万家中证红利指数证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

基金管理人：万家基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律、法规及基金合同的有关规定募集。并经中国证监会2010年10月11日证监许可[2010]1388号文核准。本基金的基金合同于2011年3月17日正式生效。2018年3月24日，基金管理人按照中国证监会《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（〔2017〕12号）的要求对基金合同的部分内容进行了修订，修订后的法律文件自2018年3月31日起正式生效。

【重要提示】

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本基金招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2019年3月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日，财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称：万家基金管理有限公司

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）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）

法定代表人：方一天

成立日期：2002年8月23日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字［2002］44号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

联系人：兰剑

电话：021-38909626

传真：021-38909627

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

董事长方一天先生，中共党员，大学本科，学士学位，先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职，2014年10月加入万家基金管理有限公司，2014年12月起任公司董事，2015年2月至2016年7月任公司总经理，2015年7月起任公司董事长。

董事马永春先生，政治经济学硕士学位，曾任新疆自治区党委政策研究室科长，新疆通宝投资有限公司总经理，新疆对外经贸集团总经理，新疆天山股份有限公司董事，曾任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。现为新疆国际实业股份有限公司高级顾问。

董事袁西存先生，中共党员，研究生，工商管理学硕士，曾任莱钢集团财务部科长、副部长，中泰证券股份有限公司计划财务部总经理，现任中泰证券股份有限公司财务总监。

董事经晓云女士，中国民主建国会会员，研究生，工商管理学硕士，曾任上海财政证券公司市场管理部经理，上海证券有限责任公司经纪管理总部副总经理、总经理，上投摩根基金管理有限公司副总经理。2016年7月加入万家基金管理有限公司，任公司董事、总经理。

独立董事黄磊先生，中国民主建国会成员，经济学博士，教授，曾任贵州财经学院财政金融系教师、山东财经大学金融学院院长、山东省政协常委，现任山东财经大学资本市场研究中心主任、山东金融产业优化与区域管理协同创新中心副主任、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员、教育部高校金融类专业教学指导委员会委员。

独立董事张伏波先生，经济学博士，曾任上海申佳船厂科员、浙江省经济建设投资公司副经理、国泰君安证券股份有限公司总裁助理、兴安证券有限责任公司副总经理、上海证券有限责任公司副总经理、海证期货有限公司董事长、业太资源有限公司董事，现任玖源化工（集团）有限公司董事局副主席。

独立董事朱小能先生，中共党员，哲学博士，教授。曾任华东理工大学商学院讲师、中央财经大学中国金融发展研究院硕士生导师、副教授、博士生导师，上海财经大学金融学院副教授、博士生导师，现任上海财经大学金融学院教授、博士生导师。

2、基金管理人监事会成员

监事会主席李润起先生，硕士学位，经济师。曾任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行部项目经理，新疆国际实业股份有限公司证券事务代表，董事会秘书兼副总经理，现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书。

监事张浩先生，中共党员，管理学博士，先后任职于山东东银投资管理有限公司、山东省国有资产控股有限公司、巨能资本管理有限公司。现任巨能资本管理有限公司董事长。

监事陈广益先生，中共党员，硕士学位，先后任职于苏州对外贸易公司、兴业全球管理有限公司。2005年3月加入本公司，现任公司总经理助理、基金运营部总监、交易部总监。

监事李丽女士，中共党员，硕士，中级讲师，先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起加入本公司，曾任公司综合管理部总监，现任公司总经理助理。

监事尹丽曼女士，中共党员，硕士，先后任职于中银万国期货有限公司、东海期货有限责任公司、万家共赢资产管理有限公司。2017年4月起加入本公司，现任公司零售业务部副总监。

3、基金管理人高级管理人员

董事长：方一天先生（简介请参见公司董事会成员）

总经理：经晓云女士（简介请参见公司董事会成员）

副总经理：李杰先生，硕士研究生。1994年至2003年任职于国泰君安证券，从事行政管理、机构客户开发等工作；2003年至2007年任职于兴安证券，从事营销管理工作；2007年至2011年任职于中泰证券，任营业部高级经理、总经理等职。2011年加入本公司，曾任综合管理部总监、总经理助理，2013年4月起任公司副总经理。

督察长：兰剑先生，中国民盟盟员，法学硕士，律师、注册会计师，曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作，2005年10月进入万家基金管理有限公司工作，2015年4月起任公司督察长。

副总经理：黄海先生，硕士研究生，先后在上海德锦投资有限责任公司、上海申银万国证券研究所有限公司、华宝信托有限责任公司、中银国际证券有限责任公司工作，历任项目经理、研究员、投资经理、投资总监等职务。2015年4月进入万家基金管理有限公司任投资总监职务，负责公司投资管理工作，2017年4月起任公司副总经理。

副总经理：沈芳女士，中共党员，经济学博士。历任东亚银行上海经济研究中心主任，富国基金管理有限公司资产管理部高级经理，长江养老保险股份有限公司大客户部副总经理(主持工作)，汇添富基金管理有限公司战略发展部总监，华融基金管理有限公司筹备组副组长、拟任公司副总经理，中保保险资产登记交易系统有限公司运营管理委员会副主任等职。2018年7月加入万家基金管理有限公司。2018年10月起任公司副总经理。

4、本基金基金经理简历

朱小明，2012年7月至2014年7月在国泰基金管理有限公司担任研究员职务。2014年7月至2016年6月在德骏达隆（上海）资产管理有限公司担任投资经理助理职务。2016年6月进入我公司，先后担任投资经理助理、基金经理助理职务。现任万家180指数证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

历任基金经理：

张鹏：2012年7月5日至2014年11月14日

吴涛：2014年11月14日至2015年5月23日

姚震天：2015年5月23日至2015年8月18日

卞勇：2015年8月18日至2018年11月9日

5、投资决策委员会成员

（1）权益与组合投资决策委员会

主　任：方一天

副主任：黄海

委　员：李杰、莫海波、苏谋东、徐朝贞、陈旭、李文宾、高源

方一天先生，董事长。

黄海先生，副总经理、投资总监。

李杰先生，副总经理。

莫海波先生，总经理助理、投资研究部总监、基金经理。

苏谋东先生，固定收益部总监，基金经理。

徐朝贞先生，国际业务部总监，组合投资部总监，基金经理。

陈旭先生，量化投资部副总监，基金经理。

李文宾先生，基金经理。

高源女士，基金经理。

（2）固定收益投资决策委员会

主　任：方一天

委　员：陈广益、莫海波、苏谋东

方一天先生，董事长。

陈广益先生，总经理助理、基金运营部总监、交易部总监。

莫海波先生，总经理助理、投资研究部总监、基金经理。

苏谋东先生，固定收益部总监，基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田　青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末，本集团资产总额228,051.82亿元，较上年末增加6,807.99亿元，增幅3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元，增幅5.42%；净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元，增幅6.08%。

2017年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在美国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位；在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部、长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末，中国建设银行已托管857只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1.直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台。

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）

法定代表人：方一天

联系人：亓翡

电话：(021)38909777

传真：(021)38909798

客户服务热线：95538转6；400-888-0800；

网址：http://www.wjasset.com

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：http://trade.wjasset.com/

2. 非直销销售机构

(1)中国建设银行股份有限公司

客户服务电话：95533

公司网站：www.ccb.com

(2)中国银行股份有限公司

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(3)中国工商银行股份有限公司

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(4)华夏银行股份有限公司

客服电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(5)上海浦东发展银行股份有限公司

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(6)中国农业银行股份有限公司

客户服务电话：95599（或拨打各城市营业网点咨询电话）

网址：www.abchina.com

(7)中国银河证券股份有限公司

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

(8)中泰证券有限公司

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(9)招商证券股份有限公司

客户服务或投诉电话：95565、0755-26951111、4008888111

公司电子邮箱：sbox@cmschina.com.cn

公司网址：http://www.newone.com.cn/

(10)江海证券有限公司

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(11)广发证券股份有限公司

统一客户服务电话：95575或致电各营业网点

网址：www.gf.com.cn

(12)中航证券有限公司

客服电话：4008866567

网址：www.avicsec.com

(13)中信证券股份有限公司

统一客服电话：95558

公司网站地址：http://www.citics.com

(14)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

客服电话：400-8888-001、(021)95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.htsec.com

(15)天相投资顾问有限公司

客服电话：010-66045678

传真：010-66045500

天相投顾网-网址：www.txsec.com

天相基金网-网址：www.txjijin.com

(16)国泰君安证券股份有限公司

客户服务热线：4008888666

网址：www.gtja.com

(17)上海证券有限责任公司

客户服务电话：(021)962518

网址：www.962518.com.cn

(18)中信建投有限责任公司

客户服务电话：400-888-8108

网址：www.csc108.com

(19)华泰证券股份有限公司

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(20)信达证券股份有限公司

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

(21)申万宏源证券有限公司

客户服务电话：(021)962505

网址：http://www.swhysc.com/

(22)国信证券股份有限公司

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(23)山西证券股份有限公司

客服电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

(24)民生证券有限责任公司

联系传真：010-85127917

客服电话：4006198888

公司网址：www.mszq.com

(25)五矿证券有限责任公司

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

(26)华龙证券有限责任公司

客服电话：4006898888

网址：www.hlzqgs.com

(27)中国国际金融有限公司

电话：010-65051166

网址：www.cicc.com.cn

(28)光大证券股份有限公司

客服电话：4008888788

网址：www.ebscn.com

(29)中信证券(山东)有限责任公司

客服电话：95548

网址：www.citicssd.com

(30)东吴证券股份有限公司

客户服务电话：0512-96288

网址：www.dwjq.com.cn

(31)日信证券有限责任公司

客服电话：4006609839

网址：http://www.rxzq.com.cn

(32)中银国际证券有限责任公司

客服电话：4006208888

网址：http://www.bocichina.com

(33)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(34)诺亚正行基金销售有限公司

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(35)上海长量基金销售有限公司

客服电话：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

(36)上海好买基金销售有限公司

客服电话：400-700-9665

网址：www. ehowbuy.com

(37)深圳众禄基金销售有限公司

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

(38)北京展恒基金销售有限公司

客服电话：400-888-6661

网址：www.myfund.com

(39)上海天天基金销售有限公司

客服电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(40)华鑫证券有限责任公司

客服电话：021-32109999；029-68918888

网址：www.cfsc.com.cn

(41)和讯信息技术有限公司

客服电话：400-920-0022

公司网站：licaike.hexun.com

(42)中国中投证券有限责任公司

客户服务电话：95532

公司网站：http://www.china-invs.cn/

(43)金元证券股份有限公司

客户服务电话：4008-888-228

公司网站：www.jyzq.cn

(44)万银财富基金销售有限公司

客服电话：400-088-0069

网站：www.wy-fund.com

(45)东海证券股份有限公司

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(46)北京钱景基金销售有限公司

客户服务电话：400-893-6885

网址：fund.qianjing.com

(47)上海汇付金融服务有限公司

客户服务电话：400-820-2819

网址：https://tty.chinapnr.com/

(48)中信期货有限公司

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(49)北京虹点基金销售有限公司

客服电话：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com/

(50)国金证券股份有限公司

客户服务电话：400-660-0109

网址：www.gjzq.com.cn

(51)大泰金石基金销售有限公司

客户服务电话：021-22267982

网址：www.dtfortune.com

(52)盈米财富管理有限公司

客户服务电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

(53)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

客户服务电话：400-166-1188

网址：http://8.jrj.com.cn/

(54)上海好买基金销售有限公司

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(55)中证金牛（北京）投资咨询有限公司

客服电话：400-8909-998

网址：www.jnlc.com

(56)深圳富济基金销售有限公司

客服电话：0755-83999907

网址：www.jinqianwo.cn

(57)武汉市伯嘉基金销售有限公司

客服电话：400-027-9899

网址：www.buyfunds.cn

(58)海银基金销售有限公司

客服电话：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

(59)北京广源达信基金销售有限公司

客服电话：400-623-6060

网址：www.niuniufund.com

(60)平安证券有限责任公司

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

(61)北京恒天明泽基金销售有限公司

客服电话：4008980618

网址：www.chtfund.com

(62)南京证券股份有限公司

客服电话：95386

网址：http://www.njzq.com.cn/

(63)上海基煜基金销售有限公司

客户服务电话：021-65370077

网址：www.jiyufund.com.cn

(64)中国民生银行直销银行

客户服务电话：10100123

网址：www.mszxyh.com

(65)华福证券有限责任公司

客服电话：400-889-6326

网址：http://www.hfzq.com.cn/

(66)北京懒猫金融信息服务有限公司

客户服务电话：4001-500-882

网址：http:// www.lanmao.com

(67)北京肯特瑞基金销售有限公司

个人业务：95118

企业业务：4000888816

网址：fund.jd.com

(68)北京新浪仓石基金销售有限公司

客服电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

(69)北京汇成基金销售有限公司

客服电话：4006199059

网址：www.fundzone.cn

(70)北京蛋卷基金销售有限公司

客户服务电话：400-061-8518

蛋卷基金官网：https://danjuanapp.com

(71)天津万家财富资产管理有限公司

客服电话：010-59013895

网址：www.wanjiawealth.com

(72)济安财富（北京）基金销售有限公司

客服电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

(73)民商基金销售（上海）有限公司

客服电话：021-50206003

网址：www.msftec.com

(74)北京百度百盈基金销售有限公司

客服电话：95055-9

网址：https://www.baiyingfund.com/

(75)西藏东方财富证券股份有限公司

客服电话：95357

网站：http://www.18.cn

场内非直销销售机构是指具有基金销售资格的深圳证券交易所会员，具体会员单位名单详见深圳证券交易所网站：http://www.szse.cn/main/marketdata/catalog_hylb.aspx

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二)注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

电话：010—58598839

传真：010—58598834

(三)律师事务所

名称：北京市大成律师事务所上海分所

地址：上海中心银城中路501号15、16层

电话：021-38722416

联系人：华涛

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国上海市南京东路61 号新黄浦金融大厦四楼

办公地址：中国上海市南京东路61 号新黄浦金融大厦四楼

联系电话：021-63391166

传真：021-63392558

联系人：徐冬

经办注册会计师：王斌、徐冬、詹阳

四、基金的名称

万家中证红利指数型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

基金类别：股票型证券投资基金

基金运作方式：上市契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段，在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对中证红利指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证红利指数的成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融产品出现后，本基金在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的90%，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，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。

八、基金的投资策略

本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证红利指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

1. 资产配置策略

本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，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。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

2. 股票投资策略

本基金原则上采用完全复制法来跟踪中证红利指数，按照中证红利指数成份股的基准权重构建股票指数化投资组合。为求基金实际投资组合尽量贴近标的指数的表现，减小跟踪误差，基金管理人将根据实际情况对基金投资组合进行适当调整：

1）本基金股票组合根据所跟踪的中证红利指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整；

2）根据指数编制规则，中证红利指数成份股因增发、送配、分红或其他原因所造成的临时成份股调整，本基金将根据中证红利指数成份股临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

3）根据指数编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，对投资组合进行优化调整，以尽量减小指数成份股变动所造成的跟踪误差；

4）根据本基金的申购、赎回、分红等情况对投资组合的影响，以尽可能贴近标的指数表现为目的，对投资组合进行相应调整；

5）指数成份股因受股票停牌限制、股票流动性限制等市场因素限制或法律法规、基金合同等合规因素限制，使本基金无法依据指数购买某成份股的情况，本基金可以根据实际情况对投资组合进行调整；

6）其他影响指数复制的因素，本基金可以根据实际情况，结合以往经验，对本基金资产进行适当调整，力争在控制风险的前提下，获得更接近标的指数的收益率。

3. 债券投资策略

本基金基于流动性管理的需要，以保证基金资产流动性为目的，可以投资于国债、金融债等到期日在一年以内的债券。本基金在构建债券投资组合时，合理评估收益性、流动性和信用风险，有效利用基金资产，提高基金资产投资收益。

4. 其他金融衍生产品投资策略

在法律法规许可时，本基金可在充分考虑金融衍生产品风险和收益特征的前提下，结合对金融衍生产品的研究，运用金融衍生工具谨慎进行投资，提高投资效率。如有新的产品推出市场，本基金将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略。

5、根据中基协发[2015]4号文“关于发布《基金参与融资融券及转融通证券出借业务指引》的通知”规定，本基金可以参与转融通证券出借交易。

九、基金的业绩比较基准

95%×中证红利指数收益率 + 5%×银行同业存款利率

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型指数基金，预期风险高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金，属于较高风险，较高预期收益的证券投资基金品种。

十一、投资组合报告

万家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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月21日复核了本招募说明书中的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及重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2018年12月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	37,486,829.99	94.14
	其中：股票	37,486,829.99	94.14
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	2,293,453.13	5.76
8	其他资产	40,728.87	0.10
9	合计	39,821,011.99	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	1,399,892.08	3.54
C	制造业	17,947,126.49	45.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,860,686.82	7.24
E	建筑业	578,757.70	1.47
F	批发和零售业	790,793.55	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	4,025,228.51	10.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,377,081.91	11.08
K	房地产业	5,507,262.93	13.94
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,486,829.99	94.92

2.2　报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

2.3　报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

3.报告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

3.1报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000550	江铃汽车	83,400	1,064,184.00	2.69
2	600664	哈药股份	235,700	931,015.00	2.36
3	601088	中国神华	49,133	882,428.68	2.23
4	601988	中国银行	222,174	802,048.14	2.03
5	002601	龙蟒佰利	53,000	651,900.00	1.65
6	600507	方大特钢	63,900	638,361.00	1.62
7	601566	九牧王	46,400	614,800.00	1.56
8	600104	上汽集团	22,154	590,847.18	1.50
9	603328	依顿电子	58,700	581,130.00	1.47
10	600873	梅花生物	129,000	544,380.00	1.38

3.2报告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五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4.报告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。

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金暂不可投资国债期货。

10.投资组合报告附注

10.1

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。

10.2

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。

10.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,065.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	505.48
5	应收申购款	38,158.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,728.87

10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.5.1报告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的情况。

10.5.2报告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。

十二、基金的业绩

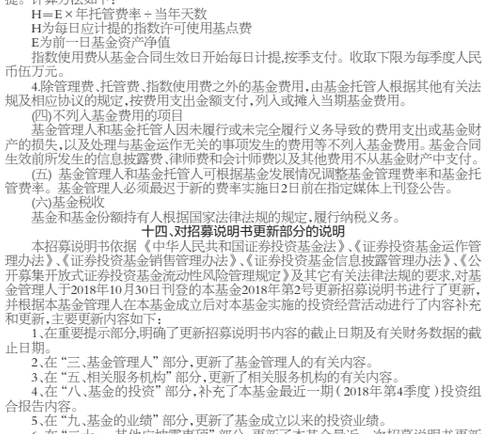
基金业绩截止日为2018年12月31日。

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本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

阶段	净值增长率①	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
2018年	-16.89%	1.13%	-18.27%	1.14%	1.38%	-0.01%
2017年	18.66%	0.55%	16.69%	0.56%	1.97%	-0.01%
2016年	-7.45%	1.45%	-7.13%	1.35%	-0.32%	0.10%
2015年	27.09%	2.70%	25.93%	2.51%	1.16%	0.19%
2014年	52.30%	1.09%	48.72%	1.08%	3.58%	0.01%
2013年	-7.98%	1.40%	-9.52%	1.41%	1.54%	-0.01%
2012年	6.93%	1.15%	6.82%	1.15%	0.11%	0.00%
基金成立日至2011年12月31日	-18.51%	1.01%	-26.16%	1.14%	7.65%	-0.13%
基金成立日至2018年12月31日	41.66%	1.44%	18.38%	1.40%	23.28%	0.04%

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较（2011年3月17日至2018年12月31）



注：本基金成立于2011年3月17日，建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费；

2.基金托管人的托管费；

3.基金上市费用；

4.基金财产按划支付的银行费用；

5.基金合同生效后的基金信息披露费用；

6.基金份额持有人大会费用；

7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

8.基金的证券交易费用；

9. 基金的指数使用费

本基金指数许可使用基点费的收取标准为以中证红利指数作为跟踪标的的基金资产净值的万分之二，许可使用基点费的收取下限为每季度人民币伍万元；

10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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3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. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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3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。

3. 基金的指数使用费

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的0.02%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的指数许可使用基点费

E为前一日基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计提，按季支付。收取下限为每季度人民币伍万元。

4.除管理费、托管费、指数使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明