万家日日薪货币市场证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2017年第2号）

基金管理人：万家基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一七年八月

重要提示

万家日日薪货币市场证券投资基金由万家14天理财债券型证券投资基金通过基金合同修订变更而来。《关于修改万家14天理财债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》经万家14天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，于2014年5月15日完成向中国证监会的备案。自2014年5月15日起，由《万家14天理财债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《万家日日薪货币市场证券投资基金基金合同》生效，原《万家14天理财债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

本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，但中国证监会对本基金募集的备案，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。

本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括：因整体政治、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，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。

本基金是货币市场基金，属证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2017年7月15日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日（财务数据未经审计）。

第一部分基金管理人

一、基金管理人概况

名称：万家基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）
法定代表人：方一天
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：壹亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：兰剑
电话：021-38909626 传真：021-38909627

二、主要人员情况

（一）、基金管理人董事会成员

董事长方一天先生，大学本科，学士学位，先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职，2014年10月加入万家基金管理有限公司，2014年12月起任公司董事，2015年2月至2016年7月任公司总经理，2015年7月起任公司董事长。

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。

董事袁西存先生，中共党员，研究生，工商管理学硕士，曾任莱钢集团财务部科长，副部长，中泰证券股份有限公司计划财务部总经理，现任中泰证券股份有限公司财务总监。

董事经晓云女士，中国民主建国会会员，研究生，工商管理学硕士，曾任上海财政证券公司市场管理部经理，上海证券有限责任公司经纪管理总部副总经理、总经理，上投摩根基金管理有限公司副总经理。2016年7月加入万家基金管理有限公司，任公司董事、总经理。

独立董事黄磊先生，中国民主建国会成员，经济学博士，教授，曾任贵州财经学院财政金融系教师、山东财经大学金融学院院长、山东省政协常委，现任山东财经大学资本市场研究中心主任、山东金融产业优化与区域管理协同创新中心副主任、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员、教育部高校金融类专业教学指导委员会委员。

独立董事张伏波先生，经济学博士，曾任上海申佳船厂科员、浙江省经济建设投资公司副经理、国泰君安证券股份有限公司总裁助理、兴安证券有限责任公司副总经理、上海证券有限责任公司副总经理、海证期货有限公司董事长、亚太资源有限公司董事，现任玖源化工（集团）有限公司董事局副主席。

独立董事朱小能先生，中共党员，哲学博士，教授。曾任华东理工大学商学院讲师、中央财经大学中国金融发展研究院硕士生导师、副教授、博士生导师，上海财经大学金融学院副教授、博士生导师，现任上海财经大学金融学院教授、博士生导师。

（二）、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。曾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，新疆国际实业股份有限公司证券事务代表，现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书兼副总经理。

监事张浩先生，中共党员，管理学博士，先后任职于山东东银投资管理有限公司、山东省国有资产控股有限公司。现任山东省国有资产投资控股有限公司综合部（党委办公室）部长（主任）。

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月起加入本公司，现任公司综合管理部总监。

监事陈广益先生，中共党员，硕士学位，先后任职于苏州市对外贸易公司、兴业全球基金管理有限公司，2005年3月起任职于万家基金管理有限公司，现任公司总经理助理、基金运营部总监。

监事尹丽曼女士，中共党员，硕士，先后任职于申银万国期货有限公司、东海期货有限责任公司、万家共赢资产管理有限公司。2017年4月起加入本公司，现任公司综合管理部副总监。

（三）、基金管理人高级管理人员

董事长：方一天先生（简介请参见基金管理人董事会成员）

总经理：经晓云女士（简介请参见基金管理人董事会成员）

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，2014年10月至2015年2月代任公司总经理。

副总经理：黄海先生，硕士研究生。先后在上海德锦投资有限责任公司、上海申银万国证券研究所有限公司、华宝信托有限责任公司、中银国际证券有限责任公司工作，历任项目经理、研究员、投资经理、投资总监等职务。2015年4月进入万家基金管理有限公司任投资总监职务，负责公司投资管理工作。2017年4月起任公司副总经理。

督察长：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，2005年10月进入万家基金管理有限公司工作，2015年4月起任公司督察长。

（四）、本基金基金经理简历

苏谋东，基金经理，复旦大学经济学硕士，CFA。2008年7月进入宝钢集团财务有限公司，从事固定收益投资研究工作，担任投资经理职务。2013年3月加入万家基金管理有限公司，现任公司万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家颐和保本混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家鑫通纯债债券型证券投资基金、万家鑫稳纯债债券型证券投资基金、万家恒景18个月定期开放债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金基金经理。

陈佳昀，2010年7月至2011年3月在上海银行虹口分行工作，担任出纳岗位。2011年7月至2015年11月在财达证券工作，先后担任固定收益部经理助理、资产管理部投资经理岗位。2015年12月至2017年4月在平安证券工作，担任资产管理部投资经理岗位。2017年4月进入我公司工作。现任万家日日薪货币市场证券投资基金、万家家盛债券型证券投资基金、万家家泰债券型证券投资基金、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

（1）权益投资决策委员会
主　任：黄海
委　员：莫海波、卞勇、叶勇、白宇、李文宾
黄海先生，副总经理、投资总监。
莫海波先生，投资研究部总监、基金经理。
卞勇先生，量化投资部总监、基金经理。
叶勇先生，权益投资二部总监。
白宇先生，交易部总监。
李文宾先生，研究总监助理、基金经理。

（2）固收投资决策委员会
主　任：方一天
委　员：陈广益、唐俊杰、苏谋东、白宇、熊义明
方一天先生，董事长
陈广益先生，总经理助理、基金运营部总监。
唐俊杰先生，固定收益部总监，基金经理。
苏谋东先生，固定收益部副总监，基金经理。
白宇先生，交易部总监。
熊义明先生，首席宏观分析师。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）
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：周慕冰
成立日期：2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-66060069
传真：010-68121816
联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013年至2016年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近140名，其中具有高级职称的专家30余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2017年6月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共372只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

第五部分相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

本基金的直销机构为万家基金管理有限公司以及该公司的网上交易平台。
住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）
法定代表人：方一天
联系人：张婉婉
电话：(021)38909777
传真：(021)38909798
客户服务热线：400-888-0800；95538转6

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅基金管理人的网站公告。网上交易网址：

https://trade.wjasset.com/

2、非直销销售机构

（1）中国农业银行股份有限公司
客户服务电话：95599（或拨打各城市营业网点咨询电话）
网址：www.abchina.com
（2）交通银行股份有限公司
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com
（3）招商银行股份有限公司
客服电话：95555
网址：www.cmbchina.com
（4）中泰股份证券有限公司
客服电话：95538
网址：www.zts.com.cn
（5）光大证券股份有限公司
客服电话：400-888-8788，10108998，95525
网址：www.ebscn.com
（6）海通证券股份有限公司
客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址：www.htsec.com
（7）信达证券股份有限公司
客户服务电话：400-800-8899
网址：www.cindasc.com
（8）中国银河证券股份有限公司
客户服务电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn
（9）国信证券股份有限公司
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn
（10）山西证券股份有限公司
客户服务电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn
（11）上海证券有限责任公司
客户服务电话：400-891-8918，021-962518
网址：www.962518.com
（12）东吴证券股份有限公司
客户服务电话：4008601555
网址：www.dwzq.com.cn
（13）国融证券有限责任公司
客户服务电话：95385
网址： www.grzq.com.cn
（14）申银万国证券股份有限公司
客服电话：021-95523、4008-895523
网址：www.sywg.com
（15）国泰君安证券股份有限公司
客服电话：400-888-8666
网址：www.gtja.com
（16）中信建投证券股份有限公司
客户服务电话：400-888-8108
网址：www.csc108.com
（17）中国国际金融有限公司
电话：010-65051166
网址：www.cicc.com.cn
（18）招商证券股份有限公司
客户服务电话：400-8888-111，95565
网址：www.newone.com.cn
（19）中信证券（山东）有限责任公司
客服电话：95548
网址：www.zxwt.com.cn
（20）江海证券有限公司
客户服务热线：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn
（21）上海好买基金销售有限公司
客服电话：400-700-9665
网址：www. ehowbuy.com
（22）杭州数米基金销售有限公司
客服电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn
（23）长量基金销售投资顾问有限公司
客服电话：400-089-1289
网址：www.erichfund.com
（24）上海天天基金销售有限公司
客服电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
（25）深圳众禄基金销售有限公司
客服电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.com
（26）和讯信息技术有限公司
客服电话： 400-920-0022
网址：licaike.hexun.com
（26）中国中投证券有限责任公司
客户服务电话：95532
公司网站：http://www.china-invs.cn/
（27）金元证券股份有限公司
客户服务电话：4008-888-228??
公司网站：www.jyzq.cn
（28）平安银行股份有限公司
客户服务电话： 95511-3
网址：bank.pingan.com
(29) 中信证券股份有限公司
客服电话：95558
网址：www.cs.ecitic.com
(30) ?中信证券（浙江）有限责任公司
公司网站：www.bigsun.com.cn
客户服务中心电话：95548
(31) 五矿证券有限公司
客户服务电话：400-184-0028
网址：http://wkzq.com.cn
(32) 华龙证券有限责任公司
客服电话：4006898888
网址：?www.hlzqgs.com
（33）北京乐融多源投资咨询有限公司
客户服务电话： 400-068-1176
网址： www.jimubox.com
（34）浙江同花顺基金销售有限公司
客服电话：4008-773-772
网址：http://fund.10jqka.com.cn/
（35）国金证券股份有限公司
客户服务电话：400-660-0109
网址：www.gjzq.com.cn
(36)盈米财富管理有限公司
客户服务电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn
(37)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
客户服务电话：400-166-1188
网址：http://8.jrj.com.cn/?
(38)杭州数米基金销售有限公司
客户服务电话：400-076-6123
网址：www.fund123.cn?
(39) 大泰金石投资管理有限公司
客户服务电话：021-22267982
网址：www.dtfortune.com
(40) 中信期货有限公司
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com
(41) 上海汇付金融服务有限公司
客户服务电话： 400-820-2819
网址： https://tty.chinapnr.com/
(42) 北京钱景财富投资管理有限公司
客户服务电话：400-893-6885
网址： fund.qianjing.com
(43) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
客户服务电话：400-821-5399
网址： www.noah-fund.com
（43）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
客服电话：400-8909-998
网址：www.jnlc.com
（44）奕丰金融服务（深圳）有限公司
客服电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
（45）浙江金观诚财富管理有限公司
客服电话：400-068-0058
网址：www.jincheng-fund.com
（46）深圳富济财富管理有限公司
客服电话：0755-83999907
网址：www.jinqianwo.cn
（47）上海陆金所资产管理有限公司
客户服务电话：4008-219-031
网址： www.lufunds.com
（48）中经北证（北京）资产管理有限公司
客服电话：400-600-0030
网址：www.bzfunds.com
（49）华泰证券股份有限公司
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
（50）武汉市伯嘉基金销售有限公司
客服电话：400-027-9899
网址：www.buyfunds.cn
（51）海银基金销售有限公司
客服电话：400-808-1016
网址：www.fundhaiyin.com
（52）北京汇成基金销售有限公司
客服电话：400-619-9059
网址： www.fundzone.cn
（53）北京广源达信投资管理有限公司
客服电话：400-623-6060
网址：www.niuniufund.com
（54）平安证券有限责任公司
客户服务电话：95511-8
网址： stock.pingan.com
（55）中航证券有限公司
客户服务电话：0791-6768763 @公司网址：www.avicsec.com
（56）南京证券股份有限公司
客服电话：95386
网址：http://www.njzq.com.cn/
（57）上海基煜基金销售有限公司
客户服务电话：021-65370077
网址： www.jiyufund.com.cn
（58）爱建证券有限责任公司
客服电话：021-63340678
网址：www.ajzq.com
（59）华鑫证券有限责任公司
客服电话：021-32109999；029-68918888
网址：www.cfsc.com.cn
（60）华福证券有限责任公司
客服电话：400-889-6326
网址：http://www.hfzq.com.cn/
（61）北京懒猫金融信息服务有限公司
客户服务电话：4001-500-882
网址：http:// www.lanmao.com
（62）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
客服电话
个人业务：95118
企业业务：4000888816
网址：fund.jd.com
（63）北京恒天明泽基金销售有限公司
客服电话：4008980618
网址：www.chtfund.com
（64）深圳众禄基金销售有限公司
客服电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
（65）北京新浪仓石基金销售有限公司
客服电话：010-62675369
网址：www.xincai.com
（66）中国银行股份有限公司
客服电话：95566
网址：http://www.boc.cn/
（67）中银国际证券有限责任公司
客服电话：400-620-8888
网址：http://www.bocichina.com/

场内代销机构指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格，并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员（以下简称“有资格的上证所会员”），名单详见上海证券交易所网站。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）基金登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
电话：（010）58598839
传真：（010）58598834

（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：北京大成（上海）律师事务所
住所：上海市浦东新区银城中路501号上海中心15/16层（200120）
电话：（021）3872 2416
传真：（021）5878 6866
联系人：华涛

（四）审计基金财产的会计师事务所
安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室（邮编:100738）
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼（邮编：200120）
联系电话：（021）22288888
传真：（021）22280000
联系人：汤骏
经办注册会计师：汤骏

第四部分基金的名称

本基金名称：万家日日薪货币市场证券投资基金

第五部分基金的类型

本基金为契约型开放式货币市场基金

第六部分基金的投资目标

在力保本金安全性和基金资产流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

第七部分基金的投资范围

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金；通知存款；短期融资券；1年以内（含1年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券；期限在1年以内（含1年）的债券回购；期限在1年以内（含1年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）；剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券；剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据；以及中国证监会认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

第八部分基金的投资策略

一、资产配置策略

本基金在投资组合的管理中，将通过短期市场利率预期策略、类属资产配置策略和无风险套利操作策略等策略构建投资组合，谋求在满足流动性要求、控制风险的前提下，实现基金收益的最大化。

（1）短期市场利率预期策略

短期利率预期策略是指基金管理人根据对短期货币市场有影响的宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化作出研究与分析，对未来短期内不同市场、不同品种的市场进行积极的判断，并以此为依据制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划，期限结构与品种配置计划是未来一段投资的基础。

（2）投资组合优化策略

投资组合优化管理策略是指在期限结构与品种比例约束下，在滚动配置策略的基础上采用优化技术获得最大化收益的策略体系。其优化目标是组合资产收益最大化，约束条件为期限结构比例约束、品种类属比例约束、信用风险约束等。

（3）类属配置策略

在满足投资组合平均剩余期限的前提下，根据各类属资产的市场规模、收益性和流动性，确定各类资产的配置比例，在保证投资组合高流动性和低风险的前提下尽可能提高组合收益率。

（4）个券选择策略

本基金将优先考虑安全性因素，优先选择高信用等级的债券品种进行投资。在个券选择上，本基金将对影响债券定价的主要因素，包括信用等级、流动性、市场供求、票息及付息频率、税赋等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

（5）回购策略

1）息差放大策略：本基金将利用回购利率低于债券收益率的机会，通过正回购将所获得的资金投资于债券以放大债券投资收益。本基金将充分考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系，选择适当的杠杆比率，谨慎实施息差放大策略，以提高投资组合收益水平。

2）逆回购策略：本基金将密切关注短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。

（6）无风险套利操作策略

由于市场环境差异以及市场参与成员的不同，市场中常常存在无风险套利机会。本基金管理人认为随着市场有效性的提高，无风险套利的机会将不断减少，但是相信在较长一段时间中市场中仍然会存在的无风险套利机会，基金管理人将贯彻谨慎的原则，充分把握市场无风险套利机会，为投资人带来更大收益。

同时，随着市场的发展，新的货币投资工具的推出，会产生新的无风险套利机会，本基金将加强对市场前沿的研究，及时发现市场中新的无风险套利机会，扩大基金投资收益。

（7）现金流管理策略

本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和银行存款、债券品种的期限结构搭配，动态调整基金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。

第九部分基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：银行活期存款利率（税后）。

第十部分基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

第十一部分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。

基金托管人农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年7月20日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。

本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	固定收益投资	67,496,403.00	31.45
	其中：债券	67,496,403.00	31.45
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	76,000,150.00	35.41
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	69,955,429.29	32.59
4	其他资产	1,194,655.27	0.56
5	合计	214,646,637.56	100.00

2.报告期债券回购融资情况

序号	项目		占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额		2.28
	其中：买断式回购融资		–
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中：买断式回购融资	–	–

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

3.基金投资组合平均剩余期限

3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	69
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	40.63	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)-60天	15.86	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)-90天	20.79	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)-120天	–	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)-397天（含）	22.47	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计		99.75	–

4.报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（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	17,970,118.98	8.40
	其中：政策性金融债	17,970,118.98	8.40
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	49,526,284.02	23.14
8	其他	–	–
9	合计	67,496,403.00	31.54
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

6.报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	140220	14国开20	100,000	10,015,001.37	4.68
2	111799936	17青岛银行CD087	100,000	9,974,935.05	4.66
3	111711209	17平安银行CD209	100,000	9,931,778.14	4.64
4	111699367	16唐山银行CD018	100,000	9,889,279.89	4.62
5	111699554	16贵州银行CD025	100,000	9,885,028.72	4.62
6	111681045	16杭州银行CD192	100,000	9,845,262.22	4.60
7	170204	17国开04	80,000	7,955,117.61	3.72

7.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0438%
报告期内偏离度的最低值	-0.1035%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0792%

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。

9.投资组合报告附注

9.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销，每日计提损益。

本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.00元。

9.2

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内不存在受到公开谴责、处罚的情形。

9.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,164.37
2	应收证券清算款	5,071.23
3	应收利息	919,254.19
4	应收申购款	269,165.48
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	1,194,655.27

第十二部分基金的业绩

基金业绩截止日为2017年6月30日。

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。

（一）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

万家日日薪A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2017年上半年	1.6213%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.4477%	0.0014%
2016年	2.5255%	0.0055%	0.3510%	0.0000%	2.1745%	0.0055%
2015年	3.6038%	0.0099%	0.3500%	0.0000%	3.2538%	0.0099%
2014年	3.0619%	0.0067%	0.7171%	0.0013%	2.3448%	0.0054%
2013年	3.5517%	0.0054%	1.2982%	0.0000%	2.2535%	0.0054%
自基金合同生效起至2017年6月30日	15.1979%	0.0068%	2.8899%	0.0013%	12.3080%	0.0055%

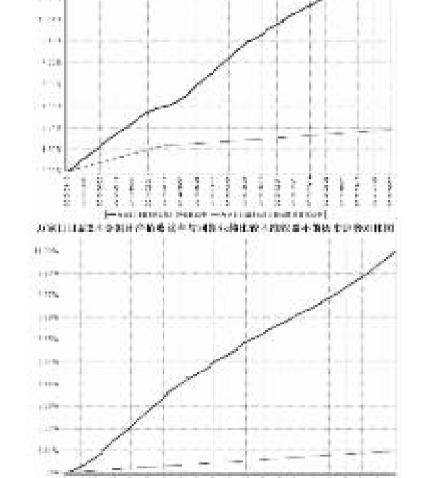
万家日日薪B

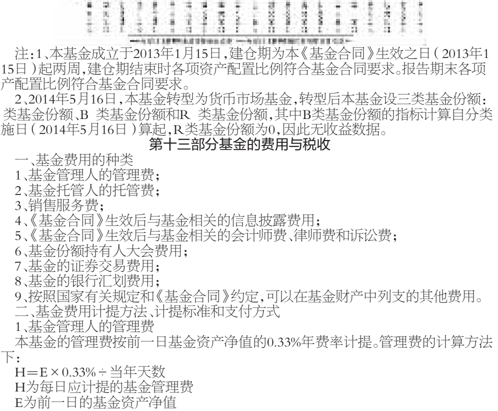
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年上半年	1.7433%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.5697%	0.0014%
2016年	2.7708%	0.0055%	0.3510%	0.0000%	2.4198%	0.0055%
2015年	3.8533%	0.0099%	0.3500%	0.0000%	3.5033%	0.0099%
2014年	2.3003%	0.0079%	0.2215%	0.0000%	2.0788%	0.0079%
自基金合同修改日起至2017年6月30日	11.0885%	0.0074%	1.0960%	0.0000%	9.9925%	0.0074%

注：1、本基金于2014年5月15日修改合同，基金业绩比较基准由原来的：“本基金业绩比较基准为7天通知存款税后利率。修改为：本基金业绩比较基准为银行活期存款利率（税后）。

2、本报告期万家日日薪R类基金份额为0，无法计算收益数据。

（二）自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较（2013年1月15日至2017年6月30日）





注：1、本基金成立于2013年1月15日，建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年1月15日）起两周，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

2、2014年5月16日，本基金转型为货币市场基金，转型后本基金设三类基金份额：A类基金份额、B类基金份额和R类基金份额，其中B类基金份额的指标计算自分类实施日（2014年5月16日）算起，R类基金份额为0，因此无收益数据。

第十三部分基金的费用与税收

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、销售服务费；
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金的证券交易费用；
8、基金的银行汇划费用；
9、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、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.33%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、销售服务费

本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%，对于由B类降级为A类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率。B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%，对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到B类条件的开放日后的下一个工作日起享受B类基金份额持有人的费率。本基金R类基金份额的销售服务费年费率为0。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×销售服务费年费率÷当年天数
H 为每日应计提的销售服务费
E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第4－9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用；
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。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分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》、《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》及其它有关法律法规的要求，对本基金2017年2月28日发布的更新招募说明书内容进行了更新，并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新内容如下：

1、在重要提示部分，明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的有关内容。
3、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的有关内容。
4、在“五、相关服务机构”部分，更新了服务机构的有关内容。
5、在“九、基金的投资”部分，补充了本基金最近一期（2017年第二季度）投资组合报告内容。
6、在“十、基金的业绩”部分，更新了基金成立以来的投资业绩。
7、增加了“二十三、其他应披露事项”部分，更新了本基金最近一次招募说明书更新以来的公告事项。

第二十五部分备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）中国证监会证券基金机构监管部《关于万家14天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]203号）
（二）《万家日日薪货币市场证券投资基金基金合同》
（三）《万家日日薪货币市场证券投资基金托管协议》
（四）法律意见书
（五）基金管理人业务资格批件、营业执照
（六）基金托管人业务资格批件、营业执照
（七）中国证监会要求的其他文件

万家基金管理有限公司
二〇一七年八月二十八日

关于国金沪深300指数分级证券投资基金基金转型份额转换与变更登记的公告

根据国金沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“国金沪深300”或“本基金”）基金份额持有人大会决议，国金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定对国金沪深300进行基金份额转换与变更登记，转型为国金沪深300指数增强证券投资基金（以下简称“国金沪深300指数增强”）。基金份额转换由基金管理人办理，并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。

1、转换基准日：2017年8月31日。

2、转换对象：转换基准日登记在册的国金沪深300、国金沪深300A、国金沪深300B基金份额。

3、基金份额的转换

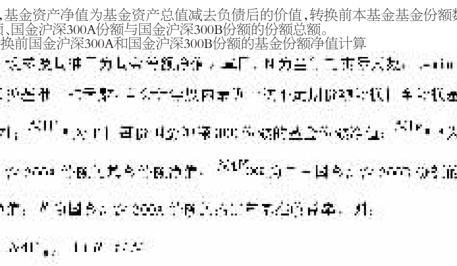
（1）转换前基金份额净值的计算

1）转换前国金沪深300份额的基金份额净值计算

转换前国金沪深300份额的基金份额净值= 转换基准日的基金资产净值／转换基准日本基金基金份额的总数。

其中，基金资产净值为基金资产总值减去负债后的价值，转换前本基金基金份额数量为转换前国金沪深300份额、国金沪深300A份额与国金沪深300B份额的份额总额。

2）转换前国金沪深300A和国金沪深300B份额的基金份额净值计算



国金沪深300份额的基金份额净值以及国金沪深300A份额和国金沪深300B份额的基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（2）基金份额转换公式

1）将国金沪深300A份额与国金沪深300B份额转换成国金沪深300份额的场内份额

在份额转换基准日日终，以国金沪深300份额的基金份额净值为基准，国金沪深300A份额、国金沪深300B份额按照各自的基金份额参考净值转换成国金沪深300份额的场内份额。国金沪深300A 份额（或国金沪深300B份额）基金份额持有人持有的转换后国金沪深300份额的场内份额取整计算（最小单位为1份），取整后的余额计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的国金沪深300A份额、国金沪深300B份额，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换计算公式如下：

国金沪深300A（或国金沪深300B）的转换比例＝份额转换基准日国金沪深300A（或国金沪深300B）的基金份额净值/份额转换基准日国金沪深300份额的基金份额净值

国金沪深300A（或国金沪深300B）基金份额持有人持有的转换后国金沪深300份额的场内份额＝基金份额持有人持有的转换前国金沪深300A（或国金沪深300B）的份额数×国金沪深300A（或国金沪深300B）的转换比例

2）将国金沪深300份额转换成国金沪深300指数增强份额

在国金沪深300A份额与国金沪深300B份额转换为国金沪深300份额的场内份额后，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将国金沪深300份额的场内份额和场外份额统一转换为份额净值为1.0000元的国金沪深300指数增强份额。基金份额转换后，场外的国金沪深300指数增强的份额数，保留到小数点后2位，小数点后第3位截位，由此产生的计算误差归入基金资产，场内的国金沪深300指数增强的份额数采用取整计算（最小单位为1份），取整后的余额计入基金资产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的国金沪深300份额的场内份额，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换的计算公式如下：

转换后国金沪深300指数增强的份额数=国金沪深300份额数×份额转换基准日国金沪深300份额的基金份额净值/1.0000

转换后国金沪深300指数增强的份额净值为1.0000元。

（3）基金份额转换结果的公告

本基金此次份额转换结果及注册登记机构变更登记完成后，基金管理人将在指定媒体对份额转换结果予以公告。

如果基金份额转换过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额转换与变更登记。

风险提示：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将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

国金基金管理有限公司
2017年8月28日

关于国金沪深300指数分级证券投资基金终止场内申购赎回暨基金份额转换业务期间暂停相关业务的公告

1 公告基本信息

基金名称		国金沪深300指数分级证券投资基金		
基金简称		国金沪深300指数分级（场内简称：国金300）		
基金主代码		167601		
基金管理人名称		国金基金管理有限公司		
公告依据		根据法律法规及《国金沪深300指数分级证券投资基金基金合同》、《国金沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》等相关规定。		
终止场内申购、赎回业务及暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	终止场内申购起始日	2017年8月31日		
	终止场内赎回起始日	2017年8月31日		
	暂停场外申购起始日	2017年8月31日		
	暂停场外赎回起始日	2017年8月31日		
	暂停场外定期定额投资起始日	2017年8月31日		
	暂停场外系统内转托管起始日	2017年8月31日		
	暂停跨系统转托管起始日	2017年8月31日		
	终止场内申购、赎回业务及暂停场外申购、赎回、定期定额投资、转托管（包括场外系统内转托管及跨系统转托管）业务的原因说明	根据《国金沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、《关于国金沪深300指数分级证券投资基金基金转型份额转换与变更登记的公告》，本基金将于2017年8月31日进行转型转换，为保证转换工作的顺利完成，转换期间暂停基金相关业务。		
下属分级基金的基金简称		国金300	国金300A	国金300B
下属分级基金的交易代码		167601	150140	150141
该分级基金是否终止场内申购、赎回业务及暂停场外申购、赎回、定期定额投资、转托管（包括场外系统内转托管及跨系统转托管）		是	–	–

2 其他需要提示的事项

（1）本公告仅对国金基金管理有限公司（以下简称“本公司”）管理的国金沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“国金沪深300”或“本基金”）终止场内申购、赎回业务及暂停场外申购、赎回、定期定额投资、转托管（包括场外系统内转托管及跨系统转托管）等业务有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，可通过本公司网站查阅本基金的相关法律文件。

（2）根据国金沪深300基金份额持有人大会决议及相关公告，本基金将于终止上市日即2017年8月31日起终止基金份额的场内申购赎回，并暂停基金份额的场外申购、赎回、定期定额投资、转托管（包括场外系统内转托管及跨系统转托管）业务。自本基金份额转换完成及转型后的国金沪深300指数增强证券投资基金（以下简称“国金沪深300指数增强”）的基金合同生效的次一交易日起，国金沪深300指数增强开放跨系统转托管业务；自国金沪深300指数增强的基金合同生效之日起不超过三个月，国金沪深300指数增强开放场外申购、赎回、定期定额投资等业务，具体日期本公司将另行公告。国金沪深300指数增强为非上市基金，不再开放场内申购赎回。

国金沪深300指数增强的基金合同自国金沪深300基金份额转换基准日（指国金沪深300转换为国金沪深300指数增强）的次一工作日起生效。在国金沪深300暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管（包括场外系统内转托管及跨系统转托管）业务前，国金沪深300的场内份额持有人可提交跨市场转托管申请将场内份额转为场外份额或者提交赎回申请进行场内份额的赎回。未提交跨市场转托管或者赎回申请的场内份额持有人所持有的基金份额仍然保留在投资者的场内资金账户中，并将于2017年8月31日转换为国金沪深300指数增强份额。自《国金沪深300指数增强证券投资基金基金合同》生效的次一交易日起三个月内，国金沪深300指数增强场内份额的持有人可自行进行场外开户和跨系统转托管，将国金沪深300指数增强场内份额转换为国金沪深300指数增强场外份额。国金沪深300指数增强将于《国金沪深300指数增强证券投资基金基金合同》生效三个月后关闭场内份额的跨系统转托管业务。原登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统的场内基金份额，将统一转登记至本基金管理人开立的中登场外基金账户上，届时仍持有国金沪深300指数增强场内份额余额的投资人，需根据基金管理人届时发布的相关公告，对其持有的基金份额进行重新确认与登记，此过程即为“确权”，确权完成后，基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及其他交易。

（3）关于本基金转型转换与变更登记的相关安排，可参见本公司之前在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站发布的《关于以通讯方式召开国金沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《国金沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、《关于国金沪深300指数分级证券投资基金基金转型份额转换与变更登记的公告》。

（4）本公告涉及上述业务的最终解释权归本公司所有。

（5）投资者可登陆本公司网站（http://www.gfund.com）查询相关信息或拨打客户服务电话（4000-2000-18）咨询相关事宜。

风险提示：

本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

国金基金管理有限公司
2017年8月28日

国金沪深300指数分级证券投资基金终止上市公告

根据《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》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等法律规范，以及根据中国证监会《关于准予国金沪深300指数分级证券投资基金变更注册的批复》（证监许可 [2017]646号）、《国金沪深300指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《关于以通讯方式召开国金沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《国金沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》等相关文件的内容，基金管理人向深圳证券交易所申请终止国金沪深300A份额和国金沪深300B份额的上市交易，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2017]543号）同意。现将本基金终止上市相关内容公告如下：

一、终止上市基金的基本信息

国金沪深300A：场内简称“国金300A”
交易代码：150140
国金沪深300B：场内简称“国金300B”
交易代码：150141
基金类型：契约型开放式基金
终止上市日：2017年8月31日

终止上市的权益登记日：2017年8月30日，即在2017年8月30日下午深圳证券交易所竞价交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的国金沪深300A、国金沪深300B基金份额持有人分别享有国金沪深300A、国金沪深300B终止上市后的相关权益。

基金转换基准日：2017年8月31日。基金管理人在转换基准日将按照《基金合同》约定的资产及收益的计算规则分别计算国金沪深300A和国金沪深300B的基金份额净值，并以份额持有人各自持有的份额数量为基础，在转换基准日转换为国金沪深300基金份额。投资者持有的国金沪深300A和国金沪深300B转换成的国金沪深300份额与原持有的国金沪深300份额（场内份额及场外份额）将统一转换为国金沪深300指数增强证券投资基金（以下简称“国金沪深300指数增强”）基金份额。

二、有关基金终止上市决定的主要内容

国金沪深300持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过了《关于国金沪深300指数分级证券投资基金转型相关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日，即 2017年8月14日生效，表决结果的具体内容详见基金管理人于2017年8月15日发布的《国金沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

大会决议生效后，基金管理人向深圳证券交易所申请终止国金沪深300基金的上市交易，获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2017]543号）同意。

三、基金终止上市后续事项说明

1、修订后基金合同的生效

自国金沪深300份额转换基准日（指国金沪深300份额转换为国金沪深300指数增强份额之日）的次一工作日起，《国金沪深300指数增强证券投资基金基金合同》生效，《国金沪深300指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

2、原国金沪深300份额的变更登记

国金沪深300A、国金沪深300B在深圳证券交易所终止上市交易后，基金管理人将进行基金份额更名以及必要的信息变更。

份额转换基准日日终，在中国结算有限责任公司深圳分公司登记在册的国金沪深300场内份额、国金沪深300A及国金沪深300B基金份额将转换为国金沪深300指数增强基金的场内份额，在中国结算有限责任公司登记在册的国金沪深300场外份额将转换为国金沪深300指数增强基金的场外份额。

3、国金沪深300指数增强基金份额的申购赎回

国金沪深300终止上市后，基金管理人将根据相关规定，在《国金沪深300指数增强证券投资基金基金合同》生效后，开放国金沪深300指数增强证券投资基金份额的日常申购、赎回，具体请见基金管理人届时发布的公告。

4、注意事项

（1）本基金终止上市交易后，国金沪深300指数增强基金份额开放赎回之前，投资人无法办理赎回，存在一定的流动性风险。具体开放赎回时间请见基金管理人届时发布的公告。

（2）对于已经办理司法冻结、质押登记等措施的基金份额，有关登记机构及证券经营机构应依照有关规定办理该限制措施的转移手续。

投资者欲了解详细情况，可登陆本公司网站（www.gfund.com）、拨打本公司的客户服务电话（4000-2000-18）（免长途话费）或010-88005812垂询相关事宜。

特此公告。

国金基金管理有限公司
2017年8月28日