（上接B13版）

客户服务电话：95548
传真：0532-85022605
网址：www.zxwt.com.cn
(81) 中银国际证券
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39-40层
法定代表人：许刚
联系人：李丹
开放式基金咨询电话：400-620-8888
开放式基金业务传真：021-50372474
网址：www.bocichina.com
(82) 中原证券
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：管明军
联系人：陈利民
联系电话：0371-65585287
开放式基金咨询电话：0371-967218、4008139666
开放式基金业务传真：0371--65585665
网址：www.ccnew.com
(83) 长平普益
注册地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人：于海锋
联系人：邓鹏
联系电话：028-82000996-828
客户服务电话：4008878566
传真：028-82000996-805
公司网址：www.pyfund.cn
（二）基金注册登记机构
名称：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004—8室
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30 号广州银行大厦40-43楼
法定代表人：叶俊英
电话：4008818088
传真：（020）38799249
联系人：余贤高
（三）律师事务所和经办律师
律师事务所：上海源泰律师事务所
地址：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人：廖海
电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
经办律师：梁丽金、刘佳
联系人：廖海
（四）会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17 层01-12 室
法定代表人：葛明
电话：(010) 58153000
传真：(010) 85188298
经办注册会计师：昌华、周刚
联系人：许建辉

六、 基金的历史沿革

（一）基金合同的历史沿革
易方达沪深300量化增强证券投资基金由易方达量化行钟映票型证券投资基金通过基金合同修订变更而来。
易方达量化行钟映票型证券投资基金经中国证监会《关于核准易方达量化行钟映票型证券投资基金募集的批复》（证监许可［2012］627号）批准募集，基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。
易方达量化行钟映票型证券投资基金自2012年6月25日至2012年7月3日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续，经中国证监会书面确认，《易方达量化行钟映票型证券投资基金合同》于2012年7月5日生效。
2013年4月1日至2013年4月30日，易方达量化行钟映票型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于易方达量化行钟映票型证券投资基金变更基金的投资及其他相关事项的议案》，同意易方达量化行钟映票型证券投资基金变更基金的投资及其他相关事项，将易方达量化行钟映票型证券投资基金变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用等条款，以及根据业务实践相应修改基金份额持有人大会、基金的信息披露及其他部分条款。上述基金份额持有人大会决定事项已经于2013年6月7日核准生效，自该日起，《易方达沪深300量化增强证券投资基金合同》生效，并原代原《易方达量化行钟映票型证券投资基金合同》，易方达量化行钟映票型证券投资基金正式变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金，本基金当事人按照《易方达沪深300量化增强证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

七、 基金的存续

（一）基金份额的变更登记
基金合同生效后，本基金注册登记机构易方达基金管理有限公司将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。
（二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模
《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并提议解决方案。
法律法规另有规定时，从其规定。

八、 基金份额的申购、赎回

（一）基金投资人范围
符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。
（二）申购、赎回的场所
1.基金管理人的直销中心及网上交易系统；
2.各代销机构开办开放式基金的营业网点；
3.基金管理人不时根据内容变更基金的销售机构，并按规定予以公告。
投资人还可通过法律法规或证监会规定的其他销售机构以接受的，其基金份额申购、赎回等业务，具体以各销售机构的规定为准。
（三）申购、赎回的开放日及时间
原易方达量化行钟映票型证券投资基金已于2012年8月6日开始办理赎回业务，已于2012年9月27日开始办理日常申购业务，原基金变更不影响本基金的正常申购和赎回。
投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回除外。
基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换请且注册登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回的价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。
（四）申购、赎回的原则
1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；
4、基金份额持有人原则时，除指定赎回外，赎回遵循“先进先出”原则，即赎回时，基金份额持有人最早认购、申购的先份额，后确认的份额先赎回，以确定所适用的赎回费率；
基金管理人在法律法规允许的情况下，可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》或其他相关规定在指定媒体上公告。
（五）申购和赎回的程序
1、申购和赎回的申请方式
投资人必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间提出申购或赎回的申请。
投资人在提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；提交赎回申请时，账户中必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购或赎回的申请无效而不予成交。
2、申购和赎回的申请确认
基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回的申请日（T日），在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认，T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，若申购不成功，则申购款项本金退还给投资人。
销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。
3、申购和赎回的款项支付
申购实用金额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，投资人已缴付的申购款项的本金退回投资人账户。
投资人赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构及相关基金销售机构按规定时段将：支付赎回款项、赎回款项自受理基金投资人有效赎回申请之日起不超过7个工作日支付，发生巨额赎回的情形时，赎回款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。
基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并进行公告。
（六）申购、赎回的数额限制
1.申购的金额限制
投资人通过代销网点或本公司网上交易系统首次申购的单笔最低金额为1000元人民币（含申购费），通过本公司直销中心首次申购的单笔最低金额为50000元人民币（含申购费），追加申购单笔最低金额均为1000元人民币（含申购费）。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。
投资人将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。
投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制，法律法规、中国证监会另有规定的除外。
2.赎回的份额限制
投资人可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回或转换不得少于100份（如该账户在该销售机构托管的单只基金余额不足100份，则必须一次性赎回或转出该基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资人在销售机构托管的单只基金余额不足100份时，基金管理人有权将投资人在该销售机构托管的该基金剩余份额一次性全部赎回。
基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的程序及有关限制，但应在调整生效前在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。
（五）基金转换费率
基金转换费由基金份额持有人承担，由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用按照基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，具体实施办法和转换费率详见相关公告。转换费用以人民币元为单位，计算结果按四舍五入方法，保留小数点后两位，代销机构可对每笔转换申请同投资者收取不高于10元的业务代理费，具体收费标准以各代销机构的规定为准。
基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对基金投资者适当调低基金转换费率。
（六）基金转换份额的计算方式
计算公式：
A=［B×C×(1-D)/(1+G)×F］/E
H= B×C×D
J=[B×C×(1-D)/(1+G)]×G
其中，A为转入的基金份额；B为转出的基金份额；C为转换申请当日转出基金的基金份额净值；D为转出基金的对应赎回费率，G为对应的申购补差费率；E为转换申请当日转入基金的基金份额净值；F为方所市场基金全部转出账户当前累计未付收益（仅限转出基金为易方达货币市场基金和易方达天天理财货币市场基金）；H为转出基金赎回费；J为申购补差费。
说明：
1.基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成。
2.转入基金时，从申购费用低的基金向申购费用高的基金转换时，每次收取申购补差费用；从申购费用高的基金向申购费用低的基金转换时，不收取申购补差费用，申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费率差额进行补差，具体收取情况视每次转换时间只基金的申购费率的差异情况而定并见相关公告。
3.转出基金时，如涉及的转出基金有赎回费用，收取该基金的赎回费用，收取的赎回费按照基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。
4.投资者可以发起多次基金转换业务，基金转换费用按每笔申请单独计算。转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。
举例说明：假定某投资者在T日转出10,000份本基金至易方达策略成长二号混合型基金份额，转出基金T日的基金份额净值为1.1000元，转入易方达策略成长二号混合型基金基金份额计算如下：
转换金额＝转出基金申请份额×转出基金份额净值=10,000×1.1000=11,000.00元
转出基金赎回费＝转换金额×转出基金赎回费率=11,000.00×0.5%=55.00元
申购补差费=（转换金额－转出基金赎回费）×申购补差费率－（1＋申购补差费率）=（11,000.00-55.00）×0.5%÷(1+0.5%)=54.45元
转换费＝转出基金赎回费+申购补差费=55.00+54.45＝109.45元
转入金额=转换金额－转换费＝11,000.00－109.45=10,890.55元
转入份额=转入金额÷转入基金份额净值=10,890.55÷1.0200=10,677.01份

转出份额	转出基金份额净值	转换金额	转换费		转入金额	转入基金份额净值	转入份额
			转出基金赎回费	申购补差费			
10,000份	1.1000元	11,000.00元	55.00元	54.45元	10,890.55元	1.0200元	10,677.01份

注：本基金转出至易方达平稳增长基金、易方达策略成长基金、易方达50指数基金、易方达积极成长基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型基金时，转入份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有；本基金转出至易方达价值精选股票型基金、易方达策略成长二号混合型基金、易方达价值成长混合型基金、易方达利润股票型基金、易方达增盈回报债券型基金、易方达中小盘股票型基金、易方达科汇灵活配置混合型基金、易方达科翔股票型基金、易方达科翔股票型基金、易方达行业领先企业股票型基金、易方达沪深300指数基金、易方达深证100ETF联接基金、易方达上证中盘ETF联接基金、易方达消费行业股票型基金、易方达医疗保健行业股票型基金、易方达安心回报债券型基金、易方达资源行业股票型基金、易方达创业板ETF联接基金、易方达双债增强债券型基金、易方达纯债债券型基金、易方达天天理财货币市场基金和易方达信用债债券型基金时，转入份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此说差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。
（七）基金转换的注册登记
投资者T日申请基金转换成功后，注册登记机构将在T+1工作日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续，一般情况下，投资者自T+2工作日起有权赎回转入部分的基金份额。
基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并应在调整生效前在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。
（八）基金转换与巨额赎回
当发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认（另有公告的除外）；在转出中止申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。
（九）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式
出现下列情况之一时，基金管理人可以暂停接受基金份额持有人的基金转换申请：
1.不可抗力的原因导致基金无法正常运作；
2.证券交易场所在交易时间非正常停市或证券交易场所依法决定临时停市，导致当日基金资产净值无法计算；
3.因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
4.基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转入或某笔转出；
5.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
6.基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
7.法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。
基金暂停转换或暂停后重新开放转换时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

十、 基金的非交易过户、转托管及冻结与解冻

（一）基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户，无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。
继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠是指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。
（二）基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。
（三）基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

十一、 基金的投资

（一）投资目标
本基金为指数增强型股票基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
（二）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，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类品种，股指期货以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。
本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具。
本基金的投资组合比例为：
股票投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。
若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。
（三）投资理念
指数增强型投资是追求投资风险、收益和成本最佳匹配的有效途径。运用数量化投资技术可以提高指数化投资的绩效，在控制与标的指数偏离风险的前提下追求超越指数的收益。
（四）投资策略
本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅，在复制标的指数基础上在一定范围调整个股权重，力求在控制与标的指数偏离风险前提下超越指数。
1.资产配置策略
本基金追求基金资产在股票市场上的充分投资，股票投资比例不低于基金资产净值的90%。
2.股票投资策略
本基金属指数增强型基金，策略上以指数化投资为主、增强型投资为辅。
本基金主要策略为复制标的指数，投资组合以标的指数的构成为基础，主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配，一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。
基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果，结合基金管理人的长期研究与实践应用，利用多因子量化模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。
（1）多因子量化模型——股票超额回报预测
多因子量化模型以对中国股票市场的长期研究为基础，一定程度上结合前瞻性市场判断，运用经长期检验有效的多个因子捕捉市场机会，预测个股的超额收益。概括来讲，本基金的多因子量化模型的因子可归为如下几类：估值（valuation）、成长（growth）、技术（technical）、情绪（sentiment）、质量（quality）等。
多因子量化模型利用基金管理人内部及外部数据库，综合了来自市场投资者、公司财务报表、证券分析师、政经政策等各方面的大量信息，通过基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出分析判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。
（2）风险估测模型——有效控制风险预算
指数化投资力求跟踪误差最小，增强型投资则需要受风险预算的约束。风险预算即最大容忍跟踪误差，本基金将结合市场通用及自主研发的风险估测模型，将投资组合风险控制在预算范围内。本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估，以控制投资组合相对于标的指数的偏离风险。
本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使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%，年化跟踪误差不超过7%。
（3）交易成本模型——控制成本并保护业绩
本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击成应，以控制交易成本，减少交易对业绩带来的负面影响。
（4）投资组合优化模型
本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化，选股范围以成分股为主，也包括非成分股中与成分股相关性强、流动性好、基本面信息充足的股票。
3.其它投资策略
本基金将审慎投资于法律法规允许及中国证监会批准的其它金融工具，以降低基金资产的风险并提高基金的收益。
（五）投资决策程序
1.投资决策依据
（1）法律、法规和《基金合同》的规定；
（2）标的指数的编制方法及调整公告等；
（3）基金管理人自主研发的多因子量化模型；
2.投资决策流程
（1）基金经理依据指数编制单位公布的指数成份股名单及权重，拟定基础投资组合方案。
（2）基金经理依据基金管理人自主研发的多因子量化模型，主要根据对标的指数成份股超额收益的预测，对基础投资组合方案中的个股权重进行调整，构建投资组合，并达到进行组合调整。
（3）当发生以下情况时，基金管理人将及时对投资组合进行调整，以降低跟踪误差。
1）指数编制方法发生变更，基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响，适时进行投资组合调整。
2）指数成份股证券因成份调整、基金管理人将预测指数成份股调整方案，并判断指数成份股调整对投资组合的影响，在此基础上确定组合调整策略。
3）指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形，基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响，并据此确定相应的投资组合调整策略。
4）当因法律法规限制基金本不能投资指数成份股或境外市场相关法规、规则禁止本基金投资相关股票时，基金管理人研究制定成份股替代策略，并适时进行组合调整。
5）基金参与新股申购、股票长期停牌、股票流动性不足等情况，基金管理人将分析这些情形对跟踪误差的影响，据此对投资组合进行相应调整。
（4）指数与量化投资前定期检验和更新股票超额收益预测模型，并利用该预测模型，预测下一阶段各成份股的超额收益率；研究股票提供收股和部分重点推荐的符合要求的非成份股本面的研究报告。
（5）投资风险管理部定期对投资组合的超额收益与跟踪误差进行量化评估，提供基金经理参考。
（6）基金经理参考有关研究报告及投资风险管理部门的报告，及时进行投资组合调整。
（六）投资限制
1.组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制：
（1）本基金股票资产占基金资产净值的比例为90%-95%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；
（2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
（4）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
（5）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
（6）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
（8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
（9）本基金持有的同一信用级别资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
（10）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
（11）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
（12）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
（13）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
（14）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先报According to the relevant laws and regulations, the fund manager shall report to the China Securities Regulatory Commission in advance and publish a notice in at least one of the designated media in China.
（15）本基金投资于股指期货，还应遵循如下投资组合限制：
① 在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货的合约价值不超过基金资产净值的10%，卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的20%。
② 在任何交易日日终，本基金持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%。
其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。
③ 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产净值的比例范围为90%-95%。
④ 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%。
⑤ 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
本基金管理人应当按照中国金融期货交易所的要求向其报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。
因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。
2.禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：
（1）承销证券；
（2）向他人贷款或者提供担保；
（3）从事承担无限责任的投资；
（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。
若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制修改或取消，如适用于本基金，则本基金可相应调整禁止行为及投资限制规定。
（七）标的指数和业绩比较基准
本基金的标的指数为：沪深300指数
本基金的业绩比较基准为：
沪深300指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
本基金管理人在基金管理期间有权更换标的指数及业绩比较基准。本基金的基金合同任何条款中涉及业绩比较基准的更换将提前3个月在指定媒体上公告。
（八）风险收益特征
本基金属股票型基金中的指数增强型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
（九）基金的融资、融券、转融通
本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会审议。
（十）未来，如果基金管理人推出与本基金投资目标、投资策略相同的ETF，在不改变本基金投资目标的前提下，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金可转为该ETF的联接基金，无需召开基金份额持有人大会。ETF联接基金是指将其他大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。
（十一） 投资组合比例调整
基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同的定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。
（十二） 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法
1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
2.有利于基金财产的安全与增值；

十二、 基金的财产

（一）基金资产总值
基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。
（二）基金资产净值
基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。
（三）基金财产的账户
基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。
（四）基金财产的保管及处分
本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担因其违反法律法规、中国证监会的有关规定、基金合同或其他有关规定给基金财产造成的损失等责任时，其赔偿以不得对基金财产的权益产生影响为限。基金托管人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。
基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权、不得与其固有财产产生的债务相互抵销；基金管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

十三、 基金的财务估值

（一）估值目的
基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值，开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值结果确定的基金份额净值计算。
（二）估值日
本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。
（三）估值对象
基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。
（四）估值方法
本基金按以下方式进行估值：
1.证券交易所上市的有价证券的估值
（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；
（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值，如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；
（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应计利息金额的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应计利息金额的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；
（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。
2.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：
（1）送股、转增股、配股和公开增发的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；
（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；
（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市日一级市场的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票、按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
3.全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。
4.同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。
5.因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。
6.股指期货合约按照估值当日的结算价进行估值，估值当日无结算价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。
7.如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。
8.相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。
如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。
根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计核百方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。
（五）估值程序
1.基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。
每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。
2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值、但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外、基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。
（六）估值错误的处理
基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。
基金会员的当事人应按照以下约定处理：
1.估值错误类型
本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误造成受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。
上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。
2.估值错误处理原则
（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经根据协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。
（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。
（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利而造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的金额超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。
（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。
（5）估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：
（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；
（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；
（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；
（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。
4.基金份额净值估值错误处理的方法如下：
（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。
（2）错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告。
（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。
（七）暂停估