

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 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：2019 年 8 月 24 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半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 2019 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	13,632,611.92 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	11,165,330.40 份	2,467,281.52 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的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
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
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
客户服务电话	95538 转 6、4008880800	95555
传真	021-38909627	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
----------------------	---

基金半年度报告备置地点	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
-------------	--

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,187,161.19	177,815.12
本期利润	2,022,115.94	-139,692.83
加权平均基金份额本期利润	0.1880	-0.0762
本期基金份额净值增长率	22.41%	22.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1186	0.1069
期末基金资产净值	12,971,594.69	2,835,426.21
期末基金份额净值	1.1618	1.1492

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)。

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

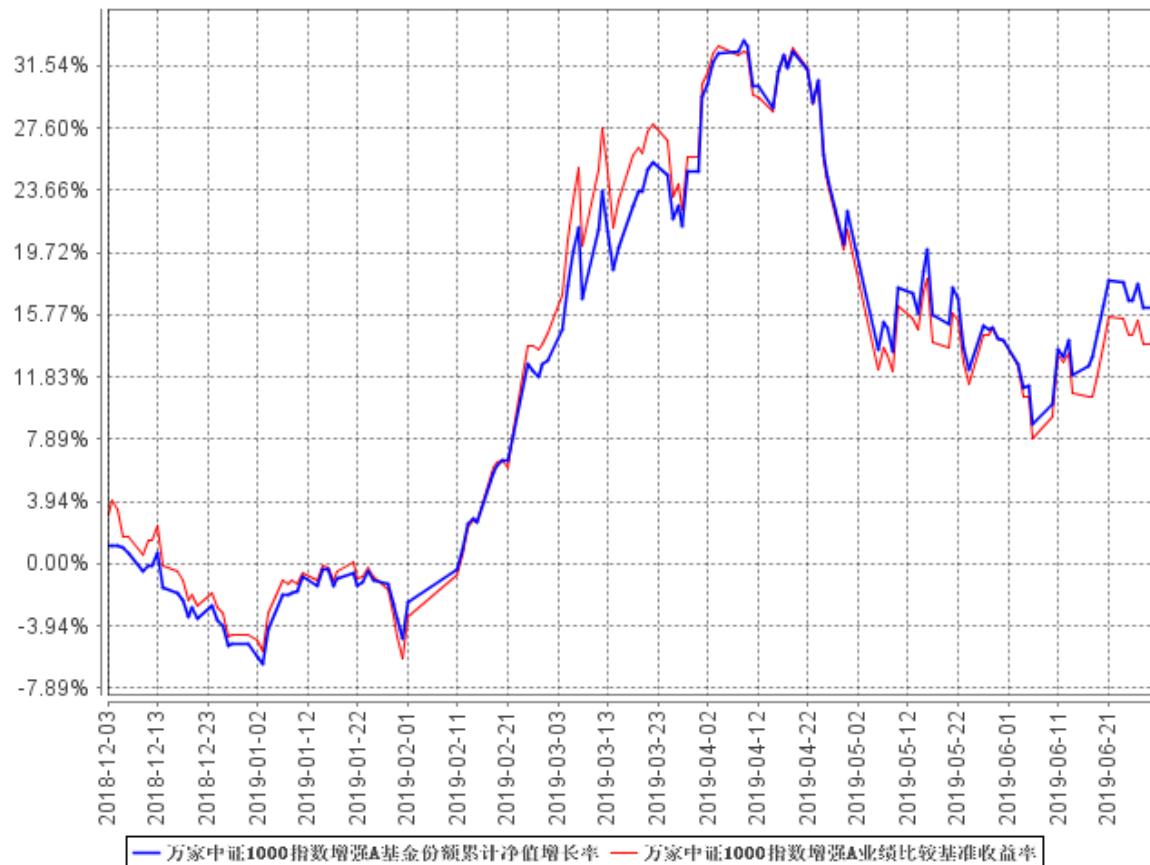
阶段	份额净值增长率 ^①	份额净值增长率标准差 ^②	业绩比较基准收益率 ^③	业绩比较基准收益率标准差 ^④	^① - ^③	^② - ^④
过去一个月	1.80%	1.34%	-0.21%	1.45%	2.01%	-0.11%
过去三个月	-6.92%	1.83%	-9.44%	1.84%	2.52%	-0.01%
过去六个月	22.41%	1.69%	19.19%	1.80%	3.22%	-0.11%
自基金合同生效起至今	14.64%	1.59%	13.89%	1.72%	0.75%	-0.13%

万家中证 1000 指数增强 C

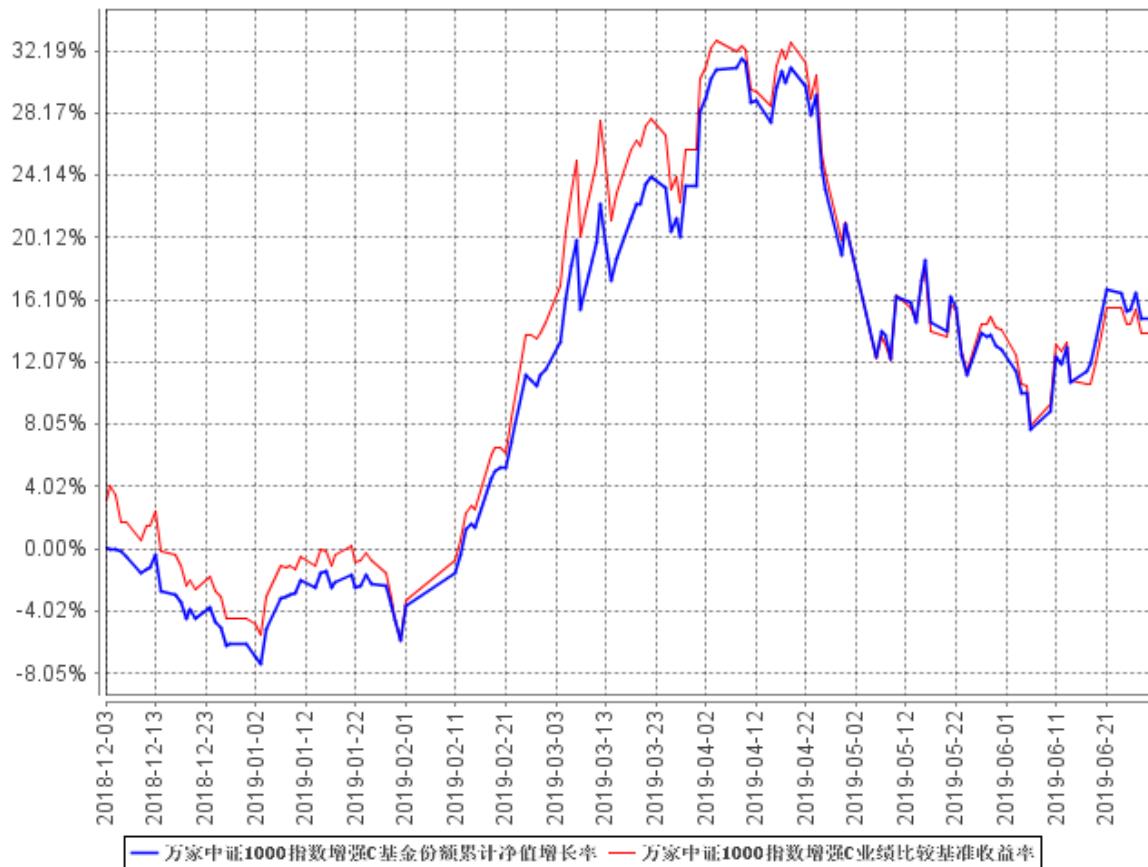
阶段	份额净值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	1.76%	1.35%	-0.21%	1.45%	1.97%	-0.10%
过去三个月	-6.94%	1.83%	-9.44%	1.84%	2.50%	-0.01%
过去六个月	22.53%	1.69%	19.19%	1.80%	3.34%	-0.11%
自基金合同 生效起至今	14.72%	1.59%	13.89%	1.72%	0.83%	-0.13%

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: 本基金原合同生效日期为 2018 年 1 月 30 日。根据基金原合同规定, 基金原合同生效后六个月内为建仓期, 建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金原合同要求。本基金已于 2018 年 12 月 3 日召开基金持有人大会, 原“万家家裕债券型证券投资基金”变更注册为“万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金”。本基金份额持有人大会 2018 年 12 月 3 日表决通过了《关于修改万家家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》, 修订和更新后的文件于 2018 年 12 月 3 日生效。基金合同生效后各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§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1亿元人民币。目前管理六十六只开放式基金,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、万家家享纯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。

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		
陈旭	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证	2018 年 12 月 3 日	-	6 年	上海交通大学模式识别与智能系统硕士。 2010 年 3 月至 2012 年 9 月在易安信中国卓越研发中心工作，担任高级软件工程师； 2013 年 1 月至 2015 年 6 月在国信证券股份有限公司工作，先后担任经济研究所分析师、自营金融工程部投资经理等职，主要从事量化投资研究分析及交易等工作； 2015 年 7 月加入万家基金管理有限公司，自 2017 年 11 月起担任基金经理职务，现任量化投资部副总监（主持工作）、基金经理。

500 指数 增 强 型 发 起 式 证 券 投 资 基 金 的 基 金 经 球				
--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边

交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 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，整体选股风格方面偏向小盘成长风格。

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 1.1618 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.41%；截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.1492 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.53%；同期业绩比较基准收益率为 19.19%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2912%、0.2909%，年跟踪误差分别为 4.6232%、4.6179%，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

从宏观角度，二季度经济具有一定压力，全球经济放缓，预期下半年经济趋于放缓阶段。消费增速下行，对增长贡献提升，居民收入差距扩大，今年上半年有所收敛。投资对地产依赖程度依然较大，全球经贸都在降温且贸易摩擦持续。减税降费继续推进，让利于民激发活力。美国开启宽松周期也增大了我们的货币政策空间。我国法定存款准备金率仍有下调空间，公开市场操作利率也可以下调，同时通过利率走廊，逐渐实现基准利率向市场利率的并轨。下半年的不确定性依然在于贸易摩擦，在全球经济高度一体化的今天，各国经贸是连在一起的，而且经贸关系是重要的“压舱石”，长期尽管有竞争，但短期也需要有合作。所以外部形势基本是确定的，不会太好也不会太差，因此维持下半年处于震荡市的判断。

从指数增强的角度，震荡市是获取估值错杀的重要阶段，也是我们获取超额收益的最佳时机。三季度处于分红集中期，科创板已经开板，这些都是提升市场风险抵御能力的方面。经历过最后

的震荡，尘埃落定后市场将回归正常风险偏好，那么估值错杀的个股将会均值回归，而我们获取超额收益的策略也将会有所表现。

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和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》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未实施利润分配。

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

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§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。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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： 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,085,967.78	1,032,385.23
结算备付金	119,505.54	2,006.13
存出保证金	7,107.61	—
交易性金融资产	14,893,759.26	8,993,920.00
其中：股票投资	14,893,759.26	8,993,920.00
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	—	—
应收利息	296.63	228.20
应收股利	—	—
应收申购款	136,725.77	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	16,243,362.59	10,028,539.56
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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	334,266.81	—
应付管理人报酬	13,387.98	7,409.22
应付托管费	2,677.60	1,483.90
应付销售服务费	1,071.90	197.07
应付交易费用	38,443.72	8,966.23

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	46,493.68	37,448.14
负债合计	436,341.69	55,504.56
所有者权益:		
实收基金	13,632,611.92	10,515,125.88
未分配利润	2,174,408.98	-542,090.88
所有者权益合计	15,807,020.90	9,973,035.00
负债和所有者权益总计	16,243,362.59	10,028,539.56

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1595 元，基金份额总额 13,632,611.92 份，其中万家中证 1000 指数增强 A 份额参考净值 1.1618 元，份额总额 11,165,330.40 份；万家中证 1000 指数增强 C 份额参考净值 1.1492 元，份额总额 2,467,281.52 份。

6.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
一、收入		2,114,379.37
1.利息收入		4,438.21
其中：存款利息收入		4,438.21
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,575,385.60
其中：股票投资收益		1,453,269.27
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		122,116.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		517,446.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		17,108.76

减：二、费用	231,956.26
1. 管理人报酬	71,293.53
2. 托管费	14,258.70
3. 销售服务费	4,205.89
4. 交易费用	104,023.54
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	38,174.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,882,423.11
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,882,423.11

注：本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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)	-	1,882,423.11	1,882,423.11
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)	3,117,486.04	834,076.75	3,951,562.79
其中：1.基金申购款	7,204,069.10	1,629,573.23	8,833,642.33
2.基金赎回款	-4,086,583.06	-795,496.48	-4,882,079.54
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)	-	-	-
五、期末所有者权益	13,632,611.92	2,174,408.98	15,807,020.90

(基金净值)			
--------	--	--	--

注：本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，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 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

根据原万家家裕债券型证券投资基金（以下简称“万家家裕债券”）基金份额持有人大会审议通过的《关于修改万家家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》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，万家家裕债券于 2018 年 12 月 3 日转型为万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。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、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、金融衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 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》、《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。

6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本半年度报告所采取的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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、地方政府债券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除本通知第一条规定的其他增值税应税行为（以下称其他业务），按照现行规定缴纳增值税，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），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；

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。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 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。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内，经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]126号文核准，基金管理人原股东山东省国有资产投资控股有限公司将其持有的基金管理人的11%股权转让给齐河众鑫投资有限公司。本次股权变更的工商变更登记手续已办理完毕，基金管理人于2019年2月13日发布了《关

于公司股权变更的公告》，公司股东由山东省国有资产投资控股有限公司变更为齐河众鑫投资有限公司。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
中泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未产生关联方佣金。本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	71,293.53
其中：支付销售机构的客户维护费	5,656.79

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,258.70

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。

本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.4.9.2.3 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 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	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	—	597.78	597.78
中泰证券股份有限公司	—	302.67	302.67
合计	—	900.45	900.45

注：1、销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及 C 类基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类不收取销售服务费，C 类销售服务费年费率为 0.40%。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$H=E \times 0.40\% / \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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。

2、本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日，无上年度可比期间数据。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
基金合同生效日(2018 年)	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C

12 月 3 日 持有的基金份额		
期初持有的基金份额	9,887,305.69	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,887,305.69	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	88.5536%	-

注: 本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日, 无上年度可比期间数据。

6.4.9.4.2 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

份额单位: 份

万家中证 1000 指数增强 C				
关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
万家共赢资产管理有限公司	-	-	249,850.09	2.3761%

注: 本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.5 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 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,085,967.78	3,831.86

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责任公司, 2019 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 565.85 元, 2019 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 119,505.54 元。

2、本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日, 无上年度可比期间数据。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。本基金合同生效时间为 2018 年 12 月 3 日, 无上年度可比期间数据。

6.4.10 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限制的证券。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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证券款余额。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	14,893,759.26	91.69
	其中：股票	14,893,759.26	91.69
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	1,205,473.32	7.42
8	其他各项资产	144,130.01	0.89
9	合计	16,243,362.59	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	163,796.70	1.04
B	采矿业	127,523.00	0.81
C	制造业	8,276,042.40	52.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	489,719.00	3.10
E	建筑业	587,575.00	3.72
F	批发和零售业	135,008.00	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	347,893.00	2.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	967,414.88	6.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	538,408.40	3.41

L	租赁和商务服务业	6,258.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	251,490.00	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	19,200.00	0.12
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	143,862.00	0.91
S	综合	—	—
	合计	12,054,190.38	76.26

7.2.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	98,748.00	0.62
B	采矿业	211,166.00	1.34
C	制造业	1,631,673.00	10.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,750.00	0.01
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	256,743.88	1.62
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	261,696.00	1.66
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	222,942.00	1.41
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	154,850.00	0.98
S	综合	—	—
	合计	2,839,568.88	17.96

7.2.3 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。

7.3 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

7.3.1 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	603118	共进股份	37,800	350,028.00	2.21
2	300363	博腾股份	41,000	343,990.00	2.18
3	601886	江河集团	46,700	332,037.00	2.10
4	601369	陕鼓动力	48,500	321,555.00	2.03
5	300061	康旗股份	44,700	307,089.00	1.94
6	600381	青海春天	49,100	299,019.00	1.89
7	601677	明泰铝业	29,000	298,990.00	1.89
8	300465	高伟达	38,300	296,442.00	1.88
9	002219	恒康医疗	95,000	287,850.00	1.82
10	600873	梅花生物	57,300	274,467.00	1.74

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半年度报告正文。

7.3.2 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	600570	恒生电子	3,840	261,696.00	1.66
2	300269	联建光电	50,900	222,942.00	1.41
3	000700	模塑科技	53,300	201,474.00	1.27
4	600319	亚星化学	37,600	186,120.00	1.18
5	601717	郑煤机	31,500	179,865.00	1.14
6	601900	南方传媒	16,300	154,850.00	0.98
7	601168	西部矿业	23,500	149,930.00	0.95
8	002724	海洋王	25,000	146,000.00	0.92
9	600828	茂业商业	26,844	134,756.88	0.85
10	603528	多伦科技	15,500	116,250.00	0.74

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半年度报告正文。

度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601677	明泰铝业	725,177.00	7.27
2	603299	苏盐井神	503,597.00	5.05
3	600728	佳都科技	503,092.00	5.04
4	000650	仁和药业	469,097.00	4.70
5	000951	中国重汽	422,379.00	4.24
6	000035	中国天楹	417,209.00	4.18
7	300465	高伟达	403,035.00	4.04
8	300363	博腾股份	375,042.00	3.76
9	603118	共进股份	367,335.00	3.68
10	601886	江河集团	356,333.00	3.57
11	603989	艾华集团	350,108.00	3.51
12	600381	青海春天	341,096.00	3.42
13	002219	恒康医疗	337,631.68	3.39
14	300149	量子生物	330,688.00	3.32
15	601369	陕鼓动力	329,462.57	3.30
16	600616	金枫酒业	320,464.60	3.21
17	600012	皖通高速	318,244.80	3.19
18	600873	梅花生物	316,234.00	3.17
19	300061	康旗股份	313,946.00	3.15
20	000705	浙江震元	301,228.00	3.02
21	300219	鸿利智汇	299,430.00	3.00
22	000967	盈峰环境	296,284.00	2.97
23	000026	飞亚达 A	281,483.00	2.82
24	002313	日海智能	274,628.00	2.75
25	300446	乐凯新材	265,971.00	2.67
26	300269	联建光电	261,706.00	2.62
27	600675	中华企业	260,689.00	2.61
28	002351	漫步者	259,691.00	2.60

29	600570	恒生电子	254, 561. 70	2. 55
30	600900	长江电力	241, 336. 00	2. 42
31	601058	赛轮轮胎	240, 957. 00	2. 42
32	300567	精测电子	240, 468. 00	2. 41
33	300494	盛天网络	236, 892. 00	2. 38
34	000700	模塑科技	232, 029. 00	2. 33
35	300014	亿纬锂能	231, 170. 00	2. 32
36	000889	中嘉博创	230, 476. 00	2. 31
37	600310	桂东电力	228, 749. 00	2. 29
38	601636	旗滨集团	224, 246. 00	2. 25
39	600261	阳光照明	224, 129. 00	2. 25
40	601717	郑煤机	208, 558. 00	2. 09
41	601515	东风股份	206, 718. 00	2. 07
42	603988	中电电机	202, 342. 00	2. 03

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	000650	仁和药业	639, 638. 00	6. 41
2	600067	冠城大通	507, 302. 00	5. 09
3	002788	鹭燕医药	499, 316. 34	5. 01
4	002335	科华恒盛	495, 175. 00	4. 97
5	000035	中国天楹	458, 858. 00	4. 60
6	000030	富奥股份	431, 575. 00	4. 33
7	601677	明泰铝业	428, 501. 03	4. 30
8	300446	乐凯新材	391, 430. 00	3. 92
9	603299	苏盐井神	372, 212. 00	3. 73
10	600616	金枫酒业	346, 505. 00	3. 47
11	002060	粤水电	338, 362. 00	3. 39
12	000951	中国重汽	329, 590. 00	3. 30
13	601515	东风股份	300, 890. 00	3. 02
14	000967	盈峰环境	297, 160. 00	2. 98
15	000026	飞亚达 A	294, 871. 00	2. 96
16	002433	太安堂	290, 724. 00	2. 92

17	002296	辉煌科技	290,064.00	2.91
18	600469	风神股份	281,435.00	2.82
19	600012	皖通高速	273,390.63	2.74
20	300494	盛天网络	272,496.00	2.73
21	000705	浙江震元	259,465.00	2.60
22	603258	电魂网络	254,208.00	2.55
23	000789	万年青	252,671.68	2.53
24	600900	长江电力	244,547.00	2.45
25	000889	中嘉博创	240,297.00	2.41
26	300465	高伟达	218,020.00	2.19
27	600033	福建高速	217,742.00	2.18
28	300378	鼎捷软件	217,159.00	2.18
29	600261	阳光照明	213,388.00	2.14
30	300567	精测电子	211,716.00	2.12
31	300014	亿纬锂能	207,552.00	2.08
32	600961	株治集团	204,126.00	2.05
33	600728	佳都科技	202,077.00	2.03
34	601636	旗滨集团	201,682.00	2.02

注：“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	36,828,805.83
卖出股票收入(成交)总额	32,899,682.64

7.5 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。

7.6 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。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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**

2018 年度，重庆博腾制药科技股份有限公司以预付货款等方式向部分供应商及个人划出资金，由供应商及个人按公司指令划转至公司实际控制人及其相关联的企业。上述行为已构成关联交易及关联方非经营性资金占用，公司未就相关情况及时履行信息披露义务。博腾股份于 2019 年 4 月 30 日收到中国证券监督管理委员会重庆监管局出具的《行政监管措施决定书》(2019)4 号，对公司采取责令改正的监管措施，并对违规行为涉及的有关人员进行严肃问责。

7.12.2 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

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。

7.12.3 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	7,107.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	296.63
5	应收申购款	136,725.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	144,130.01
---	----	------------

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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	263	42,453.73	9,902,637.77	88.69%	1,262,692.63	11.31%
万家 中证 1000 指 数 增强 C	507	4,866.43	15,515.90	0.63%	2,451,765.62	99.37%
合计	750	18,176.82	9,918,153.67	72.75%	3,714,458.25	27.25%

注：本基金存在同时持有 A 级和 C 级的客户。

8.2 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 1000 指数 增强 A	2,058.72	0.0184%
	万家中证 1000 指数 增强 C	3,143.39	0.1274%
	合计	5,202.11	0.0382%

8.3 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	0~10
	合计	0~10

8.4 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	72.53	9,887,305.69	72.53	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	72.53	9,887,305.69	72.53	3 年

§9 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	9,919,465.90	595,659.98
本报告期期间基金总申购份额	2,670,066.81	4,534,002.29
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,424,202.31	2,662,380.75
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,165,330.40	2,467,281.52

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

报告期内无涉及基金管理人的重大人事变动。

基金托管人：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
中信证券	2	28,753,063.44	41.24%	26,779.66	41.24%	-
西南证券	1	23,926,590.03	34.31%	22,282.81	34.31%	-
太平洋证券	2	17,048,835.00	24.45%	15,879.16	24.45%	-

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:

本报告期, 本基金新增西南证券交易单元 1 个和太平洋证券交易单元 2 个。

10.7.2 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。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20190101-20190630	9,887,305.69	0.00	0.00	9,887,305.69	72.53%
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20% 的情况。</p> <p>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；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。</p>							

万家基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日