

# 万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

## 重要提示

1. 万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)于2024年12月19日经中国证券监督管理委员会证监许可[2024]1884号文准予注册。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. 本基金为交易型开放式、股票型证券投资基金。

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”),登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,托管人为江苏银行股份有限公司。

4. 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、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5. 本基金将自2025年2月10日至2025年2月21日通过网上现金认购、网下现金认购2种认购方式公开发售。本基金目前暂不开通网下股票认购业务。如深圳证券交易所对网上现金认购时间作出调整,本公司将作出相应调整并及时公告。本公司可根据募集情况适当延长或缩短本基金的募集期限,但最长不超过法定募集期限,并予以公告。

6. 网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购。网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。募集期间,基金管理人可根据情况变更或增减发售代理机构。

7. 投资者认购本基金时需具有深圳证券交易所A股账户(以下简称“深圳A股账户”)或深圳证券交易所证券投资基金账户(以下简称“深圳证券投资基金账户”)。

已有深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的投资者不必再办理开户手续。

尚无深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的投资者,需在认购前持本人身份证件到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳A股账户和深圳证券投资基金账户的具体程序和办法,请到各开户网点详细咨询有关规定。

账户使用注意事项:

(1) 如投资者需要参与网下现金或网上现金认购,应使用深圳A股账户或深圳证券投资基金账户;深圳证券投资基金账户只能进行本基金的网上现金认购、网下现金认购和二级市场交易。如投资者需要参与基金份额的申购、赎回,则应开立深圳A股账户。

(2) 已购买过由万家基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资者,其拥有的万家基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

8. 募集规模上限

(1) 本基金首次募集规模上限为20亿元人民币(不包括募集期利息和认购费用)。

(2) 若募集期内认购申请全部确认后,基金认购的总份额不超过20亿份(折合为金额20亿元人民币),则对所有的有效认购申请全部予以确认。

若募集期日内任一基金份额发售日(含募集首日)业务办理时间结束后,累计有效认购申请份额总额超过20亿份(折合为金额20亿元人民币),则该日为本基金最后认购日(即募集期末日),本基金自募集期末日的次日起不再接受投资者认购申请。基金管理人将对募集期末日之前的有效认购申请全部予以确认,对募集期末日的认购申请采用“末日比例确认”的原则给予部分确认。当发生末日比例确认时,基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者。

(3) 末日认购申请确认比例的计算方法:

募集期末日认购申请确认比例=(20亿份-募集期末日之前有效认购申请份额总额)/募集期末日有效认购申请份额总额。

投资者募集期末日认购申请确认份额=投资者在募集期末日提交的有效认购申请份额×募集期末日认购申请确认比例

注:公式中“募集期末日之前有效认购申请份额总额”和“募集期期末日有效认购申请份额总额”都不包括募集期利息和认购费用。

当发生部分确认时,本基金登记机构按照募集期末日认购申请确认比例对募集期末日每笔有效认购申请份额进行部分确认处理,因对每笔认购明细处理的精度等原因,最终确认的本基金累计有效认购份额(不包括募集期利息和认购费用)可能会略微高于或低于20亿份。募集期末日认购申请确认份额不受认购总额限制的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记机构的计算并确认的结果为准。

9. 网上现金认购以基金份额申请,单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍;网下现金认购以基金份额申请,投资人通过基金管理人和发售代理机构网下现金认购时,每笔认购份额须为1,000份或其整数倍。投资人可以多次认购,单个投资者的累计认购份额不设上限,但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

10. 网上现金认购可多次申报,不可撤单,一经申报,认购资金即被冻结。网下现金认购申请提交后不得撤单。

11. 本基金基金份额净值为人民币1.00元,认购价格为人民币1.00元。

12. 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、合约上或其他障碍。

13. 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接受到认购申请,认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的任何损失由投资者自行承担。

14. 本公告仅对万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金发售的有关事项和规定予以说明,投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在中国证监会规定信息披露媒介上的《万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

15. 本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.wjasset.com)。投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金募集等相关事宜。

16. 各销售机构的销售网点以及开户、认购等事项的详细情况请向各销售机构咨询。

17. 对未开设销售网点的地方的投资者,请拨打本公司的客户服务热线(400-888-0800),万家基金管理有限公司网站(www.wjasset.com)或者通过其他渠道咨询购买事宜。

18. 基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

19. 基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商并予以公告或公示。本基金基金份额上市后,未托管在申购赎回代理券商的基金份额只能进行二级市场买卖,如投资者需进行本基金基金份额的申购赎回,须托管或转托管到申购赎回代理券商。

20. 风险提示

本基金的指数为沪深300指数。

(1) 样本空间

指数样本空间由同时满足以下条件的非ST、\*ST沪深A股和红筹企业发行的存托凭证组成:

1) 科创板股票、创业板股票:上市时间超过一年。

2) 其他证券:上市时间超过一个季度,除非该证券自上市以来日均总市值排在前30位。

(2) 选择方法

沪深300指数样本是按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、证券价格无明显异常波动或市场操纵的公司:

1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名,剔除排名后50%的证券;

2) 对样本空间内剩余证券,按照过去一年的日均总市值由高到低排名,选取前300名的证券作为指数样本。

(3) 指数计算

指数计算公式为:报告期指数=报告期样本的调整市值/除数×1000

其中,调整市值=Σ(证券价格×调整股本数)。指数计算中的调整股本数系根据分级靠档的方法对样本股本进行调整而获得。要计算调整股本数,需要确定自由流通量和分级靠档两个因素。当样本名单、股本结构发生变化或样本的市值出现非交易因素的变动时,根据样本股本维护规则,采用“除数修正法”修正原则,以保证指数的连续性。

标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司官方网站,网址:https://www.csindex.com.cn。

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,投资者在投资基金之前,应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,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,自主判断本基金的投资价值,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。投资基金可能遇到的风险包括:市场风险、管理风险、流动性风险、本基金的特有风险和其他风险等。本基金的特有风险包括:(1)指数化投资的风险,包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数计算出错的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构终止服务的风险等;(2)ETF运作的风险,包括可接受股票认购导致的风险,参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、成份股停牌的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、沪市成份股证券申赎处规则带来的风险、申购赎回单差错风险、申购赎回单标识设置不合理的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、第三方机构服务的风险、退市风险等;(3)本基金投资特定品种的特有风险,包括参与股指期货交易风险、股票期权投资风险、参与国债期货交易风险、资产投资风险、存托凭证投资风险、参与融资和转融通证券出借业务的风险等。

本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险。

本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪沪深300指数,其风险收益特征与标的指数所表现的市场组合的风险收益特征相似。

## 基金管理人:万家基金管理有限公司 基金托管人:江苏银行股份有限公司

本基金的具体风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

在现有结算规则下,当日竞价买入的基金份额,当日可以赎回;当日申购的基金份额,当日可以竞价卖出,次一交易日可以赎回。

投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所及登记机构的相关业务规则及其不时的更新,确保具备相关专业知识,清楚了解相关规则流程后方可参与本基金的认购、申购、赎回及交易。投资者一旦认购、申购或赎回本基金,即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及组合证券、现金替代、现金差额及其他对价等相关的交收方式已确认。

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起的投资风险,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。投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书、《基金合同》及基金产品资料概要。

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。基金管理人对其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

一、本次募集基本情况

1. 基金名称

万家沪深300交易型开放式指数证券投资基金(基金代码:159393;场内简称:沪深300指数ETF)。

2. 基金运作方式和类型

交易型开放式、股票型证券投资基金。

3. 基金存续期限

不定期

4. 基金份额发售面值、认购价格

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元,认购价格为人民币1.00元。

5. 基金销售机构

具体各发售代理机构和直销机构的联系方式见“八、本次募集当事人和中介机构”的“(三)基金销售机构”的相关内容。基金管理人可根据情况变更或增减发售代理机构,并在基金管理人网站公示。

6. 基金投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

7. 发售时间安排与基金合同生效

(1) 本基金的募集期限为自基金份额发售之日起最长不得超过3个月。

(2) 本基金将自2025年2月10日至2025年2月21日通过网上现金认购、网下现金认购2种认购方式公开发售。在认购期内,本基金向个人投资者和机构投资者同时发售,如深圳证券交易所对网上现金认购时间作出调整,本公司将作出相应调整并及时公告。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集期,但最长不超过法定募集期限,并予以公告。

8. 募集期结束后的基金份额总额及基金合同的生效

若募集期结束,基金募集的基金份额总额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人将办理基金募集手续,并自基金合同成立之日起3个月内开始运作。

9. 基金份额的发售

网下现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购。网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。募集期间,基金管理人可根据情况变更或增减发售代理机构。

10. 基金份额的申购与赎回

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购2种方式认购本基金。

11. 基金份额的认购费率

本基金的认购采用份额认购的原则。认购费用或认购佣金由认购基金份额的投资者承担,认购费率不超过0.80%,主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。认购费率如下表所示:

认购份额(S)	认购费率
S(50万份)	0.80%
50万份≤S<100万份	0.50%
S≥100万份	按笔固定收取,10000.00/笔

(1) 通过基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。

(2) 通过发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构,按照不超过0.80%的标准收取一定的佣金。

(3) 投资者多次申请现金认购的,须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计算。

(4) 基金管理人可以针对特定投资人(如养老金客户等)开展网下现金认购的费率优惠活动,详见基金管理人发布的相关公告。

3. 网上现金认购

(1) 认购程序:

投资人认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续,详见基金份额发售公告。

(2) 认购金额和利息折算的份额的计算

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者,认购以基金份额申请,认购金额、认购份额和利息折算的份额数量以基金管理人记录为准。

(3) 基金管理人认申购金额的计算公式:

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

(或适用固定费率的,认购佣金=固定费率)

认购金额=认购价格×认购份额×(1+佣金比率)

(或适用固定费率的,认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

净认购份额=认购份额+利息折算的份额

认购佣金由发售代理机构向投资人收取,投资人需以现金方式交纳认购佣金。

有效认购资金在募集期间产生的利息,将折算为基金份额,归基金份额持有人所有,具体利息折算份额数量以基金管理人及登记机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额=利息/认购价格

例:某投资人通过其发售代理机构以网上现金认购方式认购本基金800,000份,认购费率0.50%,假定认购金额产生的利息为10.00元,该笔认购最后按100%比例全部予以确认,则投资人需支付的认购费用和需准备的认购金额计算如下:

认购费用=1.00×800,000×0.50%-4,000.00元

认购金额=1.00×800,000×(1+0.50%)=804,000.00元

利息折算的份额=10.00/1.00=10份

认购费用由基金管理人向投资人收取,投资人需以现金方式交纳认购费用。

有效认购资金在募集期间产生的利息,将折算为基金份额,归基金份额持有人所有,具体利息折算份额数量以基金管理人及登记机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位,小数部分舍去,舍去部分计入基金财产。