

万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024 年 6 月 11 日

送出日期：2024 年 6 月 13 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	万家社会责任 18 个月定期开放混合	基金代码	161912
下属基金简称	万家社会责任 A	下属基金交易代码	161912
下属基金简称	万家社会责任 C	下属基金交易代码	161913
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
基金合同生效日	2019 年 3 月 21 日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2019 年 6 月 14 日
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	每 18 个月开放一次，每次开放 5-20 个工作日，详见届时的开放公告。
基金经理	莫海波	开始担任本基金基金经理的日期	2019 年 3 月 21 日
		证券从业日期	2010 年 3 月 2 日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资者请阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况。

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。
投资范围	<p>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、存托凭证）、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）。</p> <p>本基金可参与融资业务。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 60%，投资于本基金界定的社会责任主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，但在每个开放期的前二十个工作日和后二十个工作日以及开放期间，基金投资不受前述比例；权证投资占基金资产净值的 0-3%。在开放期，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货</p>

合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;在封闭期,本基金不受前述 5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

主要投资策略

(一) 封闭期投资策略: 1、资产配置策略; 2、股票投资策略: (1) 社会责任主题股票的筛选、(2) 股票组合的构建、(3) 存托凭证投资策略; 3、债券投资策略: (1) 利率预期策略、(2) 久期控制策略、(3) 类别资产配置策略、(4) 债券品种选择策略、(5) 套利策略、(6) 可转换债券投资策略; 4、权证投资策略; 5、金融衍生产品投资策略: (1) 股指期货投资策略、(2) 国债期货投资策略、(3) 股票期权投资策略; 6、融资交易策略; 7、资产支持证券投资策略; (二) 开放期投资策略: 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。

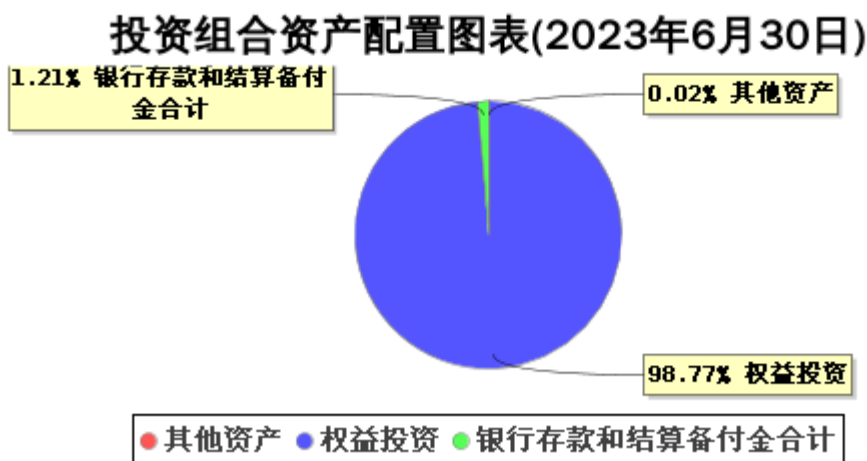
业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×80% + 上证国债指数收益率×20%

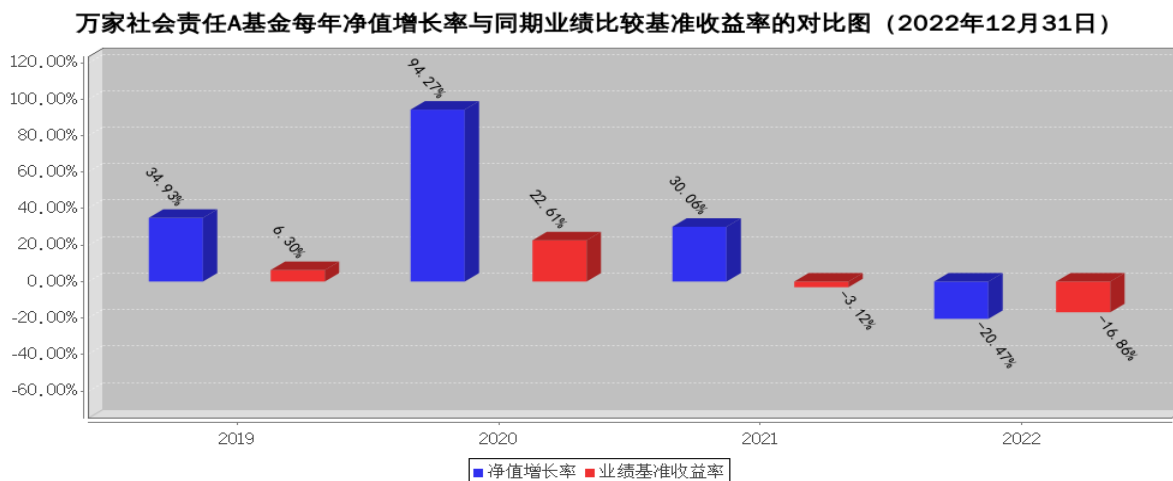
风险收益特征

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。

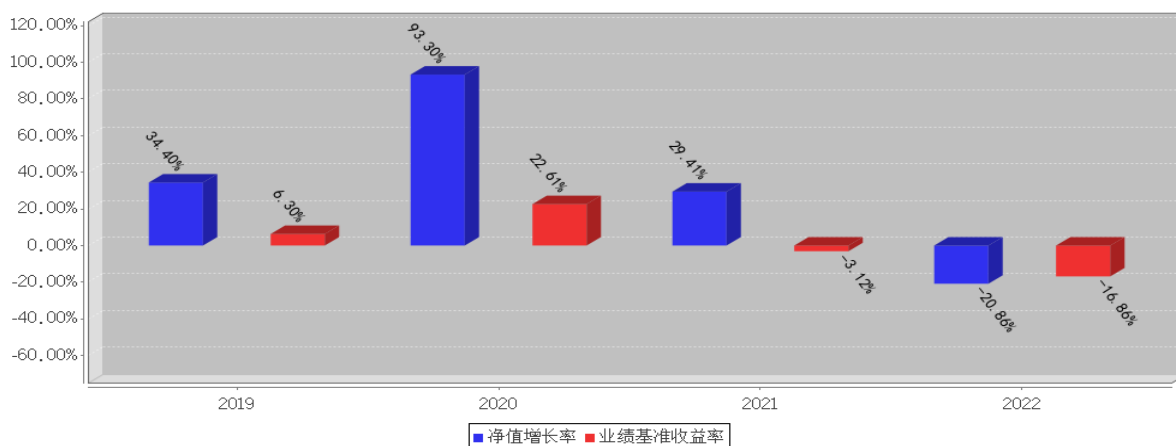
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



万家社会责任C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2022年12月31日)



注：业绩表现截止日期 2022 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

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：

万家社会责任 A

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M < 1,000,000	0.15%	特定投资者
	1,000,000 ≤ M < 3,000,000	0.10%	特定投资者
	3,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.06%	特定投资者
	M ≥ 5,000,000	1,000.00 元/笔	特定投资者
	M < 1,000,000	1.50%	其他投资者
	1,000,000 ≤ M < 3,000,000	1.00%	其他投资者
	3,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.60%	其他投资者
	M ≥ 5,000,000	1,000.00 元/笔	其他投资者
赎回费	N < 7 日	1.50%	-
	7 日 ≤ N < 30 日	0.75%	-
	30 日 ≤ N < 180 日	0.50%	-
	N ≥ 180 日	0	-

万家社会责任 C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
赎回费	N < 7 日	1.50%
	7 日 ≤ N < 30 日	0.75%
	N ≥ 30 日	0

申购费

本基金 C 类基金份额不收取申购费。

本基金 A 类基金份额的场内申购费率由销售机构参照场外 A 类基金份额申购费率执行。

(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	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
销售服务费	万家社会责任 C 0.50%	销售机构
审计费用	35,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 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: 本基金 A 类份额不收取销售服务费。

本基金交易证券、基金等产生的费用和税负, 以及《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼与仲裁费、持有人大会费用等, 按实际发生额从基金资产扣除。

上述费用金额为基金整体承担费用, 非单个份额类别费用, 且年金额为预估值, 最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额, 在持有期间, 投资者需支出的运作费率如下表:

万家社会责任 A

	基金运作综合费率 (年化)
持有期间	1.42%

注: 基金管理费率、托管费率、销售服务费率 (若有) 为基金现行费率, 其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

万家社会责任 C

	基金运作综合费率 (年化)
持有期间	1.92%

注: 基金管理费率、托管费率、销售服务费率 (若有) 为基金现行费率, 其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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。投资者可能损失投资本金。

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。投资本基金可能遇到的风险包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规性风险、本基金的特定风险及其他风险等;

本基金的投资范围包括股指期货、股票期权、国债期货、权证、存托凭证等金融衍生品, 本基金可参与融资业务, 可能给本基金带来额外风险。

本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定风险。

本基金为混合型基金,基金资产配置中股票的比例不低于基金资产的 60%,投资于本基金界定的社会责任主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,但在每个开放期的前二十个工作日和后二十个工作日以及开放期期间,基金投资不受前述比例。因此权益市场环境的变化和波动将成为影响组合绩效的主要风险来源。在本基金的封闭期内,基金份额持有人面临不能赎回基金份额的风险。

本基金 A 类份额在深圳证券交易所挂牌上市,基金份额二级市场交易价格可能低于基金份额净值,即基金折价交易,从而影响持有人收益或给持有人造成损失;上市期间可能因信息披露导致基金停牌,投资者在停牌期间不能买卖基金,产生风险;同时,可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险;另外,当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时,本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额,侧袋账户份额不能赎回,其对应特定资产的变现时间具有不确定性,最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值,基金份额持有人可能因此面临损失。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,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。

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。

根据基金合同的解决争议条款,与《基金合同》有关的争议,当事人未能经友好协商解决的,应选择提交仲裁。

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][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