浙商沪深300指数分级证券投资基金更新招募说明书（摘要）

（2012年第1期）

本基金的募集申请经中国证监会证监许可【2012】91号予以核准。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。投资者风险，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。

基金管理人依照格尽职守、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本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，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2012年11月7日，投资组合报告为2012年3季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2012年9月30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1号楼D区6层606室

法定代表人：高玮

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：鲍芸

联系电话：0571-28191825

（二）主要人员情况

1、董事会成员

高玮女士，董事长，1968年生，浙江大学数学系博士，高级工程师。历任财通证券经纪有限责任公司电脑中心副经理、市场管理总部经理、稽核部经理、职工监事。现任浙商证券股份有限公司合规总监；浙商期货有限公司董事；浙江浙商资本管理有限公司董事。

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。历任浙江省检察院副检察长；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。现任浙商证券股份有限公司顾问。

陈昌志先生，董事，1966年生，浙江大学管理工程专业工学硕士。历任金信信托投资股份有限公司理财部经理助理、研究发展部副经理；通和投资控股有限公司投资管理部副总经理、总经理，公司董事会秘书、总裁助理。现任网新科技股份有限公司总裁助理，浙江浙大网新集团投资总监。

钟晓胰先生，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。

管大源先生，董事，1963年生，研究生，高级经济师。历任杭州万向节总厂统计员、计划员、科员；万向集团公司总经理助理；万向钱潮股份有限公司董秘；万向集团公司副总裁；天和证券总裁。现任万向集团公司副总裁兼通联资本管理有限公司总裁。

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）股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。现任浙商基金管理有限公司总经理兼投资决策委员会主席。

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；上海市锦天城律师事务所高级合伙人。

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；中信国际研究所经济研究室主任；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。现任中国政法大学资本研究中心主任、教授、博士生导师；财政部财政科学研究所硕士生导师。

金雪军先生，独立董事，1958年生，南开大学经济学硕士。历任浙江大学金融系主任、经济学院副院长、证券与期货研究所所长，中国金融学会常务理事等；兼任浙江省国际金融学会会长，享受国务院政府特殊津贴，获浙江省有突出贡献中青年专家称号。现任浙江大学经济学院教授、博士生导师；浙江大学江万鲁金融投资研究中心主任；浙江省公共政策研究院执行院长，浙江省国际金融学会会长。

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主任科员；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；浙江中泰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。现任养生堂有限公司总经济师、农夫山泉股份有限公司监事。

赵琦女士，监事，1971年生，大学本科，注册会计师。曾在万向集团结算中心、万向财务公司工作。现任通联资本管理有限公司副总裁。

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监。

3、公司高管人员

周一烽先生，总经理，简历同上。

杜焰君先生，副总经理，1972年生，上海财经大学经济学博士，复旦大学应用经济学博士后，美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院EMBA，曾就职于中国证券登记结算公司上海分公司，后历任中泰信托投资有限责任公司研究发展部副总经理、信托管理中心总经理；上海证券有限责任公司创新产品总部总经理；海证期货有限公司法定代表人、总经理。

王茂根先生，副总经理，1962年出生，中山大学经济学学士，高级经济师。历任杭州市经济研究中心、杭州市体改办、杭州市证券委办公室研究人员、副主任科员、主任科员；浙江证监局上市公司监管处助理调研员，机构监管处副处长、处长，信息调研处处长；浙商基金管理有限公司总经理助理。

闻震雷先生，督察长，1975年生，中国人民大学本科学历，会计师。历任方正证券有限责任公司清算中心主任、苏州中辰期货经纪有限公司财务部总监、浙商证券股份有限公司合规审计部合规主管。

4、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。

5、投资决策委员会成员

周一烽先生，投资决策委员会主席，简历同上。

陈志龙先生，投资决策委员会委员，执行主任，1976年生，北京航空航天大学管理信息系统学士，英国约克大学经济与金融硕士，英国雷丁大学金融工程与数量分析硕士，特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM）。历任中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员、经理；中银基金管理有限公司研究员；基金经理、基金投资管理部副总经理、投资决策委员会成员、副总裁；专户理财部投资总监。现任浙商基金管理有限公司总经理助理、投资管理部总监、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金基金经理。

姜培正先生，投资决策委员会委员，1975年生，华东师范大学政治经济学硕士，英国华威大学经济和金融理学硕士。历任平安证券有限责任公司综合研究所研究员；国联安基金管理有限公司研究部研究员；浙商基金管理有限公司投资管理部研究员、研究主管。现任浙商基金管理有限公司投资管理部副总监兼研究总监、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金基金经理。

关永祥先生，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；

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劝助、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、合规性进行检查、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：吴建

组织形式：股份有限公司

注册资本：6,849,725,776元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行【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

联系电话：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。资产托管部共有员工32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2012年6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型证券投资基金、诺德双翼分级债券型证券投资基金、浙商沪深300指数分级证券投资基金及其它受托资产产品，托管各类资产规模3951.68亿元。

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

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1号楼D区6层606室

电话：0571-28191853

传真：0571-28191836

联系人：韩吟吟

2）浙商基金管理有限公司上海分公司直销中心

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：021-60350852

传真：021-60350919

联系人：张伊婷

3）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

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：郑鹏

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：项俊波

联系电话：

传真：010-85109219

联系人：滕涛

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：胡怀邦

联系电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：陈铭铭

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）厦门银行股份有限公司

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：毛燕海

客服电话：95527

公司网址：http://www.ezbank.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：徐浩明

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）华安证券有限责任公司

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）招达证券股份有限公司

住所：北京市西城区阜市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区阜市口大街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：021-63258888

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：丙敏琪

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.mszq.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）招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：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

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）申银万国证券股份有限公司

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或4008895523

公司网址：http://www.swyg.com

20）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

法定代表人：朱科敏

客服电话：400-888-8588

公司网址：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）新商证券股份有限公司

住所：杭州市杭大路9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：青岛市崂山区香岭路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：张智河

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：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

联系电话：0571-87112510

联系人：丁思聪

客服电话：0571-96598

公司网址：http://www.bigsun.com.cn

27）财富证券有限责任公司

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）齐鲁证券有限公司

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：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层邮编：100140

法定代表人：林义相

联系电话：010-66045608

传真：010-66045500

联系人：林爽

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.jjfund.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：浦东新区高翔路526号

办公地址：上海市浦东新区裕景国际B座16楼

法定代表人：张跃伟

联系电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

联系人：沈雯斌

客服电话：4000891289

公司网址：http://www.erichfund.com

38）上海天天基金销售有限公司

住所：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）杭州数米基金销售有限公司

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：周嫣旻

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：上海市虹口区砂金路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

（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、钱晓英

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%。为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标，本基金将注重仓位管理，积极防范由于申购、赎回等因素产生的跟踪误差。

2、股票投资策略

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

①股票投资组合的构建

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

②股票投资组合的调整

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

③ 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。

④ 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