

# 浙商沪深 300 指数分级证券投资基金

## 更新招募说明书

### (2017 年第 1 期)

### (摘要)

本基金的募集申请经中国证监会证监许可【2012】91号文核准。本基金的基金合同于2012年5月7日正式生效。

#### 重要提示

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资有风险，投资者在投资本基金前，应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金投资者根据所持有的份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等。本基金为开放式股票型基金，属证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

基金管理人建议基金投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基

金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本次招募说明书的更新内容中与托管相关的信息已经本基金托管人复核。所载内容截止日为2017年5月7日，投资组合报告为2016年3季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2017年3月31日（财务数据未经审计）。

## 一、 基金管理人

### （一） 基金管理人概况

基金管理人：浙商基金管理有限公司

注册地址：杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室

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

法定代表人：肖风

成立日期：2010 年 10 月 21 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可【2010】1312 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：3 亿元人民币

存续期间：持续经营

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

联系人：何萍

联系电话：021-60350835

### （二） 主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

肖风先生，董事长，1961 年生，中共党员，博士生学历。历任深圳证券管理办公室副处长、处长、证券办副主任；博时基金管理有限公司总裁。现任中国万向控股有限公司副董事长、民生人寿保险股份有限公司副董事长、万向信托有

限公司董事长、民生通惠资产管理有限公司董事长、通联支付网络服务股份有限公司董事长、通联数据股份公司董事长、浙江股权交易中心独立董事。

周跃先生，董事，1972年生，中共党员，浙江大学公共管理专业硕士。历任天健会计师事务所项目经理、高级项目经理、部门副经理；中国证监会浙江监管局上市公司监管处副主任科员、主任科员、副处长、处长，机构监管处副处长，信息调研处处长。现任浙商证券股份有限公司投资银行业务管理副总裁。

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

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

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

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

章晓洪先生，独立董事，1973年生，西南政法大学法学硕士、博士。历任浙江天健会计师事务所注册会计师；现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人、浙江财经大学中国金融研究院院长及教授、中国民事诉讼法学研究会常务理事、中华全国律师协会金融与公司专业委员会委员，浙江省人大常委会法制工作委员

会特聘专家、复旦大学法学院、浙江大学法学院、浙江工业大学法学院的客座教授或研究员。

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

金雪军先生，独立董事，1958年生，南开大学经济学硕士。历任浙江大学经济学院副院长等，享受国务院政府特殊津贴，及浙江东方集团股份有限公司独立董事；哈尔滨高科技（集团）股份有限公司独立董事。现任浙江大学教授、博士生导师；浙江大学公共政策研究院执行院长，浙江省国际金融学会会长、大地期货有限公司独立董事、新湖中宝股份有限公司独立董事、浙江伟星实业发展股份有限公司独立董事、浙商期货有限公司独立董事、精工钢构股份有限公司独立董事、华安证券股份有限公司独立董事。

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

## 2、监事会成员

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

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

谢志强先生，职工监事，1981年生，厦门大学金融学专业学士、硕士，特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM）。历任浙江证监局稽查处副主任科

员、主任科员，曾借调中国证监会稽查局工作。现任浙商基金管理有限公司监察稽核部总经理。

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

### 3、公司高管人员

李志惠先生，总经理，简历同上。

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

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

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

### 4、本基金基金经理

查晓磊先生，1982年生，曾任香港中文大学中国金融发展与改革研究中心核心研究员，博时基金博士后工作站研究员博时基金管理有限公司投资策略及大宗商品分析师兼投资经理助理。现任浙商基金管理有限公司衍生品及量化投资部总经理，浙商沪深300指数分级证券投资基金、浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金、浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

聂挺进先生，投资决策委员会主席，简历同上。

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

查晓磊先生，投资决策委员会委员，简历同上。

### 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、法律法规和中国证监会规定的或基金合同约定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

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

2、基金管理人承诺防止下列行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以抬高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

## （五） 基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

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

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## （六） 基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的目标

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

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

（3）确保基金、公司财务及其他信息真实、准确、完整、及时；

（4）建立和健全法人治理结构，形成合理的决策、执行和监督机制。通过完善的公司治理结构和风险控制流程，保护基金持有人利益不受侵犯。

### 2、内部控制的原则

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

（2）独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；

（3）相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

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

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

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



进行相应的修改和完善；

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

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

### 3、内部控制的组织机构

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

#### (1) 监督系统

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

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

#### (2) 决策和执行系统

股东会、董事会、管理层及职能部门构成公司决策与业务执行系统。

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

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

#### 4、内部控制的制度体系

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

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

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

#### 5、内部控制的层次体系

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

#### 6、基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于

内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善内部控制制度。

## 二、 基金托管人

### （一）基金托管人情况

名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

成立时间：1992 年 10 月 14 日

法定代表人：李民吉

组织形式：股份有限公司

注册资本：10,685,572,211 元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391 号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号

联系人：徐昊光

联系电话：（010）85238982

传真：（010）85238680

### （二）主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险管理室和运营室 4 个职能处室。资产托管部共有员工 34 人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

### （三）基金托管业务经营情况

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

年 12 月末，托管证券投资基金、券商资产管理计划、银行理财、资产支持专项计划、股权投资基金等各类产品合计 819 只，托管规模达到 21,732.58 亿元，同比增长 66.34%。

### 三、 相关服务机构

#### （一） 基金份额发售机构

##### 1、 直销机构

###### 1) 浙商基金管理有限公司直销中心

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

电话：021-60350857

传真：021-60350836

联系人：邹均乐

###### 2) 浙商基金管理有限公司网上直销

公司网址：<http://www.zsfund.com>

客服电话：400-067-9908（免长途话费）；021-60359000

##### 2、 代销机构

###### 1) 华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系电话：010-85238667

传真：010-85238680

联系人：陈秀良

客服电话：95577

公司网址：<http://www.hxb.com.cn>

###### 2) 中国工商银行股份有限公司

客服电话：95588

公司网址：<http://www.icbc.com.cn>

###### 3) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：蒋超良

联系电话：010-85108227

传真：010-85109219

联系人：刘一宁

客服电话：95599

公司网址：<http://www.abchina.com>

4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客服电话：95559

公司网址：<http://www.bankcomm.com>

5) 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系电话：010-58560666

传真：010-57092611

联系人：董云巍

客服电话：95568

公司网址：<http://www.cmbc.com.cn>

6) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：倪苏云、虞谷云

客服电话：95528

公司网址：<http://www.spdb.com.cn>

7) 浙商银行股份有限公司

住所：浙江杭州庆春路 288 号

办公地址：浙江杭州庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

联系电话：0571-87659546

传真：0571-87659188

联系人：毛真海

客服电话：95527

公司网址：<http://www.czbank.com>

8) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：<http://www.ebscn.com>

9) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号

办公地址：南京市中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

联系电话：025-83290979

传真:025-51863323

联系人:万鸣

客服电话:95597

公司网址:<http://www.htsc.com.cn>

10) 华安证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市长江中路 357 号

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

法定代表人: 李工

联系电话: 0551-5161666

传真: 0551-5161600

联系人: 甘霖

客服电话: 96518、400-80-96518

公司网址: <http://www.hazq.com>

11) 信达证券股份有限公司

住所: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人: 张志刚

联系电话: 010-63081000

传真: 010-63080978

联系人: 唐静

客服电话: 400-800-8899

公司网址: <http://www.cindasc.com>

12) 东方证券股份有限公司

住所: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人: 潘鑫军

联系电话: 021-63325888

传真: 021-63326173

联系人: 吴宇

客服电话：95503

公司网址：<http://www.dfzq.com.cn>

13) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏琪

客服电话：95521

公司网址：<http://www.gtja.com>

14) 民生证券有限责任公司

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

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

法定代表人：余政

联系电话：010-85127999

传真：010-85127917

联系人：赵明

客服电话：4006198888

公司网址：<http://www.msza.com>

15) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：李笑鸣

客服电话：95553

公司网址：<http://www.htsec.com>



16) 上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区西藏中路 336 号

办公地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

联系电话：021-53519888

传真：021-63608300

联系人：张瑾

客服电话：4008918918（全国）、021-962518

公司网址：<http://www.962518.com>

17) 财通证券有限责任公司

住所：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系电话：0571-87925129

传真：0571-87818329

联系人：乔骏

客服电话：0571-96336（上海地区：962336）

公司网址：<http://www.ctsec.com>

18) 国海证券股份有限公司

住所：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3F

法定代表人：张雅锋

联系电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

客服电话：95563

公司网址：<http://www.ghzq.com.cn>

19) 申万宏源证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

联系电话：021-54033888

传真：021-54038844

联系人：邓寒冰

客服电话：95523、4008895523

公司网址：<http://www.sywg.com>

20) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：刘化军

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：<http://www.longone.com.cn>

21) 平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系电话：95511-8

传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽

客服电话：95511

公司网址：<http://www.pingan.com>

22) 浙商证券股份有限公司

住所：杭州市杭大路 1 号黄龙世纪 A 区 6-7 楼

办公地址：杭州市杭大路 1 号黄龙世纪 A 区 6-7 楼

法定代表人：吴承根

联系电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：谢项辉

客服电话：0571-967777

公司网址：<http://www.stocke.com.cn>

23) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系电话：010-66568430

传真：010-66568536

联系人：田薇

客服电话：4008-888-888

公司网址：<http://www.chinastock.com.cn>

24) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层

法定代表人：王东明

联系电话：010-84588888

传真：010-84865560

联系人：张于爱

客服电话：95558

公司网址：<http://www.cs.ecitic.com>

25) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层  
(266061)

法定代表人：杨宝林

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：0532-96577

公司网址：<http://www.zxwt.com.cn>

26) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

联系电话：0571-85783737

联系人：王霏霏

客服电话：0571-95548

公司网址：<http://www.bigsun.com.cn>

27) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路 758 号 23 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：郭林

联系电话：021-32229888

传真：021-021-68728703

联系人：陈敏

客服电话：021-63340678

公司网址：<http://www.ajzq.com>

28) 中航证券有限公司

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

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

法定代表人：杜航

联系电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

客服电话：400-8866-567

公司网址: <http://www.avicsec.com/>

29) 广发证券股份有限公司

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

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

42、43、44 楼法定代表人: 孙树明

联系人: 黄岚

客服电话: 95575 或致电各地营业网点

公司网址: <http://www.gf.com.cn>

30) 兴业证券股份有限公司

住所: 福州市湖东路 268 号

办公地址: 上海市浦东民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人: 兰荣

联系电话: 021-38565785

传真: 021-38565955

联系人: 谢高得

客服电话: 95562

公司网址: <http://www.xyzq.com.cn>

31) 中泰证券有限公司

住所: 山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人: 李玮

联系电话: 0531-68889155

传真: 0531-68889752

联系人: 吴阳

客服电话: 95538

公司网址: <http://www.qlzq.com.cn>

32) 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系电话：010-85130588

传真：010-65182261

联系人：权唐

客服电话：4008888108

公司网址：<http://www.csc108.com>

33) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市益田路江苏大厦 38—45 层

办公地址：深圳市益田路江苏大厦 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

联系人：林生迎

客服电话：95565、4008888111

公司网址：<http://www.newone.com.cn>

34) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

公司网址：<http://www.guosen.com.cn>

35) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编：100032

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

法定代表人：林义相

联系电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：尹伶

客服电话：010-66045678

公司网址：<http://www.txsec.com>

36) 深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

联系人：张玉静

客服电话：4006-788-887

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

37) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

联系人：敖玲

客服电话：400-089-1289

公司网址：<http://www.erichfund.com>

38) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系电话：021-54509998

传真：021-64385308

联系人：潘世友

客服电话：4001818188

公司网址：<http://www.1234567.com.cn>

39) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系电话：0571-28829790，021-60897869

传真：0571-26698533

联系人：周熾旻

客服电话：4000-766-123

公司网址：<http://www.fund123.cn>

40) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系电话：021-58870011

传真：021-68596919

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

公司网址：<http://www.ehowbuy.com>

41) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

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

法定代表人：汪静波

联系电话：021-38602377

传真：021-38509777

联系人：方成

客服电话：400-821-5399

公司网址：<http://www.noah-fund.com>



42) 万银财富（北京）基金销售有限公司

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

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

法定代表人：李招弟

联系电话：010-59393923

传真：010-59393074

联系人：高晓芳

客服电话：400-808-0069

公司网址：<http://www.wy-fund.com>

43) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

联系电话：0571-88920897

传真：0571-86800423

联系人：杨翼

客服电话：4008-773-772

公司网址：<http://www.5ifund.com>

44) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系电话：010-57418829

传真：010-57569671

联系人：魏争

客服电话：400-678-5095

公司网址：<http://www.niuji.net>

45) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 号

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

联系电话：021-50583533-8081

传真：021-50583633

联系人：叶雪飞

客服电话：400-067-6266

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

46) 深圳宜投基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心 2405

法定代表人：华建强

联系电话：0755-23919681

传真：0755-88603185

联系人：马文静

客服电话：4008-955-811

公司网址：<http://www.yitfund.com>

(47) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层

法定代表人：于婷婷

联系人：董浩

客服电话：400-068-1176

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

(48) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四  
楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三楼

法定代表人：徐刚

存续期间：永续经营

联系电话：075-22119700

联系人：彭莲

客服电话：95564

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

(49) 联泰资产管理有限公司

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

办公地址：上海市福泉北路 518 弄 8 座 3 楼

法定代表人：燕斌

联系人：凌秋艳

客服电话：4000-466-788

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

(50) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系电话：33323999-8048

传真：33323830

联系人：李栋

客服电话：400-821-3999

公司网址：[tty.chinapnr.com](http://tty.chinapnr.com)

(51) 中大期货有限公司

注册地址：杭州市中山北路 310 号五矿大厦 3 层 12 层东

办公地址：浙江省杭州市中山北路 310 号五矿大厦 3 楼

法定代表人：颜亮

客服电话：400-8810-999

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

(52) 日发资产管理（上海）有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 33 楼 3301 室

办公地址：东亚银行大厦 33 楼 3301 室

法定代表人：周泉恭

客服电话：400-021-1010

公司网址：www.rffund.com

(53)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-818-8000

公司网址：www.myfund.com

(54)北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区双井乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

客服电话：4008-980-618

公司网址：www.chtfund.com

## (二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：金颖

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

联系电话：010-59378839

传真：010-59378907

联系人：朱立元

## (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四） 审计基金财产的会计师事务所

机构名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

办公地址：上海南京西路1266号恒隆广场50楼

法定代表人：姚建华

电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：王国蓓

经办注册会计师：王国蓓、黄超

#### 四、 基金的名称

浙商沪深300指数分级证券投资基金

#### 五、 基金的类型

契约型开放式

#### 六、 基金的投资目标

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。

#### 七、 基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板股票、创业板股票以及中国证监会允许基金投资的其他股票）、债

券、货币市场工具、股指期货、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。

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

## 八、 基金的投资策略

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

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

### 1、资产配置策略

本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标，本基金将注重仓位管理，积极防范由于申购、赎回等因素产生的跟踪误差。

### 2、股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据沪深300指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

#### （1）股票投资组合的构建

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

#### （2）股票投资组合的调整

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

##### ① 定期调整

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

##### ② 不定期调整

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

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

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

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

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

### ③ 特殊情形下的调整

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

### 3、风险预估和控制

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

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

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

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

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



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

#### 4、债券投资策略

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

#### 5、金融衍生产品投资策略

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

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

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

## 九、 基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率  $\times 95\%$  + 金融同业存款利率  $\times 5\%$

## 十、 基金的风险收益特征

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。

## 十一、 基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

### 1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	208,749,084.01	92.28
	其中：股票	208,749,084.01	92.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,365,909.20	2.81
	其中：债券	6,365,909.20	2.81
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	6,000,000.00	2.65
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,929,905.66	2.18
8	其他资产	164,471.59	0.07
9	合计	226,209,370.46	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	254,010.30	0.11
B	采矿业	9,578,099.87	4.25
C	制造业	71,302,573.91	31.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,085,941.59	2.70
E	建筑业	10,062,419.49	4.46
F	批发和零售业	4,972,608.87	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	6,496,596.65	2.88
H	住宿和餐饮业	311,904.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,400,726.98	3.73
J	金融业	72,054,547.59	31.97
K	房地产业	10,046,230.28	4.46
L	租赁和商务服务业	2,245,612.66	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,991,061.83	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	473,432.03	0.21
R	文化、体育和娱乐业	3,591,330.78	1.59
S	综合	881,987.18	0.39
	合计	208,749,084.01	92.62

### (2) 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

(1) 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	237,828	8,802,014.28	3.91
2	600036	招商银行	261,394	5,010,922.98	2.22
3	601166	兴业银行	289,945	4,700,008.45	2.09
4	600519	贵州茅台	11,577	4,472,889.72	1.98
5	600016	民生银行	520,515	4,413,967.20	1.96
6	601328	交通银行	677,516	4,220,924.68	1.87
7	000651	格力电器	106,898	3,388,666.60	1.50
8	600000	浦发银行	210,677	3,372,938.77	1.50
9	000333	美的集团	100,059	3,331,964.70	1.48
10	000002	万科A	150,700	3,101,406.00	1.38

(2) 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期期末未持有积极投资股票

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,365,909.20	2.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	6,365,909.20	2.82

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010213	02 国债(13)	63,640	6,365,909.20	2.82

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3）期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	144,763.57
2	应收证券清算款	4,912.87
3	应收股利	-
4	应收利息	8,313.51
5	应收申购款	6,481.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	164,471.59

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资的前十名股票不存在流通受限的情况。

2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十二、 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(1) 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	-----------	---------------	-----	-----

			③			
2012.5.7-2012.12.31	-3.60%	1.08%	-6.69%	1.14%	3.09%	-0.06%
2013.1.1-2013.12.31	-6.68%	1.31%	-7.14%	1.32%	0.46%	0.01%
2014.1.1-2014.12.31	48.35%	1.14%	48.72%	1.15%	-0.37%	-0.01%
2015.1.1-2015.12.31	4.44%	2.36%	5.72%	2.36%	-1.28%	0.00%
2016.1.1-2016.6.30	-15.36%	1.80%	-14.65%	1.75%	-0.71%	0.05%
2016.1.1-2016.12.31	-10.43%	1.35%	-10.61%	1.33%	0.18%	0.02%
2017.1.1-2017.3.31	2.67%	0.43%	4.20%	0.49%	-1.53%	-0.06%

注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 5 月 7 日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金生效时间已满一年。图示日期为 2012 年 5 月 7 日至 2017 年 3 月 31 日。

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

## 十三、 费用概览

### （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、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

### （三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值



基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 3、基金合同生效后的标的指数许可使用费

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

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

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

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

H 为每日应计提的标的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用基点费。

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

#### （四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

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

#### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对 2012 年 5 月 7 日公布的《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

- 1、 根据最新资料，更新了“重要提示”部分。
- 2、 根据最新资料，更新了“三、基金管理人”部分。
- 3、 根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。
- 4、 根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。
- 5、 根据最新资料，更新了“十三、基金的投资”部分。
- 6、 根据最新资料，更新了“二十七、其他应披露事项”部分。