万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
二零一八年三月
重要提示

万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2017年12月18日经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]2346号文准予注册。

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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。

本基金成立运作期间,单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

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,投资有风险,投资者在投资本基金前,请认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,自主判断基金的投资价值,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:证券市场整体环境引发的系统性风险;个别证券特有的非系统性风险;大量赎回或暴跌导致的流动性风险;基金投资过程中产生的操作风险;因交收违约和投资债券引发的信用风险;基金投资回报可能低于业绩比较基准的风险;本基金的投资范围包括股指期货、国债期货、股票期权、权证等金融衍生品,可能给本基金带来额外风险。本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。此外,本基金以1.00元初始面值进行募集,在市场波动等因素的影响下,存在单位份额净值跌破1.00元初始面值的风险。

基金不同于银行储蓄与债券,基金投资者有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。

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预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

第一部分 绪言

《万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“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》)、《公开募集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》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号(招募说明书的内容与格式)》等有关法律法规以及《万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了万家量化同顺多策略灵活配置混合型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。

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。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,并经中国证监会注册。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。

第二部分 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:

1、基金或本基金:指万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金

2、基金管理人:指万家基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同,《基金合同》:指《万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书、本招募说明书:指《万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告:指《万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》

8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改(中华人民共和国港口法)等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险管理规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有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

17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者:指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、投资者:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称

21、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者

22、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资计划等业务

23、销售机构:指万家基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构

24、直销机构:指万家基金管理有限公司

25、非直销销售机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构

26、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

27、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为万家基金管理有限公司或接受万家基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、基金账户:指登记机构为投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29、基金交易账户:指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认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资计划等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

30、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期

31、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

32、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月

33、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、T日:指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的工作日

36、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日),n为自然数

37、开放日:指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

38、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他业务的时间段

39、《业务规则》:指万家基金管理有限公司的相关业务规则,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人和投资者共同遵守

40、认购:指在基金募集期内,投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、申购:指基金合同生效后,投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

43、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

44、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

45、定期定额投资计划:指投资者通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、申购金额及扣款方式,由销售机构于每期约定申购日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

46、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%

47、元:指人民币元

48、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

49、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

50、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

52、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

53、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

54、摆动定价机制:指当本基金各类份额遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

55、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

56、不可抗力:指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

57、A类基金份额:指在投资者认购/申购时收取认购/申购费、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

58、C类基金份额:指在投资者认购/申购时不收取认购/申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称:万家基金管理有限公司

住所、办公地址:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)

法定代表人:方一天

成立日期:2002年8月23日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【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:021-38909626

传真:021-38909627

股权结构:

中泰证券股份有限公司	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。目前管理五十八只开放式基金,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、万家行业优选混合型证券投资基金(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、万家精选混合型证券投资基金、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、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达保本混合型证券投资基金、万家颐和保本混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫通纯债债券型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫稳纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金、万家恒景18个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场证券投资基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家家裕债券型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞禄灵活配置混合型证券投资基金、万家家乐债券型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金。

二、主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

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

董事马永春先生,政治经济学硕士学位,曾任新疆自治区党委政策研究室科长,新疆通宝投资有限公司总经理,新疆对外经贸集团总经理,新疆天山股份有限公司董事,新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。现为新疆国际实业股份有限公司高级顾问。

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

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

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

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

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

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,董事会秘书兼副总经理,现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书。

监事张浩先生,中共党员,管理学博士,先后任职于山东东银投资管理有限公司、山东省国有资产控股有限公司、巨能资本管理有限公司。现任巨能资本管理有限公司董事长。

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

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月起加入万家基金管理有限公司,现任公司总经理助理。

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

3、基金管理人高级管理人员

董事长:方一天先生(简介请参见基金管理人董事会成员)

总经理:经晓云女士(简介请参见基金管理人董事会成员)

副总经理:李杰先生,硕士研究生。1994年至2003年任职于国泰君安证券,从事行政管理、机构客户开发等工作;2003年至2007年任职于兴安证券,从事营销管理工作;2007年至2011年任职于齐鲁证券,任营业部高级经理、总经理等职。2011年加入万家基金管理有限公司,曾任综合管理部总监、总经理助理,2013年4月起任公司副总经理。

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

督察长:兰剑先生,法学硕士,律师、注册会计师,曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作,2005年10月进入万家基金管理有限公司工作,2015年4月起任公司督察长。

4、本基金基金经理简历

卞勇先生,量化投资部总监。现任万家180指数证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金和万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

(1)权益投资决策委员会

主任:黄海

委员:莫海波、卞勇、叶勇、白宇、李文宾

黄海先生,副总经理、投资总监。

莫海波先生,投资研究部总监、基金经理。

卞勇先生,量化投资部总监、基金经理。

叶勇先生,权益投资二部总监。

白宇先生,交易部总监。

李文宾先生,基金经理。

(2)固收投资决策委员会

主任:方一天

委员:陈广益、苏谋东、白宇、熊义明

方一天先生,董事长

陈广益先生,总经理助理、基金运营部总监。

苏谋东先生,固定收益部副总监,基金经理。

白宇先生,交易部总监。

熊义明先生,首席宏观分析师。

(3)量化投资决策委员会

主任:李杰

委员:黄海、卞勇、陈旭

李杰先生,公司副总经理。

黄海先生,公司副总经理、投资总监。

卞勇先生,量化投资部总监,基金经理。

陈旭先生,量化投资二部总监助理,基金经理。

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、依法募集资金,办理基金份额的发售和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4、按照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收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制季度、半年度和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值、确定基金份额申购、赎回价格;

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

9、按照规定召集基金份额持有人大会;

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11、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;

12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人的承诺

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)侵占、挪用基金财产;

(6)泄漏因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8)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利益;

(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)侵占、挪用基金财产;

(14)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(15)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、受雇人或任何第三人牟取利益;

(3)不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,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)不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

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的对公司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)基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确;

(2)基金管理人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。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称:中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层

法定代表人:周慕冰

成立时间:2009年1月15日

组织形式:股份有限公司

注册资本:32,479,411.7万元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]23号

联系电话:010-66060069

传真:010-68121816

联系人:贺倩

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

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

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近240名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2017年12月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共397只。

二、基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

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

2、内部控制组织结构

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

3、内部控制制度及措施

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

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、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、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、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,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,基金托管人应报告中国证监会。

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

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人直销中心及电子直销系统(网站、微交易)。

住所、办公地址:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)

法定代表人:方一天

联系人:张婉婉

电话:(021)38909777

传真:(021)38909798

客户服务热线:400-888-0800;95538转6

投资者可以通过基金管理人电子直销系统(网站、微交易)办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅基金管理人的网站公告。网上交易网址:https://trade.wjasset.com/

微交易:万家基金微理财(微信号:wjfund_e)

2、非直销销售机构

非直销销售机构名单详见《基金份额发售公告》或相关业务公告。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

二、基金登记机构

名称:万家基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)

法定代表人:方一天

联系人:尹超

(下转A34版)

万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
重要提示

1. 万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已获中国证监会证监许可[2017]2346号文注册。中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

2. 本基金为契约型、开放式、混合型证券投资基金。

3. 本基金的管理人为万家基金管理有限公司(以下简称“本公司”),登记机构为万家基金管理有限公司,托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

4. 本基金将自2018年4月2日至2018年4月27日通过基金管理人指定的销售机构(包括直销机构和非直销销售机构)公开发售。募集期间,基金管理人可根据情况变更或增减基金非直销销售机构,并予以公告。

5. 募集规模上限:本基金不设首次募集规模上限。

6. 募集对象:本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

7. 认购限额:

(1)本基金采用金额认购方式。

(2)投资者认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。

(3)投资者在募集期内可以多次认购基金份额,认购申请一经受理不得撤销。

(4)除第(5)项规定的情形外,募集期间单个投资者的累计认购金额没有限制。

(5)如本基金单个投资者累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资者的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资者认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

(6)投资者认购时,通过本基金的电子直销系统(网站、微交易)或非直销销售机构认购时,原则上,首次认购的最低限额为人民币10元,追加认购单笔最低金额为人民币10元;投资者通过本基金的直销中心认购时,首次认购的最低限额为人民币100元,追加认购单笔最低金额为人民币100元。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

(7) 以上认购金额均含认购费。

8. 投资者欲购买本基金,须开立本公司基金账户,不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

9. 投资者应保证用于认购的资金来源合法,投资者应有权自行支配,不存在任何法律上、合约上或其