（上接B87版）

法定代表人：徐黎云
联系人：梁舒岚
电话：0571-88337888
传真：0571-88337666
客户服务电话：4000680058
公司网站：http://www.jiaozheng-fund.com/
(134) 久富财富
注册地址：上海市浦东新区荣阳路2819号1幢109室
办公地址：上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人：赵惠蓉
联系人：徐金华
电话：021-68608825
传真：021-68682297
客户服务电话：400-021-9898
公司网站：www.jfcfa.com
(135) 凯石财富
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈耀武
联系人：李晓明
电话：021-63333319
传真：021-63332523
客户服务电话：4000 178 000
公司网站：www.lingxiunfund.com
(136) 利得基金
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈璐炜
联系人：徐鹏
电话：86-021-50583533
传真：86-021-50583633
客户服务电话：4000676266
公司网站：www.leadfund.com.cn
(137) 联泰资产
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法定代表人：燕斌
联系人：凌秋艳
电话：021-52823063
传真：021-52973270
客户服务电话：400-046-6788
公司网站：www.66zichan.com
(138) 陆金所资管
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
电话：021-20669052
传真：021-22066653
客户服务电话：4008219031
公司网站：www.lufunds.com
(139) 诺亚正行
注册地址：上海市虹口区 飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海静安区秣陵路210号3楼
法定代表人：汪静波
联系人：张雨
电话：021-80336399
传真：021-80336010
客户服务电话：400-166-1188
公司网站：http://8.jrj.com.cn
(140) 晨岱天下
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人：熊剑
联系人：徐长征、周超
电话：01058170943、010-58170953
传真：01058170800
客户服务电话：4008188866
公司网站：www.shengshiview.com
(141) 欢乐基金
注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1楼202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼
法定代表人：陈柏青
联系人：楼梁彬
联系电话：0571-81137494
客户服务电话：4000-766-123
传真：0571-26697013
网址：http://www.fund123.cn/
(142) 天天基金
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
联系电话：021-54509998
客户服务电话：400-1818-188
传真：021-64385308
网址：www.1234567.com.cn
(143) 同花顺
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市西湖区果灿路文电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人：凌顺平
联系人：吴强
联系电话：0571-88911818
客户服务电话：4008-773-772
传真：0571-86800423
网址：www.5ifund.com
(144) 万银财富
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座3201
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座02-04-08
法定代表人：王隽
联系人：付少帅
电话：010-59497361
传真：010-64708016
客服电话：400-059-8888
公司网站：http://www.wy-fund.com
(147) 鼎信通达
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
法定代表人：陈洪生
联系人：梁云波
电话：0592-3122737
传真：0592-3122701
客户服务电话：0592-3122716
公司网站：www.xds.com.cn
基金销售网站：www.dkhs.com.cn
(148) 新浪仓石
注册地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室
办公地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦903室
法定代表人：张琪
联系人：付文红
客户服务电话：010-62675369
邮箱：fund@staff.sina.com.cn
网址：http://www.xincai.com/
(149) 阳光人寿保险
注册地址：海南省三亚市河东区三亚河东路海康商务12,13层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙12号1号楼昆泰国际大厦12层
法定代表人：李科
联系人：龙芩
电话：010-59054007
传真：010-59053700
客户服务电话：95510
公司网站：http://fund.sinosig.com
(150) 一路财富
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：刘栋栋
电话：010-88312877
传真：010-88312899
客户服务电话：400-001-1566
公司网站：www.yilucaifu.com
(151) 宜投基金销售
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室
办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405
法定代表人：毕建强
联系人：闫娜
电话：0755-23919658
传真：0755-88603185
客户服务电话：4008-955-811
公司网站：www.yitfund.com
(152) 宜信普泽
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：王巨明
电话：010-52658713
传真：010-85894285
客户服务电话：400-6099-200
公司网站：www.yixinfund.com
(153) 盈米财富
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
电话：020-89629019
传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066
公司网站：www.yingmi.cn
(154) 期财基金
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人：罗恒安
联系人：史丽丽
电话：010-67000988
传真：010-67000988-6000
客户服务电话：400-003-8811
公司网站：www.zcvc.com.cn
(155) 展恒基金
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区霄苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人：闫振杰
联系人：王琳
联系电话：010-62820088
客户服务电话：400-888-6661
传真：010-62820355
网址：www.zhfund.com
(156) 中国国际期货
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
法定代表人：王兵
联系人：孟夏
电话：010-59539861
传真：010-59539896
客户服务电话：95162
公司网站：http://www.cifco.net/
(157) 中期资产
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层
法定代表人：姜新
联系人：侯英建
电话：010-65807865
传真：010-65807864
客户服务电话：95162
公司网站：www.cifcofund.com
(158) 中信建投期货
注册地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B、名义层11-A、8-B4、9-B、C
办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人：彭文德
联系人：董彬
电话：0755-23953913
传真：0755-83217421
客户服务电话：400-990-8826
公司网站：http://www.citicsf.com/
(160) 众禄金融
注册地址：深圳市罗湖区笋岗路物资招投置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区笋岗路物资招投置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：董彬平
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客户服务电话：4006-788-887
公司网站：www.jimmw.com
（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：刘晓艳
电话：4008818088
传真：（020）38799249
联系人：余莲东
（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：吴丽金、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）
主要经营场所：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
执行事务合伙人：Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话：（010）58153000
传真：（010）85188298
经办注册会计师：昌华、熊焕英
联系人：许建群

四、基金的名称

易方达沪深300量化增强证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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，投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变本履行相关手续后，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。

八、基金的投资策略

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，投资组合将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量化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。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，选择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风险预算范围内。 本基金采用“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本，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。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%

十、基金的收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

本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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告组合报告有关数据的期间为2015年7月1日至2015年9月30日。

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	464,086,986.15	94.11
	其中：股票	464,086,986.15	94.11
2	固定收益投资	121,248.50	0.02
	其中：债券	121,248.50	0.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	28,356,358.89	5.75
7	其他资产	565,361.57	0.11
8	合计	493,129,955.11	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）积极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	560,700.00	0.11
B	采矿业	1,972,707.00	0.40
C	制造业	22,620,720.14	4.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	271,215.00	0.06
E	建筑业	1,813,436.00	0.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	960,685.36	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,041,117.64	0.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	113,036.00	0.02
L	租赁和商务服务业	980,233.32	0.20
M	科学研究和技术服务业	153,522.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	195,693.00	0.04
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	718,933.88	0.15
	合计	31,401,999.34	6.39

（2）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	16,372,138.27	3.33
C	制造业	135,348,998.38	27.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,616,341.13	3.99
E	建筑业	16,488,723.19	3.36
F	批发和零售业	10,744,759.41	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	17,138,462.56	3.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,507,395.02	3.97
J	金融业	159,087,185.56	32.37
K	房地产业	21,901,267.92	4.46
L	租赁和商务服务业	2,972,077.82	0.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,270,741.32	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	127,144.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	8,524,777.23	1.73
S	综合	1,614,975.00	0.33
	合计	432,684,986.81	88.05

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

（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

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	601166	兴业银行	1,052,778	15,328,447.68	3.12
2	601318	中国平安	493,106	14,724,145.16	3.00
3	600000	浦发银行	757,718	12,600,850.34	2.56
4	600016	民生银行	1,223,211	10,336,132.95	2.10
5	600036	招商银行	542,789	9,645,360.53	1.96
6	600837	海通证券	708,413	9,032,265.75	1.84
7	601288	农业银行	2,888,829	8,753,151.87	1.78
8	601377	兴业证券	1,093,684	8,563,545.72	1.74
9	601398	工商银行	1,771,909	7,654,646.88	1.56
10	601766	中国中车	539,668	6,999,493.96	1.42

（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五名股票投资明细

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	600456	宝钛股份	196,100	2,753,244.00	0.56
2	002437	誉衡药业	96,590	2,339,409.80	0.48
3	000933	神火股份	555,261	2,248,807.05	0.46
4	600039	四川路桥	406,600	1,813,436.00	0.37
5	600199	金种子酒	183,423	1,456,378.62	0.30

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	121,248.50	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,248.50	0.02

5、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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	950	121,248.50	0.02

6、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序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序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

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-8,438,550.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，进行股指期货投资。本基金在出现大额净申赎等需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货保证头寸满足基金的投资现代需求和风险对冲需求。一般而言，如出现大额净申赎等需要利用期货多头进行规避风险的情况，本基金可买入股票匹配的股指期货合约以满足权益类资产配置比例的要求，并选择合适的时机在综合考虑成本的基础上逐步平仓；反之，如出现大额净赎回等需要利用期货空头的情况，本基金可先开仓股指期货空头将市场暴露降到目标水平，再选择合适的时机在综合考虑成本的基础上，逐步卖出股票，同时平仓数量匹配的股指期货合约，从而降低股票交易的冲击成本。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）根据海通证券股份有限公司2015年8月25日发布的《收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，被中国证监会予以立案调查。

根据海通证券股份有限公司2015年9月11日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，被中国证监会予以没收违法所得、没收佣金收入等行为，并处以罚款。

根据银监会上海监管局网站2014年10月8日发布的《中国银行业监督管理委员会上海监管局行政处罚决定书》，兴业银行股份有限公司信用卡中心因存在违法违规行为，被责令改正，并处罚款人民币三十万元。

根据银监会上海监管局网站2014年10月10日发布的《中国银行业监督管理委员会上海监管局行政处罚决定书》，上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心因存在违法违规行为，被责令改正，并处罚款人民币二十万元。

根据银监会上海监管局网站2014年10月8日发布的《中国银行业监督管理委员会上海监管局行政处罚决定书》，中国工商银行股份有限公司上海市分行因存在违法违规行为，被责令改正，并处罚款人民币三十万元。

根据银监会上海监管局网站2014年10月8日发布的《中国银行业监督管理委员会上海监管局行政处罚决定书》，中国民生银行股份有限公司上海分行因存在违法违规行为，被责令改正，并处罚款人民币五十万元。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述五家上市公司进行了进一步了解和分析，认为上述处罚不会对海通证券、兴业银行、浦发银行、工商银行、民生银行的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述五家上市公司的投资判断未发生改变。

除海通证券、兴业银行、浦发银行、工商银行、民生银行外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	319,481.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,515.76
5	应收申购款	239,364.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	565,361.57

（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。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

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。

十二、基金的业绩

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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同生效日为2012年7月31日，基金合同生效以来（截至2015年6月30日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

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)
基金合同生效至2012年12月31日	11.30%	0.69%	2.07%	1.00%	9.23%	-0.31%
2013年1月1日至2013年12月31日	-3.71%	1.31%	-7.07%	1.24%	3.36%	0.07%
2014年1月1日至2014年12月31日	55.94%	1.12%	48.69%	1.15%	7.25%	-0.03%
2015年1月1日至2015年6月30日	30.84%	2.15%	25.29%	2.15%	5.55%	0.00%
基金合同生效至2015年6月30日	118.66%	1.35%	76.71%	1.37%	41.95%	-0.02%

注：1.根据中国证监会2013年4月17日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监许可[2013]742号），易方达量化衍伸股票型证券投资基金自2013年6月17日起变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金，修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金份费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。修订后的《易方达沪深300量化增强证券投资基金基金合同》于2013年6月17日生效。

2.根据《易方达沪深300 量化增强证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自2013年6月7日起，由“沪深300指数收益率 × 80%+活期存款利率（税后）× 20%”变更为“沪深300指数收益率 × 95%+活期存款利率（税后）× 5%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后分别根据相应的指标计算。

十三、费用概览

（一） 与基金运作相关的费用

1、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）基金合同生效后的标的指数许可使用费；

（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

（5）《基金合同》生效后与基金相关的合计顾费、律师费和诉讼费；

（6）基金份额持有人大会费用；

（7）基金的证券交易费用；

（8）基金的银行汇划费用；

（9）证券账户开户费用、银行账户维护费用；

（10）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E × 0.8% ÷ 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为第一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内，按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E × 0.18% ÷ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为第一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内，按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

（3）标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数使用费按前一日基金资产净值的0.06%的年费率计提。标的指数许可使用费每日计算、逐日累计。

计算方法如下：

H = E × 0.06 % / 当年天数

H为每日应计提的标的指数许可使用费,E为前一日的基金资产净值。

标的指数许可使用费的收款账户限为每季度人民币伍万元（50,000），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计算方法的，本基金按照变更后的费率计提标的指数许可使用费,基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计算方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

如果申证指数有限公司根据指数使用许可协议的约定要求变更标的指数许可使用费费率和计算方法，应按照变更后的标的指数许可使用费从基金财产中支付给指数许可方，此项变更无需召开基金份额持有人大会。

上述“1.基金费用的种类中第（4）—（9）项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

（1）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；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（二） 与基金销售有关的费用

1、申购费

（1）申购费率；

本基金对通过本公司直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

通过基金管理人的直销中心申购本基金的特定投资群体申购费率为：

申购金额M（元）(含申购费)	申购费率
M<100万	0.15%
100万≤M<500万	0.12%
500万≤M<1000万	0.03%
M≥1000万	1000元/笔

其他投资者申购本基金的申购费率为：

申购金额M（元）(含申购费)	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<500万	1.2%
500万≤M<1000万	0.3%
M≥1000万	1000元/笔

（2）申购费的收取方式和用途

在申购费按金额分档的情况下，如果投资人多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

本基金的申购费由投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不计入基金财产

（3）申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

对于1000万元（含1以上的申购，净申购金额=申购金额-绝对数额的申购费金额

申购费用以人民币元为单位，四舍五入，保留至小数点后二位，申购份数采取四舍五入的方法保留小数点后二位，由此误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。

2.赎回费

（1）赎回费率：

持有时间（天）	赎回费率
0-364	0.5%
365-729	0.25%
730及以上	0%

（2）赎回费的收取和用途

本基金的赎回费由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，赎回费总额的25%归基金财产，其余用于支付注册登记费等其他相关手续费。

（3）赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用，其中：

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回总金额、赎回费用以人民币元为单位，四舍五入，保留小数点后两位，由此误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。

3.转换费率

目前，基金管理人已开通了本基金与旗下部分开放式基金之间的转换业务，具体实施办法和转换费率详见相关公告。基金转换费用由转出基金赎回费用和基金申购补差费用构成，其中转出基金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。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。

4.基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整上述费率或收费方式。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率或收费方式实施前在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

5.投资者通过本公司网上交易系统（www.efunds.com.cn）进行申购、赎回和转换的交易费率，请具体参照我公司网站上的相关规定。

6.基金管理人可以在不违反法律法规及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《易方达沪深300量化增强证券投资基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金主持的投资决策的执行情况，对2015年7月22日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“三、基金管理人”部分，更新了部分内容。

2、在“四、基金托管人”部分，根据最新资料进行了更新。

3、在“五、相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构信息

4、在“八、基金份额的申购、赎回”部分，更新了部分内容。

5、在“九、基金转换”部分，更新了部分内容。

6、在“十一、基金的投资”部分，补充了本基金2015年第3季度投资组合报告的内容。

7、在“十二、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩数据。

8、在“十六、基金的费用与税收”部分，更新了部分内容。

9、在“二十四、其他应披露事项”部分，根据相关公告的内容进行了更新。

易方达基金管理有限公司
2016年1月21日

证券代码：002667　证券简称：鞍重股份　公告编号：2016-003

鞍山重型矿山机器股份有限公司
关于使用部分超募资金购买理财产品的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

鞍山重型矿山机器股份有限公司(以下简称"公司")第三届董事会第五次会议于 2015 年 4 月 14 日以 9 票同意、0 票反对、0 票弃权的表决结果审议通过了《关于使用部分闲置超募资金购买保本型理财产品的议案》。根据《上市公司监管指引第 2 号--上市公司募集资金管理和使用的监管要求》及《中小企业板信息披露业务备忘录第 29 号：募集资金使用》的规定，公司董事会授权公司董事长或其指定代理人在不超过 8000 万元额度内使用超募资金择机购买保本型短期理财产品的投资决策，并签署相关合同文件，在上述额度内，资金可以滚动使用，授权期限自董事会通过之日起一年内有效。本次使用超募资金购买理财事项不存在变相改变募集资金用途的行为，且不影响募集资金项目的正常实施，不构成关联交易、不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。

根据上述决议购买上海浦东发展银行股份有限公司鞍山分行利多多公司理财产品2800万元，具体内容如下：

一、理财产品的主要情况

1、产品名称：上海浦东发展银行股份有限公司利多多财富班车2号

2、理财币种：人民币

3、产品代码：2101137332

4、投资标的：本理财产品投资于现金、国债、地方政府债、央行票据、政策性金融债，评级在AA及以上评级（对于上海浦东发展银行主承销的信用债，评级在A-（含）以上评级）的短期融资券、中期票据、次级债、企业债、公司债、非公开定向债务融资工具、ABS、ABN等以及ABS次级档等信用类债券,回购、同业拆借、券商收益凭证、优先股、存放同业、货币基金以及信贷资产等符合监管要求的非标准化债权资产、券商/基金/保险定向