下而上的</p>
资产类别	配置下限	配置上限												
权益类产品	0%	95%												
固定收益证券	0%	95%												
现金类资产	5%	100%												



基本面研究，再通过定量与定性相结合的分析方法，对备选行业内部企业的基本面、估值水平进行综合研判，精选优质个股进行投资。

结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度及公司核心竞争力的判断，基金管理人通过传统的定性分析手段，关注具有先进的经营模式、良好的公司治理结构和优秀的公司管理层等核心价值的上市公司；结合基金管理人定量投资方法，深入挖掘具有持续增长能力或价值被低估的公司，构建股票投资组合，同时将根据行业及公司状况的变化，结合估值水平，动态优化股票投资组合。重点从以下几个方面入手：

1) 发掘业绩高成长的公司，成长性是推动股价长期上涨的关键因素，并且公司业绩需具有相对持续、稳定的高成长预期；

2) 分析高估值的企业，中国已经进入融合并购的大时代，企业的高估值有利于外延式并购，二级市场高估值吸纳一级市场低估值，提升企业竞争能力和盈利能力；

3) 关注涨幅较低的企业，因为当行业和企业的基本面发生巨大变化、景气度和成长性向好时，涨幅较低的企业未来的上涨空间会更大；

4) 关注总体市值较低的企业，较小的市值提供了相对较高的安全边际，既包括横向比较，也包括纵向比较；

5) 寻找经营有拐点的企业，经营拐点包含了业绩和业务拐点，有业绩拐点的企业将进入一个高成长的阶段，而有业务拐点的企业则有潜在的业绩拐点预期。

### 3、固定收益证券投资策略

本计划的固定收益类投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的，具有良好流动性的金融工具。该类资产的投资目标是在充分保持本计划流动性的基础上获得稳定的收益。本计划根据宏观经济和市场利率变化情况，自上而下地确定债券投资策略。首先，通过预

### 3、债券等固定收益类资产投资策略

本基金固定收益类资产的投资目标主要为非股票资产的有效使用和管理。在实际管理中，辅助配置短久期、流动性较好的固定收益类资产以及保持现金资产以应对申购赎回资金流、交易成本等因素为本基金固定收益类资产的主要投资策略。

	<p>测市场利率的变动趋势，确定最优的债券组合久期。其次，根据对收益率曲线形状变化的预测，确定长期、中期和短期债券的配置。最后，自下而上通过个券估值和信用评级分析等手段，精选出价值被低估且有较高配置价值的个券。</p> <p><b>4、基金投资策略</b></p> <p>本计划采用浙商资管自行开发的基金智库数量化基金投资选择系统对各类基金进行筛选，再利用定性分析的手段，积极主动的选取具有比较优势的各类证券投资基金。</p> <p><b>5、权证投资策略</b></p> <p>权证为本计划的辅助性投资工具，投资原则为有利于集合计划的增值，有利于加强集合计划的风险控制。本计划在投资权证时，将通过对权证标的证券的基本面进行深入研究，寻求其合理估值水平，谨慎进行投资，以追求较为稳定的当期收益。</p> <p><b>6、股指期货投资策略</b></p> <p>本集合计划投资股指期货的主要目的是套保以对冲市场风险，管理人将在符合一定条件的市场环境中，综合运用股指期货等金融衍生品对冲系统性风险、锁定收益、降低投资组合波动性。</p>	<p><b>4、金融衍生工具投资策略</b></p> <p>本基金基于审慎原则运用股指期货、国债期货、股票期权等相关金融衍生工具，将严格根据风险管理的原则，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，从而达到降低投资组合风险、提高投资效率，更好地实现本基金投资目标。</p> <p>本基金参与股指期货的投资，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的合同，以降低股票仓位频繁调整的交易成本。</p> <p>本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资。</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p><b>5、资产支持证券投资策略</b></p> <p>对于资产支持证券，本基金将在国内资产证券化品种具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后做出相应的投资决策。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散，以降低流动性风险。</p> <p><b>6、可转换债券和可交换债券投资策略</b></p> <p>本基金密切跟踪经济运行情况，对各类市场大势做出判断的前提下，对可转换债券及其正股、可交换债券和对应股票进行综合分析；首先自上而下从行业进行评估，再自下而上评估股票的估值、盈利和成长等因素，然后根据债券属性进行综合评定，最终选择投资价值较高的个券。</p>
投资限制	<p>为维护委托人的合法权益，本集合计划投资的投资限制为：</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票投资比例为基金资产的60%-95%，其中投资于本基金所界定的先进制造主题股票的比例不低于</p>	

<p>1、将集合计划资产投资于一家公司发行的证券超过资产净值的 10%；</p> <p>2、管理人将其所管理的客户资产投资于一家公司发行的证券，超过该证券发行总量的 10%；</p> <p>3、<u>将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券，投资比例超过资产净值的 7%；</u></p> <p>4、集合计划申购新股，申报的金额超过集合计划的现金总额，申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>5、集合计划参与证券回购融入资金余额超过集合计划资产净值的 40%，中国证监会另有规定的除外；</p>	<p><u>非现金资产的 80%；</u></p> <p><u>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</u></p> <p>(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的<u>全部基金</u>持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，<u>完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；</u></p> <p><u>(5) 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%；</u></p> <p><u>(6) 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%；</u></p> <p><u>(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</u></p> <p><u>(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</u></p> <p><u>(9) 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；</u></p> <p>(10) 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；</p> <p>(11) 本基金<u>进入全国银行间同业市场</u>进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，<u>在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；</u></p> <p><u>(12) 本基金参与股指期货和国债期货交易依据下列标准建构组合：</u></p>
---	---

(12.1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

(12.2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值、股指期货合约价值和股票期权价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

(12.3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

(12.4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(12.5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

(13) 本基金参与股票期权交易的，应当符合下列要求：基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽股票期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资

因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等外部因素致使集合资产管理计划的融入资金余额比例或关联方投资比例不符合集合资产管理合同约定的,管理人应当在10个工作日内进行调整。

产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;本基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制(如股票仓位、个股占比等)、投资目标和风险收益特征;

(14) 本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(15) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

(16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合该项规定投资比例的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与本基金基金合同约定的投资范围保持一致;

(18) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资比例限制。

除上述(2)、(9)、(16)、(17)情形之外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的

	如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定，则本集合计划不受上述限制。	<p><u>投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。</u></p> <p>如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。</p>
业绩比较基准	无	<p><u>本基金投资的业绩比较基准为：沪深300 指数收益率×60%+中债总财富指数（总值）收益率×40%</u></p> <p><u>沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。</u></p> <p><u>中债总财富指数（总值）收益率由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖上海证券交易所、深圳证券交易所以及银行间市场的各类券种，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。</u></p> <p><u>若未来市场发生变化导致业绩比较基准不再适用或者有更加适合的业绩比较基准，经基金管理人和基金托管人协商一致，根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更应按照监管部门要求履行适当的程序并在变更实施日前在规定媒介予以公告，无需召开基金份额持有人大会。</u></p>
风险收益特征	无	<p><u>本基金为混合型基金，一般市场情况下，长期风险收益特征高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</u></p>

## （六）调整产品费用

### 1、删除业绩报酬的提取

原浙商汇金精选定增《资产管理合同》约定根据产品获得的收益率提取业绩报酬。

变更为浙商汇金先进制造混合基金后，不再收取业绩报酬。

### (七) 调整收益分配时间和收益分配方式

按照公募基金相关法律法规调整，主要条款对照如下：

内容	浙商汇金精选定增	浙商汇金先进制造混合基金
收益分配原则	<p><u>1、同一类份额享有同等分配权；</u></p> <p><u>2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；</u></p> <p><u>3、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</u></p> <p><u>4、在符合有关分红条件的前提下，可供分配利润每会计年度至少分配一次；</u></p> <p><u>5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</u></p>	<p><u>1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；</u></p> <p><u>2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</u></p> <p><u>3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；</u></p> <p><u>4、每一基金份额享有同等分配权；</u></p> <p><u>5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</u></p> <p><u>本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。</u></p>
收益分配方式	<p><u>委托人可以选择收益分配方式为现金或再投资于本集合计划，未做选择的默认是红利再投资方式。委托人可以修改分红方式。选择采取红利再投资方式的，分红资金按分红除权日的份额净值转成相应的集合计划份额，如果红利再投资部分将导致本集合计划实际规模超过存续期份额限制时，再投资部分按比例转成份额直到存续期份额上限，其余部分按现金分红方式；选择现金方式的，管理人直接将分红款划入推广机构结算备付金账户，最后由推广机构划入委托人账户。</u></p>	<p><u>2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</u></p>

### (八) 调整合同终止条款

按照公募基金相关法律法规调整，主要条款对照如下：

浙商汇金精选定增	浙商汇金先进制造混合基金
出现下列情形之一时，集合计划应当终止：	有下列情形之一的， <u>经履行相关程序后</u> ，基

<ol style="list-style-type: none"> <li>1、计划存续期间，客户少于 2 人；</li> <li>2、计划存续期满且不展期；</li> <li>3、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的；</li> <li>4、托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格的，且管理人未能在 30 个工作日内与其他托管人签订托管协议；</li> <li>5、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；</li> <li>6、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的，且管理人未能在 30 个工作日内与其他托管人签订托管协议；</li> <li>7、<u>存续期内，连续 20 个工作日集合计划资产净值低于 3 千万元人民币，且管理人认为需要清盘的；</u></li> <li>8、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；</li> <li>9、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。</li> </ol>	<p>金合同应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、<u>基金份额持有人大会决定终止的；</u></li> <li>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</li> <li>3、基金合同约定的其他情形；</li> <li>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</li> </ol>
--	--

#### (九) 调整估值方法

在估值核算方面，根据公募基金相关法律法规规定所调整原浙商汇金精选定增的投资范围后，相应调整不符合公募基金要求的资产估值方法，主要条款对照如下：

浙商汇金精选定增	浙商汇金先进制造混合基金
<p><u>1、投资股票的估值方法</u></p> <p><u>(1) 上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。</u></p> <p><u>(2) 上市流通股估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值。</u></p> <p><u>(3) 上市流通股估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.5% 以上的，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</u></p> <p><u>(4) 首次发行未上市的股票，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，按成本价估值。</u></p> <p><u>(5) 送股、转增股、配股和公开增发新股</u></p>	<p><u>1、证券交易所上市的有价证券的估值</u></p> <p><u>(1) 交易所上市的有价证券(包括股票等)，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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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；</u></p> <p><u>(2) 在交易所市场上市实行净价交易的债券按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</u></p> <p><u>(3) 交易所上市未实行净价交易的债券(可转债除外)按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值；</u></p>



等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值。

(6) 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，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值；在考虑投资策略的情况下，也可以参照(7)的方法估值。

(7) 通过非公开发行等其他方式获取且有明确锁定期的股票，按以下方法估值：

1) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行股票的首次取得成本时，可采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该非公开发行股票的价值；

2) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行股票的首次取得成本时，可按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_1 - D_r}{D_1}$$

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的首次取得成本；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价； $D_1$  为该非公开发行股票

锁定期所含的交易天数； $D_r$  为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

3) 股票的首个估值日为上市公司公告的股份上市日所对应的日历日。

(8) 停牌股票可根据具体情况采用以下估值方法：

1) 可把停牌期间行业指数的涨跌幅视为停牌股的涨跌幅以确定当前公允价值，即参考两交易所的行业指数对停牌股票进行估值。此种方法可称为指数收益法。

使用指数收益法进行估值可分为两个步骤：  
第一步：在估值日，以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率。

第二步：根据第一步所得的收益率计算该股票当日的公允价值。

2) 可对可比较的或者代表性的公司进行分

(4) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息后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；

(5) 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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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；

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定其公允价值。

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；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券，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。

析,尤其注意有着相似业务的公司的新近发行以及相似规模的其他新近的首次公开发行,以获得估值基础。此种方法可称为可比公司法或相对估值法。

使用可比公司法进行估值可分为三个步骤:  
第一步:选出与该股票上市公司可比的其他可以取得合理市场价格的公司。所谓“可比”,主要是指行业、地区、主营业务、公司规模、财务结构等方面具有相似性。

第二步:在估值日,以可比公司的股票平均收益率作为该股票的收益率。

第三步:根据第二步所得到的收益率计算该股票当日的公允价值。

3)可利用历史上股票价格和市场指数的相关性,根据指数的变动近似推断出股票价格的变动以确定当前公允价值。此种方法可称为市场价格模型方法。

使用市场价格模型方法进行估值可分为三个步骤:

第一步:根据历史数据计算该股票价格与某个市场指数或行业指数的相关性指标,如BETA值。

第二步:根据相关性指标和指数收益率,计算该股票的日收益率。

第三步:根据第二步所得到的收益率计算该股票当日的公允价值。

4)有充足理由表明按以上估值方法仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的,可根据具体情况,选择现金流折现法(DCF)、市盈率法(Earnings Multiple)等估值模型进行估值。

## 2、投资固定收益品种的估值方法

(1)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。

(2)在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值;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,按最近交易日的收盘价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考监管机构和行业协会估值意见,或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

(3)在证券交易所市场挂牌交易未实行净

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,采用第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

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。

价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（4）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（5）对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，按照成本估值。中小企业私募债按照成本估值。

（6）在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

### 3、投资证券投资基金的估值方法

（1）持有的交易所基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）等），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

（2）持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

（3）持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算；

（4）场内申购获得的ETF基金按【转出股票价值+现金替代+现金差额-可收替代】确认成本，其中，转出股票价值按估值日各转出股票收盘价计算；基金公司未公布估值日现金替代的，按基金公司公布的估值日预估现金部分计算，并于估值日现金差额公布后调整ETF基金成本；可收替代款于收到

退补数据后调整 ETF 基金成本；如果现金差额公布日或者退补数据公布日，已无 ETF 持仓，该部分差额直接计入产品收益。场内赎回 ETF 基金获得的成分股票按【当日收盘价，如果停牌取最近日收盘价】确认成本，管理人应按时向托管机构提供退补数据；持有的 ETF 基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(5) 主要投资于证券投资基金的资产管理业务，持有的场外开放式基金按估值日的基金份额净值估值；持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日的每万份收益计算；估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

(6) 场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照第(1)条规定的方法估值；不能在交易所交易的，按照第(2)条规定的方法估值。

(7) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

#### 4、投资证券衍生品的估值方法

(1) 从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、国债期货合约以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

7、本基金投资股票期权合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。

<p>(4) 股指期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值, 该日无交易的, 以最近一日的当日结算价计算。</p> <p>5、存款的估值方法 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示, 按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化, 管理人及时进行账务调整。</p>	<p>8、本基金投资同业存单, 按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值; 选定的第三方估值机构未提供估值价格的, 按成本估值。</p>
--	--

(十) 调整信息披露条款

按照公募基金信息披露法律法规的有关规定, 对原浙商汇金精选定增变更为浙商汇金先进制造混合基金调整的主要条款对照如下:

浙商汇金精选定增	浙商汇金先进制造混合基金
<p>十、集合计划的信息披露</p>	<p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p><u>(一)基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议</u></p> <p><u>1、基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系, 明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序, 说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。</u></p> <p><u>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项, 说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后, 基金招募说明书的信息发生重大变更的, 基金管理人应当在三个工作日内, 更新基金招募说明书并登载在规定网站上; 基金招募说明书其他信息发生变更的, 基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的, 基金管理人不再更新基金招募说明书。</u></p> <p><u>3、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件, 用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。《基金合同》生效后, 基金产品资料概要的信息发生重大变更的, 基金管理人应当在三个工作日内, 更新基金产品资料概要, 并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点; 基金产品资料概要其他信息发生变更的, 基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的, 基金管理人不再更新</u></p>

<p>(一) 定期报告</p> <p>定期报告包括<u>集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度(年度)报告、托管季度(年度)报告、年度审计报告和对账单。</u></p> <p><b>1、集合计划单位净值报告</b></p> <p><u>披露时间:每个工作日披露集合计划截至前一个工作日的单位净值、累计净值,该净值须经过托管人复核。</u></p> <p><u>披露方式:由管理人以管理人网站公告的形式提供给委托人。</u></p> <p><b>2、集合计划的资产管理季度报告和托管季</b></p>	<p><u>基金产品资料概要。</u></p> <p><b>4、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</b></p> <p><u>本基金由浙商汇金精选定增集合资产管理计划转型而来,经中国证监会注册后,基金管理人将基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上,将基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上,并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点;基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。</u></p> <p><b>(二) 基金净值信息</b></p> <p><u>基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。</u></p> <p><u>在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过其规定网站、基金销售机构网站或者营业网点,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</u></p> <p><u>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。</u></p> <p><b>(三) 基金份额申购、赎回价格</b></p> <p><u>基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。</u></p> <p><b>(四) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告(含资产组合季度报告)</b></p> <p><u>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在规定网站上,并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</u></p> <p><u>基金管理人应当在上半年结束之日起两个</u></p>
--	---

## 度报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告和托管季度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后 15 个工作日内通过管理人网站通告。

### 3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告和托管年度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后 3 个月内通过管理人网站通告。

#### (4) 年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起 3 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。

#### (5) 对账单

管理人应当每个季度按照客户选择的书面或电子方式向委托人寄送对账单，对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。

## 2、临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人网站公告的方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

(1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

(2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

(3) 发生巨额退出并延期支付；

(4) 集合计划终止和清算；

(5) 集合计划存续期满并展期；

(6) 管理人以自有资金参与和退出；

(7) 合同的补充、修改与变更；

(8) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事

月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，基金管理人应当依照相关法律法规规定，在基金中期报告、年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### (五) 临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、基金合同终止、基金清算；

3、转换基金运作方式、基金合并；

4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、

<p>项；</p> <p><u>(9) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；</u></p> <p><u>(10) 集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券；</u></p> <p><u>(11) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</u></p> <p><u>(12) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</u></p> <p><u>(13) 其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。</u></p>	<p>住所发生变更；</p> <p><u>7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；</u></p> <p><u>8、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；</u></p> <p><u>9、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；</u></p> <p><u>10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；</u></p> <p><u>11、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；</u></p> <p><u>12、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；</u></p> <p><u>13、基金收益分配事项；</u></p> <p><u>14、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</u></p> <p><u>15、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；</u></p> <p><u>16、本基金开始办理申购、赎回；</u></p> <p><u>17、本基金发生巨额赎回并延期办理；</u></p> <p><u>18、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；</u></p> <p><u>19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；</u></p> <p><u>20、在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项情形；</u></p> <p><u>21、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p> <p><u>22、本基金调整基金份额类别设置；</u></p> <p><u>23、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会及基金合同规定的其他事项。</u></p>
<p>无</p>	<p><u>(六) 澄清公告</u></p>



在基金合同存续期限内,任何公共媒介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,以及可能损害基金份额持有人权益的,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。

(七) 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备案,并予以公告。

(八) 本基金投资股指期货和国债期货的信息披露

基金管理人在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货和国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货和国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

(九) 本基金投资股票期权的信息披露

基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等,并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

(十) 本基金投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。  
基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

(十一) 清算报告

基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上,并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(十二) 实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的,相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露,详见招募说明书的

规定。

(十三) 中国证监会规定的其他信息。

### (十一) 增加基金份额持有人大会

根据《基金法》和《运作办法》的规定，在浙商汇金先进制造混合基金《基金合同》中增加基金份额持有人大会机制，约定须召开基金份额持有人大会的事项，并明确基金份额持有人大会会议召集人、召集方式；召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式；基金份额持有人出席会议的方式；议事内容与程序；表决和计票规则等。

### (十二) 增加侧袋机制

在浙商汇金先进制造混合基金《招募说明书》中增加侧袋机制如下：

#### “（一）侧袋机制的实施条件

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### （二）实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一工作日主袋账户总份额的 10% 认定。

#### （三）实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### （四）实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### （五）实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，主袋账户的管理费和托管费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。侧袋账户的托管费根据法律法规按侧袋账户基金资产净值为基数计提，法律法规对侧袋账户的计提基数等另有规定的，从其规定。

2、与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。

#### （六）侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### （七）侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者

利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

## 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值和累计净值。

## 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。”

### (十三) 调整争议处理

浙商汇金精选定增	浙商汇金先进制造混合基金
(二) 争议的处理 因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交托管人所在地法院提起诉讼。	各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，或自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，任何一方均有权将争议提交 <u>中国国际经济贸易仲裁委员会</u> ，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

## 二、合同变更流程安排

根据《资产管理合同》(以下简称“《资产管理合同》”)的约定，本公司将于 **2021 年 7 月 26 日**通过公司网站发布本公告，并向投资者发送《关于浙商汇金精选定增集合资产管理计划变更为浙商汇金先进制造混合型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函》(以下简称“《征询意见函》”)，就浙商汇金精选定增集合资产管理计划变更为浙商汇金先进制造混合型证券投资基金以及所涉及法律文件(《基金合同》和《招募说明书》)的变更事宜(以下统称“本次法律文件变更”)征询委托人意见。

征询意见期为 **2021 年 7 月 26 日至 2021 年 8 月 13 日**。本公司作为管理人在本公告发布后将 **2021 年 8 月 9 日至 2021 年 8 月 13 日**设置为开放日。如果委

托人不同意本次法律文件变更事宜的，管理人保障其退出的权利，委托人可以在上述开放日内申请退出浙商汇金精选定增集合资产管理计划，本公司将按照《资产管理合同》约定受理委托人的退出申请，并办理退出业务；如果委托人同意本次法律文件变更，可不做任何操作；如果委托人在上述开放日未退出也未在前述征询意见期内回复意见的，视为委托人同意本次法律文件变更，表明委托人对《基金合同》和《招募说明书》的承认和接受，并同意按照《基金法》、《基金合同》和《招募说明书》及其他有关规定享有权利、承担义务。如果委托人答复不同意变更但未在上述开放日退出的，视同委托人本次法律文件变更，且不影响合同变更的生效。

### 三、合同变更的效力

本次变更法律文件将于本公告发布之日起十五个工作日后（即 **2021年8月16日**）起生效，《基金合同》和《招募说明书》同日生效，原《资产管理合同》同日起失效。

### 四、重要提示

1、敬请投资者仔细阅读变更后《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，同时发布在本公司指定网站（[http:// www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)）。

2、投资者欲更详细了解浙商汇金精选定增变更为浙商汇金先进制造混合基金的详细情况，请登录本公司指定网站（<http:// www.stocke.com.cn>）或者拨打本公司的客户服务中心电话 95345 垂询。

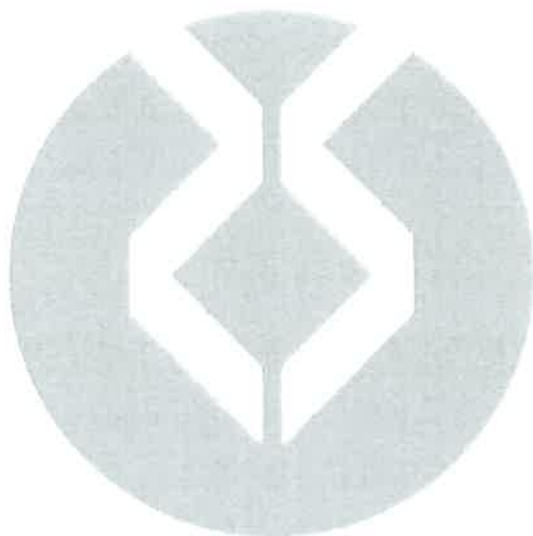
3、本公司作为基金管理人自《基金合同》生效之日起不超过3个月开始办理浙商汇金先进制造混合基金的基金份额申购和赎回业务，具体业务办理时间和办理规则另行公告。

**风险提示：**本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适

合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

浙江浙商证券资产管理有限公司（公章）

2021年7月26日





## 关于浙商汇金精选定增集合资产管理计划变更为浙商汇金先进制造混合型证券投资基金及法律文件变更的答复函

浙江浙商证券资产管理有限公司：

本人已收到并知悉贵公司《关于浙商汇金精选定增集合资产管理计划变更为浙商汇金先进制造混合型证券投资基金及法律文件变更的公告》（以下简称“《变更公告》”）并已知悉浙商汇金精选定增集合资产管理计划变更为浙商汇金先进制造混合型证券投资基金以及所涉及法律文件的变更（以下统称“本次法律文件变更”，具体详见《变更公告》）的内容。现将相关意见回函如下：

意见类型	您的意见（请再对应位置打“√”）
同意本次法律文件变更	
不同意本次法律文件变更	

特别说明：

- 1、如果委托人同意《变更公告》约定法律文件变更，可不做任何操作，继续持有。合同变更生效后，委托人将按照《基金法》、《浙商汇金先进制造混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）及其他有关规定享有权利、承担义务。
- 2、委托人回复“同意”后，视为委托人同意按照管理人《变更公告》约定法律文件变更以及合同变更相关流程安排，管理人不再另行与委托人签署补充协议或电子合同。合同变更后，表明委托人对《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。
- 3、如果委托人不同意《变更公告》约定法律文件变更，委托人须在 **2021年8月9日至2021年8月13日的开放日**内主动申请退出浙商汇金精选定增集合资产管理计划。本公司作为管理人将按照《资产管理合同》约定受理委托人的退出申请，并办理退出业务；
- 4、如果委托人在上述开放日未退出也未在前述征询意见期内回复意见的，视为委托人同意本次法律文件变更。

委托人签字（法定代表人签字并加盖公司公章）：\_\_\_\_\_

时间：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_\_月\_\_\_\_\_日

特别提示：

请您以正楷书写以下信息：委托人名称\_\_\_\_\_联系方式\_\_\_\_\_，并将对本次法律文件变更的答复函在 **2021年8月6日**之前以邮件信函方式邮寄送达，邮寄地址浙江省杭州市江干区五星路201号浙商证券大厦7楼（邮编310020），收件人浙江浙商证券资产管理有限公司财富管理部（收）。

