

# 万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2018 年第 4 季度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 1 月 22 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 01 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 10 月 01 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

转型后:

基金简称	万家中证 1000 指数增强
基金主代码	005313
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 3 日
报告期末基金份额总额	10,515,125.88 份
投资目标	本基金为指数增强型股票基金,采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制,在力求有效跟踪标的指数基础上,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上,实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品,在标的指数成份股权重基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数投资收益。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司

基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005313	005314
报告期末下属分级基金的份额总额	9,919,465.90 份	595,659.98 份

注：报告期内，万家裕债券型证券投资基金变更注册为万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金，基金管理人组织召开本基金基金份额持有人大会，本基金份额持有人大会于 2018 年 12 月 03 日表决通过了《关于修改万家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本基金份额持有人大会决议自该日起生效。

转型前：

基金简称	万家裕债券	
基金主代码	005313	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 30 日	
报告期末基金份额总额	620,903.93 份	
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金在构建债券投资组合时合理评估收益性、流动性和信用风险，追求基金资产的长期稳定增值。本基金采取积极的债券投资策略，自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析，形成对短期利率变化方向的预测，在此基础上，确定组合久期和类别资产配置比例，以此为框架，通过把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择。针对可转换债券、含权债券、资产证券化品种及其它固定收益类衍生品种，本基金区别对待，制定专门的投资策略。	
业绩比较基准	中债总全价指数（总值）收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于中低风险/收益的产品。	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	万家裕 A	万家裕 C
下属分级基金的交易代码	005313	005314
报告期末下属分级基金的份额总额	25,339.33 份	595,564.60 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018 年 12 月 3 日 — 2018 年 12 月 31 日）	
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
1. 本期已实现收益	-20,333.98	-1,907.31
2. 本期利润	-617,930.09	-37,619.00
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0727	-0.0632
4. 期末基金资产净值	9,414,386.58	558,648.42
5. 期末基金份额净值	0.9491	0.9379

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018 年 10 月 1 日 — 2018 年 12 月 2 日）	
	万家家裕 A	万家家裕 C
1. 本期已实现收益	73.43	1,118.97
2. 本期利润	49.43	751.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0019	0.0012
4. 期末基金资产净值	25,661.28	596,176.20
5. 期末基金份额净值	1.0127	1.0010

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现（转型后）

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 1000 指数增强 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④

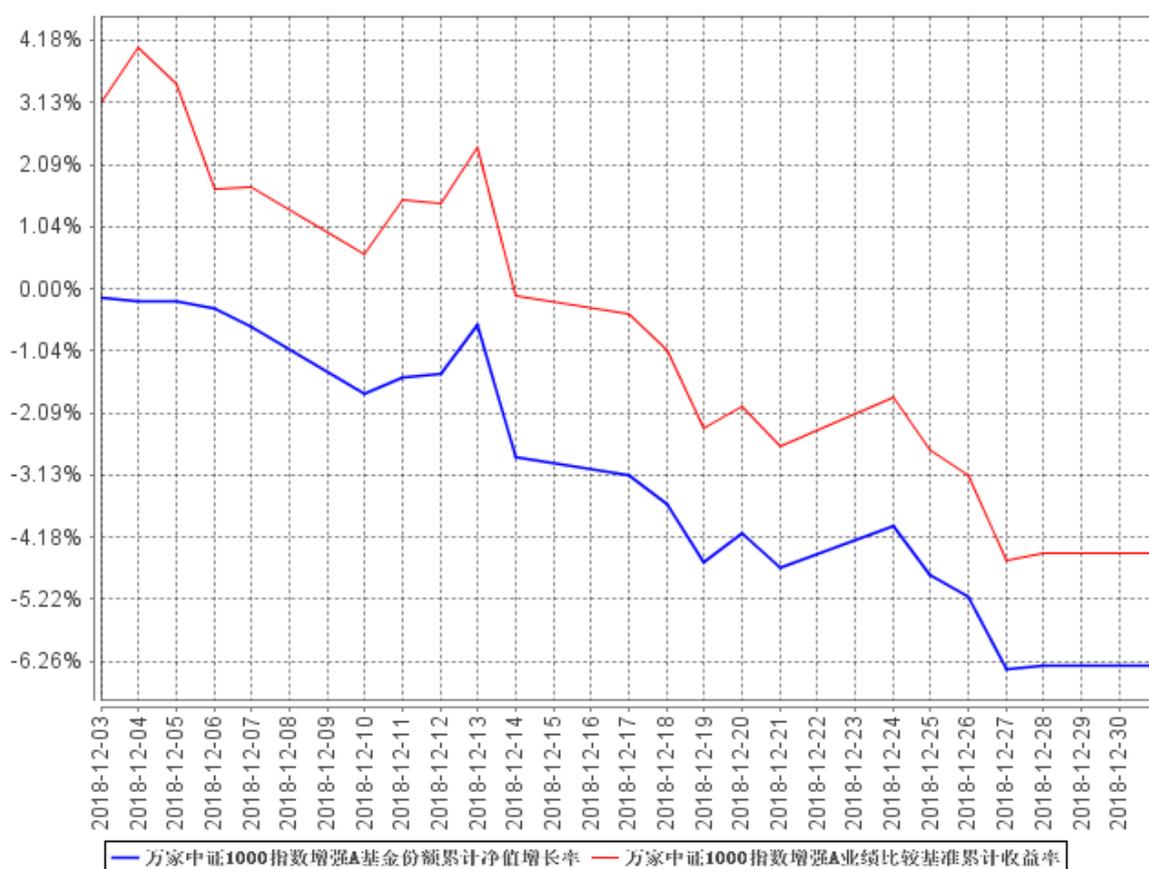
2018.12.03-2018.12.31	-6.34%	0.72%	-4.45%	1.19%	-1.89%	-0.47%
-----------------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

万家中证 1000 指数增强 C

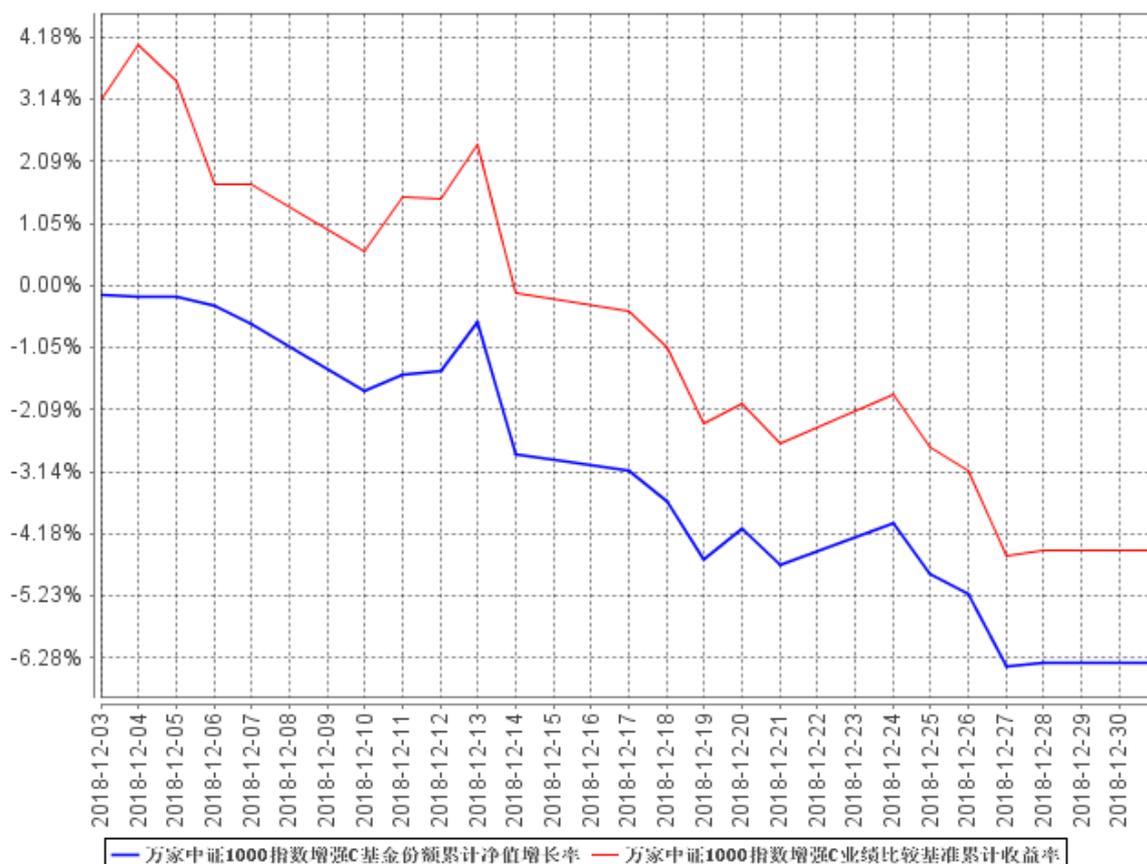
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.12.03-2018.12.31	-6.37%	0.72%	-4.45%	1.19%	-1.92%	-0.47%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家中证1000指数增强A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家中证1000指数增强C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为 2018 年 1 月 30 日，根据基金合同规定，基金建仓期为基金合同生效后六个月，本报告期末各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。本基金已于 2018 年 12 月 03 日召开基金份额持有人大会，原“万家裕债券型证券投资基金”变更注册为“万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金”。本基金份额持有人大会 2018 年 12 月 03 日表决通过了《关于修改万家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，修订和更新后的文件于 2018 年 12 月 03 日生效。基金合同生效后各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家裕 A

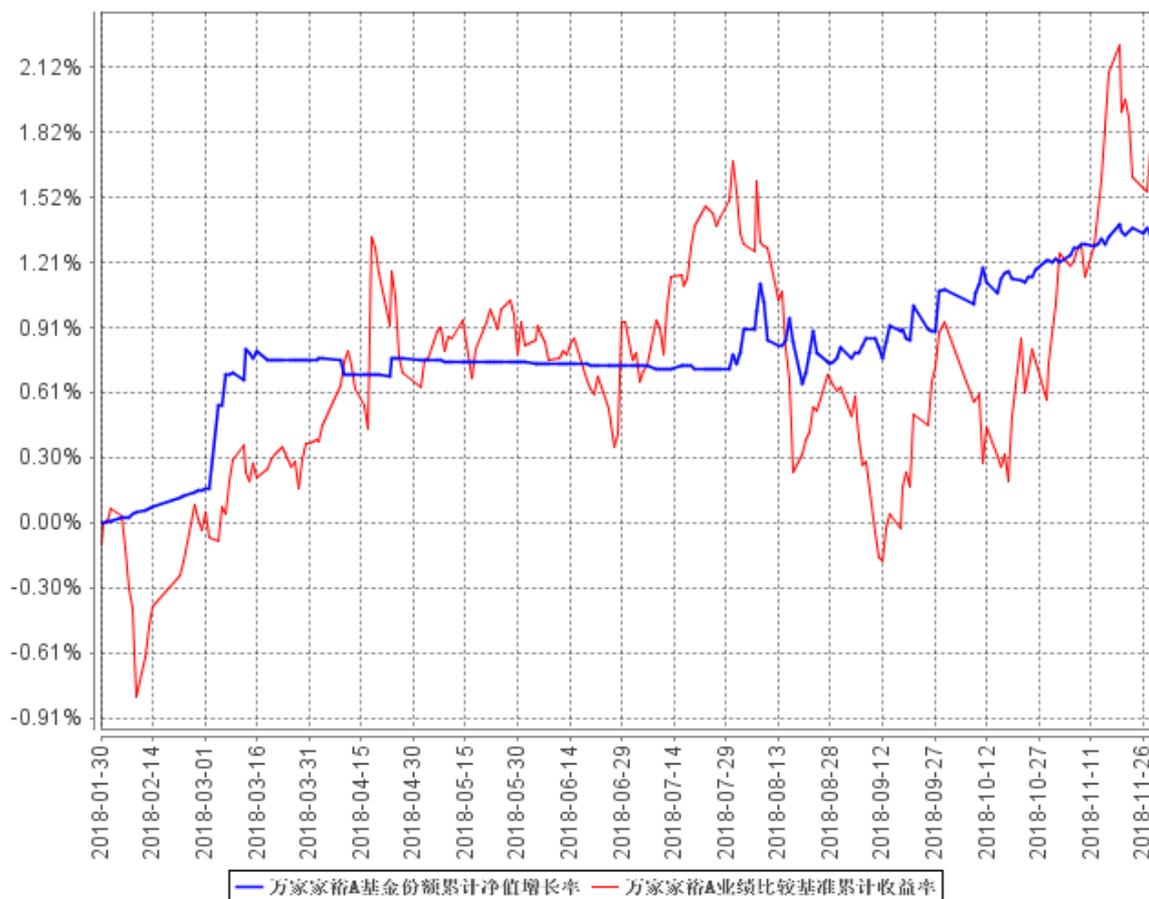
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.10.08-2018.11.30	0.25%	0.03%	0.91%	0.18%	-0.66%	-0.15%

万家裕 C

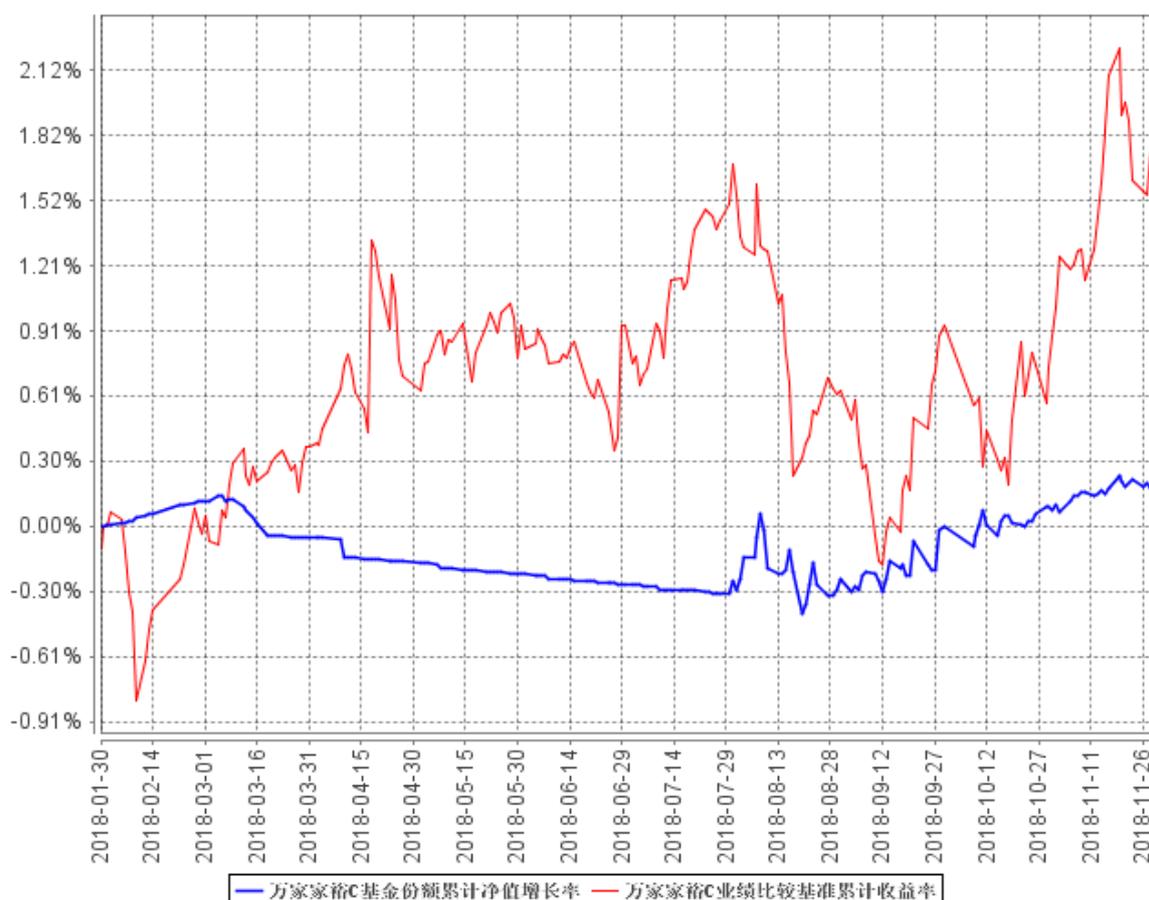
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.10.08-2018.11.30	0.17%	0.04%	0.91%	0.18%	-0.74%	-0.14%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家家裕A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家家裕C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为 2018 年 1 月 30 日，根据基金合同规定，基金建仓期为基金合同生效后六个月，本报告期末各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周潜玮	万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金	2018 年 8 月 15 日	2018 年 12 月 3 日	12.5 年	上海交通大学公共管理硕士。 2006 年 7 月至 2016 年 8 月在上海银行股份有限公司工作，其中 2012 年 2 月至 2016 年 8 月在总行金融市场部债券交易部

	金、万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家瑞丰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、万家瑞益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、万家鑫璟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、万家增强收益债券型证券投资基金、万家鑫稳纯债债券型证券投资基金基金经理			工作，2012 年 10 月起担任债券交易部副主管，主要负责债券投资及交易等相关工作； 2016 年 9 月加入万家基金管理有限公司，曾任固定收益部投资经理，主要从事债券类专户产品的投资及研究等相关工作，2018 年 3 月起担任固定收益部基金经理职务。
--	---	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈旭	万家沪深 300 指数增	2018 年 12 月 3 日	-	6 年	上海交通大学模式识别与智能系统硕士。

	<p>强型证券投资基金、万家瑞债券型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金经理</p>			<p>2010年3月至2012年9月在易安信中国卓越研发中心工作，担任高级软件工程师；</p> <p>2013年1月至2015年6月在国信证券股份有限公司工作，先后担任经济研究所分析师、自营金融工程部投资经理等职，主要从事量化投资研究分析及交易等工作；</p> <p>2015年7月加入万家基金管理有限公司，自2017年11月起担任基金经理职务，现任量化投资部副总监（主持工作）、基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平

的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年国内宏观经济承压,经济增速换挡迹象明显,央行加强逆周期调控手段,全年数次“降准”对冲压力。债市受此影响,全年表现相对较好,无风险利率高位回落,年底逐步进入长期中枢区间,实体经济融资成本开始下降。考虑到政策效果滞后现象,整体经济企稳迹象有待进一步观察,12 月份 pmi 数据依旧位于五十荣枯线之下,企业盈利数据未见明显起色。

本组合在转型前规模偏小,主要投资思路较为稳健。目前的操作是维持组合的流动性,投资于类货币市场工具品种,比如短久期利率债等。整体收益情况比较平稳。

万家中证 1000 指数增强型证券投资基金采用中证 1000 指数增强的投资策略,采用量化多因子选股模型,在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。

万家中证 1000 指数增强型证券投资基金在保持相对中证 1000 指数较小跟踪误差情况下,控制行业权重偏离度、个股集中度,通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在行业和风格配置相对于中证 1000 指数相对均衡,无重仓行业并采用动态风格调整,在量化选股方面精选行业内质优个股组合,持股较为分散。采用量化风险模型合理控制组合风险,选股方面并取得了较好的超额收益回报。选股组合 80%权重以上为中证 1000 成分股,保证了较小的跟踪误差标准,在四季度对标的指数有一定超额收益。

2019 年 1 季度展望来看,宏观经济具有一定压力,各项宏观经济指标处于下行寻底阶段。在政策面来看,今年的经济政策更加的积极,并且在宏观经济去杠杆的力度上有所缓解。外部环境上中美贸易摩擦逐步缓解,有望在今年的市场预期中逐步兑现其影响。宏观上公开市场货币调

节政策更加宽松，进一步的缓解了市场整体资金面流动性紧张。从估值角度，市场整体处于历史估值低位，从盈利面来看上市公司的盈利增速放缓成为近期更为关注的重点。从入市资金来看，外资的不断入市也带来了新的源头，伴随着行业轮动加速。市场整体资金端尚未体现积极的方面。因此，在 1 季度众多利好利空因素进行多方面博弈，市场仍处于震荡磨底的阶段，但长期投资价值已经凸显。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前，截止 2018 年 12 月 02 日，万家家裕 A 基金份额净值为 1.0127 元，2018 年 10 月 01 日至 2018 年 12 月 02 日期间基金份额净值增长率为 0.25%；万家家裕 C 基金份额净值为 1.0010 元，2018 年 10 月 01 日至 2018 年 12 月 02 日期间基金份额净值增长率为 0.17%；同期业绩比较基准收益率为 0.91%。转型后，截止 12 月 31 日，中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.9491 元，2018 年 12 月 03 日至 2018 年 12 月 31 日期间基金份额净值增长率为-6.34%；万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.9379 元，2018 年 12 月 03 日至 2018 年 12 月 31 日期间基金份额净值增长率为-6.37%；同期业绩比较基准收益率为-4.45%。基金自转型起至报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.4169%、0.4163%，年跟踪误差分别为 13.7202%、13.7376%，截止至报告期末，本基金尚在建仓期内。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内自 10 月 1 日起至 12 月 3 日万家家裕债券型证券投资基金资产净值连续 41 个工作日低于五千万元。本报告期内，公司召开本基金的基金份额持有人大会，并于 2018 年 12 月 3 日表决通过了《关于修改万家家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自万家家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效之日起，万家家裕债券型证券投资基金正式转型为万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金。本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情况。

## §5 投资组合报告

转型后：

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	8,993,920.00	89.68
	其中：股票	8,993,920.00	89.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,034,391.36	10.31
8	其他资产	228.20	0.00
9	合计	10,028,539.56	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	236,204.00	2.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,820,955.00	38.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	145,632.00	1.46
E	建筑业	403,027.00	4.04
F	批发和零售业	854,561.00	8.57
G	交通运输、仓储和邮政业	234,711.00	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	504,881.00	5.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	527,982.00	5.29
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	102,834.00	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,747.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	56,875.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	6,892,409.00	69.11

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	33,152.00	0.33
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,583,935.00	15.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	138,892.00	1.39
E	建筑业		
F	批发和零售业	64,842.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	135,795.00	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	88,335.00	0.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	36,556.00	0.37
L	租赁和商务服务业	5,269.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	5,816.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	8,919.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,101,511.00	21.07

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002788	鹭燕医药	39,700	501,014.00	5.02
2	600067	冠城大通	111,800	415,896.00	4.17
3	002335	科华恒盛	26,700	402,369.00	4.03
4	002060	粤水电	136,100	370,192.00	3.71
5	002433	太安堂	71,500	335,335.00	3.36
6	000789	万年青	22,100	240,669.00	2.41

7	000030	富奥股份	56,200	208,502.00	2.09
8	601126	四方股份	36,200	184,258.00	1.85
9	002430	杭氧股份	18,600	173,910.00	1.74
10	603385	惠达卫浴	21,100	169,011.00	1.69

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002296	辉煌科技	47,100	240,210.00	2.41
2	600426	华鲁恒升	14,200	171,394.00	1.72
3	000539	粤电力 A	29,800	137,974.00	1.38
4	601006	大秦铁路	16,500	135,795.00	1.36
5	300381	溢多利	14,000	115,360.00	1.16

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	228.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	228.20

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

转型前:

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	753,525.00	82.43
	其中：债券	753,525.00	82.43
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	141,711.67	15.50
8	其他资产	18,883.45	2.07
9	合计	914,120.12	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	753,525.00	121.18
	其中：政策性金融债	753,525.00	121.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	753,525.00	121.18

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	----	---------	--------------

1	018005	国开 1701	7,500	753,525.00	121.18
---	--------	---------	-------	------------	--------

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,883.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,883.45

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### §6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）基金份额总额	25,339.33	595,564.60
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,895,037.66	95.38
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	911.09	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	9,919,465.90	595,659.98

### §6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	万家家裕 A	万家家裕 C
报告期期初基金份额总额	26,022.08	361,352.37
报告期期间基金总申购份额	1,293.71	500,649.89
减：报告期期间基金总赎回份额	1,976.46	266,437.66

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	25,339.33	595,564.60

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	9,887,305.69
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,887,305.69
报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例（%）	99.68

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2018年12月5日	9,886,296.22	10,000,000.00	-
2	申购	2018年12月11日	1,009.47	1,020.00	1.50%
合计			9,887,305.69	10,001,020.00	

## §7 基金管理人运用自有资金投资本基金情况（转型前）

报告期内基金管理人未发生运用自有资金申赎及买卖本基金的情况。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况（转型后）

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人自有资金	9,887,305.69	94.03	9,887,305.69	94.03	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,887,305.69	94.03	9,887,305.69	94.03	3 年

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20181030-20181129	0.00	249,775.20	249,775.20	0.00	0.00%
	2	20181029-20181204	0.00	249,850.09	0.00	249,850.09	2.37%
	3	20181205-20181231	0.00	9,887,305.69	0.00	9,887,305.69	94.03%
个人	1	20181001-20181028	100,000.00	0.00	0.00	100,000.00	0.95%
	2	20181001-20181028	100,000.00	0.00	0.00	100,000.00	0.95%
	3	20181001-20181028	100,000.00	0.00	0.00	100,000.00	0.95%

产品特有风险					
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。                      未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响，极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项。</p>					

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》

### 10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司  
2019 年 1 月 22 日