

# 浙商沪深300指数分级证券投资基金 [2013]第四季度报告

基金管理人:浙商基金管理有限公司  
基金托管人:华泰银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年01月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理人保证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。

基金托管人及其高级管理人员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。

基金财产的运作遵循基金合同的规定，由基金管理人管理，基金托管人托管，由基金管理人和基金托管人共同对基金财产的运作承担责任。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财会资料经审计。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

本基金简称:浙商沪深300指数分级(场内简称:浙商300)

基金主代码:166802

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年05月07日

报告期末基金份额总额:106,039,526.76份

本基金采用量化指数化投资方式，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当的回报以及其他收益。

投资目标:本基金采用量化指数化投资方法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重重新构造指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动相应调整，力争目标跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%，年跟踪误差不超过2%。

投资策略:当预期成份股发生调整或新增时，增发、分红等行为时，本基金的申购赎回机制对本基金跟踪标的的效果可能产生影响，本基金将根据具体情况对申购机制，基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整和调整，并通过以指数化投资等金融衍生品投资管理，使本基金跟踪控制在限制的范围内。

业绩比较基准:沪深300指数收益率×95%+固定同业存款利率×5%

本基金为股票型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。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。从本基金所分属的两类基金份额来看，浙商稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征；浙商进取份额具有高风险、高预期收益的特征。

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

下属分级基金的基金简称:浙商稳健

浙商进取

报告期末下属分级基金的份额总额:11,822,650.00份

报告期末下属分级基金的份额净值:11,822,651.00份

报告期末下属分级基金的份额净值:82,394,224.76份

报告期末下属分级基金的份额净值:82,394,224.76份