

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 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

送出日期：2021 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2021 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、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 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 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	19
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	20
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	20
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息	21
6.2 审计报告的基本内容	21
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	27
7.4 报表附注	29
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	74
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	75

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	75
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	75
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12 投资组合报告附注	75
§9 基金份额持有人信息	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
9.3 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	78
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	78
§10 开放式基金份额变动	79
§11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
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	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
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	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
§12 影响投资者决策的其他重要信息	83
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	83
§13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	13,257,277.16 份	
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	11,120,961.79 份	2,136,315.37 份

2.2 基金产品说明

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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	张燕
	联系电话	021-38909626	0755-83199084
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008880800	95555
传真		021-38909627	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200122	518040
法定代表人		方一天	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2020 年		2019 年		2018 年 12 月 3 日(基金合 同生效日)-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	万家中证 1000 指数增 强 A	万家中证 1000 指数增 强 C	万家中证 1000 指数增 强 A	万家中证 1000 指数 增强 C
本期 已实 现收 益	4,294,744.5 5	3,263,838.4 7	4,449,479.5 5	22,351,174. 93	-20,333.98	-1,907.31
本期 利润	3,933,740.4 7	3,263,635.6 2	3,803,682.4 1	24,871,518. 86	-617,930.09	-37,619.0 0
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.3410	0.3462	0.3496	0.5092	-0.0727	-0.0632
本期 加权 平均 净值 利润 率	26.99%	28.40%	29.79%	42.45%	-7.40%	-6.48%
本期	33.58%	33.01%	40.77%	40.57%	-6.28%	-6.30%

基金 份额 净值 增长 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末 可供 分配 利润	4,146,667.1 3	781,361.27	645,250.58	645,014.53	-505,079.32	-37,011.5 6
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.3729	0.3658	0.0576	0.0562	-0.0509	-0.0621
期末 基金 资产 净值	15,267,628. 92	2,917,676.6 4	11,844,421. 18	12,130,844. 35	9,414,386.5 8	558,648.4 2
期末 基金 份额 净值	1.3729	1.3658	1.0576	1.0562	0.9491	0.9379
3.1. 3	2020 年末		2019 年末		2018 年末	

累计 期末 指标						
基金 份额 累计 净值 增长 率	76.11%	75.06%	31.84%	31.61%	-6.28%	-6.30%

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。

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

万家中证 1000 指数增强 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	5.08%	1.27%	0.46%	1.17%	4.62%	0.10%
过去六个月	12.46%	1.56%	5.03%	1.50%	7.43%	0.06%
过去一年	33.58%	1.66%	18.63%	1.64%	14.95%	0.02%
自基金合同 生效起至今	76.11%	1.51%	41.14%	1.55%	34.97%	-0.04%

万家中证 1000 指数增强 C

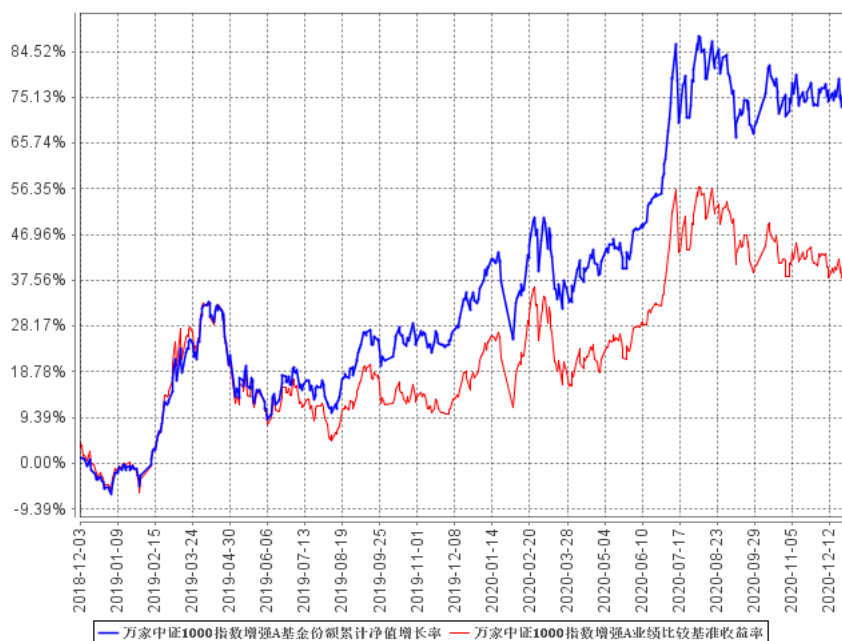
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
----	--------------	---------------------	--------------------	-----------------------	-----	-----

过去三个月	4.95%	1.27%	0.46%	1.17%	4.49%	0.10%
过去六个月	12.21%	1.56%	5.03%	1.50%	7.18%	0.06%
过去一年	33.01%	1.66%	18.63%	1.64%	14.38%	0.02%
自基金合同 生效起至今	75.06%	1.51%	41.14%	1.55%	33.92%	-0.04%

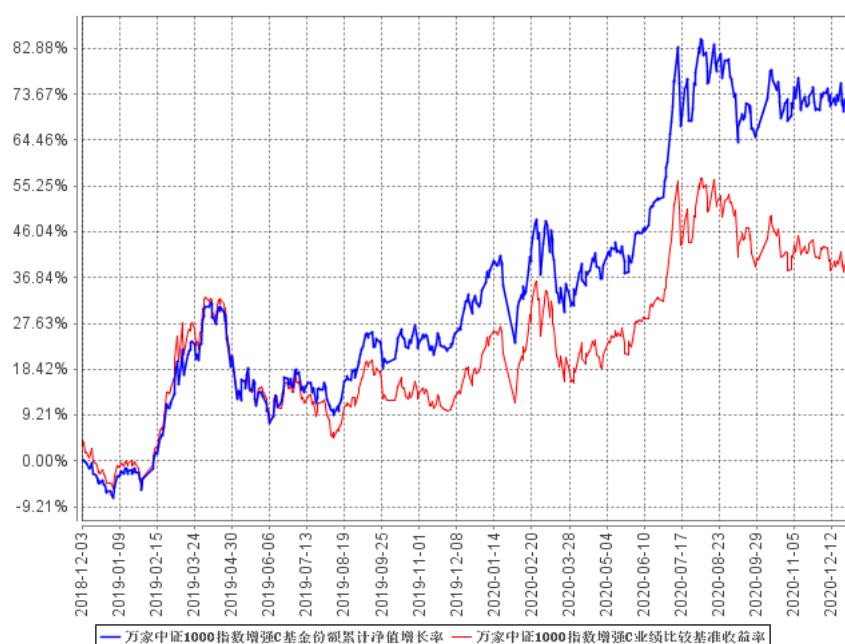
注：基金业绩比较基准增长率=中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%

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

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



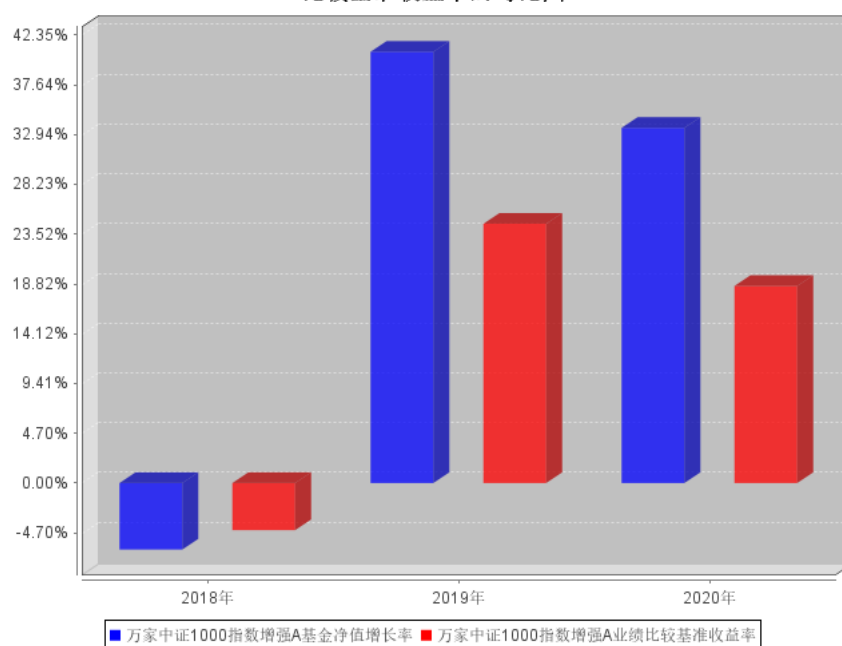
万家中证1000指数增强C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



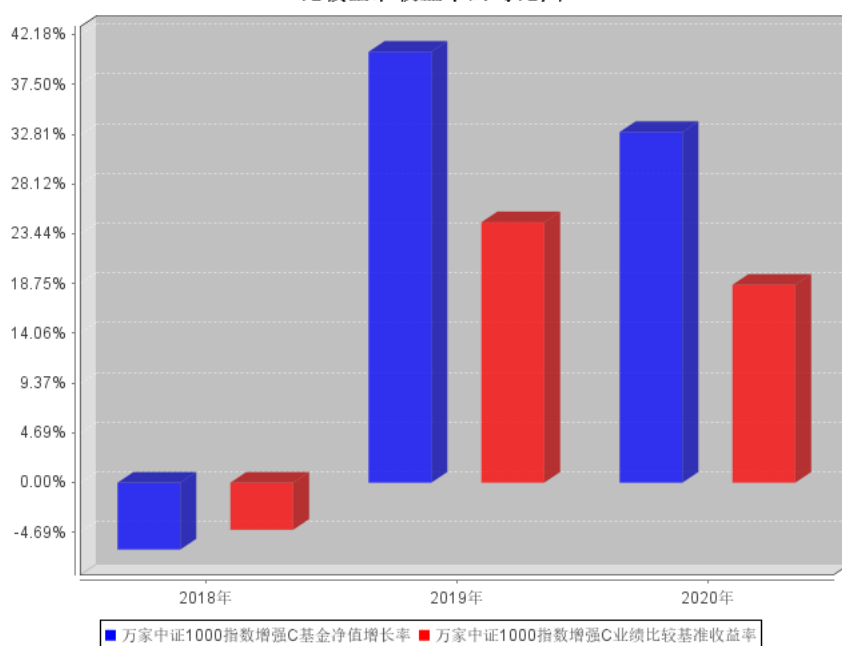
注：本基金合同生效日期为2018年12月03日，基金建仓期为基金合同生效后六个月，基金合同生效后各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

3.2.3 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

万家中证1000指数增强A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对比图



万家中证1000指数增强C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对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 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
2020	0.3920	426,301.86	11,913.86	438,215.72	
2019	2.6670	2,819,285.16	126,287.24	2,945,572.40	
2018	—	—	—	—	
合计	3.0590	3,245,587.02	138,201.10	3,383,788.12	

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 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
2020	0.3840	66,295.69	17,540.85	83,836.54	
2019	2.5130	382,394.80	30,329,130.54	30,711,525.34	
2018	—	—	—	—	
合计	2.8970	448,690.49	30,346,671.39	30,795,361.88	

§ 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)自由贸易试验区浦电路 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。目前管理八十三只开放式基金,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、万家瑞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

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、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家家丰中短债债券型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金。

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		
乔亮	万家量化睿选灵活配置混合型基金、万家中证 1000 指数增强型发起式基金、万家沪深 300 指数增强	2019 年 8 月 21 日	-	13.5 年	曾任美国巴克莱国际投资管理公司基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司基金经理，南方基金管理有限公司量化投资部基金经理，通联数据股份公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投

	型基金、 万家中证 500 指数 增强型基 金的基金 经理				资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监。2019 年 7 月加入万家基金管理有限公司，担任公司总经理助理。
--	--	--	--	--	---

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，公募基金经理和私募资产管理计划投资经理不得互相兼任。(2) 公司投资管理实行分层次决策，投资决策委员会根据公募基金和私募投资组合的规模、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，公司执行交易系统内的公平交易程序；(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投资组合的交易价格和数量，原则上公司按照价格优先、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，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共有 7 次，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

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。

万家中证 1000 指数增强基金采用量化多因子选股策略，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业绩基准指数相对均

衡，无重仓行业或具体风格，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，保证较小的跟踪误差，投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80%以上权重为中证 1000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

后续投资运作继续坚持以量化多因子选股为策略基础，积极参与科创、创业板打新等事件性机会，追求长期稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.3729 元，本报告期基金份额净值增长率为 33.58%；截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.3658 元，本报告期基金份额净值增长率为 33.01%；同期业绩比较基准收益率为 18.63%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2287%、0.2285%，年跟踪误差分别为 2.8350%、2.8215%，符合基金合同中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%的规定。

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 2021 年，疫情带来的基数效应使得业绩增长的确定性较高，业绩因素对市场总体偏正向。对于估值而言，在经历了两年的结构性行情演绎后，A 股主要板块的核心资产估值已然不低，在货币政策回归稳健和生产恢复对资金需求旺盛的背景下，流动性对 A 股估值将偏压制。因此对于 2021 年的行情我们预计为震荡向上。

中长期视角看，当前正处政策红利和技术红利叠加期，主线是科技+消费。对于科技：政策推动方面，中央经济工作会议将“强化国家战略科技力量”列为排名第一的重点任务，强调依托新型举国体制突破核心技术、解决一系列“卡脖子”问题。“十四五”规划建议稿也强调坚持创新驱动发展，科技自立自强，加快在关键核心技术领域实现突破；产业链扩散方面，当前正处 5G 引领的新一轮科技周期中，前期以硬件为主，中后期带动软件革新需求，依照硬件-软件-内容-应用场景规律，往后看计算机、传媒、新能源产业链等产业发展空间更大。对于消费：“十四五”规划建议再次强调构建“双循环”新发展格局，提出形成强大国内市场，将扩大内需作为战略基点，中央经济工作会议强调注重需求侧管理，扩大内需着力点在扩大消费。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完

整,主要做了以下工作:

(一) 加强风控文化建设

不断梳理和优化制度流程、防范操作风险、加强对员工的合规培训和加深员工对合规风控工作的理解,确保公司各项业务合法合规。

(二) 制度流程建设

为加强内控管理,保证公司各项制度流程的有效性、及时性、完备性,本年度对投资、销售、专户业务相关的制度流程及后台部门相关制度进行了修订;

(三) 定期和临时稽核工作

报告期内,监察稽核部门按计划完成了各项定期稽核和专项稽核,检查内容覆盖公司各业务部门和业务环节,检查完成后出具监察稽核报告和建议书,并对整改情况进行跟踪。

(四) 绩效评估和风险管理工作

报告期内,进一步完善了每日风险监控工作;改进基金业绩评价工作,辅助基金经理投资决策,提供风险评估意见等;针对由于市场流动性紧张的情况,加大了对固定收益产品的风险管理,防范资金交收风险。

(五) 员工行为管理与防控内幕交易

报告期内,公司进一步完善防控内幕交易制度和从业人员投资申报等制度,强化员工行为管理工作,防范内幕交易和利益输送。

4.7 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。

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》、《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》。

4.8 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：“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为 1 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%”。2020 年 12 月 21 日，本基金进行了利润分配，A 类每 10 份基金份额分红 0.392 元，共计分配利润 438,215.72 元；C 类每 10 份基金份额分红 0.384 元，共计分配利润 83,836.54 元。符合基金合同的规定。

4.9 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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2021]第 ZA30316 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“万家中证 1000 指数增强”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、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编制，公允反映了万家中证 1000 指数增强 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于万家中证 1000 指数增强，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
管理层和治理层对财务报表的责任	万家中证 1000 指数增强的基金管理人万家基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估万家中证 1000 指数增强的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

	基金管理人治理层负责监督万家中证 1000 指数增强的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对万家中证 1000 指数增强持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家中证 1000 指数增强不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与管理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项

	进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王 斌	徐 冬
会计师事务所的地址	中国 上海	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,092,654.49	38,850,913.62
结算备付金		48,374.56	809,279.82
存出保证金		—	50,575.27
交易性金融资产	7.4.7.2	17,155,937.38	22,474,923.86
其中：股票投资		17,155,937.38	22,474,923.86
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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	144.83	6,321.06
应收股利		—	—
应收申购款		—	62,643.27
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		18,297,111.26	62,254,656.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	60,013.24
应付赎回款		29,180.87	37,410,279.81
应付管理人报酬		15,642.35	111,304.94
应付托管费		3,128.47	22,260.98
应付销售服务费		1,028.83	40,227.40
应付交易费用	7.4.7.7	21,592.30	529,080.45
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	41,232.88	106,224.55
负债合计		111,805.70	38,279,391.37
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	13,257,277.16	22,685,000.42
未分配利润	7.4.7.10	4,928,028.40	1,290,265.11
所有者权益合计		18,185,305.56	23,975,265.53
负债和所有者权益总计		18,297,111.26	62,254,656.90

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.3729 元，基金份额总额 11,120,961.79 份；万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.3658 元，基金份额总额 2,136,315.37 份。万家中证 1000 指数增强份额总额合计为 13,257,277.16 份。

7.2 利润表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		7,885,142.16	31,722,229.38
1.利息收入		11,145.88	51,795.30
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,145.88	51,795.30
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,171,369.48	29,524,740.83
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,980,488.38	29,220,158.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	190,881.10	304,582.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-361,206.93	1,874,546.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	63,833.73	271,146.46
减：二、费用		687,766.07	3,047,028.11
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	262,362.18	711,065.96
2. 托管费	7.4.10.2.2	52,472.46	142,213.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	46,967.88	233,550.02

4. 交易费用	7.4.7.19	262,390.38	1,830,575.82
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	7.4.7.20	63,573.17	129,623.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,197,376.09	28,675,201.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,197,376.09	28,675,201.27

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	22,685,000.42	1,290,265.11	23,975,265.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,197,376.09	7,197,376.09
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）	-9,427,723.26	-3,037,560.54	-12,465,283.80
其中：1. 基金申购款	24,734,374.66	4,210,472.48	28,944,847.14

2. 基金赎回款	-34,162,097.92	-7,248,033.02	-41,410,130.94
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）	-	-522,052.26	-522,052.26
五、期末所有者权益（基金净值）	13,257,277.16	4,928,028.40	18,185,305.56
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 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）	10,515,125.88	-542,090.88	9,973,035.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,675,201.27	28,675,201.27
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）	12,169,874.54	6,814,252.46	18,984,127.00
其中：1. 基金申购款	161,062,368.15	16,497,703.70	177,560,071.85
2. 基金赎回款	-148,892,493.61	-9,683,451.24	-158,575,944.85
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）	-	-33,657,097.74	-33,657,097.74
五、期末所有者权益（基金净值）	22,685,000.42	1,290,265.11	23,975,265.53

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：

<u>方一天</u>	<u>陈广益</u>	<u>陈广益</u>
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。根据万家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《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》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，万家裕债券型证券投资基金于 2018 年 12 月 3 日转型为本基金。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本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登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、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、存托凭证）、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。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

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（2020 年修订）》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。

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 and 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，以公允价值计量且其变动计入当期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；

(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 1.00%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 0.20%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 0.40%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；
- 2、本基金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；
- 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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为 1 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。
- 5、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(二) 增值税

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，自 2018 年 1 月 1 日起，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。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；

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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	1,092,654.49	38,850,913.62
定期存款	—	—
其中：存款期限 1 个月以内	—	—
存款期限 1-3 个月	—	—
存款期限 3 个月以上	—	—
其他存款	—	—
合计：	1,092,654.49	38,850,913.62

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		16,276,182.32	17,155,937.38	879,755.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		16,276,182.32	17,155,937.38	879,755.06
项目		上年度末		
		2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		21,233,961.87	22,474,923.86	1,240,961.99
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		21,233,961.87	22,474,923.86	1,240,961.99

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末未持有各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	123.40	5,895.35
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	15.51	400.62
应收债券利息	—	—
应收资产支持证券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	0.12
应收黄金合约拆借孳息	—	—
应收出借证券利息	—	—
其他	5.92	24.97
合计	144.83	6,321.06

注：其他本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金所产生的应收利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	21,592.30	529,080.45
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	21,592.30	529,080.45

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	8.81	0.48
应付证券出借违约金	—	—
预提费用	41,224.07	106,224.07
合计	41,232.88	106,224.55

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,199,170.60	11,199,170.60
本期申购	4,287,122.27	4,287,122.27

本期赎回（以“-”号填列）	-4,365,331.08	-4,365,331.08
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	11,120,961.79	11,120,961.79

金额单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 C		
项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,485,829.82	11,485,829.82
本期申购	20,447,252.39	20,447,252.39
本期赎回（以“-”号填列）	-29,796,766.84	-29,796,766.84
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,136,315.37	2,136,315.37

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,641,564.11	-996,313.53	645,250.58
本期利润	4,294,744.55	-361,004.08	3,933,740.47
本期基金份额交易产生的变动数	-178,040.01	183,931.81	5,891.80

其中：基金申购款	1,034,245.01	-72,818.40	961,426.61
基金赎回款	-1,212,285.02	256,750.21	-955,534.81
本期已分配利润	-438,215.72	-	-438,215.72
本期末	5,320,052.93	-1,173,385.80	4,146,667.13

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,672,772.49	-1,027,757.96	645,014.53
本期利润	3,263,838.47	-202.85	3,263,635.62
本期基金份额交易产生的变动数	-3,845,338.57	801,886.23	-3,043,452.34
其中：基金申购款	3,934,591.28	-685,545.41	3,249,045.87
基金赎回款	-7,779,929.85	1,487,431.64	-6,292,498.21
本期已分配利润	-83,836.54	-	-83,836.54
本期末	1,007,435.85	-226,074.58	781,361.27

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	9,247.56	43,975.82
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,293.56	7,503.34
其他	604.76	316.14
合计	11,145.88	51,795.30

注：本期其他包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	92,120,654.39	600,915,283.50
减：卖出股票成本总额	84,140,166.01	571,695,125.43
买卖股票差价收入	7,980,488.38	29,220,158.07

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	190,881.10	304,582.76
其中：证券出借权益补偿收	-	-

入		
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	190,881.10	304,582.76

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-361,206.93	1,874,546.79
——股票投资	-361,206.93	1,874,546.79
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-361,206.93	1,874,546.79

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	63,122.85	271,145.34
转换费收入	710.88	1.12

合计	63,833.73	271,146.46
----	-----------	------------

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	262,390.38	1,830,575.82
银行间市场交易费用	—	—
交易基金产生的费用	—	—
其中：申购费	—	—
赎回费	—	—
合计	262,390.38	1,830,575.82

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	45,000.00
信息披露费	—	39,775.93
证券出借违约金	—	—
指数费用	40,000.00	43,152.17
银行费用	3,573.17	1,695.00
合计	63,573.17	129,623.10

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金本报告期末无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日, 本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
招商银行股份有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中泰证券股份有限公司	17,228,572.83	10.08%	—	—

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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
中泰证券股份有 限公司	16,044.60	10.34%	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1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
中泰证券股份有 限公司	—	—	—	—

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日

当期发生的基金应支付的管理费	262,362.18	711,065.96
其中：支付销售机构的客户维护费	32,107.95	12,707.36

注：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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	52,472.46	142,213.21

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 1000 指数 增强 A	万家中证 1000 指数 增强 C	合计
万家基金管理有限公司	—	26,037.60	26,037.60
中泰证券股份有限公司	—	194.90	194.90
招商银行股份有限公司	—	600.66	600.66
合计	—	26,833.16	26,833.16
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 1000 指数 增强 A	万家中证 1000 指数 增强 C	合计
万家基金管理有限公司	—	225,922.76	225,922.76
中泰证券股份有限公司	—	363.17	363.17
合计	—	226,285.93	226,285.93

注：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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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
基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	9,887,305.69	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	9,887,305.69	—
报告期末持有的基金份额	74.5802%	—

占基金总份额比例		
----------	--	--

项目	上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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
基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	43.5852%	-

7.4.10.5.2 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,092,654.49	9,247.56	38,850,913.62	43,975.82

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，活期存款按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

万家中证1000指数增强A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 12 月 21 日	-	2020 年 12 月 21 日	0.3920	426,301.86	11,913.86	438,215.72	
合 计	-	-	-	0.3920	426,301.86	11,913.86	438,215.72	

万家中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 12 月 21 日	-	2020 年 12 月 21 日	0.3840	66,295.69	17,540.85	83,836.54	
合 计	-	-	-	0.3840	66,295.69	17,540.85	83,836.54	

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券全部在证券交易所上市，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,092,654.49	-	-	-	-	-	1,092,654.49
结算备付金	48,374.56	-	-	-	-	-	48,374.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	17,155,937.38	17,155,937.38
应收利息	-	-	-	-	-	144.83	144.83
资产总计	1,141,029.05	-	-	-	-	17,156,082.21	18,297,111.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,180.87	29,180.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,642.35	15,642.35
应付托管费	-	-	-	-	-	3,128.47	3,128.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,028.83	1,028.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	21,592.30	21,592.30
其他负债	-	-	-	-	-	41,232.88	41,232.88
负债总计	-	-	-	-	-	111,805.70	111,805.70

利率敏感度缺口	1,141,029.05	-	-	-	-	17,044,276.51	18,185,305.56
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	38,850,913.62	-	-	-	-	-	38,850,913.62
结算备付金	809,279.82	-	-	-	-	-	809,279.82
存出保证金	50,575.27	-	-	-	-	-	50,575.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	22,474,923.86	22,474,923.86
应收利息	-	-	-	-	-	6,321.06	6,321.06
应收申购款	-	-	-	-	-	62,643.27	62,643.27
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	39,710,768.71	-	-	-	-	22,543,888.19	62,254,656.90
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	60,013.24	60,013.24
应付赎回款	-	-	-	-	-	37,410,279.81	37,410,279.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	111,304.94	111,304.94
应付托管费	-	-	-	-	-	22,260.98	22,260.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	40,227.40	40,227.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	529,080.45	529,080.45
其他负债	-	-	-	-	-	106,224.55	106,224.55
负债总计	-	-	-	-	-	38,279,391.37	38,279,391.37
利率敏感度缺口	39,710,768.71	-	-	-	-	15,735,503.18	23,975,265.53

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	17,155,937.38	94.34	22,474,923.86	93.74
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	17,155,937.38	94.34	22,474,923.86	93.74

注：本基金的投资组合比例为：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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-171,454.22	-175,669.11
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	171,454.22	175,669.11

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。表中为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 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 2020 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工具中属于第一层次的余额为 17,155,937.38 元，无属于第二层次和第三层次的余额。（2019 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 21,249,926.08 元，属于第二层次的余额为 1,224,997.78 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

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次均未发生重大变动。

(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及上年度末均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

本基金本期末及上年度末均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。

§ 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	17,155,937.38	93.76
	其中：股票	17,155,937.38	93.76
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	1,141,029.05	6.24
8	其他各项资产	144.83	0.00
9	合计	18,297,111.26	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	198,180.00	1.09
C	制造业	10,114,404.40	55.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	186,367.00	1.02
E	建筑业	437,450.00	2.41
F	批发和零售业	683,903.00	3.76
G	交通运输、仓储和邮政业	143,158.90	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	1,490,926.40	8.20

	业		
J	金融业	273,869.00	1.51
K	房地产业	485,285.08	2.67
L	租赁和商务服务业	5,376.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	109,500.00	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	199,159.00	1.10
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	75,736.00	0.42
S	综合	—	—
	合计	14,403,314.78	79.20

8.2.2 期末积极投资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	24,192.00	0.13
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,051,700.60	11.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,936.00	0.04
E	建筑业	79,761.00	0.44
F	批发和零售业	71,581.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	83,620.00	0.46
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,893.00	0.44
J	金融业	8,310.00	0.05

K	房地产业	124,355.00	0.68
L	租赁和商务服务业	133,736.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	87,538.00	0.48
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	2,752,622.60	15.14

8.2.3 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所有股票投资明细

8.3.1 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所有股票投资明细

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	300724	捷佳伟创	3,700	538,720.00	2.96
2	002025	航天电器	7,400	482,332.00	2.65
3	603456	九洲药业	10,300	368,740.00	2.03
4	300502	新易盛	6,140	340,647.20	1.87
5	300037	新宙邦	3,100	314,340.00	1.73
6	600569	安阳钢铁	114,100	290,955.00	1.60
7	600458	时代新材	34,000	289,340.00	1.59
8	002332	仙琚制药	20,600	275,216.00	1.51
9	603267	鸿远电子	2,100	270,396.00	1.49
10	300073	当升科技	4,100	265,885.00	1.46

11	002482	广田集团	81,200	250,096.00	1.38
12	300188	美亚柏科	11,000	236,940.00	1.30
13	002421	达实智能	65,400	234,132.00	1.29
14	000951	中国重汽	6,800	213,928.00	1.18
15	000733	振华科技	3,600	211,860.00	1.17
16	600742	一汽富维	20,200	202,808.00	1.12
17	002706	良信股份	6,600	202,224.00	1.11
18	600708	光明地产	78,500	200,175.00	1.10
19	002312	三泰控股	33,900	194,247.00	1.07
20	603337	杰克股份	6,000	182,520.00	1.00
21	601375	中原证券	25,900	181,818.00	1.00
22	300726	宏达电子	2,400	173,640.00	0.95
23	002727	一心堂	5,200	173,212.00	0.95
24	600966	博汇纸业	10,300	154,809.00	0.85
25	000950	重药控股	29,700	154,440.00	0.85
26	600622	光大嘉宝	44,100	149,058.00	0.82
27	600711	盛屯矿业	15,900	145,644.00	0.80
28	603626	科森科技	12,600	145,026.00	0.80
29	603128	华贸物流	15,410	143,158.90	0.79
30	600981	汇鸿集团	44,300	135,558.00	0.75
31	002462	嘉事堂	9,400	132,634.00	0.73
32	603612	索通发展	9,500	129,865.00	0.71
33	300567	精测电子	2,300	126,362.00	0.69
34	002497	雅化集团	5,700	125,115.00	0.69
35	002911	佛燃能源	6,600	119,196.00	0.66
36	000910	大亚圣象	8,300	115,868.00	0.64
37	002022	科华生物	7,400	114,108.00	0.63
38	000801	四川九洲	18,300	113,277.00	0.62

39	603081	大丰实业	10,300	111,755.00	0.61
40	002216	三全食品	4,300	111,585.00	0.61
41	603018	华设集团	10,000	109,500.00	0.60
42	300737	科顺股份	5,100	109,446.00	0.60
43	600612	老凤祥	2,400	108,792.00	0.60
44	603533	掌阅科技	3,100	104,160.00	0.57
45	603686	龙马环卫	6,460	103,876.80	0.57
46	002378	章源钨业	17,900	103,820.00	0.57
47	603359	东珠生态	6,200	99,138.00	0.55
48	300377	赢时胜	11,200	98,224.00	0.54
49	600096	云天化	16,000	97,120.00	0.53
50	300394	天孚通信	1,800	95,994.00	0.53
51	002314	南山控股	23,000	95,220.00	0.52
52	601678	滨化股份	18,100	95,025.00	0.52
53	603348	文灿股份	3,400	93,160.00	0.51
54	002614	奥佳华	6,700	90,115.00	0.50
55	300723	一品红	2,200	88,396.00	0.49
56	300288	朗玛信息	7,700	87,395.00	0.48
57	300007	汉威科技	5,600	87,136.00	0.48
58	600480	凌云股份	9,800	85,064.00	0.47
59	002537	海联金汇	11,500	84,640.00	0.47
60	600581	八一钢铁	21,400	81,962.00	0.45
61	002636	金安国纪	8,800	81,224.00	0.45
62	300379	东方通	1,700	77,690.00	0.43
63	002585	双星新材	7,500	75,450.00	0.41
64	601126	四方股份	10,700	74,472.00	0.41
65	600133	东湖高新	12,800	71,168.00	0.39
66	300579	数字认证	1,700	67,235.00	0.37

67	300679	电连技术	1,900	64,543.00	0.35
68	601163	三角轮胎	4,000	64,280.00	0.35
69	002055	得润电子	4,800	63,408.00	0.35
70	002204	大连重工	15,400	61,908.00	0.34
71	300119	瑞普生物	3,200	60,416.00	0.33
72	600184	光电股份	5,300	59,837.00	0.33
73	300131	英唐智控	6,900	57,684.00	0.32
74	300177	中海达	5,500	57,035.00	0.31
75	601908	京运通	5,500	56,595.00	0.31
76	600797	浙大网新	8,100	56,376.00	0.31
77	300102	乾照光电	9,400	56,212.00	0.31
78	600075	新疆天业	9,900	55,935.00	0.31
79	300339	润和软件	5,600	54,824.00	0.30
80	600761	安徽合力	3,700	52,540.00	0.29
81	603298	杭叉集团	2,500	52,525.00	0.29
82	600621	华鑫股份	2,300	52,371.00	0.29
83	600330	天通股份	5,100	51,612.00	0.28
84	000544	中原环保	7,300	51,173.00	0.28
85	002335	科华数据	2,280	50,935.20	0.28
86	603363	傲农生物	3,980	49,312.20	0.27
87	600831	广电网络	7,200	48,600.00	0.27
88	603959	百利科技	3,900	48,204.00	0.27
89	002043	兔宝宝	5,300	47,541.00	0.26
90	002106	莱宝高科	4,100	46,904.00	0.26
91	300353	东土科技	5,200	46,644.00	0.26
92	300020	银江股份	5,600	46,200.00	0.25
93	000989	九芝堂	5,800	45,646.00	0.25
94	300101	振芯科技	2,800	45,136.00	0.25

95	002567	唐人神	5,600	44,408.00	0.24
96	300366	创意信息	4,400	43,428.00	0.24
97	600988	赤峰黄金	2,400	42,984.00	0.24
98	002609	捷顺科技	4,500	41,895.00	0.23
99	603613	国联股份	325	41,626.00	0.23
100	300531	优博讯	2,600	41,548.00	0.23
101	002036	联创电子	4,000	41,360.00	0.23
102	603258	电魂网络	1,300	40,911.00	0.22
103	000498	山东路桥	8,600	40,850.00	0.22
104	600129	太极集团	3,000	39,990.00	0.22
105	603180	金牌厨柜	800	39,960.00	0.22
106	300054	鼎龙股份	2,100	39,711.00	0.22
107	002258	利尔化学	1,900	39,710.00	0.22
108	603323	苏农银行	8,000	39,680.00	0.22
109	601900	南方传媒	4,700	38,916.00	0.21
110	002034	旺能环境	2,400	38,208.00	0.21
111	000550	江铃汽车	1,800	37,152.00	0.20
112	603678	火炬电子	500	36,150.00	0.20
113	300118	东方日升	1,200	34,596.00	0.19
114	300266	兴源环境	10,100	33,835.00	0.19
115	600601	方正科技	8,200	32,554.00	0.18
116	603466	风语筑	1,400	32,312.00	0.18
117	002726	龙大肉食	2,500	32,000.00	0.18
118	300208	青岛中程	2,300	31,510.00	0.17
119	300047	天源迪科	4,100	31,119.00	0.17
120	600490	鹏欣资源	6,700	30,954.00	0.17
121	601222	林洋能源	3,800	30,096.00	0.17
122	300657	弘信电子	1,900	30,039.00	0.17

123	002104	恒宝股份	4,300	29,971.00	0.16
124	300091	金通灵	7,100	29,678.00	0.16
125	002407	多氟多	1,400	28,042.00	0.15
126	300476	胜宏科技	1,300	28,041.00	0.15
127	002283	天润工业	5,200	27,976.00	0.15
128	601789	宁波建工	6,800	27,132.00	0.15
129	300326	凯利泰	1,700	26,945.00	0.15
130	002413	雷科防务	3,800	26,866.00	0.15
131	002649	博彦科技	2,800	25,228.00	0.14
132	300663	科蓝软件	1,100	25,047.00	0.14
133	002276	万马股份	3,100	24,583.00	0.14
134	300078	思创医惠	2,700	24,435.00	0.13
135	002126	银轮股份	1,700	23,409.00	0.13
136	300355	蒙草生态	6,300	22,554.00	0.12
137	000034	神州数码	1,000	21,460.00	0.12
138	002565	顺灏股份	5,000	21,200.00	0.12
139	002016	世荣兆业	3,044	20,760.08	0.11
140	603118	共进股份	2,000	20,720.00	0.11
141	000925	众合科技	3,200	20,416.00	0.11
142	002139	拓邦股份	2,500	20,275.00	0.11
143	300624	万兴科技	360	19,940.40	0.11
144	002662	京威股份	5,600	19,936.00	0.11
145	002522	浙江众成	3,100	19,933.00	0.11
146	002488	金固股份	3,200	19,424.00	0.11
147	000881	中广核技	1,700	18,700.00	0.10
148	300770	新媒股份	260	18,278.00	0.10
149	300267	尔康制药	4,300	18,103.00	0.10
150	300373	扬杰科技	400	17,768.00	0.10

151	002367	康力电梯	1,800	17,694.00	0.10
152	000902	新洋丰	1,100	17,600.00	0.10
153	300527	中船应急	1,700	17,034.00	0.09
154	300677	英科医疗	100	16,815.00	0.09
155	688108	赛诺医疗	1,200	16,164.00	0.09
156	600116	三峡水利	1,900	15,998.00	0.09
157	601311	骆驼股份	1,600	14,960.00	0.08
158	603220	中贝通信	1,000	14,470.00	0.08
159	603956	威派格	900	13,662.00	0.08
160	600986	浙文互联	2,900	12,441.00	0.07
161	300222	科大智能	1,200	12,372.00	0.07
162	002301	齐心集团	900	12,006.00	0.07
163	300598	诚迈科技	100	11,988.00	0.07
164	000921	海信家电	800	11,528.00	0.06
165	600531	豫光金铅	1,900	11,229.00	0.06
166	600185	格力地产	1,700	10,982.00	0.06
167	603601	再升科技	800	10,920.00	0.06
168	300748	金力永磁	300	10,902.00	0.06
169	300145	中金环境	3,500	10,780.00	0.06
170	600850	华东电脑	400	10,772.00	0.06
171	603801	志邦家居	300	10,353.00	0.06
172	002322	理工环科	900	10,098.00	0.06
173	300310	宜通世纪	1,900	10,089.00	0.06
174	300666	江丰电子	200	9,902.00	0.05
175	000603	盛达资源	600	9,552.00	0.05
176	300673	佩蒂股份	300	9,387.00	0.05
177	300224	正海磁材	700	8,757.00	0.05
178	002308	威创股份	1,700	8,534.00	0.05

179	300323	华灿光电	700	8,519.00	0.05
180	603283	赛腾股份	200	7,924.00	0.04
181	002596	海南瑞泽	1,500	7,800.00	0.04
182	002228	合兴包装	1,800	7,578.00	0.04
183	000976	华铁股份	1,400	7,420.00	0.04
184	300740	御家汇	400	7,240.00	0.04
185	300292	吴通控股	1,700	7,089.00	0.04
186	300548	博创科技	200	6,930.00	0.04
187	600278	东方创业	800	6,920.00	0.04
188	603520	司太立	100	6,583.00	0.04
189	600239	云南城投	2,700	6,534.00	0.04
190	002298	中电兴发	700	6,531.00	0.04
191	600110	诺德股份	700	6,475.00	0.04
192	603301	振德医疗	100	6,253.00	0.03
193	300439	美康生物	300	5,481.00	0.03
194	300495	美尚生态	800	5,424.00	0.03
195	000058	深赛格	800	5,376.00	0.03
196	300322	硕贝德	400	5,248.00	0.03
197	002108	沧州明珠	900	4,842.00	0.03
198	000016	深康佳A	700	4,627.00	0.03
199	002343	慈文传媒	700	4,508.00	0.02
200	600206	有研新材	300	4,008.00	0.02
201	000903	云内动力	900	3,951.00	0.02
202	600571	信雅达	500	3,790.00	0.02
203	002428	云南锗业	300	3,687.00	0.02
204	603387	基蛋生物	100	3,423.00	0.02
205	600577	精达股份	1,100	3,421.00	0.02
206	300369	绿盟科技	200	3,056.00	0.02

207	300485	赛升药业	200	2,952.00	0.02
208	600223	鲁商发展	300	2,556.00	0.01
209	600626	申达股份	500	1,995.00	0.01
210	002100	天康生物	100	1,059.00	0.01
211	300299	富春股份	100	760.00	0.00
212	002467	二六三	100	594.00	0.00

8.3.2 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所有股票投资明细

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	601015	陕西黑猫	84,000	351,960.00	1.94
2	300661	圣邦股份	1,247	328,958.60	1.81
3	603345	安井食品	1,700	327,879.00	1.80
4	002568	百润股份	1,900	198,151.00	1.09
5	002705	新宝股份	3,500	147,875.00	0.81
6	300699	光威复材	1,500	133,575.00	0.73
7	002037	保利联合	17,400	113,448.00	0.62
8	603603	博天环境	17,300	87,538.00	0.48
9	603598	引力传媒	8,000	87,200.00	0.48
10	300670	大烨智能	9,000	74,610.00	0.41
11	000615	奥园美谷	9,100	69,160.00	0.38
12	300562	乐心医疗	2,700	59,103.00	0.33
13	002713	东易日盛	6,500	51,285.00	0.28
14	600067	冠城大通	14,000	51,100.00	0.28
15	300612	宣亚国际	2,400	46,536.00	0.26
16	300687	赛意信息	2,000	45,880.00	0.25
17	600012	皖通高速	7,100	43,878.00	0.24

18	603329	上海雅仕	3,000	37,470.00	0.21
19	600814	杭州解百	6,700	37,453.00	0.21
20	002903	宇环数控	2,800	36,036.00	0.20
21	002284	亚太股份	5,200	35,360.00	0.19
22	603600	永艺股份	2,000	26,560.00	0.15
23	300097	智云股份	2,400	24,912.00	0.14
24	002679	福建金森	2,100	24,192.00	0.13
25	603897	长城科技	1,300	23,166.00	0.13
26	300002	神州泰岳	4,500	22,995.00	0.13
27	300022	吉峰科技	4,200	20,412.00	0.11
28	300385	雪浪环境	2,500	19,575.00	0.11
29	002689	远大智能	5,900	19,234.00	0.11
30	002743	富煌钢构	2,900	18,937.00	0.10
31	002431	棕榈股份	5,200	16,640.00	0.09
32	002534	杭锅股份	1,800	16,578.00	0.09
33	002637	赞宇科技	1,100	13,827.00	0.08
34	000026	飞亚达	1,200	13,716.00	0.08
35	600388	龙净环保	1,500	13,320.00	0.07
36	300176	派生科技	1,700	12,971.00	0.07
37	002932	明德生物	200	12,608.00	0.07
38	300578	会畅通讯	300	12,018.00	0.07
39	300237	美晨生态	4,400	11,836.00	0.07
40	002703	浙江世宝	1,800	10,530.00	0.06
41	002472	双环传动	1,200	8,652.00	0.05
42	300309	吉艾科技	3,000	8,310.00	0.05
43	002845	同兴达	300	8,106.00	0.04
44	300335	迪森股份	1,200	6,936.00	0.04
45	000863	三湘印象	900	4,095.00	0.02

46	300135	宝利国际	1,500	3,885.00	0.02
47	002536	飞龙股份	700	3,829.00	0.02
48	300627	华测导航	100	2,273.00	0.01
49	300240	飞力达	400	2,272.00	0.01
50	002382	蓝帆医疗	100	2,109.00	0.01
51	300565	科信技术	100	1,419.00	0.01
52	002855	捷荣技术	100	1,039.00	0.01
53	002655	共达电声	100	725.00	0.00
54	600478	科力远	100	490.00	0.00

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	300661	圣邦股份	759,302.56	3.17
2	603345	安井食品	651,649.00	2.72
3	300676	华大基因	626,279.00	2.61
4	603456	九洲药业	599,396.00	2.50
5	300037	新宙邦	598,116.00	2.49
6	300463	迈克生物	589,614.00	2.46
7	600477	杭萧钢构	589,551.20	2.46
8	300724	捷佳伟创	589,047.00	2.46
9	002421	达实智能	578,163.00	2.41
10	600684	珠江实业	577,380.00	2.41
11	002312	三泰控股	564,536.00	2.35
12	300607	拓斯达	552,553.20	2.30
13	002332	仙琚制药	547,473.00	2.28

14	300502	新易盛	533,527.00	2.23
15	002897	意华股份	520,621.00	2.17
16	002025	航天电器	497,078.00	2.07
17	000544	中原环保	488,365.00	2.04
18	002100	天康生物	458,564.00	1.91
19	000951	中国重汽	439,904.00	1.83
20	600612	老凤祥	430,204.00	1.79

注：“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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300171	东富龙	1,073,998.00	4.48
2	600855	航天长峰	952,700.00	3.97
3	603063	禾望电气	941,861.00	3.93
4	300497	富祥药业	938,668.00	3.92
5	002367	康力电梯	757,037.00	3.16
6	603368	柳药股份	742,753.60	3.10
7	600477	杭萧钢构	740,467.00	3.09
8	601058	赛轮轮胎	712,541.00	2.97
9	600846	同济科技	692,329.00	2.89
10	002100	天康生物	670,180.00	2.80
11	600063	皖维高新	637,248.00	2.66
12	000838	财信发展	618,470.00	2.58
13	300676	华大基因	614,734.00	2.56
14	002611	东方精工	597,264.00	2.49
15	300037	新宙邦	589,295.00	2.46

16	000591	太阳能	588,878.00	2.46
17	300607	拓斯达	569,090.87	2.37
18	600343	航天动力	565,015.00	2.36
19	600684	珠江实业	548,618.00	2.29
20	002928	华夏航空	547,006.50	2.28
21	002782	可立克	545,143.00	2.27
22	300463	迈克生物	541,522.00	2.26
23	002792	通宇通讯	530,098.00	2.21
24	000973	佛塑科技	523,122.00	2.18
25	002312	三泰控股	522,828.00	2.18
26	300661	圣邦股份	521,593.00	2.18
27	600510	黑牡丹	506,173.00	2.11
28	603218	日月股份	503,228.00	2.10
29	600552	凯盛科技	500,027.00	2.09
30	600449	宁夏建材	495,000.00	2.06
31	300118	东方日升	481,507.00	2.01

注：本项卖出金额均按卖出成交金额(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	79,182,386.46
卖出股票收入（成交）总额	92,120,654.39

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序的所有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。

8.11 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	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	144.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	144.83

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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 中 证 1000 指 数 增 强 A	482	23,072.53	9,887,305.69	88.91%	1,233,656.10	11.09%
万 家 中 证 1000 指 数 增 强 C	791	2,700.78	0.00	0.00%	2,136,315.37	100.00%
合计	1,235	10,734.64	9,887,305.69	74.58%	3,369,971.47	25.42%

9.2 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	万家中证	188.28	0.0017%
	1000 指数		
	增强 A		
	万家中证	1,586.20	0.0742%
	1000 指数		

	增强 C		
	合计	1,774.48	0.0134%

9.3 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	万家中证 1000 指数增强 A	0~10
	万家中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	万家中证 1000 指数增强 A	0
	万家中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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
基金管理人固有资金	9,887,305.69	74.58	9,887,305.69	74.58	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	74.58	9,887,305.69	74.58	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

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
本报告期期初基金份额总额	11,199,170.60	11,485,829.82
本报告期基金总申购份额	4,287,122.27	20,447,252.39
减:本报告期基金总赎回份额	4,365,331.08	29,796,766.84
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,120,961.79	2,136,315.37

§ 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：

自 2020 年 1 月 16 日起，沈芳女士不再担任公司副总经理职务。

自 2020 年 8 月 8 日起，经晓云女士不再担任公司总经理职务，由董事长方一天先生代任公司总经理。

基金托管人：

自 2020 年 8 月 28 日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

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

报告期期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

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	
中信建投	2	52,516,695.46	30.74%	48,909.35	31.53%	-
申万宏源	1	46,940,780.47	27.48%	43,718.54	28.19%	-

太平洋证券	2	22,849,675.48	13.37%	21,279.84	13.72%	—
中泰证券	1	17,228,572.83	10.08%	16,044.60	10.34%	—
浙商证券	2	12,555,173.78	7.35%	7,675.63	4.95%	—
东方财富证 券	1	11,022,471.12	6.45%	10,265.48	6.62%	—
长江证券	1	7,734,070.24	4.53%	7,202.84	4.64%	—
西南证券	1	—	—	—	—	—
安信证券	1	—	—	—	—	—
野村东方国 际证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	1	—	—	—	—	—

注：1、本基金自 2020 年 11 月 23 日起由托管结算模式转换为券商结算模式，本基金选择浙商证券股份有限公司作为证券经纪商，此前使用的基金交易单元自转换为券商结算模式后均不再使用，本基金与证券经纪商浙商证券股份有限公司不存在关联方关系。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商结算模式进行证券交易和结算的需要；
- 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；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；
- 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足券商结算模式下 T+0 估值的时效性要求。

3、基金证券经纪商的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定证券经营机构，然

后基金管理人、基金托管人和证券经纪商签订证券经纪服务协议。

4、佣金支付情况：股票交易佣金费率为 0.7%，交易佣金包含已由证券经纪商扣收的一级交易费用（包括经手费、证管费、风险金），但不包括印花税、上海市场过户费、港股通交易相关费用等税费。

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

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 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

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	20200101-20201231	9,887,305.69	-	-	9,887,305.69	74.58%
	2	20200101-20200107	4,739,387.04	-	4,739,387.04	-	0.00%
	3	20200101-20200107、20200310-20201115	5,009,091.04	-	5,009,091.04	-	0.00%
产品特有风险							
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；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

§ 13 备查文件目录

13.1 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 2020 年年度报告原文。
- 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》

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所，并登载于基金管理人网站：<www.wjasset.com>

13.3 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

2021 年 3 月 30 日