（上接B85版）

87）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：陈东
电话：021-52822063
传真：021-52975270
客户服务电话：400-166-6788
公司网站：www.66zichan.com
88）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：胡学勤
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客户服务电话：4008219031
公司网站：www.lufunds.com
89）蚂蚁基金
注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋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：韩爱彬
联系电话：0571-26888888
客户服务电话：4000-766-123
网址：http://www.fund123.cn/
90）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：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人：汪静波
联系人：李娟
电话：021-80359115
传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399
公司网站：www.noah-fund.com
91）深圳新兰德
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：马勇
联系人：张燕
电话：010-83363099
传真：010-83363010
客户服务电话：400-166-1188
公司网站：http://8.jrj.com.cn
92）晟视天下
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：蒋煜
联系人：徐长征、周超
电话：010-58170943、010-58170953
传真：010-58170800
客户服务电话：4008188866
公司网站：www.shengshiview.com
93）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：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人：其实
联系人：黄妮娟
联系电话：021-54509998
客户服务电话：95021
传真：021-54509953
网址：www.1234567.com.cn
94）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：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼四层
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
95）鑫鼎盛
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504
法定代表人：陈洪生
联系人：梁云波
电话：0592-3122757
传真：0592-3122701
客户服务电话：400-918-0808
公司网站：www.xds.com.cn
基金销售网站：www.dkhs.com
96）一路财富
注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
法定代表人：吴雪秀
联系人：刘栋栋
电话：010-88312877
传真：010-88312099
客户服务电话：400-001-1566
公司网站：www.yilucaifu.com
97）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：深圳市福田区嘉里建设广场3座3350室
法定代表人：郭海鹰
联系人：刘娜
电话：0755-82724143
传真：0755-88601598
客户服务电话：4008-955-811
公司网站：www.yitfund.com
98）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：戎兵
联系人：魏晨
电话：010-52413385
传真：010-85894285
客户服务电话：400-6099-200
公司网站：www.yixinfund.com
99）奕丰金融
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室、1116室及1307室
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系人：叶健
电话：0755-89460507
传真：0755-21674453
客户服务电话：400-684-0500
公司网站：www.ifastps.com.cn
100）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
101）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：北京市朝阳区安苑路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：010-62020088
客户服务电话：400-888-6661
传真：010-62020355
网址：www.myfund.com
102）朝阳永续
注册地址：浦东新区上丰路977号1幢B座812室
办公地址：上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼
法人代表：廖水
联系人：陆纪青
电话：021-80234888-6813
客户服务电话：400-699-1888
公司网站：www.998fund.com
103）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：刘芸
电话：023-86769637
传真：023-86769629
客户服务电话：400-8877-780
公司网站：www.cfc108.com
104）中证金牛
注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人：钱昊旻
联系人：陈珍珍
电话：010-59336529
客户服务电话：4008-909-998
公司网站：www.jnlc.com
105）众禄金融
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客户服务电话：4006-788-887
公司网站：www.zlfund.cn 或 www.jjmmw.com
106）众升财富
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：李招弟
联系人：李艳
电话：010-59497361
传真：010-64788016
客服电话：400-876-9988
公司网站：www.zscffund.com
2、场内销售机构
具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站。
3、基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。
（二）基金登记结算机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：4008058058
传真：（010）50938907
联系人：赵亦清
（三）出具法律意见书的律师事务所
律师事务所：上海市通力律师事务所
地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
经办律师：吕红、安冬
联系人：安冬
（四）审计基金财产的会计师事务所
1、本基金的法定验资机构
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：吕华、熊姝英
联系人：许建辉
2、本基金的年度财务报表及其他规定事项的审计机构
会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人：李丹
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
经办注册会计师：陈玲、周祎
联系人：周祎
四、基金的名称
易方达并购重组指数分级证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式股票型基金、指数型基金、分级基金
六、基金的投资目标
紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。
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（包括中小板、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的相关规定）。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。
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非现金基金资产的80%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，基金管理人可对上述资产配置比例进行调整。
八、基金的投资策略
1、资产配置策略
本基金的投资比例范围为，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非现金基金资产的80%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。
2、权益类品种投资策略
（1）股票投资策略
本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：
1）法律法规的限制；
2）标的指数成份股流动性严重不足；
3）标的指数的成份股票长期停牌；
4）标的指数成份股进行配股或增发；
5）标的指数成份股派发现金股息；
6）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。
（2）股票组合的动态调整
在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人可对投资组合进行调整：
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）指数成份股定期或临时调整。基金管理人将根据指数成份股调整方案，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）标的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）基金发生申购赎回等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响，据此对投资组合进行相应调整。
5）法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据指数建立组合。基金管理人可根据市场情况，以跟踪误差最小化为原则对投资组合进行调整。
3、金融衍生品的投资策略
(1) 权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。
(2) 股指期货投资策略
本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。
4、其他
未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
九、基金的业绩比较基准
中证银行指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%。
十、基金的风险收益特征
本基金为股票基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。长期而言，其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。
此外，从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分级的安排，A类份额的预期收益和预期风险低于基础份额；B类份额的预期收益和预期风险高于基础份额。
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。
本投资组合报告有关数据的期间为2017年1月1日至2017年3月31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	1,829,403,702.63	93.87
	其中：股票	1,829,403,702.63	93.87
2	固定收益投资	39,952,000.00	2.05
	其中：债券	39,952,000.00	2.05
	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	66,412,946.27	3.41
7	其他资产	13,111,798.04	0.67
8	合计	1,948,880,446.94	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	12,892,630.00	0.67
B	采矿业	24,251,231.40	1.26
C	制造业	885,489,528.11	45.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,748,581.58	3.04
E	建筑业	41,322,626.22	2.14
F	批发和零售业	199,922,357.70	10.35
G	交通运输、仓储和邮政业	33,749,836.45	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	260,779,672.12	13.50
J	金融业	12,650,923.20	0.65
K	房地产业	169,535,355.73	8.78
L	租赁和商务服务业	44,229,633.32	2.29
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,741,078.19	1.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,436,705.44	2.25
R	文化、体育和娱乐业	9,614,509.35	0.50
S	综合	10,022,103.66	0.52
	合计	1,829,403,702.63	94.72

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

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	600690	青岛海尔	7,746,513	94,352,528.34	4.89
2	002024	苏宁云商	8,591,366	92,786,752.80	4.80
3	300104	乐视网	2,513,317	85,251,712.64	4.41
4	600649	城投控股	2,795,544	51,186,410.64	2.65
5	600584	长电科技	2,666,041	50,334,854.08	2.61
6	002044	美年健康	3,115,976	43,436,705.44	2.25
7	000547	航天发展	2,575,515	38,246,397.75	1.98
8	000415	渤海金控	4,774,964	34,045,493.32	1.76
9	600654	中安消	1,830,705	31,909,188.15	1.65
10	000878	云南铜业	2,187,155	30,642,041.55	1.59

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	39,952,000.00	2.07
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（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,952,000.00	2.07

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	019546	16国债18	400,000	39,952,000.00	2.07

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
本基金本报告期末未投资股指期货。
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）根据中安消股份有限公司董事会2017年3月24日发布的《立案调查进展暨风险提示公告》，因公司涉嫌违反证券法律法规，被中国证监会立案调查。
本基金为指数型基金，中安消系标的指数成份券，该股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除中安消外，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	247,293.00
2	应收证券清算款	12,227,570.88
3	应收股利	-
4	应收利息	577,461.04
5	应收申购款	59,473.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,111,798.04

（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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600654	中安消	31,909,188.15	1.65	重大事项停牌

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。
本基金合同生效日为2015年6月3日，基金合同生效以来（截至2016年12月31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
基金合同生效日至2015年12月31日	-30.35%	3.30%	-30.13%	3.33%	-0.22%	-0.03%
2016年1月1日至2016年12月31日	-20.13%	1.81%	-20.59%	1.70%	0.46%	0.11%
基金合同生效日至2016年12月31日	-44.37%	2.47%	-44.52%	2.43%	0.15%	0.04%

十三、费用概览
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）基金上市初费和年费；
（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会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
（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）标的指数许可使用费
（10）证券账户开户费用、账户维护费用；
（11）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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1.0%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。
（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0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.22%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。
（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及补充协议的约定，从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数许可使用费按前一日基金资产净值0.02%的年费率计提。具体计算方法如下：
H＝E×0.02%÷当年天数
H为每日应付的指数许可使用费
E为本基金前一日基金资产净值
指数许可使用费每日计提，逐日累计。标的指数许可使用费的收取下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。
如果指数许可使用费的计算方法或费率发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介进行公告，此项调整无须召开基金份额持有人大会审议。
（4）除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的基金费用，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。
3、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
（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。
4、费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和《基金合同》约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
5、与基金销售有关的费用
（1）申购费
1）申购费率
本基金对通过基金管理人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，对通过直销中心申购的特定投资群体实施特定申购费率。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。
A.场外基础份额的申购费率
特定申购费率仅适用于通过基金管理人直销中心、以场外方式申购的特定投资群体。

申购金额（元）	特定申购费率（特定投资群体）	申购费率（其他投资者）
M<100万	0.10%	1.0%
100万≤M<200万	0.06%	0.6%
200万≤M<500万	0.03%	0.3%
M≥500万	按笔固定收取1,000元/笔	

B.场内基础份额的申购费率为0。
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，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。
申购费用由基金申购投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。
3）申购份额的计算
当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：
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日基础份额基金份额净值
当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：
申购费用＝固定金额
净申购金额＝申购金额－申购费用
申购份额＝净申购金额/T日基础份额基金份额净值
申购费用以四舍五入方式保留到小数点后两位。通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；通过场内方式进行申购的，申购份额计算结果采用截尾法保留至整数位，不足1份部分对应的申购资金将返还给投资者。
（2）赎回费
1）赎回费率
A场外基础份额的赎回费率如下：

持有期限（天）	赎回费率
0-364	0.50%
365-729	0.25%
730及以上	0.00%

B场内基础份额的赎回费率为固定赎回费率0.5%。
2）赎回费的收取方式和用途
赎回费用由赎回基金份额的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，其余用于支付登记结算费等其他相关手续费。
3）赎回金额的计算
投资者在赎回基金份额时需缴纳一定的赎回费用，计算公式如下：
赎回费＝赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率
赎回金额＝赎回份额×T日基金份额净值－赎回费
赎回金额单位为元，计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。
6、转换费率
本基金与基金管理人所管理的其他基金之间的转换费率由基金管理人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定另行制定并公告。
7、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指定媒介公告。
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《易方达并购重组指数分级券投资基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2017年1月17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和基金登记结算机构信息。
4. 在“十四、基金的投资”部分，补充了本基金2017年第1季度投资组合报告的内容。
5. 在“十五、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。
6. 在“二十三、风险揭示”部分，更新了部分内容。
7. 在“二十八、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
2017年7月18日

（上接B86版）

电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
经办律师：吕红、安冬
联系人：安冬
（四）审计基金财产的会计师事务所
1、本基金的法定验资机构
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：吕华、熊姝英
联系人：许建辉
2、本基金的年度财务报表及其他规定事项的审计机构
会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人：李丹
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
经办注册会计师：陈玲、周祎
联系人：周祎
四、基金的名称
易方达银行指数分级证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式股票型基金、指数型基金、分级基金
六、基金的投资目标
紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。
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（包括中小板、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的相关规定）。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。
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非现金基金资产的80%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。
2、权益类品种投资策略
（1）股票投资策略
本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：
1）法律法规的限制；
2）标的指数成份股流动性严重不足；
3）标的指数的成份股票长期停牌；
4）标的指数成份股进行配股或增发；
5）标的指数成份股派发现金股息；
6）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。
（2）股票组合的动态调整
在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人可对投资组合进行调整：
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）指数成份股定期或临时调整。基金管理人将根据指数成份股调整方案，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）标的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）基金发生申购赎回等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响，据此对投资组合进行相应调整。
5）法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据指数建立组合。基金管理人可根据市场情况，以跟踪误差最小化为原则对投资组合进行调整。
3、金融衍生品的投资策略
(1) 权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。
(2) 股指期货投资策略
本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。
4、其他
未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
九、基金的业绩比较基准
中证银行指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%。
十、基金的风险收益特征
本基金为股票基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。长期而言，其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。
此外，从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分级的安排，A类份额的预期收益和预期风险低于基础份额；B类份额的预期收益和预期风险高于基础份额。
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。
本投资组合报告有关数据的期间为2017年1月1日至2017年3月31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	387,516,902.98	93.79
	其中：股票	387,516,902.98	93.79
2	固定收益投资	2,734,000.00	0.66
	其中：债券	2,734,000.00	0.66
	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	22,515,864.70	5.45
7	其他资产	398,757.15	0.10
8	合计	413,165,524.83	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	643,246.24	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	101,842.86	0.02
F	批发和零售业	74,088.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	93,988.44	0.02
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	386,603,737.44	93.74
K	房地产业	-	-
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	387,516,902.98	93.96

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

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	3,040,919	49,293,296.99	11.95
2	600016	民生银行	5,390,537	45,711,753.76	11.08
3	600036	招商银行	2,351,828	45,084,542.76	10.93
4	601328	交通银行	6,264,780	39,029,579.40	9.46
5	600000	浦发银行	1,971,695	31,566,836.95	7.65
6	601288	农业银行	8,716,275	29,112,358.50	7.06
7	601169	北京银行	2,773,849	26,656,688.89	6.46
8	601398	工商银行	4,917,995	23,803,095.80	5.77
9	000001	平安银行	1,957,534	17,950,586.78	4.35
10	601988	中国银行	4,805,716	17,781,149.20	4.31

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	-	-