

# 万家 180 指数证券投资基金 基金合同

(2020 年 12 月修订)

基金发起人：万家基金管理有限公司

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 目 录

前 言 .....	1
释 义 .....	2
第一部份 基金合同当事人及权利义务 .....	7
一、基金发起人 .....	7
二、基金管理人 .....	8
三、基金托管人 .....	12
四、基金份额持有人 .....	15
五、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 .....	24
第二部分 万家 180 指数证券投资基金基本情况 .....	26
一、基金的基本情况 .....	26
二、基金份额的发行 .....	26
三、基金合同的生效 .....	27
四、基金的托管 .....	24
五、基金的投资管理 .....	28
六、基金的申购、赎回 .....	27
七、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押 .....	39
八、基金的销售及服务代理 .....	40
九、基金的注册与登记过户 .....	41
十、基金的资产 .....	35
十一、基金资产估值 .....	36
十二、基金的费用与税收 .....	38
十三、基金的收益与分配 .....	40
十四、基金的会计与审计 .....	41
十五、差错处理 .....	50
十六、基金的信息披露 .....	52
十七、基金的终止与清算 .....	55
十八、基金专用交易席位的选用 .....	57

第三部分 其他事项 .....	59
一、业务规则 .....	59
二、违约责任 .....	59
三、法律适用与争议解决 .....	60
四、通知与送达 .....	60
五、《基金合同》的效力 .....	61
六、《基金合同》的修改和终止 .....	62
七、《基金合同》当事人盖章及其法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日 .....	63

## 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本基金投资者合法权益、明确本基金合同当事人的权利与义务、规范本基金运作。

2、订立本基金合同的依据是《民法通则》、《信托法》、《合同法》、《证券法》、《基金法》、《公开募集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》”)及其他法律、法规和有关规定。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、真实合法、充分保护投资者的合法权益。

4、本基金由发起人按照《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关法律、法规的规定设立，经中国证监会批准。

中国证监会做出的有关本基金的批准，并不表明其对基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

5、基金管理人、基金托管人将遵守《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。

6、基金管理人承诺恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

二、本基金合同是规定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件。本基金合同的当事人包括基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

1、基金发起人、基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。

2、基金投资者自取得依本基金合同所发行的基金份额之时，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，享有本基金合同规定的基金份额持有人的所有权利和利益，承担本基金合同规定的基金份额持有人的所有义务，其持有基金份额的行为本身即应视为其对本基金合同所有条款和条件的承认和接受。

本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披

露办法》实施之日起一年后开始执行。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深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。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

3、本基金合同的当事人按照《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关规定享有权利，同时需承担相应的义务。

基金发起人、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露的涉及本基金的信息，其内容涉及界定本基金合同当事人之间权利义务关系的，以本基金合同的规定为准。

## 释 义

万家 180 指数证券投资基金基金合同中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

- |              |  |
|--------------|--|
| 1、基金或本基金：    | 指万家 180 指数证券投资基金                             |
| 2、本合同、本基金合同： | 指《万家 180 指数证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充          |
| 3、《民法通则》：    | 指《中华人民共和国民法通则》                               |
| 4、《证券法》：     | 指《中华人民共和国证券法》                                |
| 5、《合同法》：     | 指《中华人民共和国合同法》                                |
| 6、《信托法》：     | 指《中华人民共和国信托法》                                |
| 7、《暂行办法》：    | 指 1997 年 11 月 14 日经国务院批准发布并施行的《证券投资基金管理暂行办法》 |
| 8、《试点办法》：    | 指 2000 年 10 月 8 日由中国证监会发布并实施的《开放式证券投资基金试点办法》 |

- 9、元：指人民币元
- 10、招募说明书：指《万家 180 指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- 11、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 12、基金管理人：指万家基金管理有限公司
- 13、基金发起人：指万家基金管理有限公司
- 14、基金托管人：指中国银行
- 15、基金销售代理人：指依据有关《销售代理协议》办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
- 16、基金注册与登记过户人：指办理本基金注册与登记过户的、本基金管理人或本基金管理人委托的其他机构
- 17、基金合同当事人：指受本基金合同约束，根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金发起人、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人
- 18、基金份额持有人：指根据本基金合同合法取得本基金份额的个人投资者或机构投资者
- 19、个人投资者：指自然人投资者
- 20、机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织
- 21、投资者：指个人投资者和机构投资者
- 22、基金合同生效日：指自《招募说明书》公告之日起三个月内，在基金净认购额超过人民币 2 亿元，且认购户数达到 100 户的条件下，基金发起人可以依据《试点办法》和实际发行情况停止发行，并宣告基金合同生效的日期
- 23、设立募集期：指自《招募说明书》公告之日起到基金合同生效日止的时间段，最长不超过 3 个月
- 24、工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

- 25、开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
- 26、T 日：指认购、申购、赎回或其他交易的申请日
- 27、认购：指在设立募集期内，购买基金份额的行为
- 28、申购：指本基金合同生效后，基金投资者购买基金份额的行为
- 29、赎回：指本基金合同生效后，基金投资者卖出基金份额的行为
- 30、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益
- 31、基金资产总值：指基金所购买的各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购款项以及其他投资所形成的价值总和
- 32、基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的价值
- 33、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
- 34、更新招募说明书：指本基金合同生效后每六个月公告一次的有关基金简介、基金季度报告、基金经营业绩、重要变更事项和其他按法律法规规定应披露事项的说明，更新招募说明书是对招募说明书的定期更新
- 35、销售机构：指基金管理人和基金销售代理人
- 36、基金销售网点：指基金管理人的直销中心及基金销售代理人的代销网点
- 37、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
- 38、法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章以及其他对合同当事人有约束力的决

- 定、决议、通知等
- 39、不可抗力：指本合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本协议的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易
- 40、《基金法》指《中华人民共和国证券投资基金法》
- 41、法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、行政规章、地方法规、地方规章及规范性文件；
- 42、《流动性风险管理规定》：指《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；
- 43、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；
- 44、《信息披露办法》：指《公开募集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
- 45、基金产品资料概要指《万家 180 指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 46、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账



户

47、特定资产:

包括: (一) 无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产; (二) 按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产; (三) 其他资产价值存在重大不确定性的资产

## 第一部分 基金合同当事人及权利义务

### 一、基金发起人

(一) 基金发起人：万家基金管理有限公司

- 1、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）
- 2、法定代表人：方一天
- 3、成立时间：2002 年 8 月 23 日
- 4、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
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、注册资本：3 亿元人民币
- 7、存续期间：持续经营
- 8、联系电话：021-38909626

(二) 基金发起人的权利与义务

- 1、基金发起人的权利
  - (1) 申请设立基金；
  - (2) 法律、法规和本基金合同规定的其他权利。
- 2、基金发起人的义务
  - (1) 公告招募说明书；
  - (2) 遵守基金合同；
  - (3) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
  - (4) 基金不能成立时，按照有关的法律法规及时退还所募集资金本息并承担发行费用；
  - (5) 法律、法规和本基金合同规定的其他义务。

## 二、基金管理人

(一) 基金管理人：万家基金管理有限公司

- 1、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）
- 2、法定代表人：方一天
- 3、成立时间：2002 年 8 月 23 日
- 4、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
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、注册资本：3 亿元人民币
- 7、存续期间：持续经营
- 8、联系电话：021-38909626

(二) 基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利

(1) 自本基金合同生效之日起，基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则，依法独立运用基金资产并独立决定其投资方向和投资策略；

(2) 根据本基金合同的规定，制定并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、质押、收益分配等方面的业务规则；

(3) 根据本基金合同的规定获得基金管理费，收取或委托收取投资者认购费、申购费、赎回费及其他事先公告的合理费用以及法律法规规定的费用；

以基金资产负担因处理基金事务所支出的其他费用以及对第三人所负的债务，若基金管理人以其自有财产先行支付的，对基金资产有优先受偿的权利；

基金管理人违背管理职责或者处理基金事务不当对第三人所负债务或者自己受到的损失，以其自有财产承担；

(4) 根据本基金合同规定销售基金份额；

(5) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(6) 依据本基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律规定对基金资产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国人民银行，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金托管人，或采取其它必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金销售代理人的作为或不作为违反了法律法规、本基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、本基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益；

(8) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

(9) 以基金的名义依法为基金进行融资，并以基金资产履行偿还融资和支付利息的义务；

(10) 依据本基金合同的规定，决定基金收益的分配方案；

(11) 按照《基金法》，代表基金对被投资公司行使股东权利；

(12) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

(1) 基金管理人将遵守《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；

基金管理人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金资产；

(2) 设置相应的部门并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资产，防范和减少风险；

设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其它业务或委托其它机构代理这些业务；

设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与登记过户工作或委托其它机构代理该项业务；

(3) 建立健全内部控制制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的固有资产相互独立，确保分别管理、分别计帐；保证本基金与基金管理人管理的其他基金在资产运作、财务管理等方面相互独立，确保分别管理、分别计帐。

(4) 除依据《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不为自己及任何第三方谋取利益，基金管理人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金资产，造成基金资产损失的，承担赔偿责任；

基金管理人不得将基金资产转为其自有财产，违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复基金资产的原状、承担赔偿责任；

(5) 除依据《信托法》、《基金法》、基金合同及其他有关规定外，基金管理人不得委托第三人管理、运作基金资产；

(6) 接受基金托管人依据法律法规、本基金合同和托管协议对基金管理人履行本基金合同和托管协议的情况进行的监督，并采取所有必要措施对基金托管人违反法律法规、本基金合同和托管协议的行为进行纠正和补救；

(7) 按规定计算并公告基金净值信息；

(8) 按照法律和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(9) 严格按照《信托法》、《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；

(10) 保守基金的商业秘密，不泄露基金投资计划等；除《信托法》、《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，但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露不应视为基金管理人违反本基金合同规定的保密义务；

(11) 依据本基金合同规定决定基金收益分配方案并向基金份额持有人分配基金收益；

(12) 不谋求对基金资产所投资的公司控股和直接管理；

(13) 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，执行基金份额持有人大会决议；

(14) 编制基金的财务会计报告；

(15) 保存基金的会计账册、报表及其他处理有关基金事务的完整记录 15 年以上；

(16) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配

(17) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理基金管理事务的行为承担责任；

(18) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(19) 监督基金托管人按法律法规和合同规定履行自己的义务；基金托管人因过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；

(20) 基金管理人因违反本合同规定的信托目的处分基金资产或者因违背本合同规定的管理职责、处理基金事务不当而致使基金资产受到损失的，应当承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；基金资产的受让人明知是违反本合同所规定的信托目的而接受基金资产的，应当予以返还或予以赔偿；

(21) 确保向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资人能够按照本基金合同规定的时间和方式，查阅到或得到与基金有关的公开资料；

(22) 负责为基金聘请注册会计师和律师；

(23) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

(24) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

(三) 基金管理人禁止行为

- 1、以基金名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 2、从事任何形式的证券承销业务；
- 3、从事除国家债券以外的其他证券自营业务；
- 4、从事资金拆借业务；
- 5、动用银行信贷资金从事基金投资；
- 6、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 7、从事证券信用交易；
- 8、以基金资产从事房地产投资；
- 9、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 10、基金之间相互投资；
- 11、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 12、法律、法规及中国证监会规定的基金管理公司禁止从事的其他行为。

### 三、 基金托管人

(一) 基金托管人： 中国银行股份有限公司

- 1、地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号
- 2、法定代表人：陈四清
- 3、成立时间：1983 年 10 月 31 日
- 4、组织形式：股份有限公司
- 5、注册资本： 人民币 294,387,791,241 元
- 6、存续期间：持续经营

(二) 基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金的资产；
- (2) 依照本基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督本基金的投资运作；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (5) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

(1) 基金托管人将遵守《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。

基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并保管基金资产；

(2) 设立专门的基金托管部，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，负责基金资产托管事宜；

建立健全内部风险监控制度，对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险；

(3) 购置并保持对于基金资产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行；

(4) 建立健全内部控制制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产相互独立，保证其托管的本基金资产与其托管的其他

基金资产相互独立；对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；

(5) 除依据《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金资产，造成基金资产损失的，承担赔偿责任；

基金托管人不得将基金资产转为其自有财产，违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复基金资产的原状、承担赔偿责任；

(6) 除依据《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产；

(7) 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；

(8) 基金托管人应当代表基金，以托管人和基金联名的方式开设证券账户，以基金的名义设立银行存款账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，并负责办理基金名下的资金往来；

(9) 对基金商业秘密和基金份额持有人、投资者进行基金交易有关情况负有保密义务，不泄露基金投资计划、投资意向及基金份额持有人或投资者的相关情况资料等；除《信托法》、《基金法》、本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；但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而作出的披露不应视为基金托管人违反本基金合同规定的保密义务；

(10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及单位基金资产净值；

(11) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国人民银行；

(12) 负责基金认购、申购和赎回的资金保管和清算；

(13) 采取适当、合理的措施，使基金份额的认购、申购和赎回等事项符合本基金合同等有关法律文件的规定；

(14) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合本基金合同等有关法律文件的规定；

(15) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算开放式基金份额的



认购、申购、赎回和注销价格的方法符合法律法规和本基金合同等法律文件的规定；

(16) 监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令违法、违规的，不予执行，并向中国证监会报告；

(17) 在定期报告内出具基金托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照本基金合同的规定进行，如果基金管理人未执行本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；

(18) 按有关规定，保存基金的持有人名册、会计账册、报表和其他有关基金托管事务的完整记录等 15 年以上；

(19) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(20) 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；

(21) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配

(22) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；

(23) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

(24) 因过错导致基金资产的损失或因违背托管职责或者处理基金事务不当对第三人所负债务或者自己受到的损失，应以其自有财产承担，其责任不因其退任而免除；

(25) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

(26) 法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

(三) 基金托管人的禁止行为

(1) 基金托管人不得投资于基金；

(2) 基金托管人不得以违反法律、行政法规、本基金合同及其他规定之方式保管基金资产；

(3) 除《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关规定明确规定的情形之外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产；

(4) 基金托管人对基金管理人的合法合规指令不得拖延和拒绝执行。

(5) 除依据基金管理人指令或本基金合同另有规定的，基金托管人不得自行运用、处分和分配基金资产；

(6) 基金托管人不得将基金资产转为其自有财产，不得将自有财产与基金资产进行交易，或者将不同基金资产进行相互交易；违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复基金资产的原状、承担赔偿责任；

(7) 基金托管人不得同意基金管理人将基金资产用于违反有关法律法规及本基金合同规定的投资；

(8) 基金托管人不得提供虚假的或者隐瞒重要事实的财务会计报告、统计报告、定期报告；

(9) 基金托管人不得从事法律、行政法规、中国证监会规定、本基金合同及其他规定所禁止的其它任何行为。

## 四、基金份额持有人

(一) 基金份额持有人的权利与义务

每份基金份额具有同等的权利与义务。

1、基金份额持有人的权利：

(1) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并行使表决权；

(2) 按本基金合同的规定取得基金收益；

(3) 监督基金经营情况，查询或获取公开的基金业务及财务状况的资料；

(4) 申购或赎回基金份额，并在规定的时间内取得有效申请的款项或基金份额；

(5) 获取基金清算后的剩余资产；

(6) 提请基金管理人或基金托管人按法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件的规定履行其义务；

(7) 依照本合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(8) 因基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构的过错导致利益受到损害，有要求赔偿的权利；

(9) 知悉本基金合同规定的有关信息披露内容；

(10) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件

规定的其他权利。

## 2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守本基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项，承担规定的费用；
- (3) 以其对本基金的投资额为限承担基金亏损或者终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；
- (5) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### (二) 基金份额持有人大会

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合法的授权代表共同组成。

#### 1、召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有 10% 以上（不含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 修改《基金合同》（《基金合同》中规定无需召开基金份额持有人大会的情形除外）；
- (2) 提前终止《基金合同》；
- (3) 更换基金管理人；
- (4) 更换基金托管人；
- (5) 转换基金运作方式；
- (6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (7) 《基金合同》约定的其他事项；
- (8) 法律法规规定的其它事项。

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) 在本《基金合同》规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对《基金合同》进行修改；

- (4) 对《基金合同》的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- (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;
- (6) 按照法律法规或本《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

## 2、召集方式

(1) 除法律法规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, 开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定;

(2) 在更换基金管理人或基金管理人无法行使召集权的情况下, 由基金托管人召集; 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十日内决定是否召集, 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六十日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(3) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有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十日内决定是否召集, 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六十日内召开; 基金管理人决定不召集, 代表基金份额百分之十以上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十日内决定是否召集, 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六十日内召开。

(4) 代表基金份额百分之十以上(含百分之十)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, 而基金管理人、基金托管人都不召集的, 代表基金份额百分之十以上(含百分之十)的基金份额持有人有权自行召集, 并至少提前三十日报国务院证券监督管理机构备案。

(5) 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。

## 3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在中国证监会指定的至少一种全国性信息披露报刊上公告通知。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；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权利登记日；
- (4) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话。

采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表决意见的寄交的截止时间和收取方式。

#### 4、会议的召开方式

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。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、本《基金合同》和会议通知的规定；

<2>经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权利登记日基金总份额的 50%（不含 50%）。

(1) 通讯开会。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> 基金管理人按本《基金合同》规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

<2> 基金管理人在基金托管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；

<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

人所持有的基金份额不小于在权利登记日基金总份额的 50%（不含 50%）；

〈4〉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、本《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无效表决。

(3) 如果开会条件达不到上述现场开会或通讯开会的条件，则对同一议题可履行再次开会的程序，再次开会日期的提前通知期限为 10 天，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权利登记日不应发生变化。

(4) 属于以现场开会方式再次召集基金份额持有人大会的，必须同时符合以下条件：

〈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、本《基金合同》和会议通知的规定；

〈2〉经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有的基金份额凭证显示，全部有效的凭证所对应的基金份额不小于本基金在权利登记日基金总份额的 50%（不含 50%）。

(5) 属于以通讯开会的方式再次召集基金份额持有人大会的，必须同时符合以下条件：

〈1〉基金管理人按本《基金合同》规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

〈2〉基金管理人在基金托管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；

〈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基金份额不少于在权利登记日基金总份额的 50%（不含 50%）；

〈4〉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、本

《基金合同》和会议通知的规定；

〈5〉会议通知公布前已报中国证监会备案。

## 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，如修改《基金合同》、决定终止基金、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、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（不含 10%）以上的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前 15 天提交召集人。

基金份额持有人大会的召集人发出召集现场会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 10 天前公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 10 天的间隔期。

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 10 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。

〈3〉单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（不含 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，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，需由单独或合并持

有权利登记日基金总份额 20%（不含 20%）以上的基金份额持有人提交；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，未获得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，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

## (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，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（不含 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。

### <2> 通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

(2) 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基金份额持有人所持表决权的 50%以上（不含 50%）通过方为有效；除下列（2）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基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（不含三分之二）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、提前终止基金合同以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

(5) 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。

(6) 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。



## 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，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。

〈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。

### (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。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会按照投资基金法有关规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。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、基金托管人均有法律约束力。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定。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 9、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

(1) 基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

(2) 现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

(3) 通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

(4) 当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

(5) 现场开会由出席大会的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；

(6) 一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

(7) 特别决议应当经参加大会的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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

## 五、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### （一）基金管理人和基金托管人的更换条件

#### 1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，须更换基金管理人：

（1）基金管理人解散、依法被撤销、被裁定进入破产清算程序或者由接管人接管其资产的；

（2）基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金份额持有人利益的；

（3）根据本《基金合同》，经基金份额持有人大会特别决议通过的；

（4）中国证监会充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责，并做出要求基金管理人退任的决定的；

基金管理人辞任，但在新的管理人确定之前，其仍须履行基金管理人的职责。

#### 2、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会和中国人民银行批准，须更换基金托管人：

（1）基金托管人解散、依法被撤销、被裁定进入破产清算程序或者由接管人接管其资产的；

（2）基金管理人充分理由认为更换基金托管人符合基金份额持有人利益的；

（3）根据本《基金合同》，经基金份额持有人大会特别决议通过的；

（4）中国人民银行充分理由认为基金托管人不能继续基金托管职责，并做出要求基金托管人退任的决定的。

基金托管人辞任，但在新的托管人确定之前，其仍须履行基金托管人的职责。

### （二）基金管理人和基金托管人的更换程序

#### 1、基金管理人的更换程序

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人提名。

（2）决议：基金份额持有人大会对更换原基金管理人形成特别决议。基金份额持有人大会还需对被提名的基金管理人形成决议。

（3）批准：新任基金管理人经中国证监会审查批准方可继任，原任基金管

理人经中国证监会批准方可退任。

(4) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。若基金管理人和基金托管人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人在基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上联合公告。

(5) 交接：原基金管理人应做出处理基金事务的报告，并向新任基金管理人办理基金事务的移交手续；新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

(6) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果更换后的基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中“万家”的字样。

## 2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名。

(2) 决议：基金份额持有人大会对更换原基金托管人形成特别决议。基金份额持有人大会对被提名的基金托管人形成决议。

(3) 批准：新任基金托管人经中国证监会和中国人民银行审查批准方可继任，原任基金托管人经中国证监会和中国人民银行批准方可退任；

(4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。若基金管理人和基金托管人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人在基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上联合公告。

(5) 交接：原基金托管人应做出处理基金事务的报告，并与新任基金托管人进行基金资产移交手续；新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。

## 第二部分 万家 180 指数证券投资基金基本情况

### 一、基金的基本情况

(一) 基金的名称：万家 180 指数证券投资基金；

(二) 基金类型：契约型开放式；

(三) 基金投资目标：本基金通过运用指数化投资方法，力求基金的股票组合收益率拟合上证 180 指数增长率。伴随中国经济增长和资本市场的发展，实现利用指数化投资方法谋求基金资产长期增值的目标。本基金指数化投资部分选择上证 180 指数作为跟踪目标指数，并作为业绩衡量基准；债券投资部分业绩衡量基准采用银行同业存款利率。

如果上证 180 指数被上海证券交易所停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者的合法权益原则，变更基金的投资目标和投资范围。

(四) 基金份额面值：基金份额面值为人民币 1.00 元；

(五) 基金存续期限：不定期。

### 二、基金份额的发售

(一) 设立募集期：自招募说明书公告之日起到基金合同生效之日止，最长不超过 3 个月，具体发行时间见发行公告。

(二) 发行对象：中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者(法律、法规、规章禁止投资证券投资基金的除外)。

(三) 发行方式：通过基金销售网点公开发售。

(四) 有关本基金认购费率的规定

1、本基金认购采用金额认购的方式；

2、本基金认购费率：

认购金额 M

认购费率

M < 1000 万元	1.0%
M ≥ 1000 万元	不超过 1.0%

基金管理人可以在不违背法律法规规定的情形下，根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易电话交易等)等进行基金交易的投资者，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金认购费率。

#### (五) 有关本基金认购数额的计算

本基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算方法如下：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份数} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额面值}$$

基金份额面值为 1.00 元。净认购金额以四舍五入的方法保留小数点后两位，基金份额认购份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

#### (六) 基金认购的规定

由基金管理人在招募说明书或发行公告中规定。

### 三、基金合同的生效

#### (一) 基金合同生效条件

本基金自《招募说明书》公告之日起三个月内，在基金净认购金额超过人民币 2 亿元，且认购户数达到 100 户的条件下，基金发起人依据有关法律法规及《招募说明书》可以停止发行，并宣告基金合同生效；否则本基金不成立。本基金合同生效前，投资者的认购款项只能存入发起人指定商业银行账户，不作它用。

#### (二) 基金不能成立时募集资金的处理方式

本基金不能成立时，本基金发起人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在设立募集期结束后 30 日内退还基金认购人。

#### (三) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金合同生效后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续 20 个工作

日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人有权宣布本基金终止，并报中国证监会备案。法律法规、规章另有规定的，从其规定办理。

## 四、基金的托管

为确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益，基金托管人与基金管理人必须按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定订立《万家 180 指数证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金资产的保管、基金资产的管理和运用及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 五、基金的投资管理

### （一）投资目标：

本基金通过运用指数化投资方法，力求基金的股票组合收益率拟合上证 180 指数增长率。伴随中国经济增长和资本市场的发展，实现利用指数化投资方法谋求基金资产长期增值的目标。本基金指数化投资部分选择上证 180 指数作为跟踪目标指数，并作为业绩衡量基准；债券投资部分业绩衡量基准采用银行同业存款利率。

如果上证 180 指数被上海证券交易所停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则，变更基金的投资目标和投资范围。

### （二）投资范围：

1、本基金资产的股票指数化投资部分主要投资于组成上证 180 指数的成份股票，包括：上证 180 指数包含的 180 只成份股、预期将要被选入上证 180 指

数的股票、一级市场申购的新股、存托凭证。

2、本基金资产的债券投资部分投资于国债、优质企业债、金融债以及债券回购。

3、经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。

### （三）投资理念

本基金以拟合目标指数、跟踪目标指数变化为原则，实现与市场同步成长为基本理念。指数化投资是一种充分考虑投资者利益的投资方法，采取拟合目标指数收益率的投资策略，分散投资于目标指数的成份股，力求股票组合的收益率拟合该目标指数所代表的资本市场的平均收益率。

### （四）基金的指数投资组合

指数投资组合包括上证 180 成份股票、预期选入上证 180 指数的股票、一级市场申购的新股以及现金。

#### 1、指数投资组合的构建

本基金将采用指数复制法构造投资组合，当成份股发生新增、剔除或因公司行为导致指数权重发生变化时，指数投资组合将做出相应调整。

#### 2、指数投资组合的跟踪误差的控制

本基金选择了两个评价跟踪误差的量化指标：一是拟合偏离度，这是一个日平均跟踪误差指标；另一个是指数投资相对收益率，这是相对累计收益率指标。

拟合偏离度的控制目标定为 0.5%，指数投资相对收益率（年累计偏差）的控制目标定为 2%。如果拟合偏离度或指数投资相对收益率超过了其控制目标，风险控制小组应将分析报告和调整方案上报给投资决策委员会审议，经审议批准后的组合调整方案交基金经理执行。

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### （五）投资组合限制

1、本基金投资组合在遵守法律、法规、中国证监会及本基金合同规定的投资限制的同时，还将遵守基金管理人内设监察稽核部所制定的投资对象限制。

2、本基金的投资组合遵循下列比例规定：



- (1) 本基金投资于股票的比例，不得高于基金资产净值的 95%；
- (2) 本基金持有到期日在一年以内的政府债券或者现金比例不低于基金资产净值的 5%。其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
- (3) 本基金投资于上证 180 指数成份股的比重不低于基金资产净值的 90%，并尽量用基金净值的 95% 资金进行标准指数化投资，追求与被跟踪的目标指数的最大拟合程度。
- (4) 本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；
- (5) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%；
- (6) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%，因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (7) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- (8) 遵守法律、法规、中国证监会及本基金合同所规定的其他比例限制；
- (9) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；
- (10) 法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定，在法规许可时本基金可以将指数化投资的比例调整为基金资产净值的 100%。

3、本基金将于成立日后三个月内达到符合规定的比例限制。

4、本基金可以按照国家的有关规定进行债券回购等融资业务。

5、本基金禁止从事下列行为：

- (1) 投资于其他基金；
- (2) 将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- (3) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- (4) 从事证券信用交易；
- (5) 以基金资产进行房地产投资；

(6) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

(7) 法律、法规、中国证监会及本基金合同规定禁止从事的其他行为。

法律、法规或监管部门对上述限制另有规定时从其规定。

#### (六) 基金投资过程

基金管理人内设投资决策委员会为基金投资的最高决策机构，由基金经理组成的基金管理组在投资决策委员会授权的范围内负责基金的投资工作。基金的投资过程如下：

1、投资决策委员会提出基金投资策略和投资方案的研究需求；

2、研究发展部根据投资决策委员会制定的投资策略，根据国家政策、宏观经济、利率和通货膨胀预期、基金合同的规定以及上证 180 指数构成公司的相关分析，形成指数化投资和债券投资预案；

3、金融工程部验证分析投资预案，进行历史模拟，并通过风险测算后提出可行性结论，报投资决策委员会批准；

4、基金管理组执行投资方案，确定具体的执行程序。基金管理组的目标是确保基金股票组合的收益率最大程度地拟合目标指数增长率；

5、具体的投资方案形成后，由中央交易室执行；

6、监察稽核部和金融工程部负责监督基金管理组投资方案的执行情况，并进行投资风险管理。监察稽核部负责核查基金的操作是否符合《基金合同》和有关基金投资的法律、法规；金融工程部负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，提交风险监控报告；若跟踪误差超过一定范围，协助基金管理组进行投资组合修正；

7、投资决策委员会及下设风险控制组负责审核风险监控报告。

#### (七) 基金的融资

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资。

#### (八) 侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、

业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定或相关公告。

## 六、基金的申购、赎回

### （一）基金投资者范围

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规、规章禁止投资证券投资基金者除外）。

### （二）申购与赎回的办理场所

- 1、基金管理人的直销网点
- 2、基金管理人委托的代销机构的营业网点。

基金管理人可根据情况变化增加或减少代销机构，并在基金管理人网站公示。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点）。

条件成熟时，投资者可通过基金管理人或者指定的基金销售代理人以电话、传真或互联网等形式进行申购与赎回。

### （三）申购与赎回的办理时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金为投资者办理申购与赎回等基金业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午：9:30-11:30，下午1:00-3:00。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并公告，并报中国证监会备案。

#### 2、申购与赎回的开始时间

基金的申购自基金合同生效后不超过30个工作日开始办理。

基金的赎回从基金合同生效后不超过30个工作日开始办理。

3、在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （四）申购与赎回的原则

1、未知价原则，即本基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人赎回时，基金管理人按先进先出的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5、申购费用按单笔申购申请金额对应的费率乘以单笔确认的申购金额计算；

6、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应最迟在新的原则实施前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上予以公告。

#### （五）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管理人和基金销售代理人规定，在开放日的交易时间段内提出申购或赎回的申请，并办理有关手续。投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。基金份额持有人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）及注册登记机构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。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2工作日及之后到其提出申购与赎回申请的网点进行成交查询；T日申购成功的基金份额T+2日后可以赎回。

##### 3、申购和赎回款项支付

申购采用全额缴款方式，若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，基金管理人或基金管理人指定的代理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定将赎回款项在不超过T+7个工作日之内划往赎回人指定的银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

#### （六）申购与赎回的数额限制

##### 1、申请申购基金的金额

通过代销网点申购的单笔最低金额为1000元人民币（含申购费）。

通过直销中心首次申购的最低金额为100万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为1000元人民币（含申购费）。已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。但法律法规、中国证监会另有规定的除外。

##### 2、申请赎回基金的份额

不设最低赎回份额限制，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致其基金账户中的基金份额余额少于1.00份（并同时满足销售机构的有关规定）时，剩余部分基金份额必须一同赎回。

当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的程序和数额限制，但应最迟在调整生效前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

本基金的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）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额 / T 日基金份额净值

申购份数以四舍五入的方法保留至小数点后二位。

## 2、基金赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，其中：

赎回总额=赎回数量×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回金额以四舍五入的方法保留至小数点后二位。

3、T 日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，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

4、本基金的申购费用由申购人承担，用于销售等各种相关费用。本基金的赎回费用由赎回人承担，赎回费用以四舍五入的方法保留至小数点后二位，赎回费用用于支付基本手续费，余额归基金资产，但赎回费进基金资产部分的比例不得低于 25%；

5、本基金的申购费率最高不超过 1.5%；本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.50% 的赎回费，并全额计入基金财产。本基金实际执行费率在上述范围内由基金管理人决定，并在招募说明书或更新招募说明书中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时，如果没有超过上述费率限额，基金管理人可自行调整，并最迟将于新的费率开始实施前三个工作日至少在一种中国证监会指定的信息披露媒体上予以公告。如超过这一限额调整费率，则须经基金份额持有人大会通过。

6、基金管理人可以在不违背法律法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，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式等进行基金交易的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，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购费率和基金赎回费率。

### （八）申购与赎回的注册登记

基金投资者提出的申购和赎回申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

1、投资者申购基金成功后，基金注册与登记过户人在 T+1 工作日为投资者

办理增加权益的注册登记手续，投资者自 T+2 工作日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资者赎回基金成功后，基金注册与登记过户人在 T+1 工作日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内及技术条件允许的情况下，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上予以公告。

#### （九）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

在本基金单个开放日，基金份额净赎回申请（净赎回申请=赎回申请总数+基金转换中转出申请份额总数-申购申请总数-基金转换中转入申请份额总数）超过上一日基金份额总份数的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 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赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：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的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 50%以上的部分，基金管理人有权进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入第二个工作日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金份额资产净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。

投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并部分延期支付时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份

额持有人，说明有关处理方法，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介进行公告。

(4) 本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回或在一段时间内三次以上发生巨额赎回时，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，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

#### (十) 拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

(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；

(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) 基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 基金注册与登记过户人无充分的技术保障或充足人员支持业务处理；

(5) 当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；

(6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形；

(7) 当基金管理人认为某笔申购申请可能影响到其他基金份额持有人利益时，可拒绝或部分拒绝该笔申购申请；

(8) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50% 比例要求的情形时；

(9) 当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时；或该投资者累计持有的份额超过单个投资者累计持有的份额上限时；或该投资者当日申购金额超过单个投资者单日申购金额上限时；或该投资者单笔申购金额超过单个投资者单笔申购金额上限时。



发生上述第（1）到第（6）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停公告。暂停期间，每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束，基金重新开放申购时，基金管理人应在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登基金重新开放申购公告及最近一个工作日基金份额资产净值。

对于销售机构已受理的申购申请或发生上述第（7）、（8）、（9）项拒绝申购情形时，被拒绝的申购款项将全额退划给投资者。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

- （1）拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；
- （2）拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；
- （3）按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易场所交易时间非正常停市；
- （3）因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （4）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项的措施；

- （5）法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

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时，将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，其余部分根据基金管理人制定的原则在后续开放日予以兑付，并以该工作日当日的基金份额资产净值为依据计算赎回金额。投资者也可在申请赎回时选择当日未获受理部分予以撤销。

3、其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。

基金暂停申购、赎回，基金管理人应立即在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停公告。暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额资产净值。

#### （十一）重新开放申购或赎回的公告

1、如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公布最近一个工作日的基金份额资产净值。

2、如果发生暂停的时间超过 1 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 1 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体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的基金份额资产净值。

3、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；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露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的基金份额资产净值。

#### （十二）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

## 七、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

### （一）非交易过户

非交易过户是指由于司法强制执行、继承、捐赠等原因，基金注册与登记过户人将某一基金账户的基金份额全部或部分直接划转至另一账户。

1、继承是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或受遗赠人继承。

2、捐赠仅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其他具有社会公益性质的社会团体。

3、司法强制执行是指司法机构依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户时，必须按基金注册与登记过户人的要求提供相关资料，到基金注册与登记过户人或基金注册与登记过户人指定的网点申请办理。

符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，五个工作日内办理；申请人按基金注册与登记过户人规定的标准缴纳过户费用。

### （二）转托管

基金份额持有人可以以同一基金账户在多个销售机构申购（认购）基金份额，但必须在原申购（认购）的销售机构赎回该部分基金份额。

投资者申购（认购）基金份额后可以向原申购（认购）基金的销售机构发出转托管指令，缴纳转托管手续费，转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。

转托管在转出方进行申报，基金份额转托管经一次申报便可完成。投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

对于转入方为银行类销售代理人的，投资者在转出方办理转托管手续之前，应先到转入方办理基金账户登记手续。

### （三）冻结与质押

基金注册与登记过户人只受理司法机构依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金注册与登记过户人的相关规定办理。

在相关法律法规有明确规定的条件下，基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他业务，并会同注册与登记过户人制定、公布、实施相应的业务规则。

## 八、基金的销售及服务代理

本基金的销售业务由基金管理人及其委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金销售业务的，应与其签订委托代理协议，用以明确基金管理人和基金销售代理人之间有关基金份额认购、申购和赎回等事

宜中的权利、义务和职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 九、基金的注册与登记过户

本基金的注册与登记过户业务指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记和过户、基金清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

本基金的注册与登记过户业务由基金管理人委托商业银行或中国证监会认定的其他机构办理。基金管理人委托上述机构办理登记过户业务，应与其签订委托代理协议，以明确基金管理人与其在投资人基金账户管理、基金交易确认、基金份额登记过户、基金清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

## 十、基金资产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指所拥有的各类证券价值、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。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金资产的账户

本基金资产以“万家 180 指数证券投资基金”的名义开立基金专用银行存款账户、证券交易清算备付金账户，以托管人和本基金联名的方式开设证券账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人、基金注册与登记过户人自有的资产账户以及其他基金资产账户严格分开、相互独立。

### （四）基金资产的保管及处分

本基金资产独立于基金管理人、基金托管人、基金销售代理人、注册与登记过户代理人的固有资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、

基金销售代理人、注册与登记过户代理人以其自有的资产承担其自身的法律责任,其债权人不得对本基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依《信托法》《基金法》、本基金合同及其他有关规定处分外,基金资产不得被处分。

基金管理人管理运作本基金资产所产生的债权,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的不同基金之间的债权债务不得相互抵消。

## 十一、基金资产估值

### (一) 估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### (二) 估值日

本基金合同生效后,每个交易日对基金财产进行估值。

### (三) 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### (四) 估值方法

#### 1、股票估值方法

##### (1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;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) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;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。

首次发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

### (3) 有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

## 2、固定收益证券的估值办法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；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) 证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；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) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4) 在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) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

(6) 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。

## 3、权证估值：

### (1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

### (2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，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，确定公允价值。未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

#### 4、其他资产的估值方法

本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

5、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-4 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### （五）估值程序

基金的日常估值由基金管理人进行。用于公开披露的基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人。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。

#### （六）暂停公告净值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易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、托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 4、中国证监会规定的其他情形。

### （七）基金份额资产净值的确认和错误处理方式

基金份额资产净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位。当基金资产的估值导致基金份额资产净值小数点后四位以内发生差错时，视为基金份额资产净值错误。

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当立即公告，并同时报中国证监会备案。

基金管理人完成基金资产净值的估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按本基金合同所规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后签字返回给基金管理人。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。

因发生估值差错造成基金份额持有人损失的，由基金管理人负责赔偿，赔偿原则如下：

1、赔偿仅限于因差错而导致的基金份额持有人的直接损失，基金管理人在赔偿基金份额持有人后，有权向有关责任方追偿不当得利。

2、计算的基金份额资产净值低于正确的基金份额资产净值时的处理：

（1）申购确认份额大于实际应确认份额，由基金管理人向投资者追偿少付的申购金额，不能追偿的由基金管理人承担。

（2）赎回确认金额小于实际应确认金额，不足部分由基金管理人赔付给投资者。

3、计算的基金份额资产净值高于正确的基金份额资产净值时的处理：

（1）申购确认份额小于实际应确认份额，少计基金份额部分的申购资金由基金管理人退还给投资者；

（2）赎回确认金额大于实际应确认金额，多付部分由基金管理人赔付给基金资产。

4、错误期间造成的一切管理人的策略性错误，如巨额赎回比例确定，均以当日决定为准，不予纠正。

5、基金管理人代表基金保留要求返还不当利得的权利。



6、基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给单一当事人造成 10 元人民币以上的损失。

（八）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

（九）特殊情形的处理

1、如遇国家颁布的有关基金会计制度的变化所造成的误差，不作为基金份额净值错误处理。

2、基金管理人按（四）估值方法第 5 条进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

3、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、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。

## 十二、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、基金信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、与基金相关的会计师费和律师费；
- 6、证券交易费和税收；
- 7、基金分红手续费；
- 8、注册登记费；
- 9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

### （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

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计算，主要用于支付管理人管理本基金的运作成本和向其他服务提供者支付的费用。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数};$$

H 为每日应支付的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金托管人复核后于次月的前两个工作日内，根据基金管理人向基金托管人发送的划付指令，从基金资产中支付给基金管理人以及服务提供者；若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计算。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数};$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月的前两个工

作日内从基金资产中支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、上述（一）中 3 至 9 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金合同生效前的验资费（会计师费）、律师费、基金合同、招募说明书、发行公告等信息披露费用从成立后的基金资产中列支并摊销。

#### （三）不列入基金费用的项目

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费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

#### （五）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定或相关公告。

#### （六）基金的税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十三、基金的收益与分配

### （一）收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

### （二）收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利权益登记日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称

“再投资方式”); 如果投资者没有明示选择, 则视为选择现金发放方式。

2、每一基金份额享有同等分配权;

3、基金当期收益先弥补上期亏损后, 方可进行当期收益分配;

4、如果基金投资当期出现亏损, 则可不进行收益分配;

5、基金收益分配比例按照有关规定执行;

6、在满足分配条件下, 每年至少分配一次, 分配比例不低于基金净收益的 90%。成立不满 3 个月, 收益可不分配。期中分配由基金管理人另行公告, 年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成。

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

### (三) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### (四) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定, 并由基金托管人核实后确定, 依据相关规定进行公告。

### (五) 收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收申购费用;

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

### (六) 实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的, 侧袋账户不进行收益分配, 详见招募说明书的规定或相关公告。

## 十四、基金的会计与审计

### (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, 基金管理人也可以委托基金托管人或者具有证券、期货相关业务资格的独立的会计师事务所担任基金会计, 但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务;

2、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日; 基金首次募集的会计年度报告义务, 如遇基金合同生效少于 3 个月, 可以并入下一个会计年度

实施；

- 3、基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 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基金会计账目、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。
- 8、上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

#### （二）基金的年度审计和基金分红审计

- 1、本基金管理人将聘请上海众华沪银会计师事务所及其注册会计师对基金进行年度审计和分红审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十五、差错处理

#### （一）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、或注册与登记过户人、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水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述针对不可抗力的规定执行

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或造成其他差错，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。

## （二）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，则其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（“受损方”），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返还给差错责任方。

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，基金管理人或基金托管人协助受损方向差错责任方追偿；

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、行政法规、本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。

## （三）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，需要注册与登记过户人更正差错结果的，由注册与登记过户人进行更正，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资产净值计算错误偏差达到基金资产净值 0.5%时，基金管理人应当报中国证监会备案。

## 十六、基金的信息披露

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。本基金的信息披露事项须在至少一种中国证监会指定媒介公告。

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《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。

2、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，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

（二）发行公告

本基金管理人将按照有关法律、法规的规定编制并发布发行公告。

### （三）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

### （四）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

### （五）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当按照《信息披露办法》有关规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。



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及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；
- 11、基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 12、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

22、基金资产估值方法的变更；

23、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （六）清算报告

《基金合同》终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （七）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定或相关公告。

（八）本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

#### （九）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

## 十七、基金的终止与清算

### （一）基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

1、存续期间内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元，基金管理人宣布本基金终止；

2、基金经持有人大会表决终止的；

3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

4、基金管理人因解散、破产、撤销、丧失基金管理机构资格、停止营业等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其它基金管理公司承受其原有权利及义务；

5、基金托管人因解散、破产、撤销、丧失基金托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其它托管机构承受其原有权利及义务；

6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

## 7、中国证监会允许的其他情况。

基金终止后，基金管理人和基金托管人依照《信托法》、《基金法》、本基金合同及其他有关规定，行使请求给付报酬，从基金资产中获得补偿的权利时，可以留置基金资产或者对基金资产的权利归属人提出请求。

### （二）基金的清算

#### 1、基金清算小组

（1）自基金终止之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金清算小组接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

（2）基金清算小组成员由基金发起人、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、具有从事证券、期货相关业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。清算小组在成立后五个工作日内应当公告。

（3）基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

#### 2、清算程序

- （1）基金终止后，由基金清算小组统一接管基金；
- （2）对基金资产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金资产进行估值和变现；
- （4）将基金清算结果报告中国证监会；
- （5）公布基金清算公告；
- （6）对剩余基金资产进行分配。

#### 3、清算费用

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

#### 4、基金资产按下列顺序清偿：

- （1）支付清算费用；
- （2）交纳所欠税款；
- （3）清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款(1)至(3)项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

#### 5、基金清算的公告

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具有证券、期货相关业务资格的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财产清算报告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。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上, 并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 6、清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十八、基金专用交易席位的选用

(一) 基金交易选用证券经营机构的席位作为专用交易席位, 其标准和程序为:

1、基金管理人负责选择证券经营机构, 使用其席作为基金的专用交易席位, 选择的证券经营机构应符合下列标准:

(1) 资力雄厚, 信誉良好。

(2) 财务状况良好, 经营行为规范, 最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。

(3) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要, 并能为本基金提供全面的信息服务。

(5) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

2、选择的程序是:

(1) 选用交易席位的证券经营机构由基金管理人根据上述标准考察后确定。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位使用协议。

#### (二) 席位租用期限及更换方式

席位租用期限暂定为半年至一年。租用期满后，基金管理人将根据各证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价，主要包括：

- 1、券商提供的报告数量；
- 2、券商提供的报告质量；
- 3、券商协助管理人开展公司调研情况；
- 4、券商提供的路演服务；
- 5、券商的服务态度；
- 6、与券商研究员交流和共享研究资料情况。

根据上述综合评价的结果进行排名。在这一过程中，管理人不但对已使用席位的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯，为席位的更换做准备。

若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易席位。

#### (三) 席位运作方式

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》中关于“每只基金通过任何一家证券经营机构买卖证券的年成交量，不超过该基金买卖证券年总成交量的 30%”的规定，基金管理人将结合各证券经营机构提供研究报告及信息服务的质量，分配基金在各席位买卖证券的交易量。

#### (四) 其他事宜

基金管理人将根据有关规定，在基金中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的交易量、支付的佣金等予以披露，并报中国证监会备案。

## 第三部分 其他事项

### 一、业务规则

基金合同当事人应遵守《万家基金管理有限公司开放式基金业务规则》(以下称《业务规则》)。《业务规则》由基金管理人制订,并由其解释与修改,但《业务规则》的制定、修改若构成对基金合同的实质修改,则应召开基金份额持有人大会,对本基金合同的修改形成决议。

### 二、违约责任

(一) 由于基金合同一方当事人的过错,造成基金合同不能履行或者不能完全履行的,由有过错的一方承担违约责任;如属基金合同双方或多方当事人的过错,根据实际情况,双方或多方当事人分别承担各自应负的违约责任。

(二) 当事人违约,给另一方当事人造成损失的,应就直接损失进行赔偿;给基金资产造成损失的,应就直接损失进行赔偿,另一方当事人有权利及义务代表基金向违约方追偿。但当发生下列情况时,当事人可以免责:

1、 管理人及基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律、法规或规章的作为或不作为而造成的损失等;

2、 在没有欺诈或过失的情况下,基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则或不投资造成的直接损失或潜在损失等;

3、 不可抗力。

(三) 基金合同当事人违反基金合同,给其他方造成直接损失的,应进行赔偿。

(四) 违约行为虽已发生,但本托管协议能够继续履行的,在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下,基金管理人和基金托管人应当继续履行本协议。

(五) 本合同当事人一方违约后,其他当事方应当采取适当措施防止损失的扩大;没有采取适当措施致使损失扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（六）第三方的过错而导致本基金合同当事人一方违约，并造成其他当事人损失的，违约方并不因此免除其赔偿责任。

（七）当事人之一违约而导致其他当事人损失的，基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

### 三、法律适用与争议解决

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金发起人、基金管理人、基金托管人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会北京分会根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本基金合同的其他规定。

（三）基金份额持有人或基金投资者作为一方当事人与基金发起人、基金管理人、基金托管人的一方或数方作为另一方当事人之间发生争议，首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权向有管辖权的人民法院起诉，也可将事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁。

### 四、通知与送达

（一）与本合同有关的任何事宜，如需书面告知本合同的当事人，应以下述方式做出书面通知：

- 1、如通知基金发起人：采用面呈递交、挂号邮寄或传真的方式；
- 2、如通知基金管理人：采用面呈递交、挂号邮寄或传真的方式；
- 3、如通知基金托管人：采用面呈递交、挂号邮寄或传真的方式；
- 4、如通知基金份额持有人：采用邮寄、电子邮件、传真或公告的方式。

（二）上述通知应当送达至相关当事人的下述地址或号码：

- 1、基金份额持有人：在认购或申购基金时登记的通信地址或其更改后的

通信地址，采用公告通知的方式除外。

2、基金发起人：万家基金管理有限公司

地址：上海市浦东源深路 273 号，邮政编码：200135；

传真：021-68531888

收件人：万家基金管理有限公司市场拓展部负责人

3、基金管理人：万家基金管理有限公司

地址：上海市浦东源深路 273 号，邮政编码：200135；

传真：021-68531888

收件人：万家基金管理有限公司市场拓展部负责人

4、基金托管人：中国银行

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号，邮政编码：100818；

传真：010-66594853

收件人：中国银行基金托管部负责人

基金发起人、基金管理人、基金托管人上述信息的更改，必须提前七日以书面形式相互通知，否则所有按照该当事方变更前信息做出的通知应视为有效送达。

### （三）送达

- 1、以面呈递交方式做出的通知，面呈递交时即视为送达；
- 2、以挂号邮寄的方式做出的通知，在邮件发出后第七日即视为送达；
- 3、以传真的方式做出的通知，在传真发出后即视为送达；
- 4、以公告方式做出的通知，在公告发布当日即视为送达，但法律法规另有规定的除外。

## 五、基金合同的效力

（一） 本基金合同经基金发起人、基金管理人、基金托管人三方盖章以及三方法定代表人或授权代表签字并经中国证监会批准后生效。

（二） 本基金合同的有效期限自其生效之日至本基金清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

（三） 本基金合同自生效之日起对包括基金发起人、基金管理人、基金



托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

(四) 本基金合同及其修订本正本一式八份,除上报有关监管机构二份外,基金发起人、基金管理人、基金托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。

## 六、基金合同的修改和终止

### (一) 基金合同的修改

1、本基金合同的修改应经当事人同意,经基金份额持有人大会决议通过,并经中国证监会批准,自批准之日起生效。

2、但在下列情况下,基金管理人和基金托管人协商后可直接修改基金合同,无须召开基金份额持有人大会通过,但应进行公告,并报中国证监会备案:

(1) 因法律、法规及中国证监会颁布之规定的相应修改而导致本基金合同的部分条款与之不符的,则基金合同自行适用法律、法规及中国证监会颁布之规定的相应修改;

(2) 因基金发起人、基金管理人、基金托管人的基本情况发生变更,包括但不限于住所、法定代表人、组织形式、注册资本等情况的变更;

3、本基金合同规定基金管理人有权修改的事项,一经公告,即构成对基金合同的修改,修改后的基金合同应报中国证监会备案。

### (二) 基金合同的终止

1、有下列情形之一的,基金经中国证监会批准后将终止:

(1) 存续期间内,基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人,或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元,基金管理人将宣布本基金终止;

(2) 基金经持有人大会表决终止的;

(3) 因重大违法、违规行为,基金被中国证监会责令终止的;

(4) 基金管理人因解散、破产、撤销、丧失基金管理机构资格、停止营业等事由,不能继续担任本基金管理人的职务,而无其它基金管理公司承受其原有权利及义务;

(5) 基金托管人因解散、破产、撤销、丧失基金托管机构资格、停止营业

等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其它托管机构承受其原有权利及义务；

（6）由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

（7）中国证监会允许的其他情况。

2、在本基金终止后，须按法律法规和本基金合同对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告后本基金合同终止。

七、基金合同当事人盖章及其法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日