万家上证380交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2013年12月2日
公告日期:2013年11月27日

一、重要声明与提示

万家上证380交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、万家基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")章程等会及重事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人华夏银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登于2013年10月10日《上海证券报》和万家基金管理有限公司网站(www.wjasset.com)上的《万家上证380交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

(一)基金二级市场交易简称:万家380。
(二)二级市场交易代码:510680。
(三)基金申购、赎回简称:万家申赎。
(四)申购、赎回代码:510681。
(五)募集公告日前两个工作日即2013年11月25日基金份额总额:500,724,652份。
(六)募集公告日前两个工作日即2013年11月25日基金份额净值:0.9975元。
(七)本次上市交易份额:500,724,652份。
(八)上市交易的证券交易所:上海证券交易所。
(九)上市交易日期:2013年12月2日。
(十)基金管理人:万家基金管理有限公司。
(十一)基金托管人:华夏银行股份有限公司。
(十二)上市推荐人:齐鲁证券有限公司。
(十三)申购赎回代办券商(以下简称"一级交易商"):东北证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、上海证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、东兴证券股份有限公司等21家证券公司。

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号:2013年7月31日中国证监会证监许可[2013]1047号文。
2、基金运作方式:交易型开放式。
3、基金合同期限:不定期。
4、发售日期:本基金自2013年10月14日至2013年10月25日进行发售。其中,办理网上现金认购的日期为2013年10月23日至2013年10月25日,办理网下现金认购和网下股票认购的日期为2013年10月14日至2013年10月25日。
5、发售价格:1.00元人民币。
6、发售期限:网下现金发售10个工作日,网上现金发售3个工作日,通过发售代理机构进行网下股票认购10个工作日。
7、发售方式:投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。
8、发售机构
①直销机构
投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购。
②代销机构
本基金的网下现金发售和网下股票发售的发售代理机构为:齐鲁证券有限公司、东北证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、东兴证券股份有限公司等21家证券公司。

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号:2013年7月31日中国证监会证监许可[2013]1047号文。
2、基金运作方式:交易型开放式。
3、基金合同期限:不定期。
4、发售日期:本基金自2013年10月14日至2013年10月25日进行发售。其中,办理网上现金认购的日期为2013年10月23日至2013年10月25日,办理网下现金认购和网下股票认购的日期为2013年10月14日至2013年10月25日。
5、发售价格:1.00元人民币。
6、发售期限:网下现金发售10个工作日,网上现金发售3个工作日,通过发售代理机构进行网下股票认购10个工作日。
7、发售方式:投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。
8、发售机构
①直销机构
投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购。
②代销机构
本基金的网下现金发售和网下股票发售的发售代理机构为:齐鲁证券有限公司、东北证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、东兴证券股份有限公司等21家证券公司。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数
截至2013年11月25日,本基金份额持有人户数为5,363户,平均每户持有的基金份额为93,366.52份。
(二)持有人结构
截至2013年11月25日,本基金份额持有人结构如下:
机构投资者持有的基金份额为92,827,305份,占基金总份额的18.54%;个人投资者持有的基金份额为407,897,347份,占基金总份额的81.46%。
(三)前十名基金份额持有人的情况:
截至2013年11月25日,前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额(份)	占场内总份额比例(%)
1	东兴证券-光大-东兴1号优选基金集合资产管理计划	25,001,000	4.99
2	山东东岳高分子材料有限公司	19,999,000	3.99
3	黄黎光	10,129,560	2.02
4	华西证券-建行-华西证券融诚2号集合资产管理计划	10,001,200	2.00
5	招商证券股份有限公司	10,001,000	2.00
6	中银保险有限公司-传统保险产品	10,000,400	2.00
7	汪解放	6,730,680	1.34
8	吴庆之	5,350,000	1.07
9	中投证券-中行-中投汇盈基金优选集合资产管理计划	5,000,600	1.00
10	上海诺毅投资管理有限公司	5,000,000	1.00

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、名称:万家基金管理有限公司
2、法定代表人:崔玉国
3、总经理:白宜振
4、注册资本:1亿元人民币
5、注册地址:上海市浦东新区浦电路360号8层(名义楼层9层)
6、设立批准文号:中国证监会证监基字[2002]44号
7、工商登记注册的法人营业执照文号:310115000700825号
8、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
9、股权结构:

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

10、内部组织结构及职能:
本基金管理人下设综合管理部、计划财务部、合规稽核部、权益投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易部、信息技术部、基金运营部、产品开发部、渠道服务部、机构理财部、营销策划部、客户服务部。
量化投资部负责量化产品创新和管理、量化研究与支持。
权益投资部负责权益类产品的投资与管理。
固定收益部负责固定收益类产品的投资与管理、债券研究。
研究部负责宏观、策略、行业和公司研究。
交易部负责权益类交易、固定收益类交易、交易风险管理、头寸管理、新股认购、新债认购、交易席位管理。
产品开发部负责海内外资管行业研究、产品设计与开发公募及投批、制定公司战略规划等工作。
营销策划部负责品牌推广、产品营销、媒体公关、电子商务、市场营销战略战术研究。
合规稽核部负责对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核。
信息技术部负责信息系统规划、IT基础设施建设及管理、应用系统建设及管理、信息安全管理等工作。
基金运营部负责公募基金及专户产品、专项资产计划的运营等工作。
渠道服务部负责基金销售和渠道服务维护工作。
机构理财部负责机构理财市场的分析以及机构客户、专户业务的开发、维护与管理等工作。
客户服务部负责公司客户维护、直销柜台、营销支持及投资顾问等工作。
综合管理部负责公司人力资源和行政等工作。
计划财务部负责公司财务等工作。
11、人员情况:
截至2013年6月30日,公司共有员工119人,其中63人具有硕士及以上学历,占员工总数的52.94%,拥有本科及以上学历的员工共112人,占员工总数的94.12%。
12、信息披露负责人:兰剑
电话:021-38619810
13、基金管理业务情况简介:
目前管理十六只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选股票型证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券基金、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金、万家添利分级债券型证券投资基金、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金和万家上证380交易型开放式指数证券投资基金。
14、本基金基金经理
张鹏先生,量化投资部副总监,基金经理,经济学硕士,FRM。毕业于复旦大学。长期从事金融工程研究和量化投资工作,曾任上海银行风险管理部副主管、信诚基金量化投资部副总监等职。2012年5月加入万家基金管理有限公司,现任量化投资部副总监、万家中证红利指数基金(LOF)基金经理。
(二)基金托管人情况
1、基本情况
名称:华夏银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街22号(100005)
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号(100005)
法定代表人:吴建
成立时间:1992年10月14日
组织形式:股份有限公司
注册资本:6,849,725,776元人民币
批准设立机关和设立文号:中国人民银行"银复(1992)391号"
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2005]25号
联系人:郑鹏
电话:010-85238667
传真:010-85238680
2、主要人员情况
华夏银行资产托管部内设市场综合室、交易管理室、风险管理室和销售管理室4个职能处室。资产托管部共有员工30人,高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。
3、基金托管业务经营情况
华夏银行于2005年2月23日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准,获得证券投资基金托管资格,是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来,华夏银行资产托管部本着"诚实信用、勤勉尽责"的行业精神,始终遵循"安全保管基金资产,提供优质托管服务"的原则,坚持以客户为中心的服务理念,依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验,严格履行法律和托管协议所规定的各项义务,为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2013年6月末,已托管长城货币市场基金、国联安德盛精选股票基金、万家货币市场基金、诺安优化收益债券型基金、益民红利成长混合型基金、东吴信息益定证债券型证券投资基金、诺德双赢分级债券型证券投资基金、浙商沪深300指数分级证券投资基金、华商大量量化精选灵活配置混合型证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金及其它受托资产产品,托管各类资产规模4566.19亿元。
(三)上市推荐人
齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
(四)一级交易商
①齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
②东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系人:潘鹏
电话:0431-85096709
客户服务电话:4006000686
网址:www.nesc.cn
③光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:刘晨
客户服务电话:95525
网址:www.ebscn.com
④国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人:万建华
电话:021-38676161
传真:021-38670161
联系人:芮敏祺
客户服务电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com
⑤海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:021-53594566
传真:021-53858549
联系人:金芸、杨微
客户服务电话:400-8888-001,021-962503
网址:www.htsec.com
⑥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
联系人:李巍
电话:010-88085858
传真:010-88085599
客服电话:4008-000-562
网址:www.hyzq.com
⑦华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01、C01单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:洪家新
电话:021-64339000
联系人:陈敏
公司网站:www.cfsc.com.cn
客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
⑧上海证券有限责任公司
住所、办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:郁忠民
电话:021-53519888
传真:021-53519888
联系人:刘子
客户服务电话:021-962518
网址:www.962518.com.cn
⑨申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54033888
联系人:黄维琳
客户服务电话:021-962505
网址:www.sw2000.com.cn
⑩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院1号楼信达金融中心
法定代表人:蒋冠江
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com
⑪兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海陆家嘴东路166号中保大厦
法定代表人:兰荣
电话:021-68419974
传真:021-68419867
联系人:杨盛芳
客户服务电话:400-8888-123
网址:www.xyzq.com.cn
⑫中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:朋长生
电话:010-66568047
联系人:李洋
客户服务电话:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn
⑬招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址: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
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
联系人:黄健
客户服务电话:400-8888-111,95565
网址:www.newone.com.cn
⑭浙商证券有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6/7
联系人:蒯琼辉
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客户服务电话:0571-967777
网址:www.stocke.com.cn
⑮中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:黎晓宏
电话:010-65186080
传真:010-65182261
联系人:魏明
客户服务电话:400-888-8108
网址:www.csc108.com
⑯国元证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路291号
法定代表人:杜航
统一客服电话:4008866567
公司网站地址:http://www.avicsec.com
⑰中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
法定代表人:龙翠来
开放式基金咨询电话:4006008008
网址:www.cjis.cn
⑱中信金通证券有限责任公司
住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人:刘军
电话:0571-85776115
传真:0571-85783771
联系人:俞会亮
客户服务电话:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn
⑲中银万国证券股份有限公司
注册地址:021-95523,4008-895523
网址:www.sywg.com
⑳中信万通证券有限责任公司
客服电话:96577
公司网站地址:www.zxwt.com.cn
㉑国泰君安证券股份有限公司
客服电话:4008-888-666
公司网站:www.gtja.com
㉒招商证券股份有限公司
客户服务热线:95565,4008888111
公司网站:www.newone.com.cn
㉓兴业证券股份有限公司
客户服务电话:95562
公司网站:www.xyzq.com.cn
㉔国信证券有限责任公司
客户服务电话:95536
公司网站:www.guosen.com.cn/
㉕信达证券股份有限公司
客户服务电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com
㉖中信证券有限责任公司
客服电话:4006609839
公司网址:http://www.xzq.com.cn
㉗华鑫证券有限责任公司
客户服务电话:021-32109999;029-68918888
公司网站:www.cfsc.com.cn
㉘金元证券股份有限公司
客户服务热线:95372
网址:www.jyzq.com
㉙中国中投证券有限责任公司
客户服务电话:95532
公司网站:http://www.china-invs.cn/
㉚财投资顾问有限公司
客服电话:010-66045678
公司网址:www.txsec.com
㉛上海长量基金销售投资顾问有限公司
客服电话:4000891289
公司网址:http://www.erichfund.com
㉜君正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
客服电话:4008215399
公司网址:http://www.noah-fund.com
㉝杭州数米基金销售有限公司
客服电话:4000766123
公司网址:http://www.fund123.com
㉞北京展恒基金销售有限公司
客服电话:400-888-6661
公司网址:www.myfund.com
㉟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
㊱上海好买基金销售有限公司
基金合同的内容摘要见附件:基金合同摘要。

六、基金合同摘要

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用
基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)基金资产负债表
本基金截至2013年11月25日的资产负债表如下:

资产	本报告期末 2013年11月25日
资产:	
银行存款	498,516,501.69
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中:股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	1,239,834.50
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	499,756,336.19

负债和所有者权益	本报告期末 2013年11月25日
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	170,857.90
应付托管费	34,171.59
应付销售服务费	-
应付交易费用	29,208.23
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	47,358.01
负债合计	281,595.73
所有者权益:	
实收基金	500,724,652.00
未分配利润	-1,249,911.54
所有者权益合计	499,474,740.46
负债和所有者权益合计	499,756,336.19

注:1、截至2013年11月25日,基金份额净值0.9975元,基金份额总额500,724,652.00份。
2、本报告期自2013年10月31日起至2013年11月25日止。本基金合同于2013年10月31日生效,截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2013年11月25日,本基金的投资组合情况如下:
(一)基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	498,516,501.69	99.75
6	其他各项资产	1,239,834.50	0.25
7	合计	499,756,336.19	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合
截至2013年11月25日,本基金未持有股票。
(三)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
截至2013年11月25日,本基金未持有股票。
(四)按券种分类的债券投资组合
截至2013年11月25日,本基金未持有债券。
(五)按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细
截至2013年11月25日,本基金未持有债券。
(六)投资组合报告附注
1、自基金合同生效日至2013年11月25日,本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
2、本基金前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3、其他各项资产构成如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,239,834.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,239,834.50

4、权证投资情况
截至2013年11月25日,本基金未持有权证;自基金合同生效日至2013年11月25日,本基金未投资任何权证。
5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2013年11月25日,本基金未持有可转换债券。
6、本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细
截至2013年11月25日,本基金未持有资产支持证券。
7、投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为,将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将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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,基金托管人将报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

十一、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为齐鲁证券有限公司。
上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见:
1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件;
2、基金上市文件真实、准确、完整,符合相关规定要求,文件内所载的资料均经过核实。

十三、基金份额的申购与赎回

(一)申购与赎回的场所
投资人应当在申购赎回代理券商的营业场所按申购赎回代理券商提供的方式办理基金的申购和赎回。
目前,基金申购、赎回代办证券公司(一级交易商)包括东北证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、东兴证券股份有限公司等21家证券公司。
(二)申购与赎回办理的开放日及时间
1、申购、赎回的开始时间
自2013年12月2日起,本基金开始办理申购、赎回业务。
2、开放日及开放时间
投资人可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日,开放时间为上午9:30-11:30和下午13:00-15:00。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。
若上海证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况,基金管理人可对开放日、开放时间进行相应的调整并公告。
(三)申购和赎回的原则
1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式,即申购和赎回均以份额申请。
2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
3、申购、赎回申请提交后不得撤销。
4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》的规定。
5、基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。
(四)申购和赎回的程序
1、申购和赎回的申请方式
投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。
投资人申购基金份额时,必须根据相应的申购赎回清单备足申购对价。投资人在提交赎回申请时,必须持有足够的基金份额余额和现金,否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。
2、申购和赎回申请的确认
投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价,则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价,则赎回申请失败。
投资人申购的基金份额当日可卖出;投资人赎回获得的股票当日可卖出。

3、申购和赎回的清算交收与登记
本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和《参与各方相关协议的有关规定》。
投资人T日申购、赎回成功后,登记结算机构在T日收市后为投资人办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算,在T+1日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算,并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。基金管理人、基金托管人与申购赎回代理机构在T+2日办理现金差额的交收。
如果登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形,则依据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。
基金管理人、登记结算机构可在法律法规允许的范围内,对上述申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整,并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种指定媒体公告。
(五)申购和赎回的数额限定
投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。
本基金最小申购赎回单位为100万份,基金管理人有权对其进行更改,并在更改前至少3个工作日依照有关规定在指定媒体上予以公告。
(六)申购、赎回的对价及费用
1、申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。
2、投资人在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。
3、T日的基金份额净值在当日收市后计算,并在T+1日内公告,计算公式为估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数。如遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。未来,若市场情况发生变化,或相关业务规则发生变化,基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。
(七)申购赎回清单的内容与格式
1、申购赎回清单的内容
T日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日现金替代的溢价比例、T日允许现金替代的最高比例、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其它相关内容。
2、申购赎回清单组合证券相关内容
组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。
3、最小申购赎回单位
最小申购赎回单位是基金申购赎回的最基本单位。
4、申购赎回清单现金替代相关内容
现金替代是指申购、赎回过程中,投资人按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。
①现金替代分为3种类型:禁止现金替代(标志为"禁止")、可以现金替代(标志为"允许")和必须现金替代(标志为"必须")。
禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时,该成份证券不允许使用现金作为替代。
可以现金替代是指在申购基金份额时,允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代,但在赎回基金份额时,该成份证券不允许使用现金作为替代。
必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时,该成份证券必须使用现金作为替代。
②可以现金替代
①适用情形:可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资人无法在申购时买入的证券,或基金管理人认为可以采用现金替代的其他情形。
②替代金额:对于可以现金替代的证券,替代金额的计算公式为:
替代金额=替代证券数量×该证券最新价格×(1+现金替代溢价比例)
其中,"最新价格"的确定规则为:
i)该证券正常交易时,采用最新成交价;
ii)该证券正常交易中出现涨停时,采用涨停价格;
iii)该证券停牌且当日有成交时,采用最新成交价;
iv)该证券停牌且当日无成交时,采用最近一次收盘价(考虑当日的除权除息等因素)。
收取可以现金替代溢价的原因是,对于使用可以现金替代的证券,基金管理人需随后买入,而实际买入价格加上相关交易费用后与申购赎回的最新价格可能有所差异。为便于操作,基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例,并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本,则基金管理人将通过多收取的差额;如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本,则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。
③替代金额的处理程序
T日,基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例,并据此收取替代金额。
在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+2日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。
T+2日日终,若已购入全部被替代的证券,则以替代金额与被替代证券的实际购入成本(包括买入价格与交易费用)的差额,确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项;若未能购入全部被替代的证券,则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。
特例情况:若自T日起(不含T日)上海证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日,则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。
若现金替代日(T日)后至T+2日(若在特例情况下,则为T日起第20个交易日)期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动,则进行相应调整。
T+2日后第1个工作日(若在特例情况下,则为T日起第21个交易日),基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人,相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。
④替代限制:为更有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,基金管理人可规定投资人使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为:

$$\text{现金替代比例}(\%)=\frac{\sum(\text{第}i\text{个替代证券的数量}\times\text{该证券最新价格}\times(1+\text{现金替代溢价比例}))}{\text{申购基金份额资产净值}}\times 100\%$$

⑥必须现金替代
①适用情形:必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整,即将被剔除的成份证券,或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。
②替代金额:对于必须现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金,即"固定替代金额"。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其T日预计开盘价。
5、预估现金部分相关内容
预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理机构预先冻结申请申购、赎回的投资人的相应资金,由基金管理人计算的现金数额。
本基金T日申购赎回清单中公告预估现金部分计算公式为:
T日预估现金部分=T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值-申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和)
其中,T日预计开盘价主要根据交易所提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。
另外,若T日为基金分红除息日,则计算公式中的"T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值"需扣减相应的收益分配数额。
预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。
6、申购赎回清单现金差额相关内容
T日现金差额=T+1日的申购赎回清单中公告,其计算公式为:
T日现金差额=T日最小申购赎回单位的基金资产净值-申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和)
T日投资人申购赎回基金份额时,需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资人申购时,如现金差额为正数,则投资人应根据其申购的基金份额支付相应的现金,如现金差额为负数,则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金;在投资人赎回时,如现金差额为正数,则投资人将根据其赎回的基金份额获得相应的现金,如现金差额为负数,则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。
7、申购赎回清单的格式
申购赎回清单的格式举例如下:

基本信息	
最新公告日期	2013年8月3日
基金名称	万家上证380交易型开放式指数证券投资基金
基金管理人公司名称	万家基金管理有限公司
一级市场基金代码	510681
2013年7月31日信息内容	
现金差额(单位:元)	75.640
最小申购赎回单位资产净值(单位:元)	1,026,128
基金份额净值(单位:元)	1.0261
2013年8月3日信息内容	
预估现金部分(单位:元)	114.360
现金替代比例上限	50%