

万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2025 年 10 月 29 日

送出日期：2025 年 10 月 30 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

|         |                  |                                                                                                                                                                                                     |                 |
|---------|------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
| 一、产品概况  |                  |                                                                                                                                                                                                     |                 |
| 基金简称    | 万家沪深 300ETF 联接   | 基金代码                                                                                                                                                                                                | 024011          |
| 下属基金简称  | 万家沪深 300ETF 联接 A | 下属基金交易代码                                                                                                                                                                                            | 024011          |
| 下属基金简称  | 万家沪深 300ETF 联接 C | 下属基金交易代码                                                                                                                                                                                            | 024012          |
| 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      |
| 基金合同生效日 | 2025 年 8 月 26 日  | 上市交易所及上市日期                                                                                                                                                                                          | —               |
| 基金类型    | 基金中基金            | 交易币种                                                                                                                                                                                                | 人民币             |
| 运作方式    | 普通开放式            | 开放频率                                                                                                                                                                                                | 每日              |
| 基金经理    | 杨坤               | 开始担任本基金基金经理的日期                                                                                                                                                                                      | 2025 年 8 月 26 日 |
|         |                  | 证券从业日期                                                                                                                                                                                              | 2015 年 6 月 23 日 |
| 其他      | 终止条款             | 未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求（因成份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工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、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，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。 |                 |
|         | 转型情况             | 自 2025 年 10 月 30 日起，万家沪深 300 指数证券投资基金变更为万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。                                                                                                                                |                 |

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 投资范围   | 本基金的标的指数为沪深 300 指数。 本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以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）。 本基金可根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 |
| 主要投资策略 | 本基金为目标 ETF 的联接基金，以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便投资人通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。 1、大类资产配置策略；2、目标 ETF 投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、可转换债券与可交换债券投资策略；8、股指期货交易策略；9、国债期货交易策略；10、股票期权投资策略；11、参与融资与转融通证券出借业务策略；12、其他                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，所跟踪的目标 ETF 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。 本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

## 三、投资本基金涉及的费用

### （一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

万家沪深 300ETF 联接 A

| 费用类型         | 份额（S）或金额（M）<br>/持有期限（N）   | 收费方式/费率   | 备注      |
|--------------|---------------------------|-----------|---------|
| 申购费<br>（前收费） | M < 1,000,000             | 0.10%     | 特定投资者群体 |
|              | 1,000,000 ≤ M < 3,000,000 | 0.06%     | 特定投资者群体 |
|              | 3,000,000 ≤ M < 5,000,000 | 0.04%     | 特定投资者群体 |
|              | M ≥ 5,000,000             | 1,000 元/笔 | 特定投资者群  |

|     |                       |           |       |
|-----|-----------------------|-----------|-------|
|     |                       |           | 体     |
|     | M<1,000,000           | 1.00%     | 其他投资者 |
|     | 1,000,000≤M<3,000,000 | 0.60%     | 其他投资者 |
|     | 3,000,000≤M<5,000,000 | 0.40%     | 其他投资者 |
|     | M≥5,000,000           | 1,000 元/笔 | 其他投资者 |
| 赎回费 | N<7 日                 | 1.50%     | —     |
|     | 7 日≤N<30 日            | 0.10%     | —     |
|     | N≥30 日                | 0.00%     | —     |

万家沪深 300ETF 联接 C

| 费用类型 | 份额（S）或金额（M）<br>/持有期限（N） | 收费方式/费率 |
|------|-------------------------|---------|
| 赎回费  | N<7 日                   | 1.50%   |
|      | N≥7 日                   | 0.00%   |

注：本基金 C 类基金份额不收取申购费。

## （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别  | 收费方式/年费率或金额                      | 收取方        |
|-------|----------------------------------|------------|
| 管理费   | 0.15%                            | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.05%                            | 基金托管人      |
| 销售服务费 | 万家沪深 300ETF<br>联接 C 0.20%        | 销售机构       |
| 审计费用  | 32,000.00 元                      | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 50,000.00 元                      | 规定披露报刊     |
| 其他费用  | 按照有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 |            |

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

2、本基金基金财产中目标 ETF 基金份额所对应资产净值不收取管理费和托管费。

3、本基金交易证券、期货、期权等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

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，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，自主判断基金的投资价值，对申购基金的意愿、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：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业绩比较基准收益率偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数值计算出错的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险等；（2）联接基金的特殊风险。包括可能具有与目标 ETF 不同的风险收益特征及净值增长率的风险、目标 ETF 面临的风

险可能直接或间接成为本基金的风险、由目标 ETF 的联接基金变更为直接投资目标 ETF 标的指数成份股的指数基金的风险等；（3）本基金投资特定品种的特有风险。包括股指期货交易风险、股票期权投资风险、国债期货交易风险、融资和转融通证券出借业务交易投资风险、资产支持证券投资风险、存托凭证投资风险等；（4）基金合同直接终止的风险。

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，详见招募说明书“风险揭示”部分。

本基金为 ETF 联接基金，所跟踪的目标 ETF 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。

本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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。

未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求（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，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止，但基金合同另有约定除外。因而，本基金存在着无法存续的风险。

本基金的具体风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

## （二）重要提示

中国证监会对万家沪深 300 指数证券投资基金募集的注册，并不表明其对该基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于该基金没有风险。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。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

各方当事人同意，因《基金合同》的订立、内容、履行和解释或与《基金合同》有关的一切争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商、调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费由败诉方承担。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)][客服电话：400-888-0800]

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料