

# 万家中证创业成长指数分级证券投资基金 更新招募说明书

(2014年第2号)

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一四年九月

## 重要提示

本基金由基金管理人申请并经中国证监会证监许可[2012]324号文核准募集，基金合同生效日为2012年8月2日。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。当投资者赎回时，所得或会高于或会低于投资者先前所支付的金额。

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，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，本基金的特定风险（指数投资风险、投资替代风险、跟踪偏离风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险以及基金份额折算等业务办理过程中的特定风险）等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日万家创业成长份额的净赎回申请超过前一开放日全部基金份额（包括万家创业成长份额、万家创业成长A份额与万家创业成长B份额）的10%时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部万家创业成长份额。

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。投资者在认购(或申购)本基金时，请认真阅读本基金的招募说明书和《基金合同》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2014年8月2日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年6月30日，财务数据未经审计。

## 目 录

一、绪言 .....	4
二、释义 .....	5
三、基金管理人 .....	12
四、基金托管人 .....	22
五、相关服务机构 .....	27
六、基金份额分级与净值计算规则 .....	34
七、基金的募集 .....	38
八、基金合同的生效 .....	39
九、万家创业成长份额的申购与赎回 .....	40
十、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的上市交易 .....	52
十一、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管等其他相关业务 .....	54
十二、基金的份额配对转换 .....	56
十三、基金的投资 .....	58
十四、基金的业绩 .....	67
十五、基金的财产 .....	69
十六、基金资产的估值 .....	71
十七、基金的收益与分配 .....	76
十八、基金的费用与税收 .....	77
十九、基金份额折算 .....	80
二十、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的终止运作 .....	89
二十一、基金的会计和审计 .....	91
二十二、基金的信息披露 .....	92
二十三、风险揭示 .....	98
二十四、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	102
二十五、基金合同内容摘要 .....	105
二十六、托管协议内容摘要 .....	126
二十七、基金份额持有人服务 .....	139
二十八、其他应披露事项 .....	141

二十九、招募说明书的存放及查阅方式 .....	142
三十、备查文件 .....	143

## 一、绪言

本招募说明书依据《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》)、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等有关法律法规以及《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了万家中证创业成长指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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,并经中国证监会核准。基金合同是约定《基金合同》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：

《基金合同》	《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》及对该合同的任何有效的修订和补充
中国	中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》
元	中国法定货币人民币元
基金或本基金	依据《基金合同》所募集的万家中证创业成长指数分级证券投资基金
招募说明书	《万家中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书》，即用于公开披露本基金的基金管理人及基金托管人、相关服务机构、基金份额分级与净值计算规则、基金的募集、基金合同的生效、万家创业成长份额的申购和赎回、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的上市交易、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管等其他相关业务、基金份额配对转换、基金的投资、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金份额折算、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的终止运作、基金的会计和审计、基金的信息披露、风险揭示、基金合同的变更、终止与基金财产的清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、基金份额持

	有人的服务、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其定期的更新
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《万家中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
上市交易公告书	《万家中证创业成长指数分级证券投资基金之万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额上市交易公告书》
《业务规则》	万家基金管理有限公司、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金份额持有人	根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
基金代销机构	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基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构，其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的机构必须具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位
销售机构	基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点

注册登记业务	基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	办理注册登记业务的机构。本基金的基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
注册登记系统	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统
证券登记结算系统	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
《基金合同》当事人	受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受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
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
募集期	自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限



基金存续期	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
日/天	公历日
月	公历月
工作日	上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
中证创业成长指数	由上海和深圳证券交易所主板、中小板以及创业板市场中选取 100 只股票作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映沪深证券市场创业和成长特征较为显著的中小市值公司的整体状况。中证创业成长指数由中证指数有限公司编制并发布
基金份额分级	本基金的基金份额包括万家中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额、万家中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额与万家中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额。万家中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额与万家中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变
万家创业成长份额	万家中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额
万家创业成长 A 份额	万家中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额
万家创业成长 B 份额	万家中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额
场外	通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构办理基金认购、申购和赎回等业务的场所
场内	通过深圳证券交易所会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理基金认购、申购、赎回和上市交易业务

	的场所
认购	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买万家创业成长份额的行为。万家创业成长份额的日常申购自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理
赎回	基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出万家创业成长份额的行为。万家创业成长份额的日常赎回自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理
巨额赎回	在单个开放日，万家创业成长份额的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额（包括万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额）的 10% 时的情形
上市交易	基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的行为
基金账户	基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
深圳证券账户	在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户

场外份额	登记在注册登记系统下的基金份额
场内份额	登记在证券登记结算系统下的基金份额
系统内转托管	基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
跨系统转托管	基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为
份额配对转换	根据《基金合同》的约定，万家创业成长份额与万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额之间的配对转换，包括分拆与合并
自动分离	投资者在场内认购的每两份万家创业成长份额在发售结束后按 1:1 比例自动确认为一份万家创业成长 A 份额与一份万家创业成长 B 份额的行为
分拆	根据《基金合同》的约定，基金份额持有人将其持有的每两份万家创业成长份额的场内份额申请转换成一份万家创业成长 A 份额与一份万家创业成长 B 份额的行为
合并	根据《基金合同》的约定，基金份额持有人将其持有的每一份万家创业成长 A 份额与一份万家创业成长 B 份额进行配对申请转换成两份万家创业成长份额的场内份额的行为
基金转换	投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
定期定额投资计划	投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金收益	基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、

	证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。
基金资产总值	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
货币市场工具	现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具
指定媒体	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
不可抗力	《基金合同》当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

### 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 9 层（200122）

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：中国证监会证监基金字[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：021-38619810

传真：021-38619888

股权结构：

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。目前管理十八只开放式基金，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（LOF）、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投资基金、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、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、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、万家日日薪货币市场证券投资基金、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、万家上证 380 交易

型开放式指数证券投资基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金和万家城市建设主题纯债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，硕士学历，高级会计师，注册企业风险管理师。历任莱钢股份公司炼铁厂财务科科长，莱钢股份公司财务处成本科科长，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，齐鲁证券计划财务部总经理，齐鲁证券副总经理兼财务负责人等职。现任齐鲁证券有限公司党委委员、总经理兼财务负责人。2011年3月起任本公司董事长，现兼任万家共赢资产管理有限公司董事长。

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，现任齐鲁证券有限公司副总经理兼合规总监、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。

独立董事陈增敬先生，中国民主建国会成员，博士研究生，教授，曾任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（现更名为山东大学齐鲁证券金融研究院）常务副院长兼教授，现任山东大学齐鲁证券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副教授、副院长，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，新疆财经大学金融系支教教师，上海财经大学金融学院副院长、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。

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。

## 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。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月起加入本公司，现任公司综合管理部总监。

监事蔡鹏鹏女士，本科，先后任职于北京幸福之光商贸有限公司、北方之星数码技术（北京）有限公司、路通资讯香港有限公司，2007年4月起加入本公司，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：詹志令先生，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，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

月起任本公司副总经理。

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，任董事会秘书、总经理助理。2013年4月起任本公司副总经理。

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。2007年9月加入万家基金，历任总经理、监事会主席等职，2012年4月起任公司督察长。

#### 4、基金经理简历

吴涛先生，硕士。曾任天同证券有限责任公司上海营业部副总经理、天同证券有限责任公司深圳营业部总经理、南方总部副总经理等职，2002年起任万家基金管理有限公司监察稽核部总监，负责公司投资风险管理、监察稽核等工作，现任量化投资部总监。2012年8月起任本基金基金经理，兼任万家180指数证券投资基金基金经理、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

委员会主席：吕宜振

副主席：刘芳洁

委员：吴涛、华光磊、吴印、孙驰、刘荆、高翰昆

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）、研究部总监（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，权益投资部副总监、万家和谐基金基金经理、万家双引擎基金基金经理

吴印先生，权益投资部副总监，万家行业优选股票基金（LOF）基金经理、万



## 家精选股票基金基金经理

孙驰先生，固定收益部总监、万家货币基金基金经理、万家增强收益债券基金基金经理、万家强化收益定期开放债券基金基金经理、万家日日薪货币市场证券投资基金基金经理、万家岁得利基金基金经理

刘荆先生，研究部副总监

高翰昆先生，交易部副总监

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、依法募集基金，办理或者委托经取得基金代销业务资格的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回、配对转换、折算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资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、

《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13、按《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基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

23、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；

24、基金管理人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存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会决定；

26、建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

27、有关法律法规和中国证监会规定和《基金合同》约定的其他职责。

#### （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）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （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）越权或违规经营；
- （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权益；
- （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）贬损同行，以抬高自己；
- （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) 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) 不以任何形式为除本基金管理人以外的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，监察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；由监察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。公司督察长和内部监察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) 公司合规控制委员会定期或不定期对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。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部风险控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：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

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

### （二）主要人员情况

截至 2014 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 170 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2014 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 380 只。自 2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 44 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优

良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012 年六次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2013 年中国工商银行资产托管部第七次通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律法规规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。



(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。



## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、场外发售机构

##### (1) 直销机构

万家基金管理有限公司直销中心及网上交易平台

住所：上海市浦东新区浦电路 360 号 9 层

办公地址：上海市浦东新区浦电路 360 号 9 层

法定代表人：毕玉国

电话：021-38619837

传真：021-38619998

联系人：周慧

客户服务热线：95538 转 6；400-888-0800

网址：<http://www.wjasset.com/>

投资者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本公司网站公告。网上交易网址：

<https://trade.wjasset.com/>

##### (2) 场外代销机构

#### 1) 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

法定代表人：姜建清

联系人：王均山

传真：(010) 66107914

客户服务电话：95588

公司网站：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

#### 2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

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

4) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市北京东路 689 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

5) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

6) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

7) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：400-888-8788, 10108998, 95525

网址：www.ebscn.com

8) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

9) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦 10 层

法定代表人：王开国

客户服务热线：400-8888-001、95553

网址：www.htsec.com

10) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：万建华

客服电话：400-888-8666

网址：www.gtja.com

11) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：林治海

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

12) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法人代表：王东明

客户服务电话：95558

网址：www.cs.ecitic.com

13) 中信证券（浙江）有限责任公司（原中信金通证券）

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法人代表：沈强

客服电话：0571-96598

网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

14) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：高冠江

客户服务电话：400-800-8899

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

15) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号

法定代表人：冯戎

客户服务电话：4008-000-562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

16) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈有安

客户服务电话：400-888-8888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

17) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法人代表人：何如

客户服务电话：95536

网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

18) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路758号24楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

法定代表人：张建华

客户服务电话：021-32229888 转 25115

网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

## 19) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

## 20) 山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.sxzq.com

## 21) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

客户服务电话：400-891-8918, 021-962518

网址：www.962518.com

## 22) 中信建投证券有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-888-8108

网址：www.csc108.com

## 23) 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

法定代表人：吴永敏

客户服务电话：6008601555

网址：www.dwjq.com.cn

## 24) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层 01 单元

法定代表人：高竹

客户服务电话：400-184-0028



网址：<http://wkzq.com.cn>

25) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：95579

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

26) 日信证券有限责任公司

注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

客户服务电话：400-660-9839

网址：[www.rxzq.com.cn](http://www.rxzq.com.cn)

27) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

客户服务电话：400-8888-111, 95565

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

28) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

客户服务电话：4008895523

网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

29) 深圳众禄基金销售有限公司

客服电话：4006-788-887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

30) 北京展恒基金销售有限公司

客服电话：400-888-6661

网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

31) 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](http://www.1234567.com.cn)

## 32) 杭州数米基金销售有限公司

客服电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

## 33) 华鑫证券有限责任公司

客服电话：021-32109999；029-68918888

网址：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

## 34) 和讯信息技术有限公司

客服电话：400-920-0022

公司网站：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

## 35) 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](http://www.jyzq.cn)

## 36) 万银财富基金销售有限公司

客服热线：400-808-0069

公司网站：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

## 37) 华龙证券有限责任公司

客服电话：4006898888

网址：[www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

## 38) 东海证券股份有限公司

客服电话：95531；400-8888-588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

## 2、场内发售机构

场内代销机构是指具有基金代销资格的深圳证券交易所会员，具体会员单位名单详见深圳证券交易所网站：

[http://www.szse.cn/main/marketdata/catalog\\_hylb.aspx](http://www.szse.cn/main/marketdata/catalog_hylb.aspx)

本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。具体名单可在深圳证券交易所网站

查询，基金管理人将不就此事项进行公告。

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) 基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

电话：(010) 58598888

传真：(010) 58598824

(三) 律师事务所

名称：北京市大成律师事务所上海分所

住所：上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 24 层

电话：(021) 3872 2416

联系人：华涛

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所

住所：北京市东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层 (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 (200120)

联系电话：(021) 22288888

传真：(021) 22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳，汤骏

## 六、基金份额分级与净值计算规则

(一) 基金份额结构

本基金的基金份额包括万家中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额（简称“万家创业成长份额”）、万家中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“万家创业成长 A 份额”）与万家中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“万家创业成长 B 份额”）。其中，万家创业成长 A

份额、万家创业成长 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变,且两类基金份额的基金资产合并运作。

## (二) 基金份额的自动分离与分拆规则

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,投资者场外认购的全部基金份额确认为万家创业成长份额;投资者场内认购的全部基金份额将按 1:1 的比例自动分离预期收益与风险不同的两个份额类别,即万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额。

《基金合同》生效后,万家创业成长份额只接受场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。

基金管理人将根据《基金合同》约定办理万家创业成长份额与万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额之间的份额配对转换业务。

投资者可选择将其场内申购的万家创业成长份额按 1:1 的比例分拆成万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额。投资者可按 1:1 的配比将其持有的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额申请合并为万家创业成长份额后赎回。

投资者在场外申购的万家创业成长份额不得申请进行分拆(《基金合同》另有规定的除外),但可通过跨系统转托管至场内并申请将其按 1:1 的比例分拆为万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额。

无论是定期份额折算,还是不定期份额折算(有关本基金的份额折算详见《基金合同》“第二十部分 基金份额折算”),其所产生的万家创业成长份额不进行自动分离。投资人可选择将上述折算产生的万家创业成长份额按 1:1 的比例分拆为万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额。

## (三) 万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的参考净值计算规则

根据万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的风险和收益特性不同,本基金份额所分离的这两类份额具有不同的参考净值计算规则。

在存续期内,万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的参考净值计算规则如下:

1、万家创业成长 A 份额的约定收益率为一年期银行定期存款利率加上 3.5%,一年期银行定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期存款基准利率为准;基金合同生效日所在年度的约定年基准收益率为

基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率+3.5%。年基准收益均以 1.000 元为基础进行计算。

2、本基金每个工作日对万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额进行参考净值计算。在进行万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的参考净值计算时，本基金净资产优先确保万家创业成长 A 份额的本金及其约定收益，本基金在优先确保万家创业成长 A 份额的本金及约定收益后的剩余净资产分配予万家创业成长 B 份额。每份万家创业成长 A 份额的本金为 1.000 元，每份万家创业成长 A 份额的约定收益以 1.000 元为基础，根据其约定年基准收益率计算的约定日收益率及截至计算日应计收益天数进行单利计算。

3、在基金合同生效日所在会计年度或存续的其他会计年度内，若未发生《基金合同》规定的不定期份额折算，则万家创业成长 A 份额在净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日或该会计年度首日至计算日的实际天数计算；若发生《基金合同》规定的不定期份额折算，则万家创业成长 A 份额在净值计算日应计收益的天数应按照最近一个不定期份额折算日至计算日的实际天数计算。

4、每两份万家创业成长份额所代表的资产净值等于一份万家创业成长 A 份额和一份万家创业成长 B 份额的资产净值之和。

基金管理人并不承诺或保证万家创业成长 A 份额的基金份额持有人的约定收益，如在存续期内本基金资产出现极端损失情况下，万家创业成长 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

#### （四）基金份额净值的计算

本基金分别计算并公告万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值

##### 1、万家创业成长份额的基金份额净值计算

$T$  日万家创业成长份额的基金份额净值= $T$  日闭市后的本基金的基金资产净值/ $T$  日本基金基金份额余额总数

其中，基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值， $T$  日本基金基金份额余额总数为  $T$  日万家创业成长份额、万万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的份额余额之和。

##### 2、万万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值计算

假设  $T$  日为基金份额净值计算日， $T=1, 2, \dots, N$ ； $N$  为当年实际天数； $t=\min\{\text{自}$

当年首日至 T 日实际天数，自基金合同生效日至 T 日实际天数，自最近一个不定期份额折算日至 T 日实际天数}； $NAV_T^A$  为 T 日万家创业成长 A 份额的基金份额参考净值； $NAV_T^B$  为 T 日万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值； $NAV_T$  为 T 日万家创业成长份额的基金份额净值；R 为万家创业成长 A 份额的约定年收益率。

$$NAV_T^A = 1 + R \times \frac{t}{N}$$

$$NAV_T^B = 2 \times NAV_T - NAV_T^A$$

万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （五）万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

## 七、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律、法规及《基金合同》的有关规定募集。并经中国证监会 2012 年 3 月 12 日证监许可[2012]324 号文核准募集。自 2012 年 7 月 2 日起向全社会公开发售。

截止到 2012 年 7 月 27 日，本基金的募集工作已顺利结束，经安永华明会计师事务所验资，本次募集的有效净认购金额为 412,353,281.39 元人民币。

本次募集有效认购总户数 2575 户。按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，有效认购款项连同有效认购款项在基金验资确认日之前产生的利息，合计折算为 412,423,884.23 份基金份额。

## 八、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

根据当时有效的法律法规的有关规定，本基金基金合同于 2012 年 8 月 2 日生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。



## 九、万家创业成长份额的申购与赎回

投资者可通过场内或场外两种方式对万家创业成长份额进行申购与赎回。万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额只上市交易，不接受申购与赎回。

### （一）申购与赎回的场所

投资者办理万家创业成长份额场内申购与赎回业务的场所为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务。

投资者办理万家创业成长份额场外申购与赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资者需使用基金账户办理万家创业成长份额场外申购、赎回业务。

本基金的场内、场外代销机构名单将由基金管理人在招募说明书、发售公告或其它相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。若销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

基金管理人于 2012 年 10 月 12 日起开始办理万家创业成长份额的申购和赎回业务，具体业务办理时间等情况在开放申购和赎回业务公告中规定。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理万家创业成长份额的申购、赎回。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其万家创业成长份额申购、赎回的价格为下一开放日万家创业成长份额申购、赎回的价格。

若出现新的证券市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日 2 日前在指定媒体公告。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的万家创业成

长份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、投资者办理万家创业成长份额的场外赎回业务时，赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、投资者办理万家创业成长份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行；

6、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守《基金合同》和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

##### 2、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

销售机构对申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申购申请。申购和赎回的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，

若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

#### （五）申购与赎回的数额限制

##### 1、申购的数额限制

（1）投资者场内申购时，每笔最低申购金额为 50000 元。

（2）自 2013 年 3 月 28 日起投资人通过代销渠道和本公司网上直销中心办理万家中证创业成长指数分级证券投资基金场外申购时，单笔申购（含转换转入）最低金额为 100 元人民币（含申购费）；通过本公司直销中心单笔申购（含转换转入）最低金额为 500 元人民币（含申购费）。投资人参与万家中证创业成长指数分级证券投资基金定期定额投资每期最低扣款金额为 100 元人民币（含申购费）。

（3）基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述对申购的金额和赎回的份额、最低基金份额余额和累计持有基金份额上限的数量限制。基金管理人必须在调整前 2 日内至少在一家指定媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

法律法规、中国证监会另有规定的除外。

##### 2、赎回的数额限制

（1）本基金不设场外单笔最低赎回份额；

（2）基金份额持有人场内赎回时，赎回份额必须是整数份额，并且每笔赎回最大不超过 99,999,999 份基金份额。

##### 3、在销售机构保留的基金份额最低数量限制

基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1.00 份的，在赎回时需一次全部赎回。

在不违背有关法律法规和基金合同规定的前提下，基金管理人可根据市场情况，调整上述第 1 至 3 项的数额限制。基金管理人必须最迟在调整生效日 3 个工作日前在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购与赎回的费用

自 2013 年 4 月 15 日起，本基金对通过直销渠道申购、赎回的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购、赎回费率。养老金客户指基本养老基金

与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

## 1、申购费用

### (1) 申购费率

通过基金管理人的直销渠道的养老金客户申购费率见下表：

申购金额 (M, 含申购费)	特定申购费率
M < 100 万元	0.12%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.08%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.04%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

本基金其他投资者申购费率：

	申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
场外申购费率	M < 100 万元	1.2%
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.8%
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%
	M ≥ 500 万元	每笔 1000 元
场内申购费率	深圳证券交易所会员单位应按照场外申购费率设定投资者的场内申购费率	

(2) 本基金的申购费用由申购投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售和注册登记等各项费用，不列入基金财产。

(3) 若投资者在一个交易日内多笔申购，则根据每笔申购金额所对应的费率档次分别计算每笔申购费用。

## 2、赎回费用

### (1) 赎回费率

通过基金管理人的直销渠道的养老金客户赎回费率见下表：

持有期限 (N)	特定赎回费率
----------	--------

N < 1年	0.125%
1年 ≤ N < 2年	0.0625%
N ≥ 2年	0%

对养老金客户实施特定赎回费率而收取的赎回费全额归入基金财产。

本基金其他投资者的赎回费率具体为：

	持有期限 (N)	赎回费率
场外赎回费率	N < 1年	0.50%
	1年 ≤ N < 2年	0.25%
	N ≥ 2年	0
场内赎回费率	本基金的场内赎回费率为固定值 0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。	

注：赎回费的计算中，1年指365个公历日。

(2) 本基金的赎回费用在基金份额持有人赎回本基金份额时收取，本基金赎回费总额的25%归入基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(3) 从场内跨系统转托管至场外的基金份额，从场外赎回时，其持有期限从跨系统转托管转入确认日开始计算。

4、若因法律法规的修改、更新或新法律法规的颁布施行导致本基金的申购或赎回费率与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应的变更或调整，同时就该等变更或调整进行公告。

5、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式。在按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以调低基金申购费率和基金赎回费率；调高基金申购费率和基金赎回费率，应召开基金份额持有人大会通过决议并报中国证监会备案。最新的申购费率、赎回费率或收费方式在更新的招募说明书中列示。费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率开始实施日3个工作日前在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

6、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人按相关监管部门要求履行必要手续后，可以调低基金申购费率和基金赎回费率。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以调低基金申购

费率和基金赎回费率。

基金管理人最迟应于新的费率开始实施日 3 个工作日前在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算

##### 1、万家创业成长份额申购份额的计算

申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额-申购费用）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日万家创业成长份额的基金份额净值

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日万家创业成长份额的基金份额净值为基准计算。场外申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内申购份额计算结果采用截位方式保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的申购资金返还投资者资金账户。

例：某投资者（养老金客户）投资 50,000 元通过场外申购万家创业成长份额，其对应的场外申购费率为 0.12%，假设申购当日万家创业成长份额的基金份额净值为 1.050 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=50,000/（1+0.12%）=49,940.07 元

申购费用=50,000-49,940.07=59.93 元

申购份额=49,940.07/1.050=49,940.07 份

即：投资者（养老金客户）投资 50,000 元从场外申购万家创业成长份额，假设申购当日万家创业成长份额的基金份额净值为 1.050 元，则其可得到 49,940.07 份场外万家创业成长份额。

例：某投资者（非养老金客户）投资 50,000 元通过场外申购万家创业成长份额，其对应的场外申购费率为 1.2%，假设申购当日万家创业成长份额的基金份额净值为 1.050 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=50,000/（1+1.2%）=49,407.11 元

申购费用=50,000-49,407.11=592.89 元

申购份额=49,407.11/1.050=47,054.39 份

即：投资者（非养老金客户）投资 50,000 元从场外申购万家创业成长份额，假设申购当日万家创业成长份额的基金份额净值为 1.050 元，则其可得到 47,054.39 份场外万家创业成长份额。

例：如上例，该投资者（非养老金客户）选择通过场内申购万家创业成长份额，其对应的场内申购费率为 1.2%，则其可得到 47,054 份场内万家创业成长份额，不足 1 份部分对应的申购资金返还投资者。

$$\text{返还金额} = 49,407.11 - 47,054 \times 1.050 = 0.41 \text{ 元}$$

## 2、赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的万家创业成长份额的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日万家创业成长份额的基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以赎回当日万家创业成长份额的基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某基金份额持有人（养老金客户）赎回 10,000 份万家创业成长份额，且持有时间不满 1 年，赎回费率为 0.125%，假设赎回当日的万家创业成长份额的基金份额净值为 1.050 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.050 = 10,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10,500 \times 0.125\% = 13.13 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,500 - 13.13 = 10,486.87 \text{ 元}$$

即，该基金份额持有人（养老金客户）可得到的净赎回金额为 10,486.87 元。

例：某基金份额持有人（非养老金客户）赎回 10,000 份万家创业成长份额，且持有时间不满 1 年，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日的万家创业成长份额的基金份额净值为 1.050 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.050 = 10,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10,500 \times 0.5\% = 52.50 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,500 - 52.50 = 10,447.50 \text{ 元}$$

即，该基金份额持有人（非养老金客户）可得到的净赎回金额为 10,447.50

元。

### 3、万家创业成长份额基金份额净值的计算

T 日万家创业成长份额基金份额净值=T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金（包括万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额）的基金份额余额总数

T 日的万家创业成长份额的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。万家创业成长份额基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### （八）申购和赎回的注册登记

万家创业成长份额申购与赎回的注册登记业务，按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

中国证券登记结算有限责任公司可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一家指定媒体公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者对万家创业成长份额的申购申请：

- 1、不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- 2、证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- 3、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- 4、法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- 5、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 4 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停申购公告。

#### （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式



除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人对万家创业成长份额的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- 1、不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2、证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- 4、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第 3 款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定媒体公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停万家创业成长份额的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体上公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，万家创业成长份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额（包括万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额）的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按

正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额（包括万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额）的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

万家创业成长份额连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在至少一家指定媒体公告。

#### (十二) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日万家创业成长份额的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日万家创业成长份额的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新

开放申购或赎回日公告最近一个工作日万家创业成长份额的基金份额净值。

### （十三）基金的转换

1、目前本基金在本公司直销中心、直销网上交易和直销电话委托等渠道开通与万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）（简称：万家优选，基金代码：161903）、万家增强收益债券型证券投资基金（基金简称：万家债券，基金代码：161902）、万家180指数证券投资基金（基金简称：万家180指数，基金代码：519180）、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）（基金简称：万家红利，基金代码：161907）与万家稳健增利债券型证券投资基金（简称：万家稳增，基金代码：A类：519186，C类：519187）、万家和谐增长混合型证券投资基金（前端收费模式）（简称：万家和谐（前），基金代码：519181）、万家货币市场证券投资基金（简称：万家货币，基金代码：519508）、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金（简称：万家引擎，基金代码：519183）、万家精选股票型证券投资基金（简称：万家精选，基金代码：519185）、万家信用恒利债券型证券投资基金（简称：万家信用恒利债券，基金代码：519188）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）（万家添利：161908）、万家日日薪货币市场证券投资基金（简称：万家日日薪A，基金代码：519511；万家日日薪B，基金代码：519512）之间的转换业务。

在代销渠道，在同一注册登记机构登记（中登上海TA和中登深圳TA不属于同一注册登记机构），由同一销售机构销售的、使用同一个交易账户的由本公司管理的基金可以互相转换。开通转换的具体代销机构名称和在该机构开通的可转换基金的名称，参见基金管理人公告。

2、本公司所有基金间转换费用的计算规则如下：

基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费差异情况和转出基金的赎回费而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

（1）基金转换申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金的申购费率和转出基金的申购费率之差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

（2）转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用，赎回费的25%归入转出基金资产。

基金转换业务规则详见本公司基金转换业务的相关公告。

### （十四）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资者可与销售机构就本基金申请定期定额投资业务约定每期固定扣款金额，定期定额申购每期最低扣款金额不少于人民币 100 元。具体最低扣款金额遵循投资者所开户的销售机构的规定。

新增加的开通定期定额投资的代销机构，基金管理人将随时进行公告，具体可到基金管理人网站查询。

## 十、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的上市交易

本基金《基金合同》生效后，基金管理人将根据有关规定，申请万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易。

### （一）上市交易的地点

深圳证券交易所

### （二）上市交易的时间及交易代码

万家中证创业成长指数分级证券投资基金 A 份额、B 份额于 2012 年 10 月 12 日开始在深圳证券交易所上市交易，万家中证创业成长 A 份额，简称：万家创 A，代码：150090；万家中证创业成长 B 份额，简称：万家创 B，代码：150091。

### （三）上市交易的规则

1、万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易；

2、万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市首日的开盘参考价分别为前一交易日各自的基金份额参考净值；

3、万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；

4、万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；

5、万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；

6、万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

### （四）上市交易的费用

万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

### （五）上市交易的行情揭示

万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额在深圳交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额参考净

值。

（六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

（七）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，《基金合同》相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 十一、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管等其他相关业务

### （一）基金份额的登记

1、本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的万家创业成长份额登记在注册登记系统基金份额持有人的基金账户下；万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额，以及场内申购的万家创业成长份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人的深圳证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的万家创业成长份额可以申请场内赎回；登记在注册登记系统中的万家创业成长份额可申请场外赎回。

3、登记在证券登记结算系统中的万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。但可按 1：1 比例申请合并为万家创业成长份额后再申请场内赎回。

### （二）系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理万家创业成长份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有万家创业成长份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易或万家创业成长份额场内赎回的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4、基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取系统内转托管费。

### （三）跨系统转托管

1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的万家创业成长份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2、万家创业成长份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责

任公司的相关规定办理。

3、基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取跨系统转托管费。

#### （四）基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的有关规定办理。

#### （五）基金的冻结与解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。



## 十二、基金的份额配对转换

本基金《基金合同》生效后，在万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的存续期内，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

（一）份额配对转换是指本基金的万家创业成长份额与万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。

1、分拆。基金份额持有人将其持有的每两份万家创业成长份额的场内份额申请转换成一份万家创业成长 A 份额与一份万家创业成长 B 份额的行为。

2、合并。基金份额持有人将其持有的每一份万家创业成长 A 份额与一份万家创业成长 B 份额进行配对申请转换成两份万家创业成长份额的场内份额的行为。

（二）份额配对转换的业务办理机构

投资人可以通过依据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登”）有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务，按照中登有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位名单可向本公司及中登网站查询。

万家基金直销中心提供份额配对转换业务的代办功能，若投资者的基金份额托管于不具备配对转换业务资格的券商处，可通过万家基金直销中心提交份额配对转换业务申请。

基金投资者应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、基金注册登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

（三）份额配对转换的业务办理时间

本公司自 2012 年 10 月 12 日起，开通万家中证创业成长指数分级证券投资基金的份额配对转换业务。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），业务办理时间为上午 9：30-11：30 和下午 1：00-3：00。在此时间之外不办理份额配对转换业务。若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

（四）份额配对转换的原则

- 1、份额配对转换以份额申请。
- 2、申请进行“分拆”的万家创业成长份额的场内份额必须是偶数。
- 3、申请进行“合并”的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。
- 4、万家创业成长的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转托管为万家创业成长份额的场内份额后方可进行。
- 5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

深圳证券交易所、基金注册登记机构或基金管理人可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前 2 日在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。

#### （五）份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

#### （六）暂停份额配对转换的情形

- 1、深圳证券交易所、基金注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。
- 2、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

#### （七）份额配对转换的业务办理费用

份额配对转换业务办理机构可对配对转换业务的办理酌情收取一定的佣金，具体见相关业务公告。

## 十三、基金的投资

### （一）投资目标

本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段，在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对中证创业成长指数的有效跟踪。

### （二）投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证创业成长指数成份股及其备选成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，中证创业成长指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金还可投资于法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资策略

本基金为指数型基金，采用完全复制方法进行投资运作，按照成份股在中证创业成长指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

#### 1、资产配置策略

本基金投资于中证创业成长指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数

的有效跟踪。

## 2、股票投资策略

本基金采用完全复制方法来跟踪中证创业成长指数，按照中证创业成长指数成份股的基准权重构建股票指数化投资组合。为求基金实际投资组合尽量贴近标的指数的表现，减小跟踪误差，基金管理人将根据实际情况对基金投资组合进行适当调整：

(1) 本基金股票组合根据所跟踪的中证创业成长指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整；

(2) 根据指数编制规则，中证创业成长指数成份股因增发、送配、分红或其他原因所造成的临时成份股调整，本基金将根据中证创业成长指数成份股临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

(3) 根据指数编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，对投资组合进行优化调整，以尽量减小指数成份股变动所造成的跟踪误差；

(4) 根据本基金的申购、赎回、分红等情况对投资组合的影响，以尽可能贴近标的指数表现为目的，对投资组合进行相应调整；

(5) 指数成份股因受股票停牌限制、股票流动性限制等市场因素限制或法律法规、基金合同等合规因素限制，使本基金无法依据指数购买某成份股的情况，本基金可以根据实际情况对投资组合进行调整；

(6) 其他影响指数复制的因素，本基金可以根据实际情况，结合以往经验，对本基金资产进行适当调整，力争在控制风险的前提下，获得更接近标的指数的收益率。

## 3、债券投资策略

本基金基于流动性管理的需要，以保证基金资产流动性为目的，可以投资于国债、金融债等到期日在一年以内的债券。本基金在构建债券投资组合时，合理评估收益性、流动性和信用风险，有效利用基金资产，提高基金资产投资收益。

### (四) 投资限制

#### 1、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金投资于中证创业成长指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 90%；

(2) 现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(4) 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 40%；

(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(9) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(10) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自《基金合同》生效之日起开始。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

#### (五) 标的指数与业绩比较基准

本基金以中证创业成长指数为标的指数。

中证创业成长指数由中证指数有限公司编制并发布。其由上海和深圳证券交易所主板、中小板以及创业板市场中选取 100 只股票作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映沪深证券市场创业和成长特征较为显著的中小市值公司的整体状况。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证创业成长指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$

由于本基金投资标的指数为中证创业成长指数，且投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，本基金认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或是本基金的标的指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金管理人在征得基金托管人同意的情况下，履行适当程序并报中国证监会核准后按实际情况变更基金的标的指数和业绩比较基准，并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

#### (六) 风险收益特征

本基金为指数分级基金，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。万家创业成长份额为常规指数基金份额，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；万家创业成长 A 份

额，具有较低风险、收益相对稳定的特征；万家创业成长 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

（七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（八）基金的融资、融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

（九）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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 9 月 2 日复核了本招募说明书中的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及重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2014 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	权益投资	15,388,962.25	93.33
	其中：股票	15,388,962.25	93.33
2	固定收益投资	701,813.63	4.26
	其中：债券	701,813.63	4.26
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	362,423.56	2.20
7	其他资产	35,150.72	0.21
8	合计	16,488,350.16	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股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	68,037.44	0.42
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,233,858.09	50.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,999.40	0.33
E	建筑业	1,097,778.28	6.78
F	批发和零售业	236,081.88	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	112,457.80	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,161,325.85	13.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	502,886.92	3.11
L	租赁和商务服务业	1,154,608.07	7.14
M	科学研究和技术服务业	196,584.34	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	498,163.50	3.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	134,724.06	0.83
R	文化、体育和娱乐业	938,456.62	5.80
S	综合	-	-
	合计	15,388,962.25	95.11

### 2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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	300027	华谊兄弟	25,896	619,432.32	3.83
2	002415	海康威视	36,096	611,466.24	3.78
3	002241	歌尔声学	22,849	609,154.34	3.76



4	300104	乐视网	12,491	548,354.90	3.39
5	002450	康得新	22,615	514,491.25	3.18
6	002236	大华股份	17,481	471,112.95	2.91
7	300070	碧水源	15,906	465,250.50	2.88
8	002353	杰瑞股份	11,439	460,419.75	2.85
9	300058	蓝色光标	17,014	451,551.56	2.79
10	002065	东华软件	22,034	443,324.08	2.74

### 3.2 报告期末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

本基金本报告期末未持有积极投资股票

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	698,209.40	4.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,604.23	0.02
8	其他	-	-
9	合计	701,813.63	4.34

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019314	13 国债 14	6,980	698,209.40	4.32
2	128002	东华转债	21	3,604.23	0.02

注：本基金本报告期末仅有上述债券投资持仓。

### 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**

根据基金合同，本基金暂不可投资于股指期货。

**10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

根据基金合同，本基金暂不可投资国债期货。

**11、投资组合报告附注****11.1**

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，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

**11.2**

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定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	10,471.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,185.04
5	应收申购款	494.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,150.72

**11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	128002	东华转债	3,604.23	0.02

## **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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

### **11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有积极投资股票

## 十四、基金的业绩

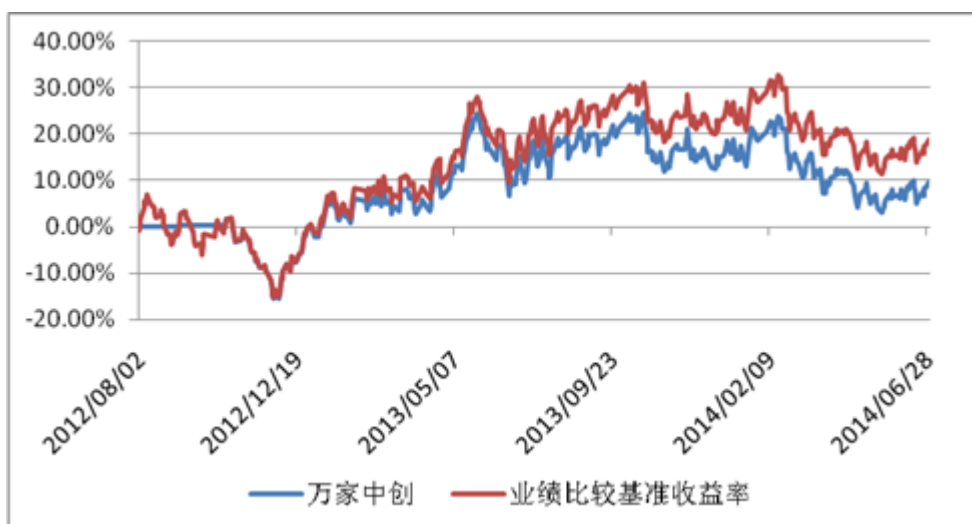
基金业绩截止日为 2014 年 6 月 30 日，托管人中国工商银行于 2014 年 9 月 2 日复核了本招募说明书中的基金净值表现。

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

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
2014 年上半年	-5.36%	1.36%	-4.05%	1.35%	-1.31%	0.01%
2013 年	15.51%	1.53%	23.12%	1.51%	-7.61%	0.02%
2012 年	0.30%	0.94%	0.78%	1.39%	-0.48%	-0.45%
基金成立日至 2014 年 6 月 30 日	9.65%	1.37%	19.04%	1.45%	-9.39%	-0.08%

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较（2012 年 8 月 2 日至 2014 年 6 月 30 日）



本基金于2012年8月2日成立，建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

## 十五、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销机构以

其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十六、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出万家创业成长份额的基金份额净值，是计算万家创业成长份额的申购与赎回价格以及计算万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值的基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常工作日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式发送给基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，以双方认可的方式发送给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （五）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；



(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基

金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （六）基金份额净值的确认和估值错误的处理

万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。当估值或份额净值计算错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先从基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，《基金合同》的当事人按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则该当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负

责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额

净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

#### （七）暂停估值的情形

- 1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### （八）特殊情形的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第 6 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；
- 2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十七、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）基金收益分配原则

在存续期内，本基金（包括万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 十八、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、基金的指数许可使用费；
- 4、基金上市初费及上市年费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### （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 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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前 2 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 0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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前 2 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、基金的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。

通常情况下，标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元。

指数许可使用费自基金合同生效日起每日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于次季初十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

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：

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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费

率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体及基金管理人网站上公告。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更本基金标的指数的使用许可费率和计费方式，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒体上刊登公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。



## 十九、基金份额折算

### （一）定期份额折算

在万家创业成长 A 份额、万家创业成长份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### 1、基金份额折算日

每个会计年度第一个工作日。

#### 2、基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的万家创业成长 A 份额、万家创业成长份额。

#### 3、基金份额折算频率

每年折算一次。

#### 4、基金份额折算方式

万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额按照《基金合同》规定的参考净值计算规则进行参考净值计算，在基金份额折算日，对万家创业成长 A 份额上一会计年度的约定收益进行定期份额折算，每两份万家创业成长份额将按一份万家创业成长 A 份额获得约定收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

对于万家创业成长 A 份额上一会计年度的约定收益，即万家创业成长 A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内万家创业成长份额分配给万家创业成长 A 份额持有人。万家创业成长份额持有人持有的每两份万家创业成长份额将按一份万家创业成长 A 份额获得新增万家创业成长份额的分配。持有场外万家创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外万家创业成长份额的分配；持有场内万家创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内万家创业成长份额的分配。经过上述份额折算，万家创业成长 A 份额的基金份额参考净值和万家创业成长份额的基金份额净值将相应调整。

有关计算公式如下：

#### （1）万家创业成长 A 份额

定期份额折算后万家创业成长 A 份额的份额数= 定期份额折算前万家创业成长 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前万家创业成长份额资产净值} - NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times (\text{每份万家创业成长A份额期末资产净值} - 1.000)}{NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}}$$

万家创业成长 A 份额持有人新增的场内万家创业成长份额的份额数=

$$\frac{NUM_{\text{A}}^{\text{前}} \times (\text{每份万家创业成长A份额期末资产净值} - 1.000)}{NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后万家创业成长份额净值

$NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前万家创业成长份额的份额数

$NUM_{\text{A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前万家创业成长 A 份额的份额数

万家创业成长 A 份额新增份额折算成万家创业成长份额的场内份额采用截位方法保留到整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

#### （2）万家创业成长 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变万家创业成长 B 份额参考净值及其份额数。

#### （3）万家创业成长份额

万家创业成长份额持有人新增的万家创业成长份额的份额数=

$$\frac{NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{(\text{每份万家创业成长A份额期末资产净值} - 1.000)}{NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}}$$

万家创业成长份额的场外份额经折算后的份额数采用截位方法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；万家创业成长份额的场内份额经折算后的份额数采用截位方法保留到整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

#### （4）折算后万家创业成长份额的总份额数

定期份额折算后万家创业成长份额的总份额数= 定期份额折算前万家创业成长份额的份额数+ 万家创业成长份额持有人新增的万家创业成长份额的份额数+ 万家创业成长 A 份额持有人新增的万家创业成长份额的份额数

在实施基金份额折算时，份额折算日折算前万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （5）举例

假设本基金成立后第 3 个会计年度第一个工作日为定期份额折算日，万家创

业成长份额当日折算前资产净值为 4,658,000,000 元。当日场外万家创业成长份额、场内万家创业成长份额分别为 30 亿份、5 亿份。前一个会计年度末每份万家创业成长 A 份额资产净值为 1.065000000 元，且未进行不定期份额折算。投资者甲持有万家创业成长份额场内份额 100,000 份，投资者乙持有万家创业成长 A 份额 20,000 份，投资者丙持有万家创业成长 B 份额 8,000 份，则执行定期份额折算后：

万家创业成长份额的基金份额净值=[4,658,000,000 - 3,500,000,000 × (1.065000000-1.000)/2]/3,500,000,000=1.298 元

投资者甲新增场内万家创业成长份额数=[100,000/2 × (1.065000000-1.000)]/1.298=2,503 份

投资者乙新增场内万家创业成长份额数=[20,000 × (1.065000000-1.000)]/1.298=1,001 份

即：份额折算后，投资者甲共持有万家创业成长份额的场内份额 102,503 份，投资者乙共持有万家创业成长 A 份额 20,000 份及万家创业成长份额的场内份额 1,001 份，投资者丙仍持有万家创业成长 B 份额 8,000 份。

#### 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的上市交易和万家创业成长份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

#### 7、特殊情形的处理

若在某一会计年度最后一个工作日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，将按照不定期份额折算的规则进行份额折算。

2014 年 1 月 2 日，本基金进行了第二次定期折算，万家创业成长份额的场外份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产；万家创业成长份额的场内份额、万家创业成长 A 份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。份额折算比例按截位法精确到小数点后第 9 位，如下表所示：

基金份额名称	折算前份额	折算后份额	新增份额折算比例	折算后基金份额净值	折算后基金份额累计净值
万家创业成长场外份额	22,611,921.10	23,261,401.82	0.028722934	1.1315	1.1775
万家创业成长场内份额	157,982	261,127	0.028722934	1.1315	1.1775
万家创业成长A份额	1,716,556	1,716,556	0.057445839	1.0004	1.0924

注：万家创业成长场外份额经份额折算后产生新增的万家创业成长场外份额；万家创业成长场内份额经份额折算后产生新增的万家创业成长场内份额；万家创业成长A份额经份额折算后产生新增的万家创业成长场内份额。

## （二）不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当万家创业成长份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元；当万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元。

1、当万家创业成长份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

### （1）基金份额折算日

万家创业成长份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元，基金管理人可根据市场情况确定折算日。

### （2）基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和万家创业成长份额。

### （3）基金份额折算频率

不定期。

### （4）基金份额折算方式

当万家创业成长份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元后，本基金将在基金份额折算日分别对万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和万家创业成长份额进行份额折算，份额折算后万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额的比例仍保持 1:1 不变。份额折算后万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值和万家创业成长份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。基金份

额折算日折算前万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值和万家创业成长份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分均折算为万家创业成长份额分配给基金份额持有人。

份额折算公式如下：

1) 万家创业成长 A 份额

份额折算前后万家创业成长 A 份额的份额数保持不变，即： $NUM_A^{\text{后}}=NUM_A^{\text{前}}$

万家创业成长 A 份额持有人份额折算后新增的场内万家创业成长份额数= $[NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)] / 1.000$ ，即超出 1 元以上的净值部分全部折算为场内万家创业成长份额。

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算前万家创业成长 A 份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算前万家创业成长 A 份额的份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后万家创业成长 A 份额的份额数

万家创业成长 A 份额折算成万家创业成长份额的场内份额采用截位方法保留到整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

2) 万家创业成长 B 份额

份额折算前后万家创业成长 B 份额份额数保持不变，即： $NUM_B^{\text{后}}=NUM_B^{\text{前}}$ ；

万家创业成长 B 份额的基金份额持有人在份额折算后新增的场内万家创业成长份额数= $[NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)] / 1.000$ ，即超出 1 元以上的净值部分全部折算为场内万家创业成长份额。

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$ ：份额折算前万家创业成长 B 份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$ ：份额折算前万家创业成长 B 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后万家创业成长 B 份额的份额数

万家创业成长 B 份额折算成万家创业成长份额的场内份额采用截位方法保留到整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

3) 万家创业成长份额

场外万家创业成长份额持有人份额折算后获得新增场外万家创业成长份额，

场内万家创业成长份额持有人份额折算后获得新增场内万家创业成长份额。

万家创业成长份额的基金份额持有人在份额折算后新增的万家创业成长份额数 =  $[NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{创业成长}}^{\text{前}} - 1.000)] / 1.000$

万家创业成长份额的场外份额经折算后的份额数采用截位方法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；万家创业成长份额的场内份额经折算后的份额数采用截位方法保留到整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

#### 4) 折算后万家创业成长份额的总份额数

折算后万家创业成长份额的总份额数 = 不定期份额折算前万家创业成长份额的份额数 + 万家创业成长份额持有人新增的万家创业成长份额数 + 万家创业成长 A 份额持有人新增的万家创业成长份额数 + 万家创业成长 B 份额持有人新增的万家创业成长份额数

#### 5) 举例：

假设 T 日万家创业成长份额的基金份额净值为 2.015000000 元，万家创业成长 A 份额的基金份额参考净值为 1.025000000 元，万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值为 3.005000000 元，投资者甲持有万家创业成长份额的场内份额 100,000 份，投资者乙持有万家创业成长 A 份额 20,000 份，投资者丙持有万家创业成长 B 份额 8,000 份，若基金管理人决定以该日为份额折算日，则执行此次不定期份额折算后：

万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元

投资者甲新增的万家创业成长份额数 =  $[100,000 \times (2.015000000 - 1.000)] / 1.000 = 101,500$  份

投资者乙新增的场内万家创业成长份额数 =  $[20,000 \times (1.025000000 - 1.000)] / 1.000 = 500$  份

投资者丙新增的场内万家创业成长份额数 =  $[8,000 \times (3.005000000 - 1.000)] / 1.000 = 16,040$  份

即：份额折算后，投资者甲共持有万家创业成长份额的场内份额 201,500 份，投资者乙共持有万家创业成长 A 份额 20,000 份及万家创业成长份额的场内份额 500 份，投资者丙共持有万家创业成长 B 份额 8,000 份及万家创业成长份额的场内份额 16,040 份。

#### (5) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的上市交易和万家创业成长份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### (6) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

2、当万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### (1) 基金份额折算日

万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元，基金管理人可根据市场情况确定份额折算日。

#### (2) 基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和万家创业成长份额。

#### (3) 基金份额折算频率

不定期。

#### (4) 基金份额折算方式

当万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元后，本基金将分别对万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和万家创业成长份额进行份额折算，份额折算后万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的比例仍保持 1:1 不变。份额折算后万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的份额数将得到相应的调整。

份额折算公式如下：

#### 1) 万家创业成长 B 份额

份额折算后万家创业成长 B 份额的份额数： $NUM_B^{\text{后}} = (NUM_B^{\text{前}} \times NAV_B^{\text{前}}) / 1.000$

万家创业成长 B 份额经份额折算后的份额数采用截位方法保留到整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

#### 2) 万家创业成长 A 份额

份额折算前后万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的份额数始终保持

1: 1 不变, 即:  $NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$ ;

万家创业成长 A 份额的持有人在份额折算后新增场内万家创业成长份额数  
 $= (NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000) / 1.000$

万家创业成长 A 份额经份额折算后的份额数采用截位方法保留到整数位 (最小单位为 1 份), 余额计入基金财产。万家创业成长 A 份额经份额折算成万家创业成长份额的场内份额采用截位方法保留到整数位 (最小单位为 1 份), 余额计入基金财产。

### 3) 万家创业成长份额:

万家创业成长份额的持有人在份额折算后持有的万家创业成长份额数  
 $= (NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{创业成长}}^{\text{前}}) / 1.000$

万家创业成长份额的场外份额经份额折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位, 由此产生的误差计入基金财产; 万家创业成长份额的场内份额经份额折算后的份额数采用截位方法保留到整数位 (最小单位为 1 份), 余额计入基金财产。

### 4) 折算后万家创业成长份额的总份额数

折算后万家创业成长份额的总份额数 = 万家创业成长份额的持有人在不定期份额折算后持有的万家创业成长份额数 + 万家创业成长 A 份额持有人新增的万家创业成长份额数

### 5) 举例:

假设 T 日万家创业成长份额的基金份额净值为 0.585000000 元, 万家创业成长 A 份额的基金份额参考净值为 1.025000000 元, 万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值为 0.145000000 元, 投资者甲持有万家创业成长份额的场内份额 100,000 份, 投资者乙持有万家创业成长 A 份额 20,000 份, 投资者丙持有万家创业成长 B 份额 8,000 份, 若基金管理人决定以该日为份额折算日, 则执行此次不定期份额折算后:

万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元

投资者甲折算后持有万家创业成长份额数 =  $(100,000 \times 0.585000000) / 1.000$   
 $= 58,500$  份

投资者乙折算后持有万家创业成长 A 份额数 =  $(20,000 \times 0.145000000) / 1.000$   
 $= 2,900$  份



投资者乙新增的场内万家创业成长份额数 =  $[20,000 \times 1.025000000 - 2,900 \times 1.000] / 1.000 = 17,600$  份

投资者丙折算后持有万家创业成长 B 份额数 =  $(8,000 \times 0.145000000) / 1.000 = 1,160$  份

即：份额折算后，投资者甲持有万家创业成长份额的场内份额 58,500 份，投资者乙共持有万家创业成长 A 份额 2,900 份及万家创业成长份额的场内份额 17,600 份，投资者丙持有万家创业成长 B 份额 1,160 份。

#### (5) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的上市交易和万家创业成长份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### (6) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 二十、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额持有人以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额将全部转换成万家创业成长份额的场内份额。

### （一）份额转换基准日

万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

### （二）份额转换方式

在转换基准日日终，以万家创业成长份额的基金份额净值为基准，万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成万家创业成长份额的场内份额。

万家创业成长 A 份额（或万家创业成长 B 份额）基金份额持有人持有的转换后万家创业成长份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。份额转换计算公式：

万家创业成长 A 份额（或万家创业成长 B 份额）的转换比例 = 份额转换基准日万家创业成长 A 份额（或万家创业成长 B 份额）的基金份额参考净值 / 份额转换基准日万家创业成长份额的基金份额净值。

万家创业成长 A 份额（或万家创业成长 B 份额）基金份额持有人持有的转换后万家创业成长份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前万家创业成长 A 份额（或万家创业成长 B 份额）的份额数 × 万家创业成长 A 份额（或万家创业成长 B 份额）的转换比例。

### （三）份额转换后的基金运作

万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额全部转换为万家创业成长份额的

场内份额后，本基金仅剩余万家创业成长份额这一类基金份额。万家创业成长份额将上市交易，并接受场外与场内申购和赎回。

#### （四）份额转换的公告

万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额进行份额转换结束后，基金管理人应在 2 日内在至少一家指定媒体基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 二十一、基金的会计和审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 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；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在2日内在至少一家指定媒体公告。

## 二十二、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### (二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，

将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

(1) 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。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

(2) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

## 2、基金份额发售公告

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，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。

## 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

## 4、基金份额上市公告书

万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易 3 个工作日前，将上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## 5、万家创业成长份额开始申购、赎回公告

基金管理人应于万家创业成长份额申购开始日、赎回开始日前 2 日在指定媒体及基金管理人网站上公告。

## 6、基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理万家创业成长份额申购或者赎回或万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与

万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值。

在开始办理万家创业成长份额申购或者赎回或万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日万家创业成长份额的基金份额净值和基金份额累计净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、万家创业成长份额的基金份额净值和基金份额累计净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计参考净值登载在指定媒体上。

#### 7、万家创业成长份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明万家创业成长份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 8、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。

《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、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

#### 9、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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：

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止《基金合同》；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- (14) 重大关联交易事项；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金销售机构；
- (20) 更换基金注册登记机构；
- (21) 万家创业成长份额开始办理申购、赎回；



- (22) 万家创业成长份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 万家创业成长份额发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 万家创业成长份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 万家创业成长份额暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 万家创业成长份额接受或暂停接受份额配对转换申请；
- (27) 本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
- (28) 万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作；
- (29) 万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作后万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的份额转换；
- (30) 万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易；
- (31) 本基金实施基金份额折算；
- (32) 中国证监会规定的其他事项。

#### 10、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### 11、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### 12、中国证监会规定的其他信息。

##### (六) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值、万家创业成长份额申购赎回价格、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作后的份额转换比例、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 二十三、风险揭示

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

### （一）市场风险

本基金主要投资于证券市场，证券市场价格因受到政治因素、经济因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，主要包括但不限于：

#### 1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动，从而影响基金收益。

#### 2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行周期性变化将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益造成影响。

#### 3、利率风险

金融市场利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，从而影响基金所持有证券的收益水平。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

#### 5、购买力风险

基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

### （二）流动性风险

1、如果基金投资的某些投资品种由于流动性差、成交稀少，导致基金在进行

投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生较大影响，使基金投资成本提高，从而对基金收益造成影响。

2、本基金运作方式为契约型开放式，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会由于基金仓位调整的困难，导致本基金的现金支付出现困难，或被迫在不适当的价格将所持有的证券卖出变现，将会影响基金资产净值。

### （三）信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

### （四）本基金所特有的风险

本基金为跟踪指数的股票型分级基金，标的指数为中证创业成长指数，本基金的特有风险包括：

#### 1、标的指数波动风险

标的指数成分股价格可能受政治、经济、上市公司经营情况、市场情绪等因素影响而波动，导致指数价格波动。本基金采取指数化投资策略，被动跟踪指数。当指数下跌时，本基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

#### 2、投资替代风险

因流动性受限或个别成分股投资受限等特殊原因，导致本基金无法投资相关股票时，基金管理人将通过投资近似品种的股票的方法进行适当的替代，有可能产生替代风险。

#### 3、标的指数变更风险

根据《基金合同》的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资人还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

#### 4、跟踪偏离风险

本基金可能由以下因素导致基金投资组合收益率与标的指数收益率发生偏离：

- （1）标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；
- （2）标的指数成份股的调整；

- (3) 基金买卖股票时产生的交易成本和交易冲击；
- (4) 申购、赎回因素带来的跟踪误差；
- (5) 新股市值配售、新股认购带来的跟踪误差；
- (6) 基金现金资产的拖累；
- (7) 基金的管理费和托管费带来的跟踪误差；
- (8) 指数成份股停牌、摘牌，成份股涨、跌停板等因素带来的偏差；
- (9) 其他因素带来的偏差。

#### 5、标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数的回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### 6、分级基金运作风险

##### (1) 上市交易风险

万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露、份额折算等因素导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致不能及时买入或卖出基金，产生流动性风险。

##### (2) 杠杆机制风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险较高预期收益的特征。由于万家创业成长 B 份额内含杠杆机制的设计，万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值的变动幅度将大于万家创业成长份额的变动幅度，万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值的波动性高于本基金的其他两类份额。

##### (3) 折/溢价交易风险

万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与其基金份额参考净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易风险。

##### (4) 风险收益特征变化风险

根据本基金份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施份额折算后，万家创业成长 A 份额持有人或万家创业成长 B 份额持有人将会获得一定比例的万家创业成长份额，因此出现风险收益特征变化的风险。

当万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作后，万家创业成长 A

份额与万家创业成长 B 份额将全部转换为万家创业成长份额场内份额，基金份额持有人面临所持基金份额发生风险收益特征变化的风险。

#### （5）份额折算的风险

1) 在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果采取截位方式保留至整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

2) 份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

在场内购买万家创业成长 A 份额或万家创业成长 B 份额的一部分投资者可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资者赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金代销资格的证券公司购买万家创业成长 A 份额或万家创业成长 B 份额，在其参与份额折算后，则折算新增的万家创业成长份额并不能被赎回。此风险需要引起投资者注意，投资者可以选择在份额折算前将万家创业成长 A 份额或万家创业成长 B 份额卖出，或者将新增的万家创业成长份额通过系统内转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

#### （五）其他风险

1、因技术因素而产生的风险,如电脑系统不可靠产生的风险;

2、因基金业务快速发展,在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面的不完善产生的风险;

3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险;

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险;

5、因业务竞争压力可能产生的风险;

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产的损失,影响基金收益水平,从而带来风险;

7、其他意外导致的风险。

## 二十四、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一)《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- (1) 更换基金管理人；
- (2) 更换基金托管人；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (5) 变更基金类别；
- (6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 终止万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的运作；
- (9) 变更基金份额持有人大会召开程序；
- (10) 终止《基金合同》；
- (11) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》生效之日起在至少一家指定媒体公告。

## （二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

### （7）对基金财产进行分配；

### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

## （四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

## （五）基金财产清算剩余资产的分配



依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的应计分配比例，并据此由万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十五、基金合同内容摘要

### (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、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：

- 1) 依法募集基金；
- 2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4) 销售基金份额；
- 5) 召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据《基金合同》及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- 9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- 10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- 11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理万家创业成长份额的申购与赎回申请；
- 12) 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、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本《基金合同》规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- 13) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益

行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

14) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(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) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

2) 办理基金备案手续；

3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7) 依法接受基金托管人的监督；

8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回、配对转换、折算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资产净值，万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值，万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作后的份额转换比例；

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

- 10) 编制季度、半年度和年度基金报告;
- 11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
- 12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
- 13) 按《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基金收益;
- 14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
- 15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- 16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;
- 17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;
- 18) 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
- 20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
- 21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
- 22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;
- 23) 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实施其他法律行为;

24) 基金管理人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存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

26) 建立并保存基金份额持有人名册,定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册;

27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 2、基金托管人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

1) 自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

3) 监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户;

5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户,用于证券交易资金清算;

6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户,负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算;

7) 提议召开或召集基金份额持有人大会;

8) 在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

2) 设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;

3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 确保基金财产的安全, 保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立; 对所托管的不同的基金分别设置账户, 独立核算, 分账管理, 保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外, 不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户, 按照《基金合同》的约定, 根据基金管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;

7) 保守基金商业秘密, 除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前予以保密, 不得向他人泄露;

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值, 万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值, 万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作后的份额转换比例;

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行; 如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为, 还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上;

12) 建立并保存基金份额持有人名册;

13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

16) 按照法律法规、《基金合同》和《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作;

17) 参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利和义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额持有人持有的每一份基金份额按《基金合同》约定仅在其份额类别内拥有同等的合法权益。如果万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的运作出现终止，则在终止万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

(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：

1) 分享基金财产收益；

2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

3) 依法转让其持有的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额，依法申请赎回其持有的万家创业成长份额；

4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

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；

6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7) 监督基金管理人的投资运作；

8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(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:

1) 遵守《基金合同》;

2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

3) 在其持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;

4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;

5) 返还在基金交易过程中因任何原因, 自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利;

6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

7) 标的指数名称变更或指数公司调整指数编制方法;

8) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

1、召开事由

(1) 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:

1) 终止《基金合同》;

2) 更换基金管理人;

3) 更换基金托管人;

4) 转换基金运作方式;

5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;

6) 变更基金类别;

7) 本基金与其他基金的合并;

8) 变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);



- 9) 终止万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的运用;
- 10) 变更基金份额持有人大会程序;
- 11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- 12) 单独或合计持有万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额 10%以上(含 10%, 下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算, 下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
- 13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- 14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2) 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:

- 1) 调低基金管理费、基金托管费;
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整万家创业成长份额的申购费率、调低赎回费率;
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
- 6) 经中国证监会允许, 基金管理人、基金注册登记机构、销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则;
- 7) 标的指数名称变更或指数公司调整指数编制方法;
- 8) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集;

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时, 由基金托管人召集;

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并

书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

(4) 单独或合计代表万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(5) 单独或合计代表万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在至少一家指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效

期限等)、送达时间和地点;

- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话;
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

#### 4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定,但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

2) 经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%)。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4) 上述第 3) 项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 5、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额 10%（含 10%）以上的基

基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1) 关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权益登记日万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## （2）议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。

大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

## 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额类别内享有平等的表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经参加大会的万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议，特别决议应当经参加大会的万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的运作、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议

通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7、计票

### (1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日

起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一家指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

### （三）基金收益分配原则、执行方式

在存续期内，本基金（包括万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### （四）与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### 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 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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前 2 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 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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前 2 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、基金的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。

通常情况下，标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元。

指数许可使用费自基金合同生效日起每日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于次季初十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

## （五）基金资产的投资方向和投资限制

### 1、投资目标

本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段，在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对中证创业成长指数的有效跟踪。

### 2、投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证创业成长指数成份股及其备选成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，中证创业成长指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金还可投资于法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 3、投资限制

#### (1) 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1) 本基金投资于中证创业成长指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 90%；

2) 现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

4) 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 40%；

5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

9) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

10) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自《基金合同》生效之日起开始。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

## (2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

## (六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

### 1、基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 2、基金资产净值的公告方式

《基金合同》生效后，在开始办理万家创业成长份额申购或者赎回或万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值。

在开始办理万家创业成长份额申购或者赎回或万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额上市交易后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日万家创业成长份额的基金份额净值和基金份额累计净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、万家创业成长份额的基金份额净值和基金份额累计净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计参考净值登

载在指定媒体上。

(七) 基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、《基金合同》的变更

(1) 以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- 1) 更换基金管理人；
- 2) 更换基金托管人；
- 3) 转换基金运作方式；
- 4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 5) 变更基金类别；
- 6) 变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外)；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 终止万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的运作；
- 9) 变更基金份额持有人大会召开程序；
- 10) 终止《基金合同》；
- 11) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- 6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(2) 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自新《基金合同》生效之日起在至少一家指定媒体公告。

2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- (3) 《基金合同》约定的其他情形；
- (4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
  - 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
  - 3) 对基金财产进行估值和变现；
  - 4) 制作清算报告；
  - 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
  - 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
  - 7) 对基金财产进行分配；
- (5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算万家创业成长份额、

万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的应计分配比例，并据此由万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### （八）争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### （九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 二十六、托管协议内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

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 9 层（200122）

邮政编码：200122

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

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

#### 2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

基金托管业务批准文号：中国证监会和中国人民银行证监基字[1998]3 号

组织形式：股份有限公司

注册资金：人民币 349,018,545,827 元

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债

券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### 1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的比例不低于基金资产的 90%；现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投



资限制：

a、本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 90%；

b、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

c、本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；

d、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 40%；

e、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

f、本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

g、本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

h、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

i、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

j、本基金持有同一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 2%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

k、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

### 3) 法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个工作日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

5) 相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

1) 承销证券；

2) 向他人贷款或提供担保；

3) 从事可能使基金承担无限责任的投资；

4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

7) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，

由基金管理人承担责任。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

(5) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

3) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银

行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。

(6) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

(7) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述

资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

5) 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值计算、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的终止运作后的份额转换比例、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作后的份额转换比例、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有关义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### （四）基金财产保管

##### 1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

（5）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

##### 2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的万家基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按

规定办理退款事宜。

### 3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

### 5、债券托管账户的开立和管理

(1)《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2)基金托管人和基金管理人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

### 6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合



同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### 7、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

### （五）基金资产净值计算和会计核算

#### 1、基金资产净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。本基金分别计算万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值。万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。

#### 2、会计复核的时间和程序

用于基金信息披露的基金资产净值和万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金

份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外予以公布法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外予以公布。

#### （六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额上市交易的前一日、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作日、基金份额折算日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称、持有的基金份额名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额上市交易的前一日、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额终止运作日、基金份额折算日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （七）争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

#### （八）托管协议的变更、终止

##### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

##### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 二十七、基金份额持有人服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目：

### （一）基金份额持有人投资交易确认服务

注册登记机构保留基金份额持有人名册上列明的所有基金份额持有人的基金投资记录。

基金管理人直销中心应根据在基金管理人直销中心进行交易的投资者的要求提交成交确认单。

基金代销机构应根据在其网点进行交易的投资者的要求提交成交确认单。

### （二）基金份额持有人交易记录查询服务

基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

### （三）基金份额持有人交易对账单寄送服务

基金份额持有人交易对账单包括季度对账单与年度对账单。万家基金公司已全面开通了电子账单服务。主要有电子邮件账单（季度）和短信账单（月度）两类，均免费发送。

### （四）信息订制服务

投资者可以通过本基金管理人网站（[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)）、客户服务中心提交信息订制申请，基金管理人通过电子邮件或手机短信定期发送所订制的信息。可订制的内容如下：

1、电子邮件：电子邮件对账单、每日净值播报等。

2、手机短信：短信对账单、账户交易确认、基金交易确认、所有基金周末净值、持有基金周末净值、生日祝福等。

### （五）资讯服务

#### 1、客户服务电话

投资者拨打客户服务电话可通过自动语音或人工座席获得基金信息查询、账户信息查询、传真对账单、建议投诉等全面的服务。

客户服务电话：400-888-0800，95538 转 6，021-68644599

客户服务传真：021—38619968

2、公司网站：

基金管理人的互联网地址：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)

基金管理人的电子信箱：[callcenter@wjasset.com](mailto:callcenter@wjasset.com)

投资者也可登录基金管理人网站,在“客户服务”->“网上客服”->“客户留言”栏目中,直接提出有关本基金的问题和建议。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站([www.wjasset.com](http://www.wjasset.com))查阅和下载招募说明书。

基金管理人网站为投资者提供了账户查询、基金信息查询、投诉建议、在线咨询等服务栏目,力争为投资者提供全方位的专业服务。

## 二十八、其他应披露事项

1、2014年3月14日，我公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“关于在申银万国证券开通旗下部分基金转换业务的公告”。

2、2014年3月17日，我公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“万家中证创业成长指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（201401）”。

3、2014年3月19日，我公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“关于旗下部分基金新增华龙证券为代销机构及开通定投业务、转换业务的公告”。

4、2014年3月26日，我公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“万家基金关于新增东海证券为代销机构及开通转换业务的公告”。

5、2014年3月28日，我公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“万家中证创业成长指数分级证券投资基金 2013 年度报告摘要”。

6、2014年4月19日，我公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“万家中创成长基金 2014 年第一季度报告”。

7、2014年7月21日，我公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“万家中创成长基金 2014 年第二季度报告”。

## 二十九、招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间查阅;投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件,基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站([www.wjasset.com](http://www.wjasset.com))查阅和下载招募说明书。

### 三十、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) 中国证监会批准万家中证创业成长指数分级证券投资基金募集的文件
- (二) 《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《万家中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集万家中证创业成长指数分级证券投资基金的法律意见
- (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  
二〇一四年九月十五日