

# 浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2019 年第 1 期) (摘要)

浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由浙商沪深300指数分级证券投资基金转型而成，本基金的基金合同自2018年8月20日起生效。

## 重要提示

本基金由浙商沪深300指数分级证券投资基金经中国证监会2017年9月4日证监许可【2017】1618号文批准变更注册而来。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会变更注册，但中国证监会对浙商沪深300指数分级证券投资基金转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，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。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响的市场风险，因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的利率风险，因债券和票据发行主体信用状况恶化而可能产生的到期不能兑付的信用风险，因基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，因投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，因本基金投资的证券交易市场数据传输延迟等因素影响业务处理流程造成赎回款顺延划出的风险等。本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券，中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。

投资有风险，投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险，谨慎做出投资决策。投资者应当根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩亦不构成对本基金业绩表现的保证。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。

投资者应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构申购和赎回基金，基金销售机构名单详见本招募说明书以及相关公告。

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2019年2月20日，投资组合报告为2018年4季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2018年12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兼执行董事、民生人寿保险股份有限公司副董事长、万向信托股份公司董事长、民生通惠资产管理有限公司董事长、通联数据股份公司董事长、浙江股权交易中心独立董事、上海万向区块链股份公司董事长兼总经理。

邓宏光先生，董事，1971 年生，中共党员，复旦大学国际经营管理专业硕士。历任中国石油集团华东管道设计研究院石化设备设计师、中国石化集团石化设备设计师、兴业证券研究发展中心行业研究员、天同星投资顾问有限公司研究发展部经理、天同证券有限责任公司研究所所长助理、东方证券研究所副所长，现任浙商证券总裁助理兼研究所所长。

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；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，博时基金管理有限公司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，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。

聂挺进先生，董事，1979年生，南开大学世界经济系硕士，历任博时基金管理有限公司基金经理、投资总监；浙商基金管理有限公司总经理助理、副总经理。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。

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；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。现任中国政法大学商学院院长、资本金融研究院院长、二级教授、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；国务院国有资产监督管理委员会法律顾问。

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监事长、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。

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、通联资本管理有限公司执行董事。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处工作。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

聂挺进先生，总经理，1979年生，简历同上。

唐生林先生，副总经理，1980年生，北京邮电大学计算机科学与技术学士。曾任深圳市脉山龙信息技术有限公司集成部系统工程师、博时基金管理有限公司信息技术部系统运维主管、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司信息技术部总监。

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、博士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智能投资部总经理，浙商沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、浙商丰利增强债券型证券投资基

金、浙商聚潮灵活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。

叶予璋先生，投资决策委员会委员，1979年生，复旦大学数学金融硕士。历任兴业银行资金营运中心外汇交易员、利率互换交易员、跨产品自营交易员、债券自营交易员、汇率利率及债券交易处副处长（主持工作）。现任浙商基金管理有限公司总经理助理兼固定收益部总经理。

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。现任浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金基金经理。

倪权生先生，投资决策委员会委员，1983年生，上海交通大学金融学博士。历任博时基金管理有限公司研究部研究员、高级研究员。现任浙商基金管理有限公司股票投资部副总经理（主持工作），浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、浙商全景消费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。

王峥先生，投资决策委员会委员，1983年生，历任华宝兴业基金管理公司海外投资部投资助理，交易部交易员、高级交易员、交易主管，上海国富投资管理有限公司交易主管。现任浙商基金管理有限公司中央交易室总经理。

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、依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；
- 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、按照规定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、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

#### **（四）基金管理人的承诺**

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (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) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄漏因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

3、本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、规章、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)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；

(9)贬损同行，以抬高自己；

(10)以不正当手段谋求业务发展；

(11)有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(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)侵占、挪用基金财产；

(14)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(15)其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、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及其代理人、受雇人或任何第三人牟取利益；

(3)不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定；不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；

(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。

### **(五) 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：15,387,223,983 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：郑鹏

电话：（010）85238667

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、风险与合规管理室和运营室 4 个职能处室。资产托管部共有员工 40 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 2018 年末，托管证券投资基金、券商资产管理计划、银行理财、保险资管计划、资产支持专项计划、股权投资基金等各类产品合计 4686 只，全行资产托管规模达到 28381.75 亿元。

# 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：周国丽

#### （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：李民吉

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：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 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：周嫵旻

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) 众升财富(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）北京钱景基金销售有限公司

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

(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

(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

(55) 上海通华财富资产管理有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

法定代表人：兰奇

客服电话：400-66-95156

公司网址：www.tonghuafund.com

(56) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服电话：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

(57) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

客服电话：4000-618-518

公司网址：www.danjuanapp.com

(58) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

法定代表人：江卉

客服电话：95118

公司网址：jr.jd.com

(59) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：杨明生

客服电话：400-643-3389

公司网址：www.vstonewealth.com

(60) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：拉萨市北京中路 101 号

法定代表人：陈宏

客服电话：95357

公司网址：www.18.cn

## (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

注册地址：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：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

## (四) 审计基金财产的会计师事务所

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：上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼

法定代表人：邹俊

电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：王国蓓

经办注册会计师：王国蓓、叶凯韵

#### 四、 基金的名称

浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

#### 五、 基金的类型

契约型开放式

#### 六、 基金的投资目标

本基金为沪深 300 指数增强型基金，在对沪深 300 指数严格跟踪的基础上，通过量化投资方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益和基金资产的长期稳定投资回报。

#### 七、 基金的投资范围

本基金主要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（包括国债、央行票据、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、次级债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、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。

本基金可参与融资及转融通证券出借交易业务。

本基金投资于股票的资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货、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。

## 八、 基金的投资策略

本基金在按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合的基础上，采用量化模型对成份股的权重进行相应调整，力求在控制与业绩比较基准之间偏离度的前提下获得超越标的指数的投资收益。本基金的风险控制目标为保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。

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

本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 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

本基金在沪深 300 指数成份股的基准权重基础上，采用量化模型构建指数增强股票投资组合，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，按照量化模型优化后的沪深 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 指数成份股及其量化模型优化后的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，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

本基金所构建的优化后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。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成份股权重的优化、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、可转换债券投资策略

本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等，这类债券赋予债权人或债务人某种期权，比普通的债券更为灵活。本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察，分析资产支持证券底层资产信用状况变化，并预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响情况，评估其内在价值进行投资。

#### 7、中小企业私募债投资策略

与传统信用债券相比，一方面，中小企业私募债由于以非公开方式发行和交易，并且限制投资人数量上限，整体流动性相对较差；另一方面，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差影响，整体的信用风险相对较高。

鉴于中小企业私募债的弱流动性和高风险性，本基金将运用基本面研究，结合财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等因素的基础上，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。

#### 8、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基金投资其他金融衍生品，本基金可将其纳入投资范围，并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。

#### 9、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

### 九、 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%

### 十、 基金的风险收益特征

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，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。

### 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 2018 年 10 月 1 日起至 12 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	51,472,658.41	92.39
	其中：股票	51,472,658.41	92.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,002,151.60	5.39
	其中：债券	3,002,151.60	5.39
	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	-	-
	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	1,100,605.29	1.98
8	其他资产	137,898.98	0.25
9	合计	55,713,314.28	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	247,250.00	0.45
B	采矿业	2,145,663.96	3.88
C	制造业	18,779,406.73	34.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,891,381.88	3.42
E	建筑业	1,886,514.00	3.42
F	批发和零售业	156,636.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	1,765,029.00	3.20
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,399,602.32	4.34
J	金融业	18,707,639.27	33.87
K	房地产业	2,910,027.00	5.27
L	租赁和商务服务业	343,140.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	57,645.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	51,289,935.16	92.85

(2) 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	69,846.39	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	112,876.86	0.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	182,723.25	0.33

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	68,228	3,827,590.80	6.93
2	600036	招商银行	108,294	2,729,008.80	4.94
3	601166	兴业银行	131,949	1,971,318.06	3.57
4	600900	长江电力	112,826	1,791,676.88	3.24
5	600016	民生银行	302,985	1,736,104.05	3.14
6	601006	大秦铁路	204,882	1,686,178.86	3.05
7	600660	福耀玻璃	73,657	1,677,906.46	3.04
8	601211	国泰君安	104,636	1,603,023.52	2.90
9	300408	三环集团	93,900	1,588,788.00	2.88
10	000651	格力电器	44,380	1,583,922.20	2.87

(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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000540	中天金融	23,178	112,876.86	0.20
2	600485	信威集团	4,721	68,879.39	0.12
3	002648	卫星石化	100	967.00	0.00

#### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,002,151.60	5.43
	其中：政策性金融债	3,002,151.60	5.43
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	3,002,151.60	5.43

#### 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	018005	国开 1701	29,890	3,002,151.60	5.43

#### 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	50,831.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	83,953.96
5	应收申购款	3,113.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	137,898.98

(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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000540	中天金融	112,876.86	0.20	临时停牌
2	600485	信威集团	68,879.39	0.12	临时停牌
3	002648	卫星石化	967.00	0.00	临时停牌

(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

本基金由浙商沪深 300 指数分级证券投资基金转型而来，本基金基金合同生效日为 2018 年 8 月 20 日，转型前和转型后的基金业绩分别列示：

#### 1) 转型前

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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
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. 12. 31	-10.43%	1.35%	-10.61%	1.33%	0.18%	0.02%
2017. 1. 1-2017. 12. 31	25.31%	0.55%	20.65%	0.61%	4.66%	-0.06%
2018. 1. 1-2018. 6. 30	-12.54%	0.99%	-12.24%	1.10%	-0.30%	-0.11%
2018. 7. 1-2018. 8. 19	-6.72%	1.21%	-7.61%	1.38%	0.89%	-0.17%

#### 2) 转型后

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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018. 8. 20-2018. 9. 30	5.40%	1.07%	6.16%	1.14%	-0.76%	-0.07%
2018. 10. 1-2018. 12. 31	-15.13%	1.51%	-11.83%	1.56%	-3.30%	-0.05%

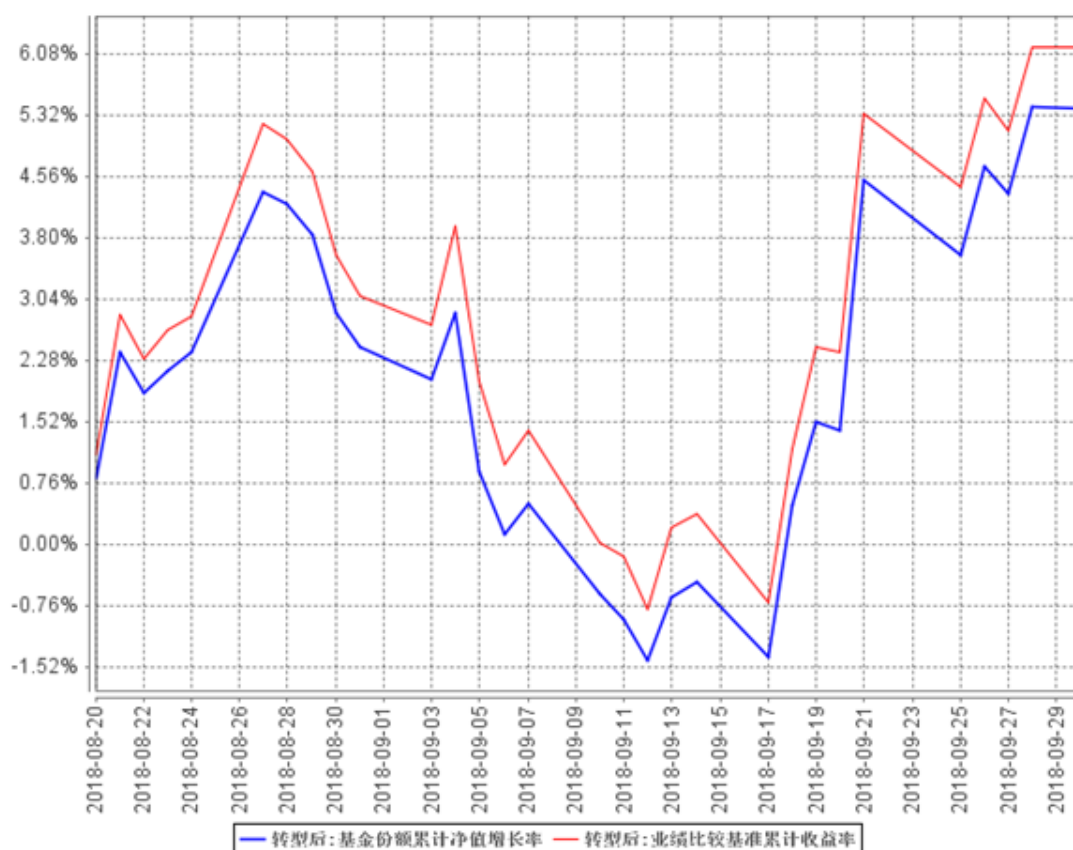
注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使

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

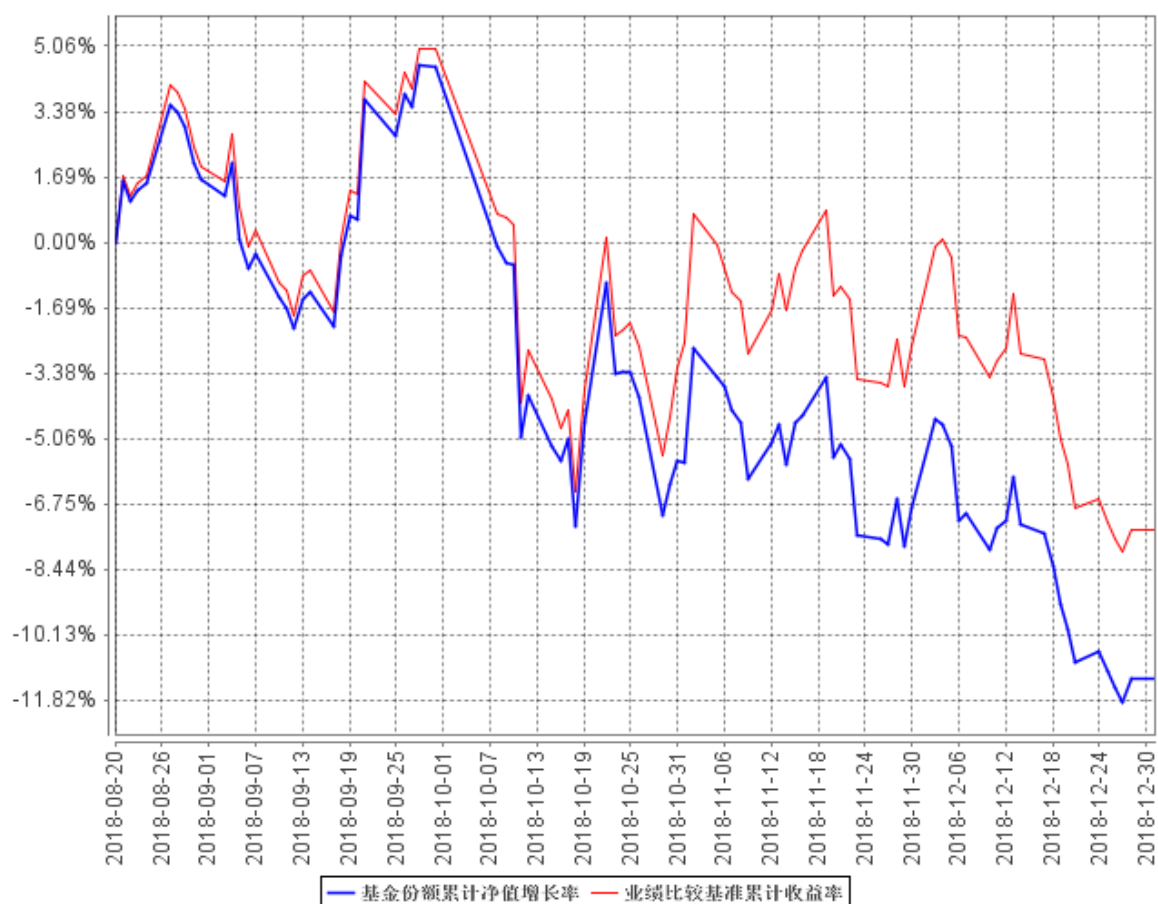
### 1) 转型前

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



### 2) 转型后

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、本基金由浙商沪深 300 指数分级证券投资基金转型而来，本基金基金合同生效日为 2018 年 8 月 20 日，截至本报告期末，本基金转型未满一年。

2、本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例应符合基金合同约定。

### 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、期货交易费用；

9、账户开户费用、维护费用；

10、基金上市初费和上市月费；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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取，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### （四）不列入基金费用的项目

1、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；

2、处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、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；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （五）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《浙商沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）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“一、绪言”部分。
- 3、 根据最新资料，更新了“二、释义”部分。
- 4、 根据最新资料，更新了“三、基金管理人”部分。
- 5、 根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。
- 6、 根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。
- 7、 根据最新资料，更新了“十一、基金的投资”部分。
- 8、 根据最新资料，更新了“二十二、其他应披露事项”部分。