

万家创业板指数增强型证券投资基金

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	万家创业板指数增强	基金代码	009981
下属基金简称	万家创业板指数增强 A	下属基金交易代码	009981
下属基金简称	万家创业板指数增强 C	下属基金交易代码	009982
基金管理人	万家基金管理有限公司	基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年1月26日	上市交易所及上市日期	-
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	开始担任本基金基金经理的日期	2021年1月26日
		证券从业日期	2006年8月7日
基金经理	张永强	开始担任本基金基金经理的日期	2023年4月11日
		证券从业日期	2015年7月2日

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

请投资者阅读《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，力争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，实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资范围	本基金的主要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、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、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、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、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。

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%。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。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

主要投资策略

1、大类资产配置策略;2、股票投资策略;3、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;8、(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;9、融资及转融通证券出借业务投资策略;9、其他。

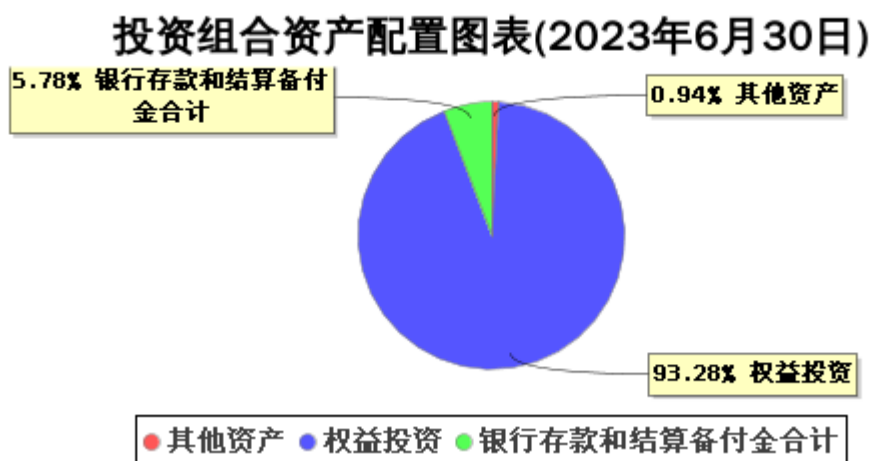
业绩比较基准

创业板指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率(税后)*5%

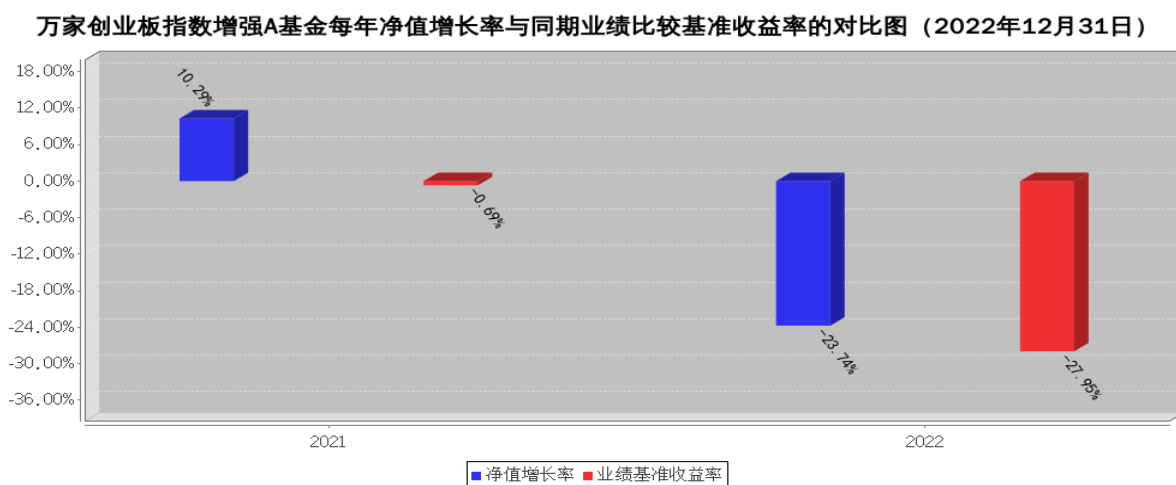
风险收益特征

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。

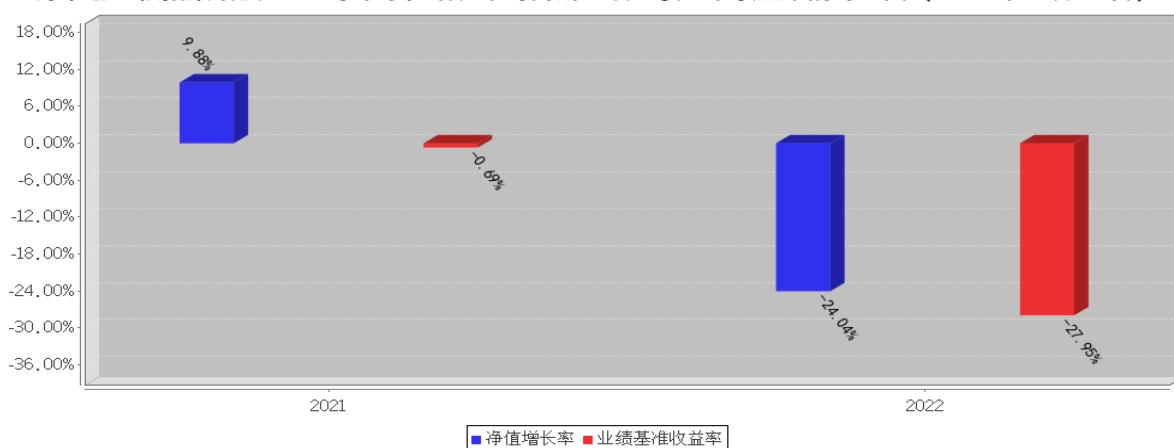
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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



万家创业板指数增强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：

万家创业板指数增强 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	0.15%	特定投资者
	1,000,000.0 ≤ M < 3,000,000.0	0.10%	特定投资者
	3,000,000.0 ≤ M < 5,000,000.0	0.05%	特定投资者
	M ≥ 5,000,000.0	1,000 元/笔	特定投资者
	M < 1,000,000.0	1.50%	其他投资者
	1,000,000.0 ≤ M < 3,000,000.0	1.00%	其他投资者
	3,000,000.0 ≤ M < 5,000,000.0	0.50%	其他投资者
	M ≥ 5,000,000.0	1,000 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	-

万家创业板指数增强 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	0.50%
	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	0.10%	基金托管人
销售服务费	万家创业板指数增强 C 0.40%	销售机构
审计费用	32,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
指数许可使用费	0.02% 年下限金额： 200,000.00 元	指数编制公司
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。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币伍万元。

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。

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：

万家创业板指数增强 A

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.41%

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。

万家创业板指数增强 C

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.81%

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。

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。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、本基金的特有风险和其他风险等；本基金的投资范围包括股指期货、股票期权、国债期货、资产支持证券、证券公司短期公司债等品种，本基

金可参与融资和转融通证券出借业务。本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。

本基金的量化模型是指采用特定的量化投资模型进行选股，并非程序化交易。由于模型测算结果是根据历史数据研究得出，如果历史情况与当前市场出现重大差异，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。本基金的特有风险还包括：

（1）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 0.5%以内，年化跟踪误差控制在 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。

（2）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。

（3）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。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险。

（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