万家上证380交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

基金管理人：万家基金管理有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
二〇一三年十月

【重要提示】

本基金经2013年7月31日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1047号文注册募集。

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备案，但并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品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，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险；基金份额二级市场交易价格折溢价的风险；基金的退市风险；投资人申购、赎回失败的风险以及基金份额赎回对价的变现风险等等。本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

投资人风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

一、绪言

《万家上证380交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”或“招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）和其他相关法律法规的规定以及《万家上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会备案。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指万家上证380交易型开放式指数证券投资基金
2、基金管理人：指万家基金管理有限公司
3、基金托管人：指华夏银行股份有限公司
4、基金合同、《基金合同》或本基金合同：指《万家上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《万家上证380交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书：指《万家上证380交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7、基金份额发售公告：指《万家上证380交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28第十一届全国人大常委会第30次会议修订，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10、《销售办法》：指2013年2月17日中国证监会监督管理委员会第28次主席办公会议修订通过、同年4月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
17、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
18、合格境外机构投资者：指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
19、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
21、基金销售机构：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
22、销售机构：指万家基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议、代为办理基金销售业务的机构
23、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
24、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
25、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月
26、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
27、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
28、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
29、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）
30、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
31、上交所（业务细则）：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》
32、交易型开放式指数基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”
33、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
34、《业务规则》：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布的其他相关规则和规定
35、登记结算机构：指中国证券登记结算有限责任公司
36、登记结算业务：指《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务
37、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
38、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
39、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为申购赎回清单所规定的赎回对价的行为
40、元：指人民币元
41、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
42、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值
43、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
44、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
45、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
46、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件
47、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件
48、申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
49、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
50、标的指数：指上海证券交易所编制并发布的上证380指数及其未来可能发生的变更，或基金管理人根据需要更换的其他指数
51、完全复制法：指一种构建跟踪指数的投资组合的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例，以达到复制指数的目的
52、最小申购赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资人申购或赎回的基金份额应为最小申购赎回单位的整数倍
53、现金替代：指申购或赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金
54、现金差额：指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资人申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算
55、预估现金部分：指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购或赎回的投资人的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额
56、指定交易：指《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中定义的“全面指定交易”
57、基金份额参考净值：上海证券交易所在交易时间内根据基金管理人提供的申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称IOPV
58、收益评价日：指基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数同期累计报酬率差额之基准日
59、基金累计报酬率：指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）
60、标的指数同期累计报酬率：指收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）
61、ETF联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：万家基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区浦电路360号8层（名义楼层9层）
办公地址：上海市浦东新区浦电路360号8层（名义楼层9层）
法定代表人：毕玉国
成立日期：2002年8月23日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【2002】44号
经营范围：基金募集；基金销售；资产管理和中国证监会许可的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：壹亿元
存续期限：持续经营
联系人：兰剑
电话：021-38619810　　传真：021-38619888
股权结构：

股东名称	所占股份
齐鲁证券有限公司	49%
新疆国际实业股份有限公司	40%
山东省国有资产投资控股有限公司	11%

万家基金管理有限公司于2002年8月23日正式成立，注册资本1亿元人民币。目前管理十五只开放式基金，分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选股票型证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券基金、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金、万家添利分级债券型证券投资基金、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金和万家强化收益定期开放债券型证券投资基金。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

董事长毕玉国先生，中共党员，研究生，高级会计师，曾任莱钢集团莱芜钢铁分公司炼铁厂厂长、莱钢集团莱钢股份公司财务处处长、莱钢集团财务部副部长、莱钢驻日照钢铁有限公司财务总监，齐鲁证券经纪有限公司计划财务部总经理。现任齐鲁证券有限公司副总经理兼财务负责人，兼任万家共赢资产管理有限公司董事长，2011年3月起任本公司董事长。

董事马永春先生，政治经济学硕士学位，曾任新疆自治区党委政策研究室科长、新疆通宝投资有限公司总经理、新疆对外经贸集团总经理、新疆天山股份有限公司董事，现任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。

董事吕祥友先生，中共党员，大学本科，硕士学位，高级经济师，曾任莱芜钢铁集团有限公司财务处科长、鲁银投资集团股份有限公司办公室主任兼董事会秘书、天同证券风险处置工作小组托管组成员、齐鲁证券有限公司人力资源部总经理、董事会秘书、党委组织部部长、人力资源部总经理、董事、鲁证期货有限公司董事，现任齐鲁证券有限公司董事会秘书、党委组织部部长、人力资源部总经理、鲁证期货有限公司董事。

董事吕宜振先生，中共党员，博士研究生。曾任易方达基金管理有限公司研究主管、信诚基金管理有限公司研究总监、天弘基金管理有限公司投资总监，2011年5月起加入本公司，曾任公司副总经理，2012年12月起任公司总经理。

独立董事刘兴云先生，中共党员，管理学博士，教授，曾任山东财政学院会计系副主任、党总支书记、教务长、副院长，中央人民政府驻香港特别行政区联络办公室行政财务部副部长、巡视员兼副部长，现任山东财经大学校长兼党委副书记，并从事企业财务管理方向的理论研究。

独立董事陈增毅先生，中国民主建国会成员，博士研究生，教授，曾任山东烟台十一中学教师，山东大学数学院讲师兼副教授，法国国家信息与自动化研究所博士后，加拿大西安大略大学保险系访问学者、兼职教授，山东大学金融研究院常务副院长兼教授，山东大学数学院副院长（兼），教授，现任山东大学金融研究院院长（兼数学院副院长），教授。

独立董事骆玉鼎先生，中共党员，研究生，经济学博士，副教授，曾任上海财经大学金融学院银行系讲师，上海财经大学证券期货学院院长助理，美国国际管理研究生院（雷鸟）访问研究员，上海财经大学证券期货学院副院长兼副教授，新疆财经学院金融系支教教师，上海财经大学金融学院副院长兼常务副院长，上海财经大学金融学院副教授，现任上海财经大学商学院副院长。

2、基金管理人监事会成员

监事会主席李润起先生，硕士学位，经济师。1996年1月起，任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行部项目经理，2012年3月起任新疆国际实业股份有限公司证券事务代表、董事会秘书，现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书兼副总经理。

监事崔朋朋先生，中共党员，工商管理硕士，经济师，先后任职于山东智星计算机总公司、中创软件、山东山大华特科技股份有限公司，将军控股有限公司。现任山东省国有资产投资控股有限公司项目经理、副部长。

监事兰剑先生，法学硕士，律师、注册会计师，曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作，现为本公司信息披露负责人、合规稽核部总监。

监事李丽女士，中共党员，硕士、中级讲师，先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起任职于万家基金管理有限公司，现任公司综合管理部副总监。

监事裴鹏鹏女士，本科，先后任职于北京华福之光商贸有限公司销售主管、北方之星数码技术（北京）有限公司高级客户经理、路通资讯香港有限公司北京代表处高级业务经理，2007年4月起任职于万家基金管理有限公司渠道客服部渠道经理、机构理财部总监助理。现任公司机构理财部副总监。

3、基金管理人高级管理人员

董事长：毕玉国先生（简介请参见基金管理人董事会成员）
总经理：吕宜振先生（简介请参见基金管理人董事会成员）
副总经理：扈志今先生，大学本科，学士学位。1997年至2004年任职于国泰君安证券从事证券营销管理工作；2004年至2005年任职于中银国际证券，任营业部副总经理；2005年至2009年任职于信诚基金管理有限公司，任直销部副总监等职；2009年至2011年任职于天弘基金管理有限公司，任机构理财部总经理兼上海分公司总经理。2011年加入本公司，任机构理财部总监、总经理助理，2013年4月起任公司副总经理。

副总经理：李杰先生，硕士研究生。1994年至2003年任职于国泰君安证券，从事行政管理、机构客户开发等工作；2003年至2007年任职于兴安证券，从事营销管理工作；2007年至2011年任职于齐鲁证券，任营业部高级经理、总经理等职。2011年加入本公司，曾任综合管理部总监、董事会秘书、总经理助理，2013年4月起任公司副总经理。

督察长：李振伟先生，中共党员，大学本科，学士学位，高级经济师。1998年6月起从事证券监管工作，先后任证监会济南证管办党委办公室、上市处主任科员，证监会济南证管办上市处、机构处副处长，证监会山东证监局机构处副处长、处长，本公司总经理、监事会主席等职。2012年3月起任本公司督察长。

4、本基金基金经理简历

张鹏先生，量化投资部副总监，基金经理，经济学硕士，FRM，毕业于复旦大学。长期从事金融工程研究和量化投资工作，曾任上海银行风险管理部副主管、信诚基金量化投资部副总监等职。2012年5月14日加入万家基金管理有限公司，现任量化投资部副总监、万家中证红利指数基金（LOF）基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员会主任：吕宜振
委员：刘芳洁、吴涛、华光磊、朱虹
吕宜振先生，万家基金管理有限公司总经理
刘芳洁先生，万家基金管理有限公司总经理助理、权益投资总监、权益投资部总监（兼）万家和谐基金基金经理
吴涛先生，量化投资部总监、万家180基金基金经理、万家中证红利基金基金经理、万家中证创业成长基金基金经理
华光磊先生，研究部总监、万家和谐基金基金经理、万家双引擎基金基金经理
朱虹女士，固定收益部总监、万家信用恒利债券型证券投资基金基金经理、万家添利分级债券型证券投资基金基金经理、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、万家稳健增利债券型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

（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、依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、执行生效的基金份额持有人大会决定；
13、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《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1)将其固有财产或者他人的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)利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
(5)依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

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)滥权或违规经营；
(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利益；
(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)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)配租同行，以拍卖自己；
(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、受雇人或任何第三者谋取利益；
(3)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)以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

根据“合法合规、全面、审慎、适时”的要求，为确定明确的基金投资方向、投资策略以及基金组织方式和运作方式，坚持基金运作“安全性、流动性、效益性”相统一的经营理念，公司内部风险控制必须遵循以下原则：

(1)健全性原则。内部风险控制必须渗透到公司的不同决策和管理层次，贯穿于各项业务过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、工作岗位和风险点，不能存在制度上的盲点。

(2)有效性原则。各种内部风险控制制度必须符合国家和监管部门的法律、法规及规章，必须具有高度的权威性，成为全体员工严格遵守的行动指南；任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力。公司的经营运作要真正做到有章必循，违章必究。

(3)独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司固有财产、基金财产及其他财产的运作应当分离。

(4)相互制约原则。各项制度必须体现公司关键的业务部门之间和关键的工作岗位之间的相互制约、相互制衡的原则，合规稽核部门具有其独立性，必须与执行部门分开，业务操作人员与控制人员必须适当分开，并向不同的管理人员负责；在存在管理人员职责交叉的情况下，要为负责监控的人员提供可以直接向最高管理层报告的渠道。

(5)多重风险监管原则。公司为了充分防范各种风险，做好事前风险控制，建立了多重风险监控架构，即由各机构及业务职能部门进行自我风险控制的第一层级的控制；由合规稽核部及风险控制委员会组成的公司监察系统的第二层级的风险控制。

(6)定性与定量相结合原则。形成一套比较完备的制度体系和量化指标体系，使风险控制工作更具科学性和可操作性。

2、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理念。

(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、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

3、内部控制的防线体系

为进行有效的业务组织的风险控制，公司设立“权责统一、严密有效、顺序递进”的四道内控防线：

(1)建立一线岗位的第一道内控防线。属于单人、单岗处理业务的，必须有相应的后续监督机制，各岗位应当职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任。

(2)建立相关部门、相关岗位之间相互监督制约的工作程序作为第二道内控防线。建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，明确业务文件签字的授权。

(3)成立独立的风险控制部门，从而形成第三道内控防线。公司督察长和内部合规稽核部门独立于其他部门，对公司内部控制制度的总体执行情况，各职能部门、岗位的业务执行情况实施严格的检查和反馈。

(4)公司风险控制委员会定期或不定期地对公司整体运营情况进行检查，并提出指导性的意见，形成第四道内控防线。

4、内部控制的主要内容

(1)环境风险控制

①制度风险——对于公司组织结构不清晰、制度不健全带来的风险控制；
②道德风险——由于职员个人利益冲突带来的风险控制。

(2)业务风险控制

①前台业务风险的控制；
②后台业务风险的控制。

（下转B14版）

万家上证380交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：万家基金管理有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
二〇一三年十月

重要提示

1、万家上证380交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会2013年7月31日证监许可[2013]1047号文核准。

2、本基金是交易型开放式证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为华夏银行股份有限公司，登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

5、本基金自2013年10月14日至2013年10月25日进行发售。其中，办理网上现金认购的日期为2013年10月23日至2013年10月25日，办理网下现金认购和网下股票认购的日期为2013年10月14日至2013年10月25日。如果在此期间未达到本基金的招募说明书规定的基金备案条件，即本基金满足基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额（含募集股票市值）不少于2亿元且基金认购人数不少于200人的条件下，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自本基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告、办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

基金募集期届满，若本基金未达到基金备案条件，则本基金募集失败。基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后30日内返还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息，同时将已冻结的股票解冻。

（八）认购费用

1、认购费用由投资者承担，本基金具体的认购费率如下：

	认购费率	认购费率
认购费率	50万份以下	1.0%
	50万份（含）至100万份	0.5%
	100万份（含）以上	每笔交易1,000元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

2、认购费用计算公式和收取方式

（1）通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：
认购佣金＝认购份额×佣金比率
认购金额＝认购份额×（1+佣金比率）
认购佣金由发售代理机构收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。
例一：某投资者通过某发售代理机构采用现金方式认购1,000份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为1%，则需准备的资金金额计算如下：
认购佣金＝1,000×1%＝10元
认购金额＝1,000×（1+1%）＝1,010元
即投资者需准备1,010元资金，方可认购到1,000份本基金基金份额。

（2）通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：
认购费用＝认购份额×认购费率
认购金额＝认购份额×（1+认购费率）
净认购份额＝认购份额÷认购金额产生的利息/基金份额面值
认购费用由基金管理人收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。
例二：某投资者通过基金管理人认购本基金1,000,000份，认购费率为0.5%，假定认购金额产生的利息为100元，则该投资人的认购金额为：
认购费用＝1,000,000×0.5%＝5,000元
认购金额＝1,000,000×（1+0.5%）＝1,005,000元
该投资者所得认购份额为：
净认购份额＝1,000,000+100/1.00＝1,000,100份
即，若该投资者通过基金管理人认购本基金1,000,000份，则该投资者的认购金额为1,005,000元，假定该笔认购金额产生的利息为100元，则可得到1,000,100份基金份额。

（3）通过发售代理机构进行网下股票认购的投资者，认购份额和认购佣金的计算公式为：
认购份额＝（第只股票在网下股票认购期最后一日的均价×有效认购数量）/1.00
（“网下股票认购期最后一日的均价，有效认购数量”由基金管理人确认，具体规定见本基金招募说明书。）
认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，在发售代理机构允许的条件下，投资者可选择以现金或基金份额的方式支付认购佣金。
如投资者选择以现金方式支付认购佣金，则需支付的认购佣金按以下公式计算：
认购佣金＝认购份额×认购份额×佣金比率
如投资者选择以基金份额支付佣金，则认购佣金和可得到的基金份额按以下公式计算：
认购佣金＝认购份额×认购份额/（1+佣金比率）×佣金比率
净认购份额＝认购份额－认购佣金/基金份额初始面值
例三：某投资者持有上证380指数成份股中股票A和股票B各5,000股和10,000股，至某发售代理机构网点认购本基金，以现金支付认购佣金。假设T日股票A和股票B的均价分别9.50元和4.50元，基金管理人确认的有效认购数量为5,000股股票A和10,000股股票B，发售代理机构确认的佣金比率为1.0%，则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下：
认购份额＝（5,000×9.50/1.00+（10,000×4.50/1.00＝92,500份
认购佣金＝1.00×92,500×1.0%＝925元
即投资者可认购到92,500份本基金份额，并需另行支付925元的认购佣金。
例四：续例三，假设该投资者以基金份额的方式交纳认购佣金，则投资者最终可得的净认购份额为：
认购份额＝（5,000×9.50)/1.00+（10,000×4.50)/1.00＝92,500份
认购佣金＝1.00×92,500/（1+1.0%）×1.0%＝915元
净认购份额＝92,500−915/1.00＝91,585份。
即该投资者最终可认购到91,585份基金份额。

二、发售方式及相关规定

（一）投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式认购本基金。

（二）募集期内，本基金在本公司及发售代理机构办理基金认购业务的营业场所或按基金管理人、发售代理机构提供的其他方式办理基金的认购。

（三）本公司直销网点接受单笔认购份额在5万份以上（含5万份）的投资者的网下现金认购。

（四）发售代理机构接受投资者单一账户单笔认购份额为1,000份或其整数倍的网上现金认购、网下现金认购申请；以及单只股票股数为1,000股以上、超过部分为100股的整数倍的网下股票认购申请。

（五）募集期内，投资者可以多次认购，累计认购不设上限。

三、投资者开户

投资者认购本基金时需具有上海证券账户，上海证券账户是指上海证券交易所A股账户或基金账户。

（一）如投资者需新开立证券账户，则应注意：

1、上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立A股账户。

2、开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

（二）如投资者已开立证券账户，则应注意：

1、如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

2、当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

四、网上现金认购的程序

（一）业务办理时间：2013年10月23日至2013年10月25日9：30~11：30和13：00~15：00。

（二）认购手续

1、开立上海证券交易所A股账户或基金账户，办理指定交易。

2、在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3、投资者可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。

五、网下现金认购的程序

（一）直销机构

1、本公司直销柜台接受单笔认购份额在5万份（含5万份）以上的投资者的认购申请。

2、业务办理时间：2013年10月14日至2013年10月25日的8：30~17：00（周六、周日及法定节假日不受理）。

3、个人投资者在本公司直销柜台办理基金的认购手续时需提供下列资料：

（1）身份证件（身份证、军官证、士兵证、户口本、警官证、文职证等）原件及复印件。
（2）上海证券交易所A股账户卡或基金账户卡。
（3）投资者开户券商营业部的席位号。
（4）盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件。
（5）填妥的《万家上证380ETF基金网下现金认购业务申请表》。

（6）本公司直销柜台要求提供的其他有关材料。

4、机构投资者在本公司直销柜台办理基金的认购手续时需提供下列资料：

（1）企业法人提供加盖单位公章的营业执照复印件及副本原件、事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件。
（2）加盖单位公章的组织机构代码证和税务登记证复印件。
（3）上海证券交易所A股账户卡或基金账户卡。
（4）投资者开户券商营业部的席位号。
（5）基金业务授权委托书。
（6）业务经办人有效身份证件原件及复印件。
（7）加盖银行受理印章的汇款凭证复印件。
（8）填妥的《万家上证380ETF基金网下现金认购业务申请表》。
（9）本公司直销柜台要求提供的其他有关材料。

5、募集期间，投资者将足额认购资金汇入本公司指定的以下任一直销资金专户，并注明用途为“万家上证380交易型开放式指数证券投资基金认购款”：

（1）工商银行
账户名称：万家基金管理有限公司
银行账号：1001202919025803311
开户银行：中国工商银行上海市分行营业部

（2）建设银行
帐户名称：万家基金管理有限公司
银行账号：31001520313056008656
开户银行：中国建设银行上海浦东分行

（3）农业银行
帐户名称：万家基金管理有限公司
银行账号：03492300879001895
开户银行：中国农业银行上海市分行卢湾支行

（4）华夏银行
帐户名称：万家基金管理有限公司
银行账号：43302000183460000858
开户银行：华夏银行上海分行营业部

（5）兴业银行
帐户名称：万家基金管理有限公司
银行账号：216250100100042564
开户银行：兴业银行上海分行静安支行

注：在办理汇款时，投资者务必注意以下事项：投资者在“汇款人”栏中填写的汇款人名称必须与认购申请人名称一致；投资者汇款金额不得小于申请的认购金额。

6、注意事项：

（1）投资者在认购时不能使用万家基金管理有限公司基金账户卡，而需使用上海证券交易所A股账户卡或基金账户卡。

（2）若投资者的认购资金在认购申请当日17：00之前未到达本公司指定的直销资金专户，则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期（即有效申请日）以资金到账日为准。在本基金发行截止日的17：00之前，若投资者的认购资金未到达本公司指定账户，则投资者提交的认购申请将可被认定为无效认购。

（二）发售代理机构

1、业务办理时间：2013年10月14日至2013年10月25日，具体业务办理时间由发售代理机构确定。

2、认购手续：

（1）开立上海证券交易所A股账户或基金账户，办理指定交易或转指定交易。
（2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。
（3）投资者填写认购委托单，同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申报一经确认，认购资金即被冻结。

六、网下股票认购的程序

（一）业务办理时间：2013年10月14日至2013年10月25日，具体业务办理时间由指定发售代理机构确定。

（二）认购程序：

1、开立上海证券交易所A股账户，办理指定交易或转指定交易。
2、在A股账户中具备足够的符合要求的标的指数成份股。
3、投资者填写认购委托单，申报一经确认，认购股票即被冻结。

七、清算与交割

（一）通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以基金管理人的记录为准。网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至列入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产。投资者的认购股票在股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间的权益归投资者所有。

（二）募集资