

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 9 月 13 日

送出日期：2021 年 9 月 15 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	万家中证500指数增强发起式	基金代码	006729
下属基金简称	万家中证500指数增强发起式A		万家中证500指数增强发起式C
下属基金代码	006729		006730
基金管理人	万家基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2019-05-23	上市交易所及上市日期	暂未上市 -
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每日
基金经理	乔亮	开始担任本基金经理的日期	2019-09-06
		证券从业日期	2006-08-07
其他	1、终止条款：本基金《基金合同》生效之日起三年后的年度对应日，若基金资产净值低于2 亿元的，本基金《基金合同》应当终止。		

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	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。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

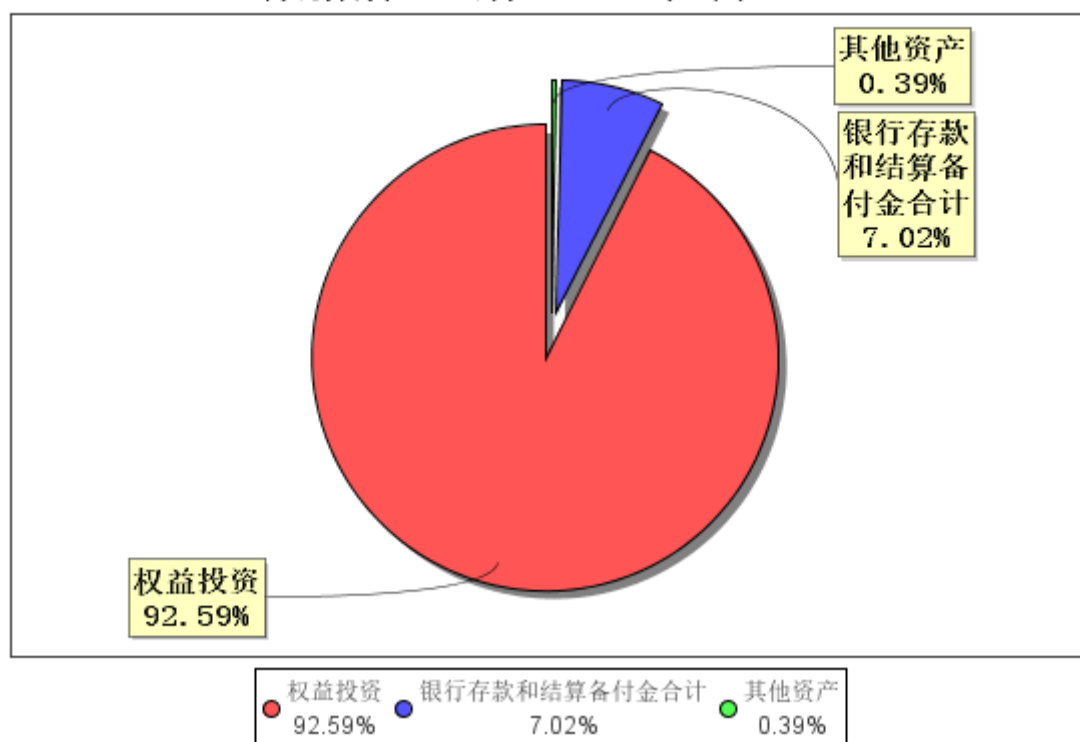
本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；权证投资占基金资产净值的0-3%。每个交易日日终，在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金标的指数为中证500指数。

主要投资策略	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。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、衍生产品投资策略：（1）权证投资策略；（2）股指期货投资策略；（3）国债期货投资策略；（4）股票期权投资策略；（5）其他金融衍生产品；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、其他。
业绩比较基准	中证500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。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

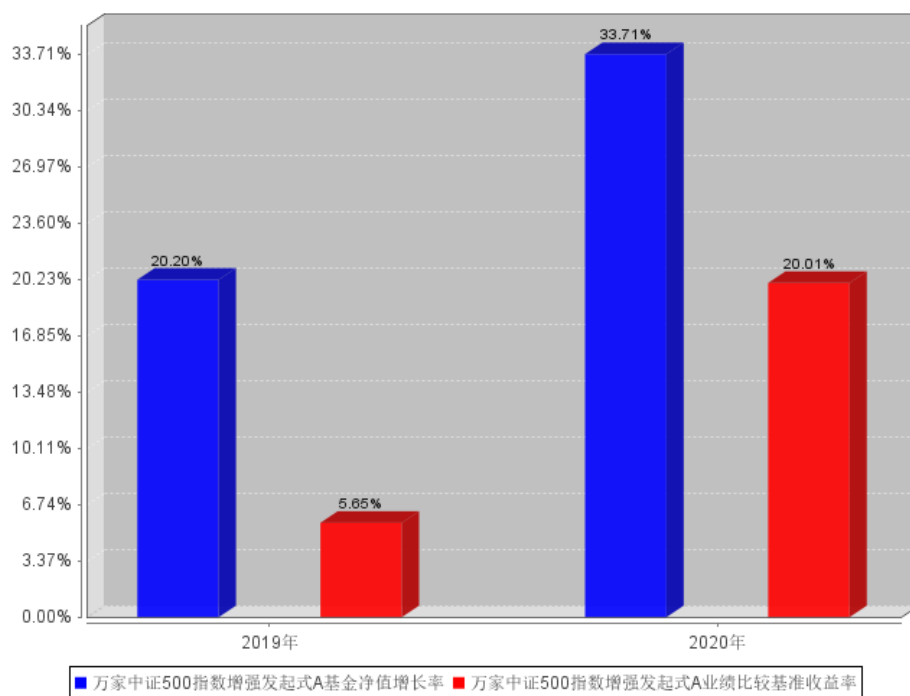
投资组合资产配置图表
数据截止日期：2021年6月30日



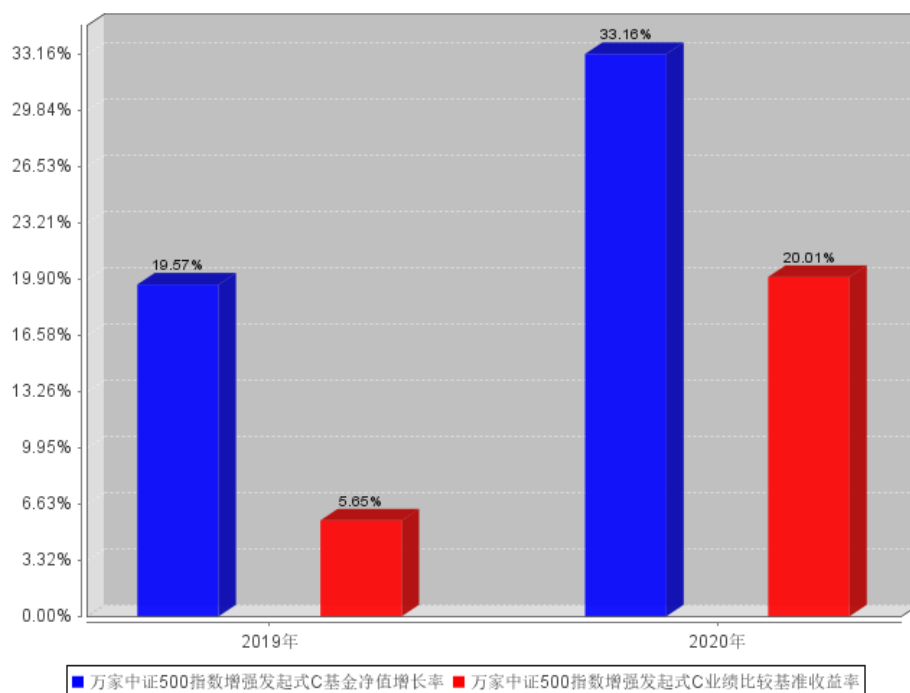
（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基

准的比较图

万家中证500指数增强发起式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500指数增强发起式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



注：业绩表现截止日期2020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：

万家中证 500 指数增强发起式 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	0.10%	特定投资者	
	1,000,000 ≤ M < 3,000,000	0.06%	特定投资者	
	3,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.02%	特定投资者	
	M ≥ 5,000,000	1000.00元/笔	特定投资者	
	M < 1,000,000	1.00%	其他投资者	
	1,000,000 ≤ M < 3,000,000	0.60%	其他投资者	
	3,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.20%	其他投资者	
	M ≥ 5,000,000	1000.00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%	-	
180日 ≤ N < 365日		0.25%	-	
N ≥ 365日		0	-	

万家中证 500 指数增强发起式 C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N < 7日	1.50%	-
	7日 ≤ N < 30日	0.50%	-
	N ≥ 30日	0	-

申购费：本基金C类份额不收取申购费。

（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
管理费	1.000%
托管费	0.200%
销售服务费	0.400%
标的指数许可使用费	0.016%

注：本基金A类份额不收取销售服务费。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币壹万元。

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、诉讼费和仲裁费和持有人大会费用等，按实际发生额从基金资产扣除。

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。

投资本基金的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；大量赎回或暴跌导致的流动性风险；基金投资过程中产生的操作风险；因交收违约和投资债券引发的信用风险；基金投资回报可能低于业绩比较基准的风险；本基金的投资范围包括股指期货、国债期货、股票期权、权证等金融衍生品、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券等品种，融资业务和转融通证券出借交易，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有风险。

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。

本基金特有风险为：

1、量化模型风险

本基金采用特定的量化投资模型进行个股超额收益的预测、组合构建和调整、交易成本和风险控制，面临的模型风险高于传统股票型基金，不排除模型失效的可能。此外，在市场流动性不足、异常波动、以及市场风格急剧变化等极端事件出现的情况下，本量化模型有可能产生跟踪误差偏离过大的风险。

2、主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

3、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.50%以内，年化跟踪误差控制7.75%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

4、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护。

5、成份股停牌的风险

本基金标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险。

（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、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