万家基金管理有限公司关于以通讯方式召开万家家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

万家基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2018年10月31日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和万家基金管理有限公司网站（www.wjasset.com）发布了《万家基金管理有限公司关于以通讯方式召开万家家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布万家基金管理有限公司关于以通讯方式召开万家家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规和《万家家裕债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的有关规定，万家家裕债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人万家基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议召开时间：自2018年11月1日起，至2018年12月2日17:00止（以基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：万家基金管理有限公司

联系地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼

联系人：路晓静

联系电话：021-38909632

邮政编码：200122

请在信封表面注明：“万家家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话95538转6或400-888-0800免长途话费咨询。

二、会议审议事项

《关于修改万家家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（见附件1）

上述议案的内容说明请参见《万家家裕债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》（见附件4）。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年11月1日，因2018年11月1日交易时间结束后在本基金登记机构登记在册的本基金的基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写说明及递交方式

1、本次会议表决票详见附件2。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录本基金管理人网站（www.wjasset.com）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人持有人自行签署的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构持有人自行授票的，需在表决票上加盖本机构公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位应提供加盖公章的有效登记证书复印件等）、法定代表人（负责人、主要负责人、执行事务合伙人委派代表、或其他机构负责人、或其他机构授权代表）身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位应提供加盖公章的有效登记证书复印件等）、法定代表人（负责人、主要负责人、或其他机构负责人、或其他机构授权代表）身份证件正反面复印件；如代理人为个人，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位应提供加盖公章的有效登记证书复印件等）。

（5）以上各项基本公告全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内（以本基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至基金管理人的办公地址，并请在信封表面注明：“万家家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（招商银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后下一工作日进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证。如基金托管人经通知拒绝参加监督计票，则基金管理人可单独进行计票并予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上的手写文字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票。无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人在提交表决票的同时，如果能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票。无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（5）如表决票上的手写文字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，以上授权将被视为是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额同意以上所做授权。

附件4：

万家家裕债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书

万家家裕债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2018年1月30日成立并正式运作，万家基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）为本基金的管理人，招商银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）为本基金的托管人。

为规范地满足投资者需求，维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）等法律法规的规定和《万家家裕债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，决定召开本基金份额持有人大会，审议《关于修改万家家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

本次《关于修改万家家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额的50%以上（含50%）同意通过方为有效，故方案存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次基金份额持有人大会决议的备案，均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

一、基金修改要点

1、变更基金名称，由“万家家裕债券型证券投资基金”变为“万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金”；

2、变更基金类型，由“债券型”变为“股票型”；

3、变更基金经理，增加“陈旭”，2013年1月军队转业进入我公司工作，现任万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家量化回报多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

4、变更业绩比较基准，由“中债总全价指数（总值）收益率*90%＋沪深300指数收益率*10%”变为“中证1000指数收益率*95%＋一年期人民币定期存款利率（税后）*5%”；

5、变更风险收益特征，由“本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于中低风险/收益的产品”变为“本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金”；

6、变更投资范围，增加“股指期货、融资业务和转融通证券出借交易”；减少“可分离交易可转债”；

7、变更投资组合限制，增加“本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成分股及其替代成分股的资产不低于非现金基金资产的80%；

本基金参与融资业务，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

本基金参与股指期货需遵照下述投资比例限制：本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货及其他期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日内，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票芯市值的20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关规定；在任何交易日内交易（不含期货交割）的股票总成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

本基金参与股票期权交易，应当符合下列要求：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值指期权合约数量与合约单位的乘积计算；

减少“本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，投资于股票、权证资产的比例不高于基金资产的20%；

本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的股票市值、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过20%；投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过5%；

本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受此限制；

6、变更投资策略，删除“投资策略概述”；

“本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。

投资组合策略

本基金为指数型股票基金，采取量化方法进行积极的股票筛选与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金的股票资产投资主要以目主开发的量化多因子模型为基础，以中证1000指数的成分股数为基础股票池，对股票池进行投资价值定量分析，从而构建市场上具备超额收益的股票投资组合。首先，基于对中国A股市场的市场风格、通过对宏观经济、政策、市场、资金、情绪、估值等因素的分析，以及对市场风格的持续性、稳定性、切换性等因素的分析，通过多因子模型对因子库中的不同因子进行动态选取，并利用量化方法进行组合优化，最后，在此基础上，根据动态多因子模型对入股市场中的股票进行打分，并选取其中具备超额收益的股票构建投资组合。本基金在数据方面选取风格因子（宏观数据、行业数据）、一致预期数据以及市场情绪指标作为选取因子的标准。利用风格因子数据在一段时间内市场风格偏好、市场情绪指标对在一段时间内市场信息传播进行有效筛选，反映在动量反转类因子上；同时一致预期因子给予了股票在基本面上的相关，最终公司的成长性和财务的稳定性决定公司的中长期表现。在投资组合管理过程中，本基金还将注重投资对象的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。

指数增强投资方式策略：跟踪误差可控，主动性权资预期能够通过风险预算的支持，风险预算因最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险控制模型，有效将投资组合风险控制在预算范围内。本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以实现控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过7.75%。

2、债券投资策略

本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

3、中小企业私募债券投资策略

本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行中小企业私募债券的投资。

本基金将根据宏观经济、证券市场、中小企业私募债券流动性管理、本基风险调整后收益最大化的原则，确定中小企业私募债券类资产的合理配置比例，保证本金相对安全和资产流动性，以期获得长期稳定收益。在投资决策过程中，将评估中小企业私募债券的流动性对基金资产流动性的影响，以确保基金资产的流动性。同时，将根据中小企业私募债券信用风险、市场风险、流动性风险等因素的变化，及时调整组合久期管理、信用风险管理、流动性管理等策略，以期获得较为稳定的收益。

4、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资应综合考虑市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差策略、提前偿还率策略等多种投资策略，投资于资产支持证券。

5、可转债券投资策略

可转换债券（含可分离转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换债券定价模型进行估值分析，投资具有较高安全边际和具较高成长性的可转换公司债券，获取稳健的投资回报。

6、证券公司短期公司债券投资策略

本基金在对证券公司短期公司债券特点和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，通过考察利率水平、票息率、付息频率、信用风险及流动性等因素判断其债券价值；采用多种定价模型以及研究人员对证券公司基本面等不同变量的研究确定其投资价值。投资综合方式为在强调安全性的基础上，以期获得较高的短期收益为目标。

7、衍生产品投资策略

（1）权证投资策略。权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

（2）股指期货投资策略。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

（3）国债期货投资策略。本基金可基于谨慎原则运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

（4）股票期权投资策略。本基金将按照风险管理的原则，以对冲投资组合的系统性风险，有效管理现金流最或降低建仓成调仓过程中的冲击成本等，本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与期权交易的投资时机和投资比例，在合理的成本控制下，以期提高基金的投资收益。

（5）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资其他衍生工具，本基金将根据国家有关规定、法律法规和监管机构的规定，确定本基金投资该类品种的投资策略和比例限制，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

8、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内，风险可控的原则前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借交易，以期获得较高的投资收益。

在杠杆作用，降低因市购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金增持有人增厚投资收益。

9、其他

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后根据需要调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

9、变更管理费率，由0.70%变为1.00%；

10、变更分红原则，增加“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为1次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%”。

11、变更申购费率A类，由“

通过基金管理人的直销中心申购本基金的特定投资者群体申购费率如下：

申购金额（M）	A类基金份额申购费率	C类基金份额申购费率
M＜100万	0.08%	0
100万≤M＜300万	0.05%	
300万≤M＜500万	0.03%	
M≥500万	每笔1,000.00元	

其他投资者申购本基金的申购费率如下：

申购金额（M）	A类基金份额申购费率	C类基金份额申购费率
M＜100万	0.80%	0
100万≤M＜300万	0.50%	
300万≤M＜500万	0.30%	
M≥500万	每笔1,000.00元	

变为

“通过基金管理人的直销中心申购本基金的特定投资者群体申购费率如下：

申购金额（M）	A类基金份额申购费率	C类基金份额申购费率
M＜100万	0.10%	0
100万≤M＜300万	0.10%	
300万≤M＜500万	0.06%	
M≥500万	每笔1,000.00元	

其他投资者申购本基金的申购费率如下：

申购金额（M）	A类基金份额申购费率	C类基金份额申购费率
M＜100万	1.00%	0
100万≤M＜300万	1.00%	
300万≤M＜500万	0.60%	
M≥500万	每笔1,000.00元	

12、变更赎回费率A类，由

持有时间（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.50%
7日≤Y＜30日	1.00%
30日≤Y＜90日	0.20%
Y≥90日	0%

变为

持有时间（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.50%
7日≤Y＜30日	0.75%
30日≤Y＜180日	0.50%
Y≥180日	0

13、变更赎回费率C类，变为“

持有时间（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.50%
7日≤Y＜30日	0.50%
Y≥30日	0

除了修改以上主要部分之外，另外还根据最新法律法规及相关要求与现行业务操作实践对《基金合同》进行了修改，详细修改情况见《万家家裕债券型证券投资基金基金合同》修改前后对照表；

章节	原《万家家裕债券型证券投资基金基金合同》版本	修订后的《万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》版本
基金名称	万家家裕债券型证券投资基金	万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金
第一部分前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 1、订立本基金合同的目的是保护投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。 二、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由万家家裕债券型证券投资基金转型而来。万家家裕债券型证券投资基金设立依据《证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《万家家裕债券型证券投资基金基金合同》及其他有关规定颁发。 三、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由万家家裕债券型证券投资基金转型而来。万家家裕债券型证券投资基金设立依据《基金法》、《万家家裕债券型证券投资基金基金合同》及其他有关规定颁发。 中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和投资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。 中国证监会对本基金募集的注册，是指中国证监会根据证券投资基金法律法规对本基金募集申请的审核，并不表明其对本基金募集的价值和投资收益作出实质性判断或保证。 投资者应根据本基金的投资目标、投资范围、风险收益特征等，自行判断本基金是否适合其投资目的、财务状况和投资需求，并根据本基金的风险收益特征，独立做出投资决策。基金管理人应按照有关规定履行信息披露义务。 投资者应当认真阅读本基金的招募说明书、基金合同及其他有关资料，并根据基金合同所载明的本基金的投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、收益分配原则、基金管理人和基金托管人的权利和义务、本基金的风险收益特征和投资人的义务等，全面了解本基金的情况，做出谨慎的投资决定，承担投资本基金所产生的投资风险。 …… 发生上述第1、2、3、4、6、7、10项情形之一且基金管理人决定拟继续管理的期间，基金管理人应书面提醒有关现金持有人，在