

# 关于浙商沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额转换的公告

根据《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》、《浙商沪深300指数分级证券投资基金基金合同》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证券监督管理委员会《关于准予浙商沪深300指数分级证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]1618号）和《浙商基金管理有限公司关于浙商沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》等的有关规定，浙商沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，包括浙商沪深300份额、浙商稳健份额与浙商进取份额）基金管理人浙商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）将于2018年8月17日进行本基金基金份额的转换，现就转换相关的信息公告如下：

## 一、有关基金转型决定的主要内容

2018年6月9日起至2018年7月8日期间，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于浙商沪深300指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”），并于2018年7月10日表决通过了本次会议议案，本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效并已由基金管理人报中国证券监督管理委员会备案。基金管理人于2018年7月12日发布了《浙商沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人已在本次基金份额持有人大会决议生效后、本基金正式转型前，预留至少二十个交易日的选择期供基金份额持有人做出选择，本基金转型选择期为2018年7月12日至2018年8月10日。转型选择期届满后，本基金浙商稳健份额、浙商进取份额将终止上市，基金管理人已向深圳证券交易所申请终止本基金的上市交易，并已获得深圳证券交易所同意（《终止上市通知书》深证上[2018]358号），浙商稳健份额、浙商进取份额于2018年8月13日终止上市。

## 二、基金份额的转换

2018年8月17日为本基金基金份额转换基准日，基金管理人在份额转换基准日进行本基金的份额转换。基金份额的转换主要分为以下二个步骤：

1、在份额转换基准日的日终，将浙商稳健份额、浙商进取份额按照转换当

日各自相应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（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份额的场内份额数取整计算（最小单位为1份），取整后的余额计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临基金资产净值减小的风险，对于持有份额数较少的浙商稳健份额、浙商进取份额持有人，将面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金财产的风险。

份额转换计算公式如下：

浙商稳健份额（或浙商进取份额）的转换比例 = 份额转换起始日浙商稳健份额（或浙商进取份额）的基金份额参考净值 / 份额转换起始日浙商沪深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

2、向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请，将浙商沪深300份额的场内份额变更登记为浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）的场内份额，将浙商沪深300份额的场外份额变更登记为浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）的场外份额。

3、转换完成后，基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则相应增加或减少。基金份额转换后，由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减少的风险。

### 三、基金合同的修订与生效

2018年8月20日起，本基金将不再设置基金份额的分级，并正式变更为浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）。自2018年8月20日起《浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》《浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》《浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》生效，原《浙商沪深300分级证券投资基金基金合同》《浙商沪深300分级证券投资基金托管协议》《浙商沪深300分级证券投资基金招募说明书》将自同一起失效。。基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》为准。

#### **四、转型期间及转型完成后的业务安排**

1、浙商稳健份额、浙商进取份额已于 2018 年 8 月 13 日终止上市，投资人已无法进行基金交易，也无法办理基金份额的拆分及合并。

2、基金份额转换基准日（即 2018 年 8 月 17 日）起暂停办理本基金申购、赎回、定期定额投资、系统内转托管和跨系统转登记和份额配对转换业务，基金份额转换基准日当日完成基金份额的转换。

3、基金份额转换基准日后的第一个工作日（即 2018 年 8 月 20 日）《浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，基金份额转换基准日后的第二个工作日（即 2018 年 8 月 21 日），开始办理浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）的申购、赎回、定期定额投资等业务。届时不在单独发布相关公告。

#### **五、其他重要提示**

1、转型后，浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）为股票型指数基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，且不再设置风险收益特征不同的两类子份额。

2、在基金份额的转换过程中，由于基金份额数取整或截位计算产生的误差，基金份额持有人将面临基金资产净值减小的风险，其中对于持有份额数较少的浙商稳健份额、浙商进取份额持有人，将面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金财产的风险。

3、如有疑问，请拨打客户服务热线 400-067-9908（免长途话费）或 021-60359000 咨询相关信息或登录本公司网站 [www.zsfund.com](http://www.zsfund.com) 获取相关信息。

特此公告。

浙商基金管理有限公司

2018 年 8 月 14 日