

万家基金管理有限公司

关于修订万家创业板指数增强型证券投资基金基金合同及托管协议的公告

为更好地满足广大投资者的理财需求，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》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引》等法律法规规定及基金合同约定，万家基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，并向中国证监会备案，决定自2021年3月31日起，对万家创业板指数增强型证券投资基金的基金合同和托管协议进行修订。

修订内容包括：

1、在基金合同和托管协议中明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证投资风险提示、存托凭证投资策略、投资比例限制、估值方法和信息披露等内容。同时将在更新的招募说明书、产品资料概要中对涉及上述修改的内容进行相应调整，并增加存托凭证投资特有的风险揭示。

2、在基金合同的前言、释义、基金的投资等章节补充或修订指数基金相关内容。同时，将在更新的招募说明书、产品资料概要中对涉及上述修改的内容进行相应调整，并增加指数基金特有的风险揭示。

对万家创业板指数增强型证券投资基金基金合同和托管协议具体修订详见附件。

存托凭证投资风险提示：

基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险，具体包括但不

限于以下风险：

(1) 与存托凭证相关的风险

1) 存托凭证是新证券品种，由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。

2) 基金买入或者持有红筹公司境内发行的存托凭证，即被视为自动加入存托协议，成为存托协议的当事人。存托协议可能通过红筹公司和存托人商议等方式进行修改，基金无法单独要求红筹公司或者存托人对存托协议作出额外修改。

3) 基金持有红筹公司存托凭证，不是红筹公司登记在册的股东，不能以股东身份直接行使股东权利；基金仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并行使分红、投票等权利。

4) 存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对基金生效。基金可能无法对此行使表决权。

5) 存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，基金可能存在失去应有权利的风险。

6) 存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

7) 存托凭证退市的，基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券，基金持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为基金提供相应服务等风险。

(2) 与创新企业发行相关的风险

创新企业证券首次公开发行的价格可能高于公司每股净资产账面值，或者高于公司在境外其他市场公开发行的股票或者存托凭证的发行价格或者二级市场交易价

格。

(3) 与境外发行人相关的风险

1) 红筹公司在境外注册设立，其股权结构、公司治理、运行规范等事项适用境外注册地公司法等法律法规的规定；已经在境外上市的，还需要遵守境外上市地相关规则。投资者权利及其行使可能与境内市场存在一定差异。此外，境内股东和境内存托凭证持有人享有的权益还可能受境外法律变化影响。

2) 红筹公司可能仅在境内市场发行并上市较小规模的股票或者存托凭证，公司大部分或者绝大部分的表决权由境外股东等持有，境内投资者可能无法实际参与公司重大事务的决策。

3) 红筹公司存托凭证的境内投资者可以依据境内《证券法》提起证券诉讼，但境内投资者无法直接作为红筹公司境外注册地或者境外上市地的投资者，依据当地法律制度提起证券诉讼。

(4) 与交易机制相关的风险

1) 境内外市场证券停复牌制度存在差异，红筹公司境内外上市的股票或者存托凭证可能出现在一个市场正常交易而在另一个市场实施停牌等现象。

2) 红筹公司在境外上市股票或存托凭证的价格可能因基本面变化、第三方研究报告观点、境内外交易机制差异、异常交易情形、做空机制等出现较大波动，可能对境内证券价格产生影响。

3) 在境内法律及监管政策允许的情况下，红筹公司现在及将来境外发行的股票可能转移至境内市场上市交易，或者公司实施配股、非公开发行、回购等行为，从而增加或者减少境内市场的股票或者存托凭证流通数量，可能引起交易价格波动。

4) 基金持有的红筹公司境内发行的证券，暂不允许转换为公司在境外发行的相同类别的股票或者存托凭证；基金持有境内发行的存托凭证，暂不允许转换为境外基础证券。

指数基金投资风险提示：

（1）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.50%以内，年化跟踪误差控制在 7.75%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（2）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

（3）成份股停牌的风险

本基金标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险，也可能使基金因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。此外，根据相关规定，本基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后可对相关成份券进行调整，从而可能产生跟踪偏离、跟踪误差控制未达约定目标的风险。

重要提示：

1、万家创业板指数增强型证券投资基金修订基金合同和托管协议的有关事项已经履行了规定的程序，符合相关法律法规规定及基金合同约定，无需召开基金份额持有人大会。

2、上述修改自 2021 年 3 月 31 日起生效。本次修订后的基金合同和托管协议全文于 2021 年 3 月 31 日在本基金管理人网站（www.wjasset.com）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）披露，供投资者查阅。如有疑问可拨打本基金管理人客服电话（400-888-0800）咨询。

3、本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则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。请充分了解基金的风险收益特征，审慎做出投资决定。

特此公告。

万家基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日

附件：万家创业板指数增强型证券投资基金修改前后文对照表

1、万家创业板指数增强型证券投资基金基金合同修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
第一部分 前言	<p>一、订立基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>2、订立基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。</p>	<p>一、订立基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>2、订立基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》”）、《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》”）、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》</u>（以下简称“《<u>指数基金指引</u>》”）和其他有关法律法规。</p> <p>.....</p> <p><u>七、本基金为指数增强型股票基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</u></p> <p><u>八、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。</u></p>
第二部分 释义	无	<p>15、<u>《指数基金指引》</u>：指《公开募集证券投资基金运作指引第3号——<u>指数基金指引</u>》及颁布机关对其不时做出的修订</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允</p>

	<p>许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。</p> <p>.....</p> <p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p>—(21)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p>	<p>许基金投资的股票、<u>存托凭证</u>)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。</p> <p>.....</p> <p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>.....</p> <p><u>对于存托凭证的投资,本基金将根据投资目标,依照境内上市交易的股票投资策略执行,并最大限度避免由于存托凭证在交易规则、上市公司治理结构等方面的差异而或有的负面影响。</u></p> <p>.....</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p><u>(21)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;</u></p> <p><u>(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>创业板指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率(税后)*5%</p> <p>创业板指数是本基金的标的指数,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。一年期人民币定期存款利率是中国人民银行公布并执行的金融机构一年期人民币整存整取定期存款利率。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>创业板指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率(税后)*5%</p> <p>创业板指数是本基金的标的指数,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。一年期人民币定期存款利率是中国人民银行公布并执行的金融机构一年期人民币整存整取定期存款利率。</p> <p><u>未来若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起十个</u></p>

	<p>如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称、或今后法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。</p>	<p><u>工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。</u></p> <p><u>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</u></p> <p><u>如果标的指数变更对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位更名、指数更名等事项）、或今后法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。</u></p>
第十四部分 基金资产估值	<p>四、估值方法</p> <p>.....</p> <p>11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按法律法规以及监管部门最新规定估值。</p>	<p>四、估值方法</p> <p>.....</p> <p><u>11、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。</u></p> <p><u>12</u>、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按法律法规以及监管部门最新规定估值。</p>
第十八部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p>(十二) 中国证监会规定的其他信息。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p><u>(十二) 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。</u></p> <p><u>(十三)</u> 中国证监会规定的其他信息。</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要	同步修改	

2、万家创业板指数增强型证券投资基金托管协议修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
----	------	-------

	内容	内容
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。</p> <p>.....</p> <p>(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p>.....</p> <p>—(21)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p>	<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、<u>存托凭证</u>)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。</p> <p>.....</p> <p>(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p>.....</p> <p><u>(21)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。</u></p> <p><u>(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</u></p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>.....</p> <p>2. 估值方法</p> <p>.....</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>.....</p> <p>2. 估值方法</p> <p>.....</p> <p><u>(11)本基金投资存托凭证的估值核</u></p>

	<p>(11)相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按法律法规以及监管部门最新规定估值。</p>	<p><u>算依照境内上市交易的股票执行。</u> (12)相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按法律法规以及监管部门最新规定估值。</p>
<p>十、基金信息披露</p>	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告、基金合同生效公告、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、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）、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、清算报告、投资证券公司短期公司债券、股指期货、国债期货、资产支持证券、股票期权、参与融资、转融通出借业务、实施侧袋机制期间的信息披露以及中国证监会规定的其他信息。基金年度报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后，方可披露。</p>	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告、基金合同生效公告、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、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）、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、清算报告、投资证券公司短期公司债券、股指期货、国债期货、资产支持证券、股票期权、参与融资、转融通出借业务、实施侧袋机制期间的信息披露以及中国证监会规定的其他信息。<u>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。</u>基金年度报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后，方可披露。</p>