

# 万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019 年第 1 号)

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

二零一九年七月

## 重要提示

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由万家裕债券型证券投资基金转型而来。万家裕债券型证券投资基金于 2016 年 5 月 3 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]977 号文注册募集，并于 2017 年 5 月 23 日获中国证监会机构部函[2017]1288 号文延期募集备案的回函。2018 年 9 月 29 日，万家裕债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会[2018]1578 号文准予变更注册。

万家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会于 2018 年 12 月 3 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》，同意变更万家裕债券型证券投资基金的基金类别、投资范围、投资比例限制、基金费率等事项并相应修订基金合同。自 2018 年 12 月 3 日起，《万家裕债券型证券投资基金基金合同》失效且《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》同日起生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本基金经中国证监会注册，但中国证监会对万家裕债券型证券投资基金转型为万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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，请认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，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：证券市场整体环境引发的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；大量赎回或暴跌导致的流动性风险；基金投资过程中产生的操作风险；因交收违约和投资债券引发的信用风险；本基金使用量化模型的特有风险；基金投资回报可能低于业绩比较基准的风险；本基金的投资范围包括股指期货、国债期货、股票期权、权证等金融衍生品、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券等品种，可能给本基金带来额外风险。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等风险。本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金的量化模型是指采用特定的量化投资模型进行选股，并非程序化交易。由于模型测算结果是根据历史数据研究得出，如果历史情况与当前市场出现重大差异，不排除模型失效的可能。此外，在市场流动性不足、异常波动、以及市场风格急剧变化等极端事件出现的情况下，本量化模型有可能产生跟踪误差偏离过大的风险。

本基金为股票型基金，理论上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致的投资风险，由投资者自行负责。

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及《基金合同》。

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。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2019 年 6 月 3 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日,财务数据未经审计。

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：万家基金管理有限公司

住所、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

法定代表人：方一天

总经理：经晓云

成立日期：2002 年 8 月 23 日

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

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：兰剑

电话：021-38909626 传真：021-38909627

### 二、主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

董事长方一天先生，中共党员，大学本科，学士学位，先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职，2014 年 10 月加入万家基金管理有限公司，2014 年 12 月起任公司董事，2015 年 2 月至 2016 年 7 月任公司总经理，2015 年 7 月起任公司董事长。

董事马永春先生，政治经济学硕士学位，曾任新疆自治区党委政策研究室科长，新疆通宝投资有限公司总经理，新疆对外经贸集团总经理，新疆天山股份有限公司董事，曾任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。现为新疆国际实业股份有限公司高级顾问。

董事袁西存先生，中共党员，研究生，工商管理学硕士，曾任莱钢集团财务部科长，副部长，中泰证券股份有限公司计划财务部总经理，现任中泰证券股份有限公司财务总监。

董事经晓云女士，中国民主建国会会员，研究生，工商管理学硕士，曾任上海财政证券公司市场管理部经理，上海证券有限责任公司经纪管理总部副总经理、总经理，上投摩根基金管理有限公司副总经理。

2016 年 7 月加入万家基金管理有限公司，任公司董事、总经理。

独立董事张伏波先生，经济学博士，曾任上海申佳船厂科员、浙江省经济建设投资公司副经理、国泰君安证券股份有限公司总裁助理、兴安证券有限责任公司副总经理、上海证券有限责任公司副总经理、海证期货有限公司董事长、亚太资源有限公司董事，现任玖源化工（集团）有限公司董事局副主席。

独立董事朱小能先生，中共党员，哲学博士，教授。曾任华东理工大学商学院讲师、中央财经大学中国金融发展研究院硕士生导师、副教授、博士生导师，上海财经大学金融学院副教授、博士生导师，现任上海财经大学金融学院教授、博士生导师。

独立董事武辉女士，农工党员，会计学博士，曾任潍坊市第二职业中专讲师，现任山东财经大学教授。

#### 2、基金管理人监事会成员

监事会丁治平先生，工商管理硕士，EMBA，高级工程师，曾任职于新疆维吾尔自治区统计局、中国银行

新疆分行，新疆对外经济贸易（集团）有限责任公司董事长。现任新疆国际实业股份有限公司董事长、总经理。

监事苏海静女士，大学本科，学士学位，先后任职于荣成飞利浦电子有限公司、山东永锋贸易有限公司、山东莱钢永锋钢铁有限公司。2007年7月起加入永锋集团有限公司，现任永锋集团有限公司资金中心副主任。

监事尹丽曼女士，中共党员，硕士，先后任职于申银万国期货有限公司、东海期货有限责任公司、万家共赢资产管理有限公司。2017年4月起加入本公司，现任公司机构业务部副总监。

监事卢涛先生，博士，先后任职于上海证券交易所、易方达基金管理有限公司。2015年6月起加入万家基金管理有限公司，现任公司产品开发部总监、组合投资部副总监。

监事路晓静女士，中共党员，硕士，先后任职于旺旺集团、长江期货有限公司。2015年5月起加入万家基金管理有限公司，现任公司合规稽核部总监助理。

### 3、基金管理人高级管理人员

董事长：方一天先生（简介请参见公司董事会成员）

总经理：经晓云女士（简介请参见公司董事会成员）

副总经理：李杰先生，硕士研究生。1994年至2003年任职于国泰君安证券，从事行政管理、机构客户开发等工作；2003年至2007年任职于兴安证券，从事营销管理工作；2007年至2011年任职于中泰证券，任营业部高级经理、总经理等职。2011年加入本公司，曾任综合管理部总监、总经理助理，2013年4月起任公司副总经理。

督察长：兰剑先生，中国民盟盟员，法学硕士，律师、注册会计师，曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作，2005年10月进入万家基金管理有限公司工作，2015年4月起任公司督察长。

副总经理：黄海先生，硕士研究生，先后在上海德锦投资有限责任公司、上海申银万国证券研究所有限公司、华宝信托有限责任公司、中银国际证券有限责任公司工作，历任项目经理、研究员、投资经理、投资总监等职务。2015年4月进入万家基金管理有限公司任投资总监职务，负责公司投资管理工作，2017年4月起任公司副总经理。

副总经理：沈芳女士，中共党员，经济学博士。历任东亚银行上海经济研究中心主任，富国基金管理有限公司资产管理部高级经理，长江养老保险股份有限公司大客户部副总经理(主持工作)，汇添富基金管理有限公司战略发展部总监，华融基金管理有限公司筹备组副组长、拟任公司副总经理，中保保险资产登记交易系统有限公司运营管理委员会副主任等职。2018年7月加入万家基金管理有限公司。2018年10月起任公司副总经理。

首席信息官：陈广益先生，中共党员，硕士学位，曾任职兴全基金管理有限公司运作保障部，2005年3月加入本公司，曾任运作保障部副总监，现任公司首席信息官，分管信息技术、基金运营、交易等业务。

### 4、本基金基金经理简历

陈旭，男，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；于2015年7月进入万家基金管理有限公司工作，曾任万家基金量化投资部总监助理、投资经理，现任万家基金量化投资部副总监、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金和万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金、万家中证500指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

#### （1）权益与组合投资决策委员会

主任：方一天

副主任：黄海

委员：李杰、莫海波、苏谋东、徐朝贞、陈旭、李文宾、高源

方一天先生，董事长。  
黄海先生，副总经理、投资总监。  
李杰先生，副总经理。  
莫海波先生，总经理助理、投资研究部总监、基金经理。  
苏谋东先生，固定收益部总监，基金经理。  
徐朝贞先生，国际业务部总监，组合投资部总监，基金经理。  
陈旭先生，量化投资部副总监，基金经理。  
李文宾先生，基金经理。  
高源女士，基金经理。

## （2）固定收益投资决策委员会

主任：方一天  
委员：陈广益、莫海波、苏谋东  
方一天先生，董事长。  
陈广益先生，首席信息官。  
莫海波先生，总经理助理、投资研究部总监、基金经理。  
苏谋东先生，固定收益部总监，基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 第二部分 基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）  
设立日期：1987年4月8日  
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦  
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦  
注册资本：252.20亿元  
法定代表人：李建红  
行长：田惠宇  
资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号  
电话：0755-83199084  
传真：0755-83195201  
资产托管部信息披露负责人：张燕

#### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2019年3月31日，本集团总资产67,943.47亿元人民币，高级法下资本充足率15.86%，权重法下资本充足率13.28%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工80人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境

外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017 年 6 月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018 年 1 月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣膺公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；5 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣膺 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月招商银行荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖。

## （二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991 年至 1995 年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995 年 6 月至 2001 年 10 月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001 年 10 月至 2006 年 3 月，历任北京分行行长助理、副行长；2006 年 3 月至 2008 年 6 月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008 年 6 月至 2012 年 6 月，任北京分行行长、党委书记；2012 年 6 月至 2013 年 11 月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013 年 11 月至 2014 年 12 月，任招商银行总行行长助理；2015 年 1 月起担任本行副行长；2016 年 11 月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。

2002 年 9 月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2019 年 3 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 450 只证券投资基金。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

本基金直销机构为万家基金管理有限公司直销中心及该公司的电子直销系统（网站、微交易）。

住所、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

法定代表人：方一天

联系人：元翡

电话：(021)38909777

传真：(021)38909798

客户服务热线：400-888-0800；95538 转 6

投资者可以通过基金管理人电子直销系统（网站、微交易）办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，

具体交易细则请参阅基金管理人的网站公告。网上交易网址：<https://trade.wjasset.com/>

微交易：万家基金微理财（微信号：wjfund\_e）

#### 2、非直销销售机构

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

##### （1）上海天天基金销售有限公司

客服电话：400-181-8188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

##### （2）浙江同花顺基金销售有限公司

客服电话：400-877-3772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

##### （3）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

客服电话：400-076-6123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

##### （4）上海陆金所基金销售有限公司

客服电话：4008-219-031

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

##### （5）北京肯特瑞基金销售有限公司

客服电话：

个人业务：95118

企业业务：4000888816

网址：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

##### （6）和讯信息科技有限公司

客服电话：400-920-0022

网址：[www.hexun.com](http://www.hexun.com)

##### （7）诺亚正行基金销售有限公司

客服电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

##### （8）光大证券股份有限公司

客服电话：95525

网址：<http://www.ebscn.com>

(9) 中泰证券股份有限公司

客服电话：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(10) 上海基煜基金销售有限公司

客服电话：400-820-5369

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn) (11) 恒泰证券股份有限公司

客服电话：400-196-6188

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(12) 联储证券有限责任公司

客服电话：4006206868

网址：[www.lczq.com](http://www.lczq.com)

(13) 上海长量基金销售有限公司

客服电话：400-820-2899

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

## 二、基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区太平桥大街 17 号

电话：(010) 58598888

传真：(010) 58598824

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼 1405 室

办公场所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼 1405 室

负责人：廖海

经办律师：刘佳、张雯倩

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

联系人：刘佳

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国上海市南京东路 61 号新黄浦金融大厦四楼

办公地址：中国上海市南京东路 61 号新黄浦金融大厦四楼

联系电话：021-63391166

传真：021-63392558

联系人：徐冬

经办注册会计师：王斌、徐冬、詹阳

## 第四部分基金的名称

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

## 第五部分基金的类型

基金类别：指数增强型股票基金

基金运作方式：契约型开放式

基金存续期间：不定期

## 第六部分基金的类型

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。

## 第七部分基金的投资范围

本基金的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、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债券、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、金融衍生品（包括权证、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）。

本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。

本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的 0-3%。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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## 第八部分基金的投资策略

本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的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的投资收益。

### 1、股票投资策略

本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的股票筛选与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金的股票资产投资主要以自主开发的量化多因子模型为基础，以中证 1000 指数的成份股做为基础股票池，对股票池进行投资价值定量分析，从而构建市场上具备超额收益的股票投资组合。首先，基于对中国 A 股市场的实际情况，通过对大量历史数据的统计分析及实证检验，构建具备超额收益能力因子库；其次，结合择时模型对因子库中的不同因子进行动态选取，并利用量化方法赋予权重；最后，在此基础上，根据动态多因子模型对 A 股市场中的股票进行打分，并选取其中具备超额收益的股票构建投资组合。本基金在数据方面选取风格因子（宏观数据、行业数据），一致预期数据以及市场情绪指标作为选取因子的标准。利用风格因子控制在一段市场环境下组合的整体风格偏好；市场情绪指标对在一段时间内市场信息传播进行有效描述，反映在动量反转类因子上；同时一致预期因子给予了股票在基本面上的把关，最终公司的成长性和财务的稳定性决定公司的中长期表现。在投资组合管理过程中，本基金还将注重投资对象的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。

指数增强投资力求跟踪误差可控，主动性投资则需要适度风险预算的支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。

本基金将结合市场通用及自主研发的风险估测模型，有效将投资组合风险控制在预算范围内。本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使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%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

### 2、债券投资策略



本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

### 3、中小企业私募债券投资策略

本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别注重中小企业私募债券的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定中小企业私募债券类资产的合理配置比例，保证本金相对安全和资产流动性，以期获得长期稳定收益。在投资决策过程中，将评估中小企业私募债券的流动性对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的中小企业私募债券具有适当的流动性；同时密切关注影响中小企业私募债券价值的因素，并进行相应的投资操作。

本基金将对中小企业私募债券进行深入研究，由债券研究员根据公司内部《信用债券库管理办法》对中小企业私募债券的信用风险和投资价值进行分析并给予内部信用评分和投资评级。本基金可投资于内部评级界定为可配置类的中小企业私募债券；对于内部评级界定为风险规避类的中小企业私募债券，禁止进行投资。

### 4、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。

### 5、可转换债券投资策略

可转换债券（含可分离转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换债券定价模型进行估值分析，投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换公司债券，获取稳健的投资回报。

### 6、证券公司短期公司债券投资策略

本基金在对证券公司短期公司债券特点和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，通过考察利率水平、票息率、付息频率、信用风险及流动性等因素判断其债券价值；采用多种定价模型以及研究人员对证券公司基本面等不同变量的研究确定其投资价值。投资综合实力较强的证券公司发行的短期公司债券，获取稳健的投资回报。

### 7、衍生产品投资策略

（1）权证投资策略。权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

（2）股指期货投资策略。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

（3）国债期货投资策略。本基金可基于谨慎原则运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

（4）股票期权投资策略。本基金将按照风险管理的原则，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与期权交易的投资时机和投资比例。

（5）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资其他衍生工具，本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，

在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

#### 8、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

#### 9、其他

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

### 第九部分基金的投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 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) 本基金参与融资业务，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(4) 在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

(5) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的部分不受此限制；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的部分不受此限制；

(7) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(9) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(11) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(12) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(13) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(14) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(15) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(16) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(17) 本基金投资于单只中小企业私募债的市值，不得超过本基金资产净值的 10%；

(18) 本基金持有单只证券公司短期公司债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

(19) 本基金参与股指期货、国债期货交易，需遵循下述投资比例限制：

本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货及国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关规定；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

（20）本基金参与股票期权交易，应当符合下列要求：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（21）本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（22）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，但完全按照标的指数的构成比例进行证券投资的部分不受此限制；

（23）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；

（24）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；

（25）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。

除上述第（2）、（14）、（23）、（24）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形及法律法规另有规定的除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。上述期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

3、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，

按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

4、法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

#### 第十部分基金的业绩比较基准

中证 1000 指数收益率\*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）\*5%

中证 1000 指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是选择中证 800 指数样本股之外规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成。

一年期人民币定期存款利率系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。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依据维护基金份额持有人利益的原则，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。

#### 第十一部分基金的风险收益特征

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。

#### 第十二部分基金的投资组合报告

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 4 月 19 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。

本投资组合报告所载数据截止日至 2019 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 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 14,433,243.00 90.72

其中：股票 14,433,243.00 90.72

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 1,149,969.07 7.23

8 其他资产 327,030.35 2.06

9 合计 15,910,242.42 100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 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	304,606.00	1.96
B 采矿业	187,167.00	1.21
C 制造业	7,136,372.00	46.03
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	182,930.00	1.18
E 建筑业	327,492.00	2.11
F 批发和零售业	563,804.00	3.64
G 交通运输、仓储和邮政业	306,214.00	1.97
H 住宿和餐饮业	--	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	1,792,454.00	11.56
J 金融业	--	
K 房地产业	532,535.00	3.43
L 租赁和商务服务业	--	
M 科学研究和技术服务业	95,472.00	0.62
N 水利、环境和公共设施管理业	60,752.00	0.39
O 居民服务、修理和其他服务业	--	
P 教育	--	
Q 卫生和社会工作	21,150.00	0.14
R 文化、体育和娱乐业	285,639.00	1.84
S 综合	45,636.00	0.29
合计	11,842,223.00	76.37

### 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	64,951.00	0.42
B 采矿业	--	
C 制造业	1,802,667.00	11.63
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,190.00	0.07
E 建筑业	--	
F 批发和零售业	134,250.00	0.87
G 交通运输、仓储和邮政业	--	
H 住宿和餐饮业	--	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	315,589.00	2.04
J 金融业	81,696.00	0.53
K 房地产业	--	
L 租赁和商务服务业	--	
M 科学研究和技术服务业	7,240.00	0.05
N 水利、环境和公共设施管理业	40,390.00	0.26
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 133,047.00 0.86  
S 综合 --  
合计 2,591,020.00 16.71

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。

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

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	000650	仁和药业	59,400	393,822.00	2.54
2	601677	明泰铝业	34,800	377,928.00	2.44
3	000030	富奥股份	52,000	269,360.00	1.74
4	000967	盈峰环境	35,400	246,738.00	1.59
5	002433	太安堂	41,100	243,723.00	1.57
6	603989	艾华集团	10,600	220,480.00	1.42
7	300465	高伟达	22,700	212,245.00	1.37
8	300567	精测电子	2,500	202,325.00	1.30
9	002060	粤水电	57,200	201,344.00	1.30
10	601636	旗滨集团	43,000	192,640.00	1.24

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	600585	海螺水泥	3,700	141,266.00	0.91
2	002150	通润装备	17,000	136,850.00	0.88
3	000026	飞亚达A	15,000	134,250.00	0.87
4	300455	康拓红外	15,800	129,876.00	0.84
5	600469	风神股份	27,500	128,700.00	0.83

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、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。

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。

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。

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。

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。

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。

#### 11、投资组合报告附注

##### 11.1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

##### 11.2、基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

##### 11.3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	4,497.36
---	-------	----------

2	应收证券清算款	-
---	---------	---

3	应收股利	-
---	------	---

4	应收利息	254.41
---	------	--------

5	应收申购款	322,278.58
---	-------	------------

6	其他应收款	-
---	-------	---

7	待摊费用	-
---	------	---

8	其他	-
---	----	---

9	合计	327,030.35
---	----	------------

##### 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。

##### 11.5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

###### 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。

###### 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。

#### 第十三部分基金的业绩

基金业绩截止日为 2019 年 3 月 31 日。

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代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 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

2019 年一季度 31.51% 1.49% 31.61% 1.71% -0.10% -0.22%

自合同成立日至 2018 年 12 月 31 日 -6.28% 0.72% -4.45% 1.19% -1.83% -0.47%

自合同成立日至 2019 年 3 月 31 日 23.17% 1.37% 25.75% 1.61% -2.58% -0.24%

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

2019 年一季度 31.67% 1.49% 31.61% 1.71% 0.06% -0.22%

自合同成立日至 2018 年 12 月 31 日 -6.30% 0.72% -4.45% 1.19% -1.85% -0.47%

自合同成立日至 2019 年 3 月 31 日 23.28% 1.38% 25.75% 1.61% -2.47% -0.23%

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况, 并与同期业绩比较基准的变动的比较

注: 本基金于 2019 年 12 月 03 日成立, 根据基金合同规定, 基金合同生效后六个月内为建仓期。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。本基金已于 2018 年 11 月 1 日至 2018 年 12 月 2 日以通讯方式召开基金持有人大会, 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, 同日起, 原“万家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。

#### 第十四部分 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、C 类基金份额计提的销售服务费;
- 4、标的指数许可使用费;
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
- 7、基金份额持有人大会费用;
- 8、基金的证券、期货交易费用;
- 9、基金的银行汇划费用;
- 10、基金的开户费用、账户维护费用;
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值



基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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

基金托管费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

## 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

## 4、标的指数许可使用费

本基金基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。指数许可使用费的费率、具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为本基金前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币壹万元（10,000 元），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法，并于新的费率和计费方式生效前书面通知基金托管人，此项调整无需召开基金份额持有人大会审议。

若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 5-10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

## 四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致并履行适当程序后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定针对全部或部分份额类别调整基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等相关费率。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按届时国家税收法律、法规执行。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可通过本基金财产账户划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

#### 第十五部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对基金管理人于 2018 年 12 月 4 日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、在重要提示部分，新增了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
- 2、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的有关内容。
- 3、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的有关内容。
- 4、在“五、相关服务机构”部分，更新了非直销销售机构的有关内容。
- 5、在“九、基金的投资”部分，更新了本基金最近一期（2019 年第 1 季度报告）投资组合报告内容。
- 6、在“十、基金的业绩”部分，更新了基金成立以来的投资业绩。
- 7、在“二十二、其他应披露事项”部分，更新了本基金发售以来的公告事项。

万家基金管理有限公司

二零一九年七月十七日