万家基金管理有限公司关于万家沪深300指数证券投资基金变更为万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、降低管理费率和托管费率并修订基金合同与托管协议的公告

万家沪深300指数证券投资基金(以下简称“本基金”)于2025年8月26日成立。基金管理人为万家基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”或“本公司”),基金托管人为江苏银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据《万家沪深300指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)约定:“若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF),则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金,并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致,无需召开基金份额持有人大会,在履行适当程序后及时公告”。

本公司旗下万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金已于2025年2月25日成立。本公司根据《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》和《基金合同》的有关规定,经与本基金基金托管人协商一致,决定于2025年10月30日起,将万家沪深300指数证券投资基金变更为万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金,同时降低管理费率和托管费率,并相应修改《基金合同》和《万家沪深300指数证券投资基金托管协议》(以下简称“《托管协议》”)中相关条款。现将具体事宜公告如下:

一、基金份额的变更登记

本基金变更为万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金后,基金的登记机构将进行基金份额变更登记,即将“万家沪深300指数证券投资基金A类基金份额”变更为“万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额”,“万家沪深300指数证券投资基金C类基金份额”变更为“万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额”。本基金的基金简称分别由“万家沪深300指数A”变更为“万家沪深300ETF联接A”,基金代码“024011”不变;“万家沪深300指数C”变更为“万家沪深300ETF联接C”,基金代码“024012”不变。

前述变更不影响各类基金份额净值的计算,各类基金份额的申购费率、赎回费率、销售服务费率及申购、赎回相关业务规则均保持不变(销售机构对费率实施优惠的,从其规定)。

二、降低管理费率和托管费率

根据《基金合同》的约定,万家沪深300指数证券投资基金的管理费“按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提”,托管费“按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提”。

经调整后,万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理费“按前一日基金资产净值扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.15%年费率计提”,托管费“按前一日基金资产净值扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.05%的年费率计提”。

三、《基金合同》与《托管协议》的修订

本公司经与基金托管人协商一致,对本基金《基金合同》、《托管协议》中涉及基金变更和降低管理费率相关内容进行修改,属于《基金合同》约定的无需召开基金份额持有人大会的情形。修订后的《万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》、《万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》自2025年10月30日起生效,原《基金合同》和《托管协议》同日起失效。

本基金管理人将于公告当日将修改后的《万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》和《万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》登载于规定网站。本基金招募说明书及基金产品资料概要涉及前述内容的,将一并修改,并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

四、其他需要提示的事项

1、本公告仅对万家沪深300指数证券投资基金变更为万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、降低管理费率和托管费率并修改《基金合同》和《托管协议》事项予以说明,最终解释权归本公司。投资者欲了解基金信息,请仔细阅读本基金的《基金合同》等相关法律文件。本基金管理人可以在法律法规和《基金合同》规定范围内调整上述有关内容。

2、投资者可登录本基金管理人网站www.wjasset.com或拨打客户服务电话400-888-0800咨询相关事宜。

特此公告。

风险提示:本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。本基金管理人管理的基金及其投资人员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及关注基金特有风险,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

万家基金管理有限公司

2025年10月28日

万家沪深300指数证券投资基金《基金合同》、《托管协议》修订对照表

一、《万家沪深300指数证券投资基金基金合同》修订对照表

章节	原基金合同表述	修订后基金合同表述
全文	万家沪深300指数证券投资基金	万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
第一部分 前言	一、订立基金合同的目的、依据和原则 2、订立基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。 三、万家沪深300指数证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。 七、本基金为指数基金,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险,详见本基金招募说明书“风险揭示”部分。 ……	一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式 通过各销售机构网站或营业网点公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站届时披露的基金销售机构名录。基金管理人可根据情况调整销售机构。 3、发售对象 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、合格境外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。具体发售对象以招募说明书、基金份额发售公告或相关公告为准。 二、基金份额的认购 1、认购费用 本基金A类基金份额在认购申购收取认购费用,C类基金份额不收取认购费用。 本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定,并在招募说明书及基金产品资料概要等文件中列示。基金认购费用不列入基金财产。 2、募集期利息的处理方式 有效认购款项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,其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。 3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。 4、认购份额余额的处理方式 认购份额余额的处理方式在招募说明书中列示。 5、认购申请的确认 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的任何损失由投资者自行承担。 三、基金份额认购金额的限制 1、投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。 2、基金管理人可以对每个基金交易账户的认购金额进行限制,具体限制请参看招募说明书或相关公告。 3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制,具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。 4、投资者在募集期内可以多次认购基金份额,认购费按每笔认购申请单独计算,但已受理的认购申请不允许撤销。	第四部分 基金的历史沿革 万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金由万家沪深300指数证券投资基金变更而来。 万家沪深300指数证券投资基金于2025年4月7日经中国证券监督管理委员会证监许可[2025]711号文准予注册,《万家沪深300指数证券投资基金基金合同》于2025年8月26日生效。基金管理人为万家基金管理有限公司,基金托管人为江苏银行股份有限公司。 根据《万家沪深300指数证券投资基金基金合同》的约定:“若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF),则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金,并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致,无需召开基金份额持有人大会,在履行适当程序后及时公告。”,故万家沪深300指数证券投资基金变更为万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金无需召开基金份额持有人大会,可经基金管理人与基金托管人协商一致后修改基金合同。 经基金管理人与基金托管人协商一致,决定将万家沪深300指数证券投资基金变更为万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金,并据此修订《万家沪深300指数证券投资基金基金合同》。自2025年10月30日起,《万家沪深300指数证券投资基金基金合同》失效,《万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效。本基金合同当事人将按照《万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》享有相应权利并承担有关义务。
第五部分 基金备案	一、基金备案的条件 本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在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,向中国证监会办理基金备案手续。 基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告,同时书面通知基金托管人。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式 如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任: 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用; 2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已交纳的款项,并加计银行同期活期存款利息; 3、知基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会。 法律法规、中国证监会或基金合同另有规定时,从其规定。	第五部分 基金的存续 《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会。 法律法规、中国证监会或基金合同另有规定时,从其规定。
第六部分 基金份额的申购与赎回	四、申购与赎回的程序 …… 2、申购和赎回的款项支付 …… 基金份额持有人通交赎回申请,赎回成立;基金份额登记机构确认赎回时,赎回生效。基金份额持有人赎回申请生效后,基金管理人将指示基金托管人在法律法规规定的期限内支付赎回款项。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程,则赎回款项的支付时间可相应顺延。在发生巨额赎回或基金合同约定的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。 …… 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金分为A类和C类基金份额,各类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值。本基金各类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,由此产生的收益或损失由基金财产承担。如遇特殊情况,为保护基金份额持有人利益,基金管理人与基金托管人协商一致,可协段性调整基金份额净值计算精度并进行相应公告,无需召开基金份额持有人大会审议。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算,并按照基金合同的约定公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。 七、拒绝或暂停申购的情形 …… 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的50%,或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形时。 …… 发生上述第1、2、3、5、6、9、10项情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上进行公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金分为A类和C类基金份额,各类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值。本基金各类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,由此产生的收益或损失由基金财产承担。如遇特殊情况,为保护基金份额持有人利益,基金管理人与基金托管人协商一致,可协段性调整基金份额净值计算精度并进行相应公告,无需召开基金份额持有人大会审议。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算,并按照基金合同的约定公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。未来若市场情况发生变化,或目标ETF净值计算和发布时间发生变化,或因实际需要,经履行适当程序后,本基金可相应调整基金份额净值计算和公告时间或频率并提前公告。 七、拒绝或暂停申购的情形 …… 7、目标ETF暂停估值,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 8、目标ETF暂停申购、暂停上市或目标ETF停牌,或达到、接近申购上限,基金管理人认为有必要暂停本基金申购的。 …… 发生上述第1、2、3、5、6、7、8、10、11项情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上进行公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 5、目标ETF暂停估值,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 6、目标ETF暂停赎回、暂停上市或目标ETF停牌,或延缓支付赎回对价时,或达到、接近赎回上限时,基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 (二)基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于: …… (12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利。 …… (16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资计划、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则; …… 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于: …… (8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定各类基金份额申购、赎回的价格; …… (24)基金在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人; …… 三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于: …… (5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权; …… 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于: …… (4)交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用; ……	一、基金管理人 (二)基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于: …… (12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利,为基金的利益行使因基金财产投资于目标ETF、其他证券所产生的权利; …… (16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资计划、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则; …… (19)代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标ETF所产生的权利,基金合同另有约定的除外; …… 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于: (1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的申购、赎回和登记事宜; …… (8)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定各类基金份额申购、赎回的价格; …… (删除) 三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于: …… (5)出席或者委派代表出席本基金或目标ETF的基金份额持有人大会,对本基金或目标ETF的基金份额持有人大会审议事项行使表决权; …… 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于: …… (4)交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用; ……
第八部分 基金份额持有人大会	一、基金份额持有人大会召集、议事及决议的主要事项 1、召开大会的事由 当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会,但法律法规、中国证监会另有规定的除外: …… 2、在不违反法律法规规定和《基金合同》约定,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会: …… (5)基金管理人、基金登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、定期定额投资计划、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押等业务规则; …… (8)若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF),则基金管理人在履行适当程序后可将本基金转换为该基金的联接基金,并相应修改《基金合同》; ……	基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。 鉴于本基金是目标ETF的联接基金,本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金基金份额参加或者委派代表参加目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时,本基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为:在目标ETF基金份额持有人大会的权益登记日,本基金持有目标ETF基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例,计算结果按照四舍五入的方法,保留到整数位。本基金折算为目标ETF后的每一参会份额和目标ETF的每一参会份额拥有平等的投票权。若本基金启用侧袋机制且特定资产不包括目标ETF,则本基金的主袋账户份额持有人可以凭持有的主袋账户份额直接参加或者委派代表参加目标ETF基金份额持有人大会并表决。 本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权,但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。 本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF的基金份额持有人大会的,须先遵照本基金基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会,本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标ETF的基金份额持有人大会的,由本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF的基金份额持有人大会。 本基金份额持有人大会暂不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的,以届时有效的法律法规为准。 一、召开事由 当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会,但法律法规、中国证监会另有规定的除外: …… (11)基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会; …… 2、在不违反法律法规规定和《基金合同》约定,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会: …… (5)基金管理人、基金登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、定期定额投资计划、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押等业务规则; …… (8)由于目标ETF变更标的指数、变更交易方式、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并而变更基金投资目标、范围或策略; ……
第十二部分 基金的投资	一、投资目标 本基金通过主要投资于目标ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 二、投资范围 本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货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)。 …… 基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%,投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债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%的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。 三、投资策略 1、股票投资策略 本基金主要采用完全复制法,即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但在因特殊情形导致基金无法完全复制标的指数成份股时,基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于:(1)法律法规的限制;(2)标的指数成份股流动性严重不足;(3)标的指数成份股紧长期停牌;(4)标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并;(5)标的指数成份股紧发现金股息;(6)标的指数成份股定期或临时调整;(7)标的指数编制方法发生变化;(8)其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 …… 五、业绩比较基准 …… 本基金以“紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化”作为投资目标,在投资中将不低于非现金基金资产的80%的资产投资于标的指数成份股及备选成份股,且每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,因此选取“沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%”作为业绩比较基准,能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征。 未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外),指数编制机构退出等情形,基金管理人应当及时变生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,基金合同终止。 六、风险收益特征 本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪沪深300指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 ……	一、投资目标 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 二、投资范围 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货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)。 …… 基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%,投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;本基每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,因此选取“沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%”作为业绩比较基准,能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征。 未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外),指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,基金合同终止。但下文“目标ETF发生相关变更情形的处理方式”另有约定的除外。 六、风险收益特征 本基金为ETF联接基金,所跟踪的目标ETF为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金主要通过投资于目标ETF来实现对标的指数的紧密跟踪,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 七、目标ETF发生相关变更情形的处理方式 目标ETF出现下述情形之一的,本基金将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金,无需召开基金份额持有人大会:若届时本基金管理人已有跟踪该标的指数的指数基金,则本基金将本着维护投资者合法权益的原则,履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地,本基金基金同中将删除关于目标ETF的表述部分,或变更标的指数,届时将由基金管理人另行公告。 1、目标ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现; 2、目标ETF终止上市; 3、目标ETF基金合同终止; 4、目标ETF与其他基金进行合并; 5、目标ETF的基金管理人发生变更; 6、中国证监会规定的其他情形。 若目标ETF变更标的指数,本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF。但目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的,本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决,目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的,本基金在履行适当程序后,可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。 ……
第十三部分 基金的财产	一、基金资产总值 基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。 ……	一、基金资产总值 基金资产总值是指基金拥有的目标ETF基金份额、各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。 ……
第十四部分 基金资产估值	二、估值对象 基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、衍生工具和银行存款本息、应收款项,其它投资等资产及负债。 四、估值方法 …… 七、暂停估值的情形 …… 十、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第9项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 ……	二、估值对象 基金所拥有的目标ETF基金份额、股票、债券、资产支持证券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 四、估值方法 1、目标ETF估值方法 对持有的目标ETF基金,按估值日目标ETF基金的份额净值估值。如该日目标ETF未公布净值,则按目标ETF最近公布的净值估值。 …… 七、暂停估值的情形 …… 4、基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形; …… 十、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第10项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 ……
第十五部分 基金费用与税收	一、基金费用的种类 …… 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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.50%÷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 …… 2、基托管人的托管费 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 …… 上述“一、基金费用的种类”中第4—10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: …… 3、《基金合同》生效前的相关费用; 4、标的指数许可使用费,本基金标的指数许可使用费由基金管理人承担; ……	一、基金费用的种类 …… 10、基金投资目标ETF的相关费用(包括但不限于目标ETF的交易费用、申赎费用等); …… 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扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.15%÷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扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0) …… 2、基托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E×0.05%÷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扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0) …… 上述“一、基金费用的种类”中第4—11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: …… 3、《基金合同》生效前的相关费用根据《万家沪深300指数证券投资基金基金合同》的约定执行; (删除) ……
第十七部分 基金的会计与审计	一、基金会计政策 …… 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则:如果《基金合同》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度披露; ……	一、基金会计政策 …… 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日; ……
第十八部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括: (一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告 …… 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。 …… 5、基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告。 基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人应当在基金份额发售的3日前,将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上,将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上,其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点;基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。 (二)《基金合同》生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。 (三)基金净值信息 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。 …… (五)基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 …… 《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。 如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。 …… (六)临时报告 …… 前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件: …… 8、基金募集期延长或提前结束募集; ……	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括: (一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 …… 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。 …… 5、基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告。 基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人应当在基金份额发售的3日前,将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上,将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上,其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点;基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。 (二)《基金合同》生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。 (三)基金净值信息 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、基金销售机构网站或者营