
浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 基金合同

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

目录

一、前言.....	4
二、释义.....	6
三、基金的基本情况.....	13
四、基金份额的分类与净值计算规则.....	15
五、基金份额的发售.....	19
六、基金备案.....	22
七、浙商沪深 300 份额的申购与赎回.....	23
八、浙商稳健份额与浙商进取份额的上市交易.....	31
九、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.....	33
十、基金的份额配对转换.....	35
十一、基金合同当事人及权利义务.....	37
十二、基金份额持有人大会.....	44
十三、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	53
十四、基金的托管.....	56
十五、基金份额的注册登记.....	57
十六、基金的投资.....	58
十七、基金的财产.....	66
十八、基金资产的估值.....	67
十九、基金的费用与税收.....	73
二十、基金的收益与分配.....	76
二十一、基金份额折算.....	77
二十二、浙商稳健份额与浙商进取份额的终止运作.....	84
二十三、基金的会计和审计.....	86
二十四、基金的信息披露.....	87
二十五、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	92
二十六、违约责任.....	96
二十七、争议的处理.....	97
二十八、基金合同的效力.....	98
二十九、其他事项.....	99
附：基金合同内容摘要.....	100

一、前言

（一）订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作，保障基金财产的安全。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《中华人民共和国合同法》、《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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性管理规定》（以下简称“《流动性规定》”）和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益。

（二）基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。本基金合同当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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。本基金合同的当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利，承担义务。

（三）浙商沪深 300 指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守，诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

（四）基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。

基金合同应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致基金合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定存在冲突之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

（五）本基金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%，但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。

二、释义

在本基金合同中，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：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、基金合同或本基金合同：指《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》及对本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作出的修订
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 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、《流动性规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 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
- 13、《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

14、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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

15、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

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

17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

18、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

19、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

20、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

21、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

22、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

23、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

24、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

25、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

26、基金合同当事人：指受基金合同约束，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

27、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

28、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

29、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

30、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

31、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

32、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

33、销售机构：指直销机构和代销机构

34、直销机构：指浙商基金管理有限公司

35、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是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

36、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

37、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

38、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

39、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

40、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。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

41、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

42、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

43、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

44、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基金份额的变动及结余情况的账户

45、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

46、基金合同生效日：指基金募集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

47、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

48、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

49、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

50、日/天：指公历日

51、月：指公历月

52、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

53、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

54、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

55、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

56、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

57、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

58、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

59、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

60、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

61、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

62、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

63、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

64、会员单位：指深圳证券交易所会员单位

65、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

66、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

67、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

68、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

69、基金转换：指基金份额持有人按照本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

70、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

71、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%

72、元：指人民币元

73、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

74、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

75、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

76、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

77、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

78、流动性受限资产：是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

79、摆动定价机制：是指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

80、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

81、不可抗力：指本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、基金的基本情况

（一）基金的名称

浙商沪深 300 指数分级证券投资基金

（二）基金的类别

股票型

（三）基金的运作方式

契约型开放式

（四）基金的投资目标

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。

（五）标的指数

本基金的标的指数为沪深 300 指数。

（六）基金份额自动分离与分拆

基金发售结束后，投资人场内认购的全部浙商沪深 300 份额将按 1:1 的比例自动分离成预期收益与风险不同的两个份额类别，即稳健收益类的浙商稳健份额和积极收益类的浙商进取份额，两类基金份额的基金资产合并运作。

投资人可在场内申购浙商沪深 300 份额，并可选择将其申购的浙商沪深 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。

投资人在场外认购和申购的浙商沪深 300 份额不进行分离或分拆，其通过跨系统转登记至场内后，可选择将其持有的浙商沪深 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。

（七）基金的最低募集份额总额和金额

基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元。

（八）基金份额初始面值和认购费用

基金份额的初始面值为人民币 1.00 元。

本基金的认购费率最高不超过 5%，具体费率情况由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。

（九）基金存续期限

本基金的存续期限为不定期。

（十）基金份额的上市交易

本基金合同生效后，场内的浙商稳健份额和浙商进取份额将同时申请在深圳证券交易所上市交易。

四、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。

投资者可在场内申购和赎回浙商沪深 300 份额，投资者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。投资者可按 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。

投资者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。投资者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。投资者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。

五、基金份额的发售

（一）基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

本基金通过场内、场外两种方式公开发售。

场内发售是指通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售基金份额的行为（具体名单见本基金份额发售公告或相关业务公告）。尚未取得基金代销资格，但属于深交所会员的其他机构，可在浙商稳健份额、浙商进取份额上市后，通过深圳证券交易所交易系统为投资人办理浙商稳健份额、浙商进取份额的上市交易。场外发售是指通过基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及场外代销机构的代销网点，具体名单见基金份额发售公告）场外公开发售基金份额的行为。

通过场内认购的基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下，本基金在深圳证券交易所上市交易后，基金份额持有人可以通过深圳证券交易所交易基金份额；通过场外认购的基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司注册登记系统的基金份额持有人的基金账户下，基金份额持有人可以通过跨系统转登记至证券登记结算系统在深圳证券交易所上市交易。基金份额持有人可通过办理跨系统转登记业务实现基金份额在两个登记系统之间的转换。

基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

3、发售对象

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。

（二）基金份额的认购

1、认购费用

本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用，认购费率不得超过认购金额的 5%。本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

2、募集期利息的处理方式

认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。

3、基金认购份额的计算

投资人认购浙商沪深 300 份额、发售结束后浙商稳健份额及浙商进取份额各自具体的计算方法在招募说明书中列示。

4、认购份额余额的处理方式

场外认购的浙商沪深 300 份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后部分采取截位法，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

场内认购浙商沪深 300 份额时，认购方式为份额认购，认购的份额为整数。利息折算的份额保留至整数位（最小单位为 1 份），整数位以后部分采取截位法，余额计入基金财产。

场内经确认的浙商稳健份额、浙商进取份额的计算均采用截位的方式，保留至整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

（三）基金份额认购金额的限制

1、投资人认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。

2、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

3、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。

4、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具

体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。

六、基金备案

（一）基金备案的条件

1、本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售，基金管理人应当自基金募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3、本基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。有效认购款项在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成基金份额，归基金份额持有人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

（二）基金募集失败

1、基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后 30 日内退还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（三）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，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

七、浙商沪深 300 份额的申购与赎回

本基金合同生效后，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招募说明书、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

1、开放日及开放时间

深圳证券交易所的工作日为浙商沪深 300 份额的申购、赎回开放日。基金投资者在开放日申请办理浙商沪深 300 份额的申购和赎回，具体办理时间为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本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。

2、浙商沪深 300 份额申购、赎回开始日及业务办理时间

浙商沪深 300 份额的申购、赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其申购、赎回、转换价格为下一开放日浙商沪深 300 份额申购、赎回、转换的价格。

（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、赎回的确认以基金管理人的确认结果为准。

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本基金合同有关条款处理。

（五）浙商沪深 300 份额申购和赎回的数额限制

1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购浙商沪深 300 份额的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。

2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低浙商沪深 300 份额余额，具体规定请参见招募说明书。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的浙商沪深 300 份额上限，具体规定请参见招募说明书。

4、当接受浙商沪深 300 份额申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见相关公告。

5、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》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

（六）浙商沪深 300 份额申购和赎回的价格、费用及其用途

1、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。

2、浙商沪深 300 份额的申购份额的计算及余额的处理方式：浙商沪深 300 份额的申购份额的计算详见招募说明书。浙商沪深 300 份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的浙商沪深 300 份额的基金份额净值，有效份额单位为份。其中，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。

3、浙商沪深 300 份额的赎回金额的计算及处理方式：本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。浙商沪深 300 份额的赎回金额的计算详见招募说明书，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。

4、浙商沪深 300 份额的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

5、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。

6、浙商沪深 300 份额的申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%。浙商沪深 300 份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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。

7、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人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。

（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人对浙商沪深 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人的申购申请。

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、发生本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、申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的；

8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形。

9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、4、5、9、10项情形，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、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5、基金管理人续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、4、5、6、7 项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（单个基金份额持有人当日赎回份额超过上一日基金总份额 30%以上的情形下除外）。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) 若基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 30% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人应当延期办理赎回申请。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。

(4) 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本

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

基金管理人可以为投资人办理浙商沪深 300 份额定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。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。

八、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

本基金合同生效后，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

浙商稳健份额与浙商进取份额拟在基金合同生效后六个月内申请在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒体上刊登基金份额上市交易公告书。

（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，本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。

九、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、基金的份额配对转换

本基金合同生效后，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

份额配对转换自浙商稳健份额与浙商进取份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。

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招募说明书或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。

十一、基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人

名称：浙商基金管理有限公司

住所：浙江省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：310003

法定代表人：肖风

成立时间：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

（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 号华夏银行大厦

法定代表人：李民吉

成立时间：1992 年 10 月 14 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行[银复（1992）391 号]

注册资本：10,685,572,211 元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号

（三）基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为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，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。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。

（四）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、自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本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，在法律法规和本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、根据本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本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。

（五）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。

（六）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、自本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、根据本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本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。

（七）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。

（八）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。

（九）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。

（十）本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称变更而有所改变。

十二、基金份额持有人大会

（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）在法律法规和本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本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) 按照法律法规或本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、除法律法规或本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本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书代理手续完备，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. 召集人按本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）议事内容为本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。

十三、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

（一）基金管理人的更换

1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- （1）基金管理人被依法取消基金管理资格；
- （2）基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- （3）基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- （4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人或者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提名；

（2）决议：基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，该决议需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各自基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的担任基金管理人的资格条件；

（3）核准：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

（4）交接：原基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金资产总值；

（5）审计：原基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支；

（6）公告：基金管理人更换后，由基金托管人在新任基金管理人获得中国证监会核准后 2 日内公告；

(7) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。

(二) 基金托管人的更换

1、基金托管人的更换条件有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- (1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；
- (2) 基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；
- (3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或者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提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，该决议需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各自基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的担任基金托管人的资格条件；

(3) 核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4) 交接：原基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值；

(5) 审计：原基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支；

(6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在新任基金托管人获得中国证监会核准后 2 日内公告。

(三) 基金管理人与基金托管人同时更换

1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由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提名新的基金管理人和基金托管人；

2、基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上联合公告。

（四）新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。

十四、基金的托管

基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

十五、基金份额的注册登记

(一) 本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户建立和管理、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。

(二) 本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在注册登记业务中的权利义务，保护基金份额持有人的合法权益。

(三) 注册登记机构享有如下权利：

- 1、建立和管理投资人基金账户和深圳证券账户；
- 2、取得注册登记费；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则；
- 5、法律法规规定的其他权利。

(四) 注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；
- 3、保存基金份额持有人名册及相关的认购、申购、赎回业务记录 15 年以上；
- 4、对基金份额持有人的基金账户和深圳证券账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法、行政等强制检查情形除外；
- 5、按基金合同和招募说明书规定为投资人办理非交易过户等业务，并提供其他必要服务；
- 6、接受基金管理人的监督；
- 7、法律法规规定的其他义务。

十六、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，使投资者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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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。

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

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）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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(15) 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与基金合同约定的投资范围保持一致；

(16) 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；

(17) 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。除上述第（8）、（11）、（14）、（15）项情况以外，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。

(六) 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交易所中选取 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。

（七）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。

（八）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。

（九）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。

十七、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。

十八、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、当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

8、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。

本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, 所造成的误差不得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。

十九、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、基金财产拨划支付的银行费用；
- 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、基金财产投资运营过程中的增值税；
- 12、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本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。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

二十、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。

二十一、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 =

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

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 =

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

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、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。

6、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。

7、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）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。

（6）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) 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。

(6) 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。

二十二、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。

二十三、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。

二十四、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。

6、本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半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。报告期内出现单一投资者持有基金份额的比例超过基金份额总数 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

（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、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；
- 33、中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

（十）澄清公告

在本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。

二十五、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）在法律法规和本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本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) 按照法律法规或本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) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本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，应当按法律法规和本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。

二十六、违约责任

（一）基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1、不可抗力；

2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

（二）基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成经济损失的，应当对直接损失承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。

（三）本基金合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（四）因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

（五）由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

二十七、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。

本基金合同受中国法律管辖。

二十八、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

（一）本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（二）本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

（三）本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

（四）本基金合同可印制成册，供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，但其效力应以基金合同正本为准。

二十九、其他事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

附：基金合同内容摘要

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、自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本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，在法律法规和本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、根据本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本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、自本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、根据本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本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

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) 在法律法规和本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本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) 按照法律法规或本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、除法律法规或本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本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书代理手续完备，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. 召集人按本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）议事内容为本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、基金收益分配原则、执行方式

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。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

(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、基金财产拨划支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、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；
- 7、基金的证券交易费用；

- 8、证券账户开户费用、银行账户维护费；
- 9、基金上市初费和上市月费；
- 10、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 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

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与标的指数许可方的许可协议从基金财产中计提和列支。

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。

五、基金资产的投资方向和投资限制

（一）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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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）投资限制

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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%;

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的

因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（15）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与基金合同约定的投资范围保持一致；

（16）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；

（17）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。除上述第8、11、14、15项情况以外，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）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。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）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。

（二）公告方式

1、基金合同生效后，在浙商稳健份额、浙商进取份额上市交易前或者开始办理浙商沪深 300 份额申购或者赎回前，基金管理人应当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的基金份额参考净值。

2、在浙商稳健份额、浙商进取份额上市交易或者开始办理浙商沪深 300 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登载在指定媒体和基金管理人网站上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（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) 在法律法规和本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本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) 按照法律法规或本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) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本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，应当按法律法规和本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。

八、争议解决方式

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。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、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。

本页无正文，为《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》签字页。

基金合同当事人盖章及其法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日

基金管理人：浙商基金管理有限公司（章）

法定代表人或授权代表：（签字）

基金托管人：华夏银行股份有限公司（章）

法定代表人或授权代表：（签字）

签订地点：中国北京

签订日：年月日

