万家社会责任18个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)
2019年年度报告摘要

2019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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2020年3月25日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020 年 3 月 23 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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计，立信会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家社会责任 18 个月定期开放混合	
场内简称	社会责任	
基金主代码	161912	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2019 年 3 月 21 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	551,438,198.79 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2019 年 6 月 14 日	
下属分级基金的基金简称：	万家社会责任 A	万家社会责任 C
下属分级基金的场内简称：	社会责任	-
下属分级基金的交易代码：	161912	161913
报告期末下属分级基金的份额总额	535,904,729.00 份	15,533,469.79 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以“自下而上”精选证券的策略为主，并适度动态配置大类资产。通过定性与定量分析相结合的方法，精选出具备持续竞争优势且价值被低估的企业进行重点投资。本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析，结合对股票市场整体估值水平、上市公司利润增长情况，债券市场整体收益率曲线变化等综合指标的分析，形成对各大类资产收益风险水平的前瞻性预测，以此确定股票、固定收益证券和现金等大类资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具在给定区间内的动态配置。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80% +上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	贺倩

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	联系电话	021-38909626	010-66060069
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008880800	95599
传真		021-38909627	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易实验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）基金管理人办公场所

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日	
	万家社会责任 A	万家社会责任 C
本期已实现收益	43,102,303.09	1,181,408.74
本期利润	186,759,365.67	5,327,733.08
加权平均基金份额本期利润	0.3490	0.3439
本期基金份额净值增长率	34.93%	34.40%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0326	0.0318
期末基金资产净值	697,215,013.91	20,182,821.37
期末基金份额净值	1.3010	1.2993

注：1、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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

4、本基金合同生效于 2018 年 3 月 21 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

万家社会责任 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	24.86%	1.51%	6.11%	0.59%	18.75%	0.92%
过去六个月	45.24%	1.38%	6.18%	0.69%	39.06%	0.69%
自基金合同生效起至今	34.93%	1.24%	6.30%	0.92%	28.63%	0.32%

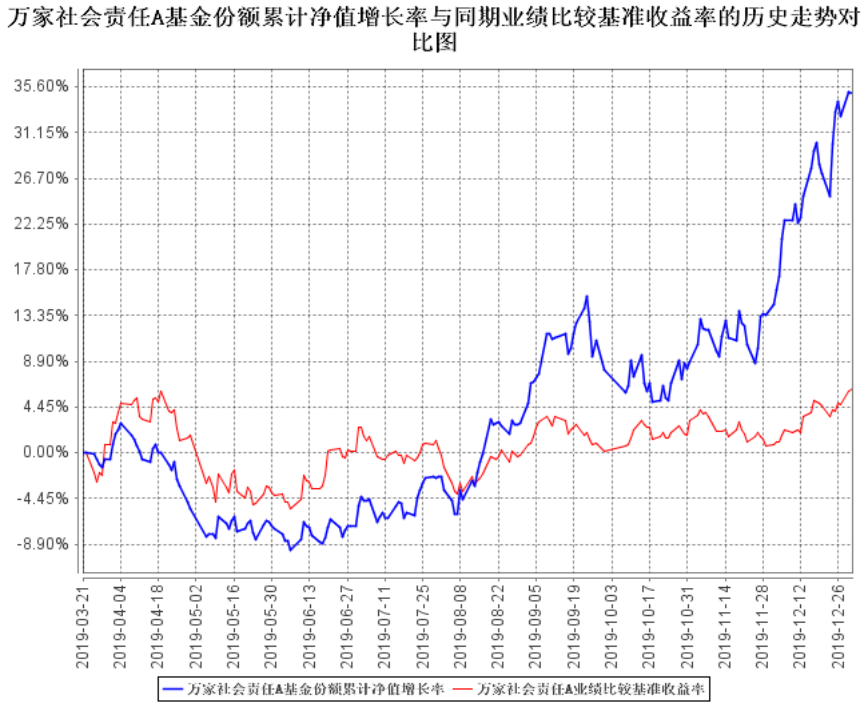
万家社会责任 C

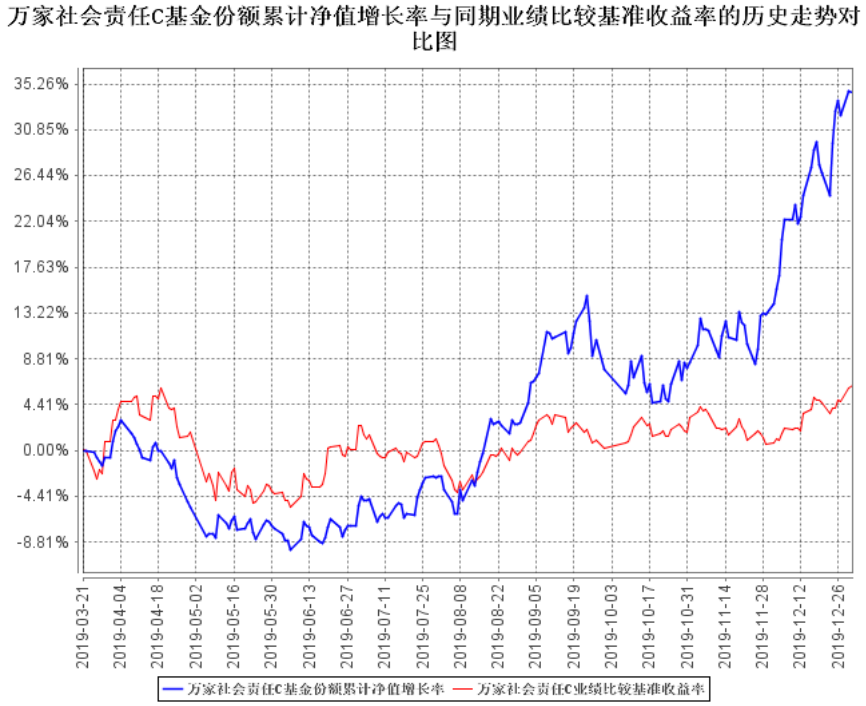
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

过去三个月	24.71%	1.51%	6.11%	0.59%	18.60%	0.92%
过去六个月	44.88%	1.38%	6.18%	0.69%	38.70%	0.69%
自基金合同生效起至今	34.40%	1.24%	6.30%	0.92%	28.10%	0.32%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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





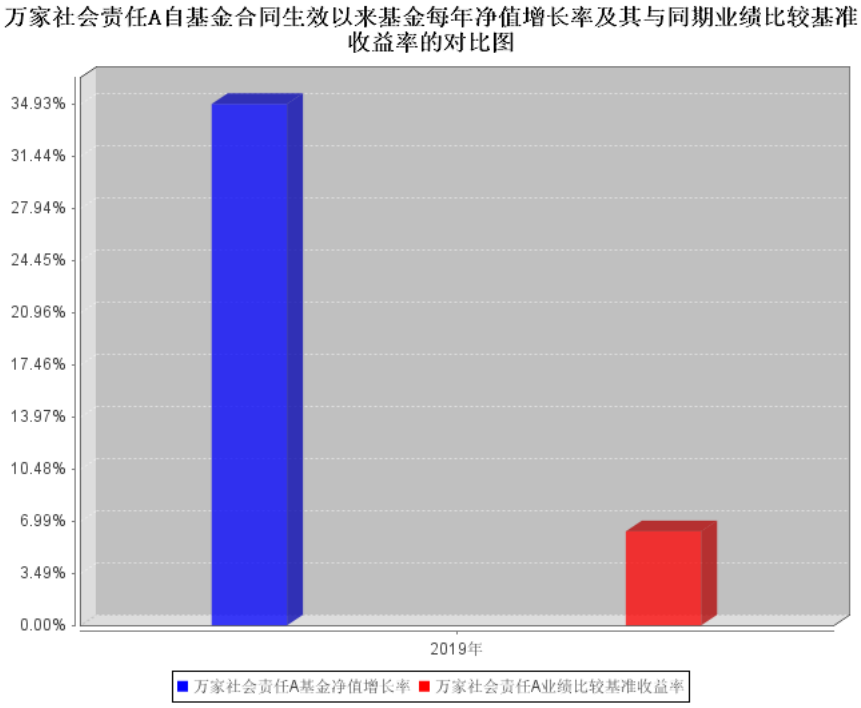
注：（1）本基金合同生效日期为 2019 年 03 月 21 日，基金合同生效起至披露时点未满一年。

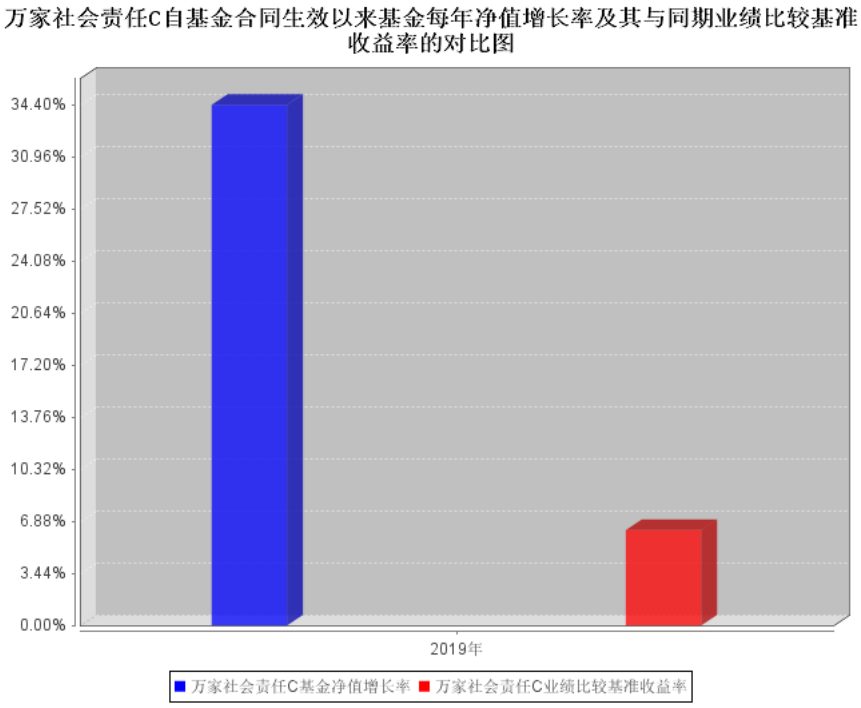
（2）本基金建仓期为基金合同生效后六个月，截至报告期末各项资产配置比例符合本基金合同有

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金合同于 2019 年 03 月 21 日生效，截至 2019 年 12 月 31 日未满一年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

万家社会责任 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019	0.4800	24,612,411.53	1,070,852.32	25,683,263.85	
合计	0.4800	24,612,411.53	1,070,852.32	25,683,263.85	

单位：人民币元

万家社会责任 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019	0.4450	638,549.71	50,916.99	689,466.70	
合计	0.4450	638,549.71	50,916.99	689,466.70	

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所：中国（上海）自由贸易实验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层）,办公地点：上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼,注册资本 3 亿元人民币。目前管理七十只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利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、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活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、万家新兴蓝筹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、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰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、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧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、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金和万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
莫海波	万家和谐增长混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金 、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家	2019 年 3 月 21 日	-	9.5 年	美国圣约翰大学 MBA。 2010 年 3 月至 2011 年 2 月在财富证券有限责任公司任分析师、投资经理助理，2011 年 2 月至 2015 年 3 月在中银国际证券有限责任公司任投资经理； 2015 年 3 月进入万家基金管理有限公司，从事投资研究工作，自 2015 年 5 月起担任基金经理职务，现任公司总经理助理、投资研究部总监、基金经理。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	臻选混合型证券投资基金、万家社会责任18个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金经理				

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》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》,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,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上:(1)公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门,公募基金经理和特定客户资产管理投资经理不得互相兼任。(2)公司投资管理实行分层次决策,投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(3)公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布,确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上:(1)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度;(2)对于交易公开竞价交易,所有指令必须通过系统下达,公司执行交易系统中的公平交易程序;(3)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,各投资组合经理在交易前独立地确定各

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4)对于银行间交易,交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上,公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易,场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析,基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录,并定期编制公平交易分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析,即采集公司旗下管理的所有组合,连续四个季度期间内,不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易样本,对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为0,95%的置信水平下的t检验,并对结论进行跟踪分析,分析结果显示在样本数量大于30的前提下,组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年宏观经济明显下行，从2018年6.7%下滑至6.1%，主要是受贸易摩擦升级等影响。分季度来看，1-4季度GDP增速分别为6.4%，6.2%，6.0%和6.0%，其中出口下滑幅度最大，从2018年的9.9%下滑至2019年的0.5%；由于汽车低迷，消费也出现一定回落，社融零售品总额增速下滑1个百分点至8%，固定资产投资增速也小幅下滑，从5.9%下滑至5.4%。通胀方面，CPI上升，PPI 下行，主要是猪肉的结构性通胀压力。政策方面，全年政策宽松，一季度和三季度都出现了明显的稳增长,全年减税降费超2万亿,3次降准,1次降息,社融增速上升0.4个百分点至10.7%。

A股从最低2400点在一季度单边上涨到3288，二季度震荡下跌、三季度横盘整理，四季度震荡上扬。全年从板块上看，食品饮料、电子、家电、农林牧渔、计算机涨幅排在最前。一季度市场的单边上涨主要是基于当时货币宽松，政策加码，经济强势好转的背景下助推股市全面大涨；二季度市场震荡下跌主要原因是货币略微收紧，贸易战加码，经济依然不错，但预期向下的背景下股市先快速下跌后反弹，但白酒、创新药（核心资产）是横盘整理，之后进入了上涨通道；三季度横盘整理的背景是货币保持收紧，地产限价政策加码，贸易战加码，经济出现下行趋势，但后期政策利好频出，经济预期平稳，在该背景下股市下跌后涨，科技大幅领涨，消费跟涨估值抬升，地产等周期是跌的；四季度开始震荡上扬主要是经济预期政策措施难以逆转经济下行，悲观

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

过度，中美关系跌宕起伏，股市下跌探底，在各种利空出尽后，股市震荡上扬。

本产品上半年以地产+新能源为主要持仓结构，考虑到中美贸易摩擦升级的背景下，国内科技行业迎来自主创新的良机，三季度策略发生了调整，逐步把地产换成半导体和消费电子，事后证明当时的决策是正确及时的，四季度新能源板块、半导体和消费电子板块成为市场上最强的龙头板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家社会责任A基金份额净值为1.3010元，本报告期基金份额净值增长率为34.93%；截至本报告期末万家社会责任C基金份额净值为1.2993元，本报告期基金份额净值增长率为34.40%；同期业绩比较基准收益率为6.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2020年，预计经济增速相比2019年继续回落，由于疫情冲击，经济节奏预计是V型走势，一季度较低，二季度开始逐步回升，全年增速 5.5%~5.7%左右。从三驾马车来看，预计出口增速会小幅恢复，消费增速由于疫情影响继续回落，固定资产投资将出现一定回升，其中基建将发挥重要作用，关注新基建。通胀方面，预计CPI将从高点逐步下行，PPI整体平稳。政策方面，预计财政政策更加积极和货币政策稳健阶段性宽松，专项债额度会明显增加。

长期来看，经济在疫情的负面冲击下，预计政府逆周期调控力度将进一步加大，国家会出台政策刺激汽车消费，需求短期被压制后有望出现爆发式回归，特别是新能源汽车在刺激政策和全球主要汽车厂商发力新能源汽车的双重作用下，有望提前出现拐点，迎来黄金十年。另外持续看好高端制造、5G、半导体等成长方向龙头。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定“当本基金某类份额净值达到或超过1.2000元时，且自然年度该类基金份额未进行过收益分配，则该类基金份额必须进行收益分配；在符合有关基金分红的前提条件下，本基金每年收益分配次数至少为1次”，2019年12月27日，本基金实施分红，A类每10份基金份额分红0.48元，C类每10份基金份额分红0.445元，共向持有人分配红利26,372,730.55元，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—万家基金管理有限公司2019年3月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§6 审计报告

本基金 2019 年年度财务会计报告已经立信会计师事务所（特殊普通合伙）审计,注册会计师签字出具了信会师报字[2020]第 ZA30150 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家社会责任18个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日： 2019年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年12月31日
资 产：	
银行存款	6,582,826.68
结算备付金	1,418,395.54
存出保证金	379,135.34
交易性金融资产	706,243,386.60
其中：股票投资	706,243,386.60
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	4,838,231.89
应收利息	11,818.91
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	719,473,794.96
负债和所有者权益	**本期末 2019年12月31日**
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	874,030.31
应付托管费	145,671.71
应付销售服务费	8,172.54
应付交易费用	853,085.12
应交税费	-
应付利息	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	195,000.00
负债合计	2,075,959.68
所有者权益：	
实收基金	551,438,198.79
未分配利润	165,959,636.49
所有者权益合计	717,397,835.28
负债和所有者权益总计	719,473,794.96

注：1、报告截止日 2019 年 12 月 31 日，万家社会责任 A 基金份额净值 1.3010 元，基金份额总额 535,904,729.00 份；万家社会责任 C 基金份额净值 1.2993 元，基金份额总额 15,533,469.79 份。万家社会责任 18 个月定期开放混合份额总额合计为 551,438,198.79 份。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.2 利润表

会计主体：万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入	204,260,149.77
1.利息收入	1,205,028.01
其中：存款利息收入	1,176,585.73
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	28,442.28
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	55,251,734.84
其中：股票投资收益	52,586,993.98
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	2,664,740.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	147,803,386.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

减：二、费用	12,173,051.02
1．管理人报酬	6,669,490.52
2．托管费	1,111,581.79
3．销售服务费	62,442.60
4．交易费用	4,051,240.27
5．利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6．税金及附加	-
7．其他费用	278,295.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	192,087,098.75
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	192,087,098.75

注：1、本财务报表的实际编制期间为2019年3月21日（基金合同生效日）至2019年6月30日。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家社会责任18个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019年3月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	550,561,697.77	-	550,561,697.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	192,087,098.75	192,087,098.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	876,501.02	245,268.29	1,121,769.31
其中：1.基金申购款	876,501.02	245,268.29	1,121,769.31
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-26,372,730.55	-26,372,730.55

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

五、期末所有者权益（基金净值）	551,438,198.79	165,959,636.49	717,397,835.28

注：1、本财务报表的实际编制期间为2019年3月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天	经晓云	陈广益
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家社会责任18个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2018】2172号文《关于准予万家社会责任18个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为管理人于2019年2月18日至2018年3月15日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2018]第ZA30152号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年3月21日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币550,272,385.47元，在募集期间产生的活期存款利息为289,312.30元，以上实收基金（本息）合计为人民币550,561,697.77元，折合550,561,697.77份基金份额。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、国债期货、股票期权以及债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、权证、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等金融工具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的相关规定）。本基金可参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80% +上证国债指数收益率×20%。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年12月31日的财务状况以及2019年3月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2019年3月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 基金的 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50%的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

(2)本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内收益分配方式为现金分红；

(3)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)当本基金某类基金份额净值达到或超过 1.2000 元时，且该自然年度该类基金份额未进行过收益分配，则该类基金份额必须进行收益分配；

(6)在符合有关基金分红的前提条件下，本金每年收益分配次数至少为 1 次；

(7)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015 年1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(一)印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008 年4 月24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008 年9 月19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(二)增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004 年1 月1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016 年5 月1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，管理人接受投资者委托或信托对受托资产提供的管理服务以及管理人发生的其他增值税应税行为，按照现行规定缴纳增值税，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。本通知自 2018 年 1 月 1 日起施行，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(三)企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(四)个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中泰证券	679,901,291.42	24.37%

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间对比数据。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年3月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中泰证券	633,193.01	24.46%	473,552.60	55.51%

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间对比数据。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,669,490.52
其中:支付销售机构的客户维护费	3,486,581.39

注：(1) 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提，其中基金管理人应将净管理费收入（税后）的 5%用于公益事业。管理费的计算方法如下：

H=E×1.50%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（2）本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,111,581.79

注：(1)基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷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款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

(2)本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家社会责任 A	万家社会责任 C	合计
万家基金管理有限公司	-	449.33	449.33
中泰证券股份有限公司	-	32,255.90	32,255.90
合计	-	32,705.23	32,705.23

注：（1）基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金销售服务年费率为 0.50%,计算方法如下:

H=E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人指令于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给各代销机构,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（2）本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年3月21日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	6,582,826.68	1,153,272.12

注：（1）本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司,2019 年度获得的利息收入为人民币 20,372.01 元,2019 年末结算备付金余额为人民币 1,418,395.54 元。

（2）本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	值单价	（单位：股）	成本总额		
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股发行	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688010	福光股份	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定	25.22	40.83	17,276	435,700.72	705,379.08	-
688012	中微公司	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定	29.01	89.16	23,850	691,888.50	2,126,466.00	-
688111	金山办公	2019 年 11 月 11 日	2020 年 5 月 18 日	新股锁定	45.86	128.63	14,659	672,261.74	1,885,587.17	-
688122	西部超导	2019 年 7 月 15 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定	15.00	32.80	15,715	235,725.00	515,452.00	-
688333	铂力特	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	新股锁定	33.00	53.75	7,359	242,847.00	395,546.25	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019 年 12 月 31 日	重大事项	39.39	2020 年 1 月 2 日	40.43	1,582,980	43,508,728.02	62,353,582.20	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(一)公允价值

1、金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

2、持续的以公允价值计量的金融工具

（1）各层次金融工具公允价值

于2019年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为638,254,795.86元，属于第二层次的余额为67,988,590.74元，无属于第三层次的余额。

（2）公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

（3）第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末未以第三层次公允价值计量。

3、非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

4、不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

售金融资产、应收利息以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(二)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	706,243,386.60	98.16
	其中：股票	706,243,386.60	98.16
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	8,001,222.22	1.11
8	其他各项资产	5,229,186.14	0.73
9	合计	719,473,794.96	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	488,857,258.52	68.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,004.16	0.00
E	建筑业	46,652.83	0.01
F	批发和零售业	-	-
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	90,361,028.15	12.60
J	金融业	100,813,062.48	14.05
K	房地产业	26,029,810.00	3.63
L	租赁和商务服务业	46,980.22	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
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	50,012.20	0.01
	合计	706,243,386.60	98.45

8.2.2 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股票投资组合。

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	317,738	65,101,338.82	9.07
2	603799	华友钴业	1,582,980	62,353,582.20	8.69
3	002460	赣锋锂业	1,758,935	61,263,706.05	8.54
4	300618	寒锐钴业	714,447	58,863,288.33	8.21
5	002371	北方华创	505,043	44,443,784.00	6.20
6	300033	同花顺	382,300	41,712,753.00	5.81
7	300136	信维通信	826,400	37,502,032.00	5.23
8	002241	歌尔股份	1,591,200	31,696,704.00	4.42
9	002624	完美世界	657,500	29,022,050.00	4.05
10	002384	东山精密	1,235,700	28,606,455.00	3.99

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	002460	赣锋锂业	77,652,287.39	10.82
2	600584	长电科技	61,120,347.58	8.52
3	002273	水晶光电	57,317,175.77	7.99
4	002036	联创电子	52,945,293.36	7.38
5	300059	东方财富	50,282,162.47	7.01

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6	002371	北方华创	45,503,781.23	6.34
7	603986	兆易创新	45,076,443.00	6.28
8	002405	四维图新	44,848,193.17	6.25
9	603799	华友钴业	43,508,728.02	6.06
10	002185	华天科技	42,337,975.99	5.90
11	600340	华夏幸福	42,057,557.34	5.86
12	300136	信维通信	41,150,367.95	5.74
13	002123	梦网集团	40,394,218.98	5.63
14	300618	寒锐钴业	39,773,961.66	5.54
15	300033	同花顺	39,594,891.53	5.52
16	002555	三七互娱	37,644,707.62	5.25
17	000002	万　科Ａ	34,224,164.38	4.77
18	300450	先导智能	33,635,179.39	4.69
19	601231	环旭电子	30,319,895.94	4.23
20	300073	当升科技	29,756,297.65	4.15
21	001979	招商蛇口	29,382,364.38	4.10
22	002241	歌尔股份	29,224,339.00	4.07
23	002373	千方科技	27,980,416.00	3.90
24	002384	东山精密	27,900,083.92	3.89
25	300679	电连技术	27,586,929.60	3.85
26	300750	宁德时代	25,006,419.25	3.49
27	600703	三安光电	24,219,080.10	3.38
28	300207	欣旺达	24,115,214.10	3.36
29	600030	中信证券	23,340,924.00	3.25
30	601211	国泰君安	23,297,702.22	3.25
31	002624	完美世界	21,875,614.15	3.05
32	002594	比亚迪	21,738,640.00	3.03
33	300369	绿盟科技	21,550,892.18	3.00
34	002466	天齐锂业	20,932,648.60	2.92
35	600837	海通证券	20,517,110.00	2.86
36	000961	中南建设	20,327,496.64	2.83
37	300088	长信科技	19,911,139.10	2.78
38	600570	恒生电子	19,893,240.50	2.77
39	300223	北京君正	18,589,599.06	2.59
40	601138	工业富联	17,026,386.65	2.37
41	688012	中微公司	16,980,848.84	2.37

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

42	600048	保利地产	16,661,882.00	2.32
43	300568	星源材质	16,180,795.00	2.26
44	600606	绿地控股	15,578,555.00	2.17
45	300498	温氏股份	15,408,620.00	2.15

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600584	长电科技	70,502,739.07	9.83
2	002273	水晶光电	67,574,188.56	9.42
3	002036	联创电子	59,842,953.90	8.34
4	002185	华天科技	45,928,423.34	6.40
5	002123	梦网集团	45,128,386.00	6.29
6	600340	华夏幸福	41,674,336.70	5.81
7	002555	三七互娱	41,120,414.84	5.73
8	002405	四维图新	40,940,145.68	5.71
9	601231	环旭电子	36,949,601.68	5.15
10	000002	万　科A	33,842,682.79	4.72
11	001979	招商蛇口	28,590,621.00	3.99
12	300073	当升科技	26,183,511.88	3.65
13	300679	电连技术	25,407,707.42	3.54
14	300059	东方财富	25,090,064.00	3.50
15	300088	长信科技	23,710,314.00	3.31
16	603986	兆易创新	23,267,973.60	3.24
17	300207	欣旺达	23,193,103.00	3.23
18	300223	北京君正	22,883,832.14	3.19
19	002373	千方科技	22,450,221.82	3.13
20	300369	绿盟科技	19,138,122.40	2.67
21	600570	恒生电子	19,104,424.67	2.66
22	000961	中南建设	18,618,725.45	2.60
23	002594	比亚迪	18,182,292.00	2.53
24	601138	工业富联	17,355,102.41	2.42
25	002460	赣锋锂业	17,212,707.00	2.40
26	002241	歌尔股份	16,775,229.00	2.34
27	603133	碳元科技	16,447,698.00	2.29

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

28	300498	温氏股份	15,242,732.66	2.12
29	300568	星源材质	14,980,632.00	2.09

注：卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,657,794,932.33
卖出股票收入（成交）总额	1,151,941,926.63

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易以套保值为目的，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货约之间的定价关系、 套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行态配置。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，以套期保值未主要目的，运用国债期货对基金投资组合进行管理，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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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

本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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	379,135.34
2	应收证券清算款	4,838,231.89
3	应收股利	-
4	应收利息	11,818.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,229,186.14

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值	流通受限情况说明

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

				比例（%）	
1	603799	华友钴业	62,353,582.20	8.69	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
万家社会责任A	15,908	33,687.75	8,421,410.81	1.57%	527,483,318.19	98.43%
万家社会责任C	527	29,475.27	0.00	0.00%	15,533,469.79	100.00%
合计	16,349	33,729.17	8,421,410.81	1.53%	543,016,787.98	98.47%

9.2 期末上市基金前十名持有人

万家社会责任A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	兴全基金－兴业银行－兴业证券股份有限公司	3,404,400.00	3.79%
2	孙晓菲	3,051,059.00	3.40%
3	周旭峰	2,444,452.00	2.72%
4	张国藩	2,181,200.00	2.43%
5	张继荣	1,736,271.00	1.93%
6	路丕思	1,500,204.00	1.67%
7	沈昌胜	1,189,849.00	1.33%
8	金刚	1,114,000.00	1.24%
9	张建光	1,011,241.00	1.13%
10	韩国京	1,010,137.00	1.13%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家社会责任A	521,894.28	0.0974%
	万家社会责任C	-	-
	合计	521,894.28	0.0946%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家社会责任 A	10~50
	万家社会责任 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家社会责任 A	0
	万家社会责任 C	0
	合计	0

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家社会责任 A	万家社会责任 C
基金合同生效日（2019 年 3 月 21 日）基金份额总额	535,068,059.77	15,493,638.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	836,669.23	39,831.79
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
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）	-	-
本报告期期末基金份额总额	535,904,729.00	15,533,469.79

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

公司高级管理人员：

首席信息官：

2019 年 6 月 13 日，公司聘任陈广益先生担任公司首席信息官。

副总经理：

2019 年 7 月 20 日，公司聘任满黎先生担任公司副总经理。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自合同生效日起由立信会计师事务所（特殊普通合伙）为基金进行审计。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

中泰证券	2	679,901,291.42	24.37%	633,193.01	24.46%	-
方正证券	2	375,502,801.00	13.46%	349,705.66	13.51%	-
华福证券	2	359,707,142.91	12.89%	334,994.12	12.94%	-
新时代证券	1	337,476,244.25	12.09%	314,292.22	12.14%	-
广发证券	1	263,729,138.88	9.45%	245,612.18	9.49%	-
天风证券	1	236,415,979.49	8.47%	220,175.46	8.51%	-
银河证券	2	194,947,774.33	6.99%	171,339.51	6.62%	-
恒泰证券	1	130,148,508.57	4.66%	121,207.04	4.68%	-
国盛证券	1	129,177,841.80	4.63%	120,303.28	4.65%	-
中信建投	2	45,267,889.30	1.62%	42,157.39	1.63%	-
海通证券	1	37,993,276.38	1.36%	35,382.51	1.37%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下:

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况:

本基金本报告期内成立，上述席位均为新增席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

方正证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	346,700,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

万家基金管理有限公司

2020 年 3 月 25 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn