浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金说明书（更新）（摘要）

（2020年第1次重大信息临时更新）

基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司

一、基金合同的生效日期

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）由浙江浙商证券资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会于2015年10月9日下发的证监许可【2015】2247号文《关于准予浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金注册的批复》准予注册，并经中国证监会证券基金机构监管部于2016年11月8日下发的证监许可[2016] 2726号文《关于浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金延期募集备案的回函》准予延期募集。本基金的基金合同自2016年12月19日正式生效。

二、重要提示

基金管理人保证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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为股票指数型基金，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。本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、股指期货投资风险、管理风险、操作风险、技术风险和不可抗力风险等等。投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并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，由投资者自行负担。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的情形导致达到或超过50%的除外。

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认/申购和赎回基金，基金销售机构名单详见本招募说明书。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。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。

本招募说明书中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。本次更新招募说明书主要更新“基金管理人”中有关基金经理的部分内容，截止日为2020年1月21日；其他内容截止日为2019年9月30日，其中有关财务数据截止日为2019年9月30日（本招募说明书中的财务数据未经审计）。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：浙江浙商证券资产管理有限公司

住所：浙江省杭州市下城区天水巷25号

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼7层

法定代表人：盛建龙

设立日期：2013年4月18日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2012]1431号

公开募集基金管理业务资格批文及文号：中国证监会证监许可[2014]857号

联系电话：（0571）87903351

联系人：傅旭菁

（二）注册资本和股权结构

1、注册资本：12亿元人民币

2、股权结构

股东名称	持股占总股本比例
浙商证券股份有限公司	100%

（三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

（1）董事会

盛建龙先生，董事长，硕士，中国注册会计师（非执业会员），高级会计师。1994年8月至2000年2月在杭州市民防局从事财务管理工作；2000年3月至2006年6月历任沪杭甬计划财务部经理助理、内审部副主任、主任；2006年7月起任浙商证券总裁助理兼计划财务部总经理，2009年1月起任浙商证券财务总监，2014年12月6日至2015年4月2日任浙江浙商证券资产管理有限公司合规风控总监。现任浙江浙商证券资产管理有限公司董事长兼总经理，浙商证券股份有限公司财务总监，浙商期货有限公司董事。

王青山先生，董事，硕士。曾任浙江省交通投资集团财务有限公司副总经理、总经理，浙江沪杭甬高速公路股份有限公司党委委员兼浙商证券党委书记，浙商证券监事会主席。现任浙江沪杭甬高速公路股份有限公司党委委员，浙商证券股份有限公司董事、总裁及党委委员，浙江浙商证券资产管理有限公司董事，浙商期货有限公司董事，浙江浙商创新资本管理公司董事长。

赵伟江先生，董事，硕士。1986年7月至1997年7月为杭州金融管理干部学院教师；1997年10月至2006年6月为金通证券股份有限公司信息技术部负责人；2006年7月历任浙商证券技术总监、监事长。现任浙商证券股份有限公司副总裁，浙江浙商证券资产管理有限公司董事，浙商期货有限公司董事。

高玮女士，董事，博士。1996年6月至2006年6月任财通证券经纪有限责任公司（原浙江财政证券公司）电脑中心副经理、市场管理总部经理、稽核部经理、职工监事。2006年7月起在浙商证券股份有限公司工作。现任浙商证券股份有限公司副总裁及首席风险官，浙江浙商证券资产管理有限公司董事，浙商期货有限公司副董事长。

楼小平先生，董事，硕士。历任申银万国证券嘉兴营业部总经理、申银万国证券宁波第二营业部总经理、申银万国证券杭州营业部总经理、中富证券公司总裁助理兼浙江业务总部总经理、浙商证券创新业务总部总经理、运保中心总经理，浙江浙商证券资产管理有限公司私募投行总部总经理。现任浙江浙商证券资产管理有限公司董事、董事会秘书、常务副总经理。

（2）监事

许向军先生，监事，本科。1998年至2000年在浙江联创软件有限公司任助理工程师；2000年至2002年在浙江省工商信托投资股份有限公司任职；2002年至2010年在浙江省证监局任科员、科长、副处长；2010年起任浙商证券股份有限公司信息技术总监。现任浙商证券股份有限公司合规总监，浙江浙商证券资产管理有限公司监事。

（3）高级管理人员

盛建龙，总经理（兼），董事长，简历参见上述董事会成员基本情况。

楼小平，常务副总经理、董事会秘书（兼）。简历参见上述董事会成员基本情况。

方斌，合规总监，首席风险官（兼），硕士。2002年7月至2006年4月曾任职于浙江天健会计师事务所；2006年4月至2015年9月在中国证监会浙江监管局机构监管处、上市监管处任职；2015年10月至2017年7月曾任中融基金管理有限公司总经理助理；2017年7月起担任浙江浙商证券资产管理有限公司合规风控副总监；自2017年11月起任浙江浙商证券资产管理有限公司合规风控总监，2018年7月起任浙江浙商证券资产管理有限公司合规总监、首席风险官（兼）。

2、本基金基金经理

周涛，中国国籍，硕士，曾任国金证券研究所首席行业分析师、齐鲁证券研究所所长、浙商证券证券投资部总经理、浙商资本副总经理。2017年加入浙江浙商证券资产管理有限公司，现任总经理助理、浙商汇金转型成长混合型基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型基金、浙商汇金中证转型成长指数型基金的基金经理。

陈顾君，伊利诺伊大学香槟分校金融工程硕士，CFA，FRM。历任上海海通证券资产管理有限公司量化研究员，浙江浙商证券资产管理有限公司量化研究员、基金经理助理。

本基金历任基金经理：自2016年12月19日止2019年4月10日，宫幼林曾任本基金的基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度，公募基金投资执行委员会分为权益公募投资执行委员会和固定收益公募投资执行委员会，具体如下：

权益公募投资执行委员会：主任由总经理助理周涛先生担任，委员包括：总经理助理余春梅女士、合规风控部负责人闻震宙先生、基金经理马斌博、周文超先生；

固定收益公募投资执行委员会：主任由总经理助理周涛先生担任，委员包括：总经理助理陈国辉先生、总经理助理余春梅女士、合规风控部负责人闻震宙先生、姜金香女士。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街25 号、甲25 号中国光大中心

成立日期：1992年6月18日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095亿元人民币

法定代表人：李晓鹏

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75号

投资与托管业务部总经理：张博

电话：（010） 63636363

传真：（010） 63639132

网址：www.cebbank.com

（二）投资与托管业务部部门及主要人员情况

法定代表人李晓鹏先生，曾任中国工商银行河南省分行党组成员、副行长，中国工商银行总行营业部总经理，中国工商银行四川省分行党委书记、行长，中国华融资产管理公司党委委员、副总裁，中国工商银行党委委员、行长助理兼北京市分行行长，中国工商银行党委委员、副行长，中国工商银行股份有限公司党委委员、副行长、执行董事；中国投资有限责任公司党委副书记、监事长；招商局集团副董事长、总经理、党委副书记。曾兼任工银国际控股有限公司董事长、工银金融租赁有限公司董事长、工银瑞信基金管理公司董事长，招商银行股份有限公司副董事长、招商局能源运输股份有限公司董事长、招商局港口控股有限公司董事会主席，招商局华建公路投资有限公司董事长、招商局资本投资有限责任公司董事长、招商局联合发展有限公司董事长、招商局投资发展有限公司董事长等职务。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长，兼任中国光大银行股份有限公司党委书记、董事长，中国光大集团有限公司董事长，中国旅游协会副会长、中国城市金融学会副会长、中国农村金融学会副会长。武汉大学金融学博士研究生，经济学博士，高级经济师。

张博先生，曾任中国光大银行厦门分行副行长，西安分行行长，乌鲁木齐分行筹备组组长、分行行长，青岛分行行长，光大消费金融公司筹备组组长。曾兼任中国光大银行电子银行部副总经理（总经理级），负责普惠贷款团队业务。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

（三）证券投资基金托管情况

截至2019年9月30日，中国光大银行股份有限公司托管华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金等共160只证券投资基金，托管基金资产规模3389.81亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

（四）托管业务的内部控制制度

1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

（2）预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

（3）及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

（4）独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。投资与托管业务部建立了严密的内控督察体系，设立了投资监督与内控管理处，负责证券投资基金托管业务的风险管理。

4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行投资与托管业务部保密规定》等十余项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行投资与托管业务部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、监督稽核）还建立了安全保密区，安装了录像监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以书面或电话形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）浙江浙商证券资产管理有限公司直销柜台

住所：杭州市下城区天水巷 25 号

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 7 楼

法定代表人：盛建龙

联系人：芦银洁

联系电话：（0571）87901920

传真：（0571）87902581

网址：www.stocke.com.cn

客服电话：95345

（2）浙江浙商证券资产管理有限公司直销网上交易平台

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 7 楼

联系人：芦银洁

联系电话：（0571）87901920

传真：（0571）87902581

网址：https://fund.stocke.com.cn/etrading/

2、销售机构

（1）浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼

法定代表人：吴承根

联系人：高扬

联系电话：（0571）87901963

传真：（0571）87901955

网址：www.stocke.com.cn

（2）中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

联系人：张谓

客户服务热线：95595

网址：www.cebbank.com

（3）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：陈四清

联系人：李慧

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（4）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层

办公地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

客户服务热线：953309

网址：www.dwzq.com.cn

（5）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦16-20 层

办公地址：深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦16-20 层

法定代表人：詹露阳

联系人：周驰

客户服务热线：95511-8

网址：stock.pingan.com

（6）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

联系人：杜晶

客户服务热线：95310

网址：www.gjzq.com.cn

（7）深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层IJ单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：龚江江

客户服务热线：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

（8）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：董一锋

客户服务热线：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

（9）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3号楼C座9楼

法定代表人：其实

联系人：段颖

客户服务热线：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

（10）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：王之光

联系人：朴美玲

客户服务热线：4008219031

网址:www.lufunds.com

（11）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

联系人：陈孜明

客服电话：400-067-6266

网址：www.leadfund.com.cn

（12）贵州华阳众惠基金销售有限公司

注册地址：贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区C栋标准厂房

办公地址：贵州省贵阳市云岩区北京路9 号贵州医科大学学术交流中心 16楼

法定代表人：李陆军

联系人：许木根

客户服务热线：4008391818

网址：www.hyzhfund.com

（13）上海朝阳永续基金销售有限公司

注册地址：浦东新区上丰路977号1幢B座812室

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

联系人：郑秋月

客户服务热线：400-699-1888

网址：www.998fund.com

（14）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：谢俐

客户服务热线：400-0411-001

网址：www.taichengcaifu.com

（15）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层，200127

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层，200127

法定代表人：戴新装

联系人：王宁

客户服务热线：4008201515

网址：www.zhengtongfunds.com

（16）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1 号

法定代表人：刘汉青

联系人：钟宇龙

客户服务热线：95177

网址：www.snjijin.com

（17）上海联泰基金销售有限公司

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：上海长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

客户服务热线：400-166-6788

网址：www.66zichan.com

（18）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

客户服务热线：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（19）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

联系人：李关洲

客户服务热线：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

（20）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66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市海淀区中关村66号1号楼22层2603-06

法定代表人：江卉

联系人：张华阳

客户服务热线：400-088-8816/400-098-8511

公司网址：fund.jd.com

（21）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：胡燕亮

联系人：孙琦

客户服务热线：021-50810673

公司网址：www.wacaijijin.com

也可通过APP挖财宝查询相关产品

（22）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

客户服务热线：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（23）上海好买基金销售有限公司

注册地址：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

联系人：高源

客户服务热线：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

（24）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室

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：张晶

联系人：甄宝林

客户服务热线：400-820-2819

网址：www.chinapnr.com

（25）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：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层2302室

法定代表人：梁越

联系人：高承在

客户服务热线：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

（26）奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

客户服务热线：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（27）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号A座1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号A座

法定代表人：王伟刚

联系人：王骁骁

客户服务热线：400-619-9059

公司网址：www.hcjijin.com

（28）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

客户服务热线：4008-888-108

公司网址：www.csc108.com

（29）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

客户服务热线：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（30）扬州国信嘉利基金销售有限公司

注册地址：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地3期20B栋

办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路56号公元国际大厦320

法定代表人：刘晓光

联系人：陈莉娜

客户服务热线：400-021-6088

公司网址：www.gxjlcn.com

（二）登记机构

名称：浙江浙商证券资产管理有限公司

住所：浙江省杭州市下城区天水巷25号

法定代表人：盛建龙

电话：0571-87901972

传真：0571-87902581

联系人：俞绍锋

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：浙江天册律师事务所

住所：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座11楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座11楼、8楼

负责人：章靖忠

电话：（0571）87901111

传真：（0571）87901501

联系人：俞晓瑜

经办律师：刘斌、俞晓瑜

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市西城区裕民路18号北环中心22层

办公地址：北京市西城区裕民路18号北环中心22层

执行事务合伙人：陈胜华

电话：（010）82250666

联系人：张庆栾

经办会计师：张庆栾、李鑫

六、基金的名称

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金

七、基金的类型

股票型证券投资基金

八、基金的投资目标

本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.50%，年跟踪误差不超过6%，实现对中证转型成长指数的有效跟踪。

九、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证转型成长指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适 当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例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， 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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履 行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

十、基金的投资策略

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证转型成长指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证转型成长 指数中的基准权重构建指数化投资组合。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例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，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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

十一、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

95%×中证转型成长指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)

十二、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十三、基金的投资组合报告

以下投资组合报告数据截至2019年9月30日。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	33,770,159.09	92.35
	其中：股票	33,770,159.09	92.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,681,829.12	7.33
8	其他资产	114,890.46	0.31
9	合计	36,566,878.67	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例（%）
A	农、林、牧、渔业	700,410.00	1.95
B	采矿业	1,517,535.00	4.22
C	制造业	14,410,168.95	40.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	785,338.00	2.18
E	建筑业	1,529,808.00	4.25
F	批发和零售业	779,524.00	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,541,471.00	4.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	741,598.00	2.06
J	金融业	2,984,323.40	8.30
K	房地产业	6,325,580.00	17.59
L	租赁和商务服务业	383,130.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	776,253.00	2.16
N	水利、环境和公共设施管理业	1,220,253.00	3.39
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	33,695,392.35	93.71

2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	33,721.30	0.09
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	41,045.44	0.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	74,766.74	0.20

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金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

3.1 报告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

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	002487	大金重工	90,500	495,035.00	1.38
2	300214	日科化学	54,000	451,980.00	1.26
3	300703	创源文化	39,225	431,867.25	1.20
4	300586	美联新材	31,100	424,826.00	1.18
5	002034	旺能环境	26,100	424,386.00	1.18
6	601009	南京银行	49,000	420,910.00	1.17
7	603519	立霸股份	26,200	420,772.00	1.17
8	600223	鲁商发展	115,300	418,539.00	1.16
9	300587	天铁股份	34,400	415,208.00	1.15
10	300517	海波重科	27,600	414,828.00	1.15

3.2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	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	603927	中科软	464	41,045.44	0.11
2	300790	宇瞳光学	448	20,760.32	0.06
3	603786	科博达	482	12,960.98	0.04

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 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序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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末参与股指期货交易。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末参与国债期货交易。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券中陕国投A于2019年9月26日因未及时披露公司重大事项受到陕西银保监局处罚28万元人民币。

本基金投资上述股票的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定，本基金为被动跟踪指数的基金，所跟踪的指数每月调整一次持仓。9月初调整持仓时，陕国投A尚未违规，所以入选了股票池。10月初调整持仓时已将陕国投A剔除。

11.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,221.01
2	应收证券清算款	66,080.87
3	应收股利	-
4	应收利息	588.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	114,890.46

11.4 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债。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

11.5.2 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	流通受限部分公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603786	科博达	12,960.98	0.04	新股申购

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十四、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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

以下基金业绩数据截至2019年9月30日。

1、基金净值表现

1.1、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

（1）浙商汇金中证转型成长指数型

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
2016年12月19日（基金合同生效日）至2016年12月31日	0.10%	0.03%	1.06%	0.51%	-0.96%	-0.48%
2017年1月1日至2017年12月31日	1.20%	0.87%	-3.08%	1.01%	4.28%	-0.14%
2018年1月1日至2018年12月31日	-35.64%	1.43%	-33.73%	1.52%	-1.91%	-0.09%
2019年1月1日至2019年9月30日	23.47%	1.39%	25.01%	1.47%	1.54%	0.08%
2016年12月19日（基金合同生效日）至2019年9月30日	-19.5%	1.24%	-18.8%	1.34%	0.7%	0.1%

注：本基金的业绩比较基准：本基金业绩比较基准为：95%×中证转型成长指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

1.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率