

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

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

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市日期：2012 年 7 月 13 日

公告日期：2012 年 7 月 10 日

目 录

一、重要声明与提示	3
二、基金概览	4
三、基金的募集与上市交易	7
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	10
五、基金主要当事人简介	12
六、基金合同摘要	15
七、基金财务状况	16
八、基金投资组合	17
九、重大事件揭示	20
十、基金管理人承诺	21
十一、基金托管人承诺	22
十二、基金上市推荐人意见	23
十三、备查文件目录	24
附：基金合同摘要	25

一、重要声明与提示

浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额和浙商进取份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“基金法”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本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、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之浙商稳健份额和浙商进取份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在 2012 年 3 月 19 日《中国证券报》、2012 年 3 月 19 日《上海证券报》和 2012 年 3 月 19 日《证券时报》及浙商基金管理有限公司网站(<http://www.zsfund.com>)的上的《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：浙商沪深 300 指数分级证券投资基金。

2、基金类型与基金运作方式：股票型、契约型开放式。

3、浙商沪深 300 指数分级证券投资基金（以下简称“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（简称“浙商沪深 300 指数分级”，场内简称“浙商 300”）、浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（场内简称“浙商稳健”）与浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额（场内简称“浙商进取”）。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。

4、本基金的存续期限为不定期。

5、浙商 300 的申购与赎回：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。

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。

浙商稳健份额、浙商进取份额只上市交易，不接受申购和赎回。

6、份额配对转换：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。

投资者 T 日提出的 M 份份额“分拆”申请被确认成功后，中登深圳分公司将在投资者所申报的深市证券账户上扣减 M 份浙商 300 份额，同时增加 M/2 份浙商稳健份额与 M/2 份浙商进取份额。正常情况下，自 T+1 日（含该日）起新增的浙

商稳健与浙商进取份额可进行交易。

份额配对转换自 2012 年 6 月 11 日起开始办理,有关份额配对转换的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

7、基金份额折算:

(1) 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,本基金将分别对浙商沪深 300 份额和浙商稳健份额进行定期份额折算。

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。

(2) 不定期份额折算

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。

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。

8、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。

9、基金份额总额：截至 2012 年 7 月 6 日，本基金的基金份额总额为 354,363,602.17 份，其中，浙商 300 为 295,612,331.17 份，浙商稳健为 29,375,635.00 份，浙商进取为 29,375,636.00 份。

10、基金份额净值：截至 2012 年 7 月 6 日，浙商 300 的基金份额净值为 0.957 元，浙商稳健的基金份额净值为 1.011 元，浙商进取的基金份额净值为 0.903 元。

11、本次上市交易的基金份额简称：浙商稳健、浙商进取

12、本次上市交易的基金份额总额：浙商稳健 29,375,635.00 份，浙商进取 29,375,636.00 份

13、本次上市交易的基金份额交易代码：浙商稳健为 150076，浙商进取为 150077

14、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

15、上市交易日期：2012 年 7 月 13 日

16、基金管理人：浙商基金管理有限公司

17、基金托管人：华夏银行股份有限公司

18、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

(一) 上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可【2012】91号

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2012年3月28日至2012年4月27日

5、发售价格：1.00元人民币

6、发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构：

(1) 场内发售机构

1) 已具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中原证券（排名不分先后）

2) 本基金募集期期间获得基金代销资格并具有深交所会员单位资格的证券公司经深交所确认后也可代理场内的基金份额发售。具体名单可在深交所网站查

询，本基金管理人就此事项将不再进行公告。

3) 尚未取得基金代销资格，但属于深交所会员的其他机构，可在本基金上市交易后，代理投资者通过深交所交易系统参与本基金的买卖。

(2) 场外发售机构

1) 直销机构

浙商基金管理有限公司直销中心、浙商基金管理有限公司上海分公司直销中心、网上直销

2) 场外代销机构

华夏银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、光大证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、民生证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、上海证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、浙商证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、爱建证券有限责任公司、中航证券有限公司、广发证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司等 33 家代销机构。

8、验资机构名称：毕马威华振会计师事务所。

9、募集资金总额及入账情况：

募集期间净认购金额为 354,249,853.79 元人民币，上述资金已于 2012 年 5 月 7 日划入本基金在基金托管人华夏银行股份有限公司开立的基金托管专户。认购资金在募集期间产生的利息 113,748.38 元人民币。

10、基金备案情况：

2012 年 5 月 7 日聘请毕马威华振会计师事务所验资，随后向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，2012 年 5 月 7 日中国证监会予以书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2012 年 5 月 7 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：354,363,602.17 份，其中，浙商 300 为 336,090,191.17 份，浙商稳健为 9,136,705.00 份，浙商进取为 9,136,706.00 份

(二) 上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2012]215 号

2、上市交易日期：2012 年 7 月 13 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、本次上市交易的基金份额场内简称：浙商稳健、浙商进取

5、本次上市交易的基金份额交易代码：浙商稳健为 150076；浙商进取为 150077

6、本次上市交易的基金份额总额：浙商稳健为 29,375,635.00 份；浙商进取为 29,375,636.00 份

7、基金资产净值的披露：基金管理人于每个估值日（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）对基金资产进行估值。用于基金信息披露的基金资产净值和浙商 300 的基金份额净值、浙商稳健和浙商进取基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个估值日将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，由深交所于下一个交易日通过行情系统揭示前一估值日的基金份额参考净值。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）基金份额持有情况

截至 2012 年 7 月 6 日，浙商沪深 300 基金份额持有人户数为 2,265 户，平均每户持有的基金份额为 130,513.17 份；浙商稳健为 29 户，平均每户持有的基金份额为 1,012,952.93 份；浙商进取为 29 户，平均每户持有的基金份额为 1,012,952.97 份。

机构投资者持有的本次上市交易的浙商稳健基金份额为 26,751,778.00 份，占本次浙商稳健上市交易基金份额比例为 91.07%；个人投资者持有的本次上市交易的浙商稳健基金份额为 2,623,857.00 份，占本次浙商稳健上市交易基金份额比例为 8.93%。

机构投资者持有的本次上市交易的浙商进取基金份额为 26,751,778.00 份，占本次浙商进取上市交易基金份额比例为 91.07%；个人投资者持有的本次上市交易的浙商进取基金份额为 2,623,858.00 份，占本次浙商进取上市交易基金份额比例为 8.93%。

（二）基金份额前十名持有人情况：

本次上市交易的浙商稳健与浙商进取前十名持有人情况：

浙商稳健：

序号	持有人名称	持有份额（份）	持有比例（%）
1	国都安心成长集合资产管理计划	7,500,850.00	25.53%
2	中航证券有限公司	5,000,400.00	17.02%
3	世纪证券-华夏-世纪金彩 1 号“七新伴悦”集合资产管理计划	5,000,000.00	17.02%
4	兴业证券股份有限公司	3,750,260.00	12.77%
5	上海证券有限责任公司	3,000,208.00	10.21%
6	海证期货有限公司	2,500,060.00	8.51%
7	李惠灵	505,035.00	1.72%
8	顾惠敏	390,027.00	1.33%
9	陈玉英	284,020.00	0.97%
10	励振华	250,038.00	0.85%
合计		28,180,898.00	95.93%

浙商进取：

序号	持有人名称	持有份额（份）	持有比例（%）
1	国都安心成长集合资产管理计划	7,500,850.00	25.53%
2	中航证券有限公司	5,000,400.00	17.02%
3	世纪证券-华夏-世纪金彩1号“七新伴悦”集合资产管理计划	5,000,000.00	17.02%
4	兴业证券股份有限公司	3,750,260.00	12.77%
5	上海证券有限责任公司	3,000,208.00	10.21%
6	海证期货有限公司	2,500,060.00	8.51%
7	李惠灵	505,035.00	1.72%
8	顾惠敏	390,027.00	1.33%
9	陈玉英	284,019.00	0.97%
10	励振华	250,038.00	0.85%
合计		28,180,897.00	95.93%

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

- 1、名称：浙商基金管理有限公司
- 2、法定代表人：高玮
- 3、总经理：周一烽
- 4、注册资本：壹亿元人民币
- 5、住所：浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室
- 6、设立批准文号：中国证监会证监许可【2010】1312 号
- 7、法人营业执照文号：330000000053461
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
- 9、股东及持股比例：浙商证券有限责任公司、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%
- 10、内部组织结构及职能：公司下设投资管理部、中央交易室、市场部、运营保障部、监察稽核部、策略发展部、综合管理部等职能部门。其中，投资管理部负责基金的投资管理及宏观、策略、行业与公司研究工作；策略发展部负责金融工程、基金产品设计等工作；中央交易室负责交易执行；市场部负责基金销售、营销策划、电子商务与客户服务工作；运营保障部负责基金运营与信息技术工作；监察稽核部负责对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核，督促公司内部管理制度的执行，处理日常法律事务、信息披露事务；综合管理部负责公司财务管理、人力资源、办公室和行政管理的工作。
- 11、人员情况：截止 2012 年 5 月 10 日，公司共有员工 60 名，大学本科及以上学历 54 名，占员工总数 90%。
- 12、信息披露负责人及咨询电话：闻震宙，0571-28191875。
- 13、基金管理业务情况简介：截至 2012 年 3 月 31 日，本基金管理人共管理 2 只基金，分别为浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金，资产管理规模 14.84 亿元人民币。
- 14、本基金基金经理：关永祥先生，1974 年生，北京大学金融学专业硕士，

中科院研究生院软件系统分析工程硕士。历任华泰证券股份有限公司、泰阳证券有限责任公司研究员；长信基金管理有限公司数量策略研究员；国联安基金管理有限公司数量策略研究员。现任浙商基金管理有限公司策略发展部副总监。

（二）基金托管人

1、名称：华夏银行股份有限公司

2、法定代表人：吴建

3、注册资本：49.9 亿元人民币

4、住所：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

5、基金托管部门负责人及人员情况：华夏银行基金托管部成立于 2004 年 7 月，2009 年 8 月更名为资产托管部，内设市场综合室、交易管理室、风险管理室和销售管理室 4 个职能处室，并在上海、深圳分行设立 2 个托管分部。资产托管部共有员工 31 人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

6、信息披露负责人及咨询电话：郑鹏，010-85238667

7、托管业务情况简介：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 2011 年 12 月末，已托管长城货币市场基金、国联安德盛精选股票基金、万家货币市场基金、诺安优化收益债券型基金、益民红利成长混合型基金、东吴行业轮动股票基金、申万菱信稳益宝债券基金及其它受托资产产品，托管规模 2395.1 亿元。

（三）基金验资机构

1、名称：毕马威华振会计师事务所

2、法定代表人：姚建华

3、住所：北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层

4、经办注册会计师：石峰、王国蓓

5、电话：021-22122888

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

浙商沪深 300 指数分级证券投资基金 2012 年 7 月 6 日资产负债表如下：

单位：人民币元

资 产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资 产：		负债：	
银行存款	22,683,929.73	短期借款	
结算备付金	1,590,475.07	交易性金融负债	
存出保证金	250,000	衍生金融负债	
交易性金融资产	314,402,579.25	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	314,402,579.25	应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券		应付管理人报酬	55,251
投资		应付托管费	12,155.23
基金投资		应付销售服务费	
衍生金融资产		应付交易费用	32,041.20
买入返售金融资产		应付税费	
应收证券清算款		应付利息	
应收利息	15,220.71	应付利润	
应收股利	724,871.39	其他负债	379,869.03
应收申购款		负债合计	479,316.46
其他资产		所有者权益：	
		实收基金	354,363,602.17
		未分配利润	-15,175,842.48
		所有者权益合计	339,187,759.69
资产合计：	339,667,076.15	负债与持有人权益总计：	339,667,076.15

八、基金投资组合

截止到 2012 年 7 月 6 日，本基金的投资组合如下：

（一）基金资产组合情况

资产类别	市值（元）	占总资产的比例(%)
股票	314,402,579.25	92.56
现金（银行存款及清算备付金）	24,274,404.80	7.15
其他资产（交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等）	990,092.10	0.29
其中：买入返售证券		0
资产合计	339,667,076.15	100

（二）按行业分类的股票投资组合

证券板块名称	证券库存数量	证券市值（元）	市值占净值(%)
A 农、林、牧、渔业	248,916	2,082,387.93	0.6100%
B 采掘业	2,664,194	31,603,722.57	9.3200%
C 制造业	10,411,174	111,537,679.78	32.8800%
C0 食品、饮料	617,422	24,757,428.74	7.3000%
C1 纺织、服装、皮毛	114,789	1,191,345.98	0.3500%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	568,225	6,862,526.01	2.0200%
C5 电子	1,486,491	5,499,194.76	1.6200%
C6 金属、非金属	3,188,549	25,148,724.18	7.4100%
C7 机械、设备、仪表	3,630,705	32,570,622.97	9.6000%
C8 医药、生物制品	786,955	15,153,570.82	4.4700%
C99 其他制造业	18,038	354,266.32	0.1000%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	1,600,978	7,837,610.55	2.3100%
E 建筑业	2,346,650	10,238,206.28	3.0200%
F 交通运输、仓储业	1,831,536	9,114,937.98	2.6900%

G 信息技术业	1,138,906	8,953,072.95	2.6400%
H 批发和零售贸易	797,625	8,460,116.14	2.4900%
I 金融、保险业	13,053,333	97,447,909.31	28.7300%
J 房地产业	1,876,507	18,294,094.21	5.3900%
K 社会服务业	372,571	2,812,311.10	0.8300%
L 传播与文化产业	123,957	1,064,362.85	0.3100%
M 综合类	745,760	4,956,167.60	1.4600%
金额合计:		314,402,579.25	92.6800%

(三) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	股票市值(元)	占期末净值比例(%)
1	601318	中国平安	213,058.00	9,851,801.92	2.9
2	600016	民生银行	1,434,905.00	8,666,826.20	2.56
3	600036	招商银行	788,098.00	8,330,195.86	2.46
4	601328	交通银行	1,611,315.00	7,218,691.20	2.13
5	600519	贵州茅台	26,207.00	6,813,557.93	2.01
6	601166	兴业银行	483,908.00	6,242,413.20	1.84
7	000002	万科A	616,570.00	5,949,900.50	1.75
8	600000	浦发银行	712,753.00	5,680,641.41	1.67
9	600030	中信证券	440,103.00	5,532,094.71	1.63
10	600837	海通证券	514,019.00	4,821,498.22	1.42
	合计		6,840,936.00	69,107,621.15	20.37

(四) 按券种分类的债券投资组合

本报告期末本基金无债券投资。

(五) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本报告期末本基金无债券投资。

(六) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、期末其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	724871.39
4	应收利息	15220.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	990092.10

4、本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期末本基金无权证投资。

6、本报告期末本基金无资产支持证券投资。

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

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易之后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

(一) 备查文件目录

- 1、中国证监会核准浙商沪深 300 指数分级证券投资基金募集的文件
- 2、《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 4、《浙商沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》
- 5、关于申请募集浙商沪深 300 指数分级证券投资基金之法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

(二) 存放地点

浙江省杭州市文三路 90 号东部软件园 1 号楼 2 楼

(三) 查阅方式

- 1、书面查询：投资者可在我公司营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- 2、网站查询：<http://www.zsfund.com>

浙商基金管理有限公司

2012 年 7 月 10 日

附：基金合同摘要

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进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权益登记日浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额各自基金份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商

进取份额各自基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

（2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（七）决议形成的条件、表决方式、程序

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

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议

一般决议须经出席会议的浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额的基金份额持有人（或其代理人）各自所持浙商沪深 300 份额、浙商稳健份额与浙商进取份额表决权的 50%以上通过方为有效，除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

（2）特别决议

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

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

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则

表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（八）计票

1、现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

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

2、通讯方式开会

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

（九）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、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% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(12) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(13) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产的 85%；

(14) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(15) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、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。