

易方达基金管理有限公司关于召开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的第一次提示性公告

易方达基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2013年3月29日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及易方达基金管理有限公司网站（<http://www.efunds.com.cn>）发布了《易方达基金管理有限公司关于召开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的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开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的第一次提示性公告。

一、会议基本情况

为使易方达量化衍伸股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）具有更加明确稳定的风险收益特征，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议变更本基金的投资及其他相关事项，将本基金变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金。

- 1、会议召开方式：通讯方式。
- 2、会议投票表决起止时间：自2013年4月1日起，至2013年4月30日17:00止（投票表决时间以基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）。
- 3、会议通讯表决票将在公证机关的监督下拆封和/或统计。

二、会议审议事项

本次持有人大会拟审议的事项为《关于易方达量化衍伸股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》（以下简称“《议案》”），《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2013 年 4 月 8 日，于权益登记日在本基金注册登记机构易方达基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、投票方式

1、本次会议仅接受纸质投票，表决票的样式见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站下载 (<http://www.efunds.com.cn>) 等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

(1) 个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件；

(2) 机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章，并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）；

(3) 基金份额持有人可以根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“五、授权（三）授权方式 1、纸面方式授权”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2013 年 4 月 1 日起，至 2013 年 4 月 30 日 17:00 以前（以公证机关收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址：

公证机关收件人：北京市方正公证处

地址：北京市西城区阜外大街 7 号国投大厦三层

联系人：孟必珍、李乐

联系电话：010-68096212、010-58073515

邮政编码：100037

请在信封表面注明：“易方达量化衍伸股票型证券投资基金持有人大会表决专用”

五、授权

为方便基金份额持有人参与本次大会并充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需遵守以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有基金份额的数额，以注册登记机构的登记为准。

（二）受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人仅接受纸面授权方式，授权受托人代为行使表决权。

授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录易方达基金网站（<http://www.efunds.com.cn/>）下载等方式获取授权委托书样本。

1、纸面授权

1) 个人基金份额持有人委托他人投票的，应由委托人填妥并签署授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并提供个人身份证明文件复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团

体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

2) 机构持有人委托他人投票的，应由委托人填妥授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本）并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

2、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额多次以有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的纸面授权为准；

(2) 如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

(3) 如委托人既进行委托授权，又送达了有效表决票，则以有效表决票为准，授权视为无效。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中国建设银行股份有限公司)授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程及结果予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 表决票填写完整清晰, 所提供文件符合本会议通知规定, 且在规定时间内送达公证机关的, 为有效表决票; 有效表决票按表决意见计入相应的表决结果, 其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2)如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认,但其他各项符合会议通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并按“弃权”计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3)如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在规定时间之内送达公证机关的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4)基金份额持有人重复提交表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表决意见不相同,则按如下原则处理:

①送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

②送达时间为同一天的,视为在同一表决票上做出了不同表决意见,计入弃权表决票;

③送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以公证机关收到的时间为准。

七、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的50%(含50%)以上;

2、《关于易方达量化衍伸股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》应当由提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过;

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会核准,基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准之日起生效。

八、本次大会相关机构

1、召集人:易方达基金管理有限公司

持有人大会专线/客服电话:400 881 8088

联系人：陈晓梅

传真：020-38798812

网址：<http://www.efunds.com.cn>

电子邮件：service@efunds.com.cn

2、公证机构：北京市方正公证处

地址：北京市西城区阜外大街7号国投大厦三层

邮政编码：100037

联系人：孟必珍、李乐

联系电话：010-68096212、010-58073515

3、见证律师：北京德恒律师事务所

注册及办公地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系电话：010-52682888

传真：010-52682999

经办律师：刘焕志、刘露

4、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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

邮政编码：100033

联系人：尹东

联系电话：010-67595003

九、重要提示

1、请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次大会需要本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）方可举行，经出席基金份额持有人大会的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的50%以上（含50%）通过才能

做出有效决议。如本次基金份额持有人大会不能成功召开或未能通过本次大会审议的议案，根据《基金法》及《基金合同》的有关规定，本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。

3、上述基金份额持有人大会有关公告可通过易方达基金管理有限公司网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电 4008818088 咨询。

4、本通知的有关内容由易方达基金管理有限公司解释。

附件一：《关于易方达量化衍伸股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》

附件二：授权委托书（样本）

附件三：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表决票

易方达基金管理有限公司

2013 年 4 月 11 日

附件一

关于易方达量化衍伸股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

易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人：

为使易方达量化衍伸股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）具有更加明确稳定的风险收益特征，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议变更本基金的投资及其他相关事项，将本基金名称变更为易方达沪深300 量化增强证券投资基金，修改《基金合同》中有关本基金的名称、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，主要修改内容见《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同修改说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议批准，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议修改《基金合同》，并可在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，对《基金合同》进行其他修改或必要补充。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

附件：《关于易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同修改说明》

易方达基金管理有限公司

2013 年 3 月 29 日

《关于易方达量化衍伸股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》之附件：

易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同修改说明

为实现变更易方达量化衍伸股票型证券投资基金的投资及其他相关事项之目的，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规规定以及《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》，现拟就《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》相关条款进行修改，说明如下：

原基金合同涉及修改章节	原基金合同表述	拟修订方案
基金合同的名称	《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》	《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》
基金名称	易方达量化衍伸股票型证券投资基金	易方达沪深 300 量化增强证券投资基金
第三部分 基金的基本情况 四、基金的投资目标	本基金主要采用量化策略进行投资组合管理，追求超越业绩比较基准的投资回报。	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。
第三部分 基金的基本情况 增加表述	无	新增“八、基金份额的分级 在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可在条件允许时为本基金提供基金份额的分级服务。基金管理人可就分级后的全部或部分份额申请上市，并制定、公布相应的业务规则。”
第六部分 基金份额的申购	本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数	本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数

与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及用途 第 1 款	点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	发生上述情形且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。	发生上述情形且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应报中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，基金管理人可在 20 个工作日内支付赎回款项。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。
第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 （一）基金管理人简况	住所：广东省珠海市香洲区情侣路 428 号九州港大厦 4001 室	住所：广东省珠海市横琴新区宝中路 3 号 4004—8 室

<p>第八部分 基金份额持有人大会 一、召开事由 第2款 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会中的第(3)项</p>	<p>在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率</p>	<p>在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会 一、召开事由 第2款 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会中增加三种情况</p>	<p>无</p>	<p>(6) 基金管理人、基金登记机构、基金销售机构,在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则; (7) 在法律法规规定或中国证监会许可的范围内基金推出新业务或服务; (8) 在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整基金份额类别设置;</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会 一、召开事由 第2款 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会中的第(9)项</p>	<p>按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。</p>	<p>按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会 四、基金份额持有人出席会议的方式</p>	<p>基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。</p>	<p>基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式及法律法规、中国证监会允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。</p>

<p>第八部分 基金份额持有人大会 四、基金份额持有人出席会议的方式 1、现场开会（1）及（2）</p>	<p>（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。</p>	<p>（1）亲自出席会议者持有的有关证明文件、受托出席会议者出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；（2）经核对，到会者在权益登记日代表的有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会 四、基金份额持有人出席会议的方式 2、通讯开会（4）</p>	<p>上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符；</p>	<p>上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的有关证明文件、受托出具书面意见的代理人出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符；</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会 四、基金份额持有人出席会议的方式 增加两条约定</p>	<p>无</p>	<p>3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会 增加表述</p>	<p>无</p>	<p>九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人</p>

		大会审议。
第十二部分 基金的投资 一、基金的投资目标	本基金主要采用量化策略进行投资组合管理，追求超越业绩比较基准的投资回报。	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。
第十二部分 基金的投资 二、投资范围 第 2 款	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。	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。
第十二部分 基金的投资 二、投资范围 第 3 款	<p>基金的投资组合比例为：</p> <p>本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%。</p>	<p>本基金的投资组合比例为：</p> <p>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%。</p>

<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>三、基金的投资理念</p>	<p>本基金采用阿尔法与贝塔分离的现代投资组合管理理念，对投资组合的市场收益（贝塔）和超额收益（阿尔法）分别建立量化模型，根据模型的预测进行组合优化管理，发挥量化策略在策略宽度、信息处理效率、客观性和纪律性等方面的优势。本基金首先采用量化行为金融资产配置策略，确定投资组合市场暴露度的目标，以获取市场收益并控制市场风险；其次，本基金将运用多种量化套利策略，发现和捕捉因市场波动及无效定价带来的价差机会，以获取与市场收益无关的超额收益；最后，本基金还可增加权益类资产主动投资比例并利用股指期货进行套期保值，在不改变投资组合市场暴露的条件下，进一步放大超额收益，实现投资组合的主动增强。</p>	<p>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。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、基金的投资策略</p>	<p>1、资产配置策略</p> <p>行为金融理论认为，证券市场价格并不仅由证券内在价值所决定，在很大程度上还受到投资者主体行为的影响，即投资者心理与行为对证券市场价格的决定及其变动具有重大影响。</p> <p>本基金运用现代行为金融学关于市场有限套利和投资者有限理性的理论建立量化资产配置模型，综合考虑宏观经济与相关政策预期、微观经济、市场情绪及投资者行为等因素，对金融市场的预期收益及风险进行预测，并据此确定组合中权益类品种、固定收益类品种及金融衍生品的投资比例目标，以达到获取市场收益、控制市场风险的目的。本基金所采用的量化资产配置模型主要考虑如下因素：（1）宏观经济因素。</p>	<p>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。（一）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%。（二）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定量投资模型充分借鉴国内</p>

包括国内生产总值增长率及其构成、价格指数（CPI和PPI）的变动及其构成、货币供给与需求水平的变动、利率水平的变化及市场对此类因素的预期等；（2）政策预期因素。包括货币政策、财政政策以及与证券市场密切相关的其他各种政策出台对市场的影响及市场对此类因素的预期等；

（3）微观经济因素。包括各行业盈利周期及其波动、各行业主要企业的盈利变化情况及各类投资机构的预期等；（4）市场情绪因素。包括市场供求资金供求关系及其变化、大类资产的预期收益率水平及其历史比较、股票市场与债券市场的相对强弱、股票市场整体估值水平及其与历史水平的比较等；

（5）投资者行为因素。包括各类投资者（各类机构投资者及个人投资者）在不同市场周期内对市场收益及风险的预期、资产配置比例及风险偏好等投资行为及其变化等。

2、权益类品种投资策略

本基金权益类品种的投资策略包括实现市场暴露目标和追求超额收益两个部分。

2.1 实现市场暴露目标

根据资产配置策略所确定的投资组合市场暴露度目标，本基金将参考业绩比较基准中股票指数的成份股构成及权重，确定股票组合中各成份股的初始配置比例。

2.2 追求超额收益

在实现市场暴露度目标的前提下，本基金运用统计套

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，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%。

利、定向增发套利与大宗交易套利等多种量化套利策略的理念和方法，根据各策略的预期收益、风险及其所使用的市场环境，对股票组合中各成份股的初始配置比例进行优化与调整，以发现和捕捉因市场波动及无效定价带来的价差机会，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

(1) 统计套利策略

统计套利策略利用定量方法，综合考虑宏观经济、上市公司基本面、市场情绪与投资者预期等多种因素，对股票的投资价值进行统计评估，利用市场中价格与价值的偏差获取长期持续的超额收益。此处所定义的统计套利策略并不一定需要卖空股指期货进行套期保值。

该策略在投资程序上分成两步：

1) 超额收益预测

本基金根据现代投资组合理论，将股票收益按市场收益和超额收益两个维度进行分解，引进国际先进的量化对冲基金经验与模式，建立多因子模型对个股的超额收益进行预测。本基金在多因子模型中所使用的因子从信息来源上可分为：

①基本面因子：如估值水平、盈利能力和成长性指标等；②技术因子：如价格动量、成交金额和换手率等；③分析师因子：如分析师关注度、一致性和预期变化等；④风险因子：如波动率和 Beta 等。本基金管理人将根据市场环境的变化和因子的实际表现，适时调整各因子类别的具体组合及权重。

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效应，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。

(三) 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。

2) 投资组合优化

在超额收益预测的基础上,本基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素,通过主动投资组合优化器,构建风险调整后的最优投资组合。

(2) 定向增发套利策略

定向增发是指向特定投资者非公开发行股票的融资方式。定向增发的股票份额在锁定期内不得转让,作为对其流通限制的补偿,定向增发的股票通常会折价发行。持有定向增发股票的投资者将会面临市场系统性风险和个股非系统性风险。

定向增发套利策略按照分散化投资原则,分批、分期投资于多个定向增发项目以分散非系统性风险,同时利用股指期货套期保值,以获得由折价带来的超额收益。

(3) 大宗交易套利策略

大宗交易通过沪深两市大宗交易平台进行。由于大宗交易涉及证券的交易数量或金额通常远超过该证券二级市场平均交易规模,若直接在二级市场进行交易可能受流动性限制,因此大宗交易的卖方通常会向买方提供一定的折价,作为对流动性限制的补偿。

大宗交易套利策略借助大宗交易平台,以折价交易的方式购入股票,通过投资组合多元化分散个股风险,同时利用股指期货套期保值,以实现折价带来的超额收益。

本基金管理人将关注中国资本市场的发展，持续研发新的量化股票投资策略，争取投资策略的长期有效，并运用于本基金的投资管理。

(4) 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。

3、固定收益类品种投资策略

在固定收益品种投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次方面，本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

在券种选择方面，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，合理运用投资管理策略，实施积极主动的债券投资管理。

随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁，更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的投资机会，谋求高于市场平均水平的投资回报。

4、金融衍生品投资策略

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。本基金参与股指期货交易应符合以下投资比例规定：在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约

价值不超过基金资产净值的 10%，卖出期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的 20%；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）应符合前述关于股票投资比例的有关约定。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人可对上述投资比例进行调整。

具体而言，本基金将运用股指期货进行如下投资：

（1）主动增强

本基金在根据量化资产配置模型确定投资组合的目标市场暴露度后，调整权益类资产主动投资比例并利用股指期货进行套期保值，在实现目标市场暴露度的同时，力争放大超额收益，实现对投资组合的主动增强。

（2）流动性风险管理

出现大量净申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理。如出现大量净申购，本基金可买入数量匹配的股指期货合约以满足权益类资产配置比例的要求，并在净申购资金到账后逐步平仓；反之，如预期出现大量净赎回，本基金可在逐步卖出股票的同时买入数量匹配的股指期货合约以维持目标市场暴露度，并在投资者赎回的同时平仓。本基金将关注国内其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资该衍生工具，本基金将制定与本基金投资目标相适应的投资策略，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

	<p>5、新股（含新发行可转债）申购策略</p> <p>由于新股（含新发行可转债）申购可能为本基金带来低风险的绝对回报，本基金将对新发行企业的基本面进行深入研究，综合考虑新股发行的市盈率、可转债的量化定价结果、股本结构、预测中签率、新股/券上市价格等因素，决定是否参与以及参与金额。</p>	
<p>第十二部分 基金的投资增加</p> <p>五、投资决策程序</p>	<p>无</p>	<p>五、投资决策程序</p> <p>（一）投资决策依据</p> <ol style="list-style-type: none"> 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； <p>（二）投资决策流程</p> <ol style="list-style-type: none"> 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，并适时进行组合调整。 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。 <ol style="list-style-type: none"> （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。

		<p>(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。</p> <p>(4) 当因法律法规限制本基金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。</p> <p>(5) 基金参与新股申购、股票长期停牌、股票流动性不足等情形。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。</p> <p>4、指数与量化投资部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；研究部提供成份股和部分重点推荐的符合要求的非成份股基本面的研究报告。</p> <p>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。</p> <p>6、基金经理参考有关研究报告及投资风险管理部的报告，及时进行投资组合调整。</p>
<p>第十二部分 基金的投资 五、投资限制 修改为六、投资限制；1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制中的（1）</p>	<p>本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；</p>	<p>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%；</p>
<p>第十二部分 基金的投资 六、投资限制 （15）本基金投资于股指期货，还应遵</p>	<p>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）占基金资产的比例范围为 60%-95%。</p>	<p>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%。</p>

<p>循如下投资组合限制中的 ③</p>		
<p>第十二部分 六、业绩比较基准修改为七、标的指数和业绩比较基准</p>	<p>沪深 300 指数收益率×80%+活期存款利率（税后）×20%</p>	<p>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。标的指数及业绩比较基准的更换将提前 3 个月在指定媒体上公告。</p>
<p>第十二部分 七、风险收益特征修改为八、风险收益特征</p>	<p>本基金为进行主动管理的股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金和债券基金，属于较高预期风险和较高预期收益的基金品种。</p>	<p>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。</p>
<p>第十二部分 八、基金的融资、融券修改为九、基金的融资、融券、转融通</p>	<p>本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。</p>	<p>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。</p>

第十二部分增加表述	无	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联接基金是指将其绝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。
第十四部分 基金的估值 四、估值程序第1条的表述	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0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。	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。
第十四部分 基金的估值 五、估值错误的处理第1条的表述	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3位以内（含第3位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。	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。
第十五部分 基金的费用与 税收 一、基金费用的种类 增加条款	无	3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费；

<p>第十五部分 基金的费用与税收 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p>	<p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$ <p>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</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。</p>	<p>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：</p> $H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$ <p>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</p> <p>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。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。</p>
<p>第十五部分 基金的费用与税收 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>2、基金托管人的托管费</p>	<p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ <p>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</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p>	<p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>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</p> <p>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。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。</p>

<p>第十五部分 基金的费用与 税收 二、基金费用计提方 法、计提标准和支付方式 增加条款</p>	<p>无</p>	<p>3、标的指数许可使用费</p> <p>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0.016%的年费率计提。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计。</p> <p>计算方法如下：</p> $H = E \times 0.016 \% / \text{当年天数}$ <p>H为每日应付的标的指数许可使用费，E为前一日的基金资产净值。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>如果中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率和计算方法，应依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。</p>
--	----------	---

第十五部分 基金的费用与税收 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式	上述“一、基金费用的种类中第3-8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。	上述“一、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。
第十八部分 基金的信息披露 第一条中增加表述	无	相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒体、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。
第十八部分 基金的信息披露增加表述	无	若本基金投资股指期货，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 一、基金合同的变更”第2款	关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。	关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效，自决议生效之日起2个工作日内在指定媒体公告。

附件二： 授权委托书

本人（或本机构）持有或申购了易方达量化衍伸股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额，就易方达基金官网（www.efunds.com.cn）及2013年3月29日《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》公布的《易方达基金管理有限公司关于召开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的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项，本人（或本机构）的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

同意	反对	弃权

本人（或本机构）特此授权_____代表本人（或本机构）参加审议上述事项的基金份额持有人大会，并按照上述意见行使表决权。本人（或本机构）同意受托人转授权，转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。

委托人（签字/盖章）：_____

委托人证件号码（填写）：_____

签署日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1. 基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。
2. 如委托人未在授权委托书表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托书表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。
3. 本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。
4. 如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

附件三：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表决票

基金份额持有人姓名或名称：			
证件号码(身份证件号/营业执照号)：			
审议事项	同意	反对	弃权
《关于易方达量化衍伸股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》			
基金份额持有人/受托人签名或盖章			
年 月 日			
说明： 请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。表决意见未选、多选或字迹无法辨认或意愿无法判断、相互矛盾的表决票或表决意见空白的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。			