易方达标普500指数证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
二〇一七年七月

重要提示

本基金根据2016年9月26日中国证券监督管理委员会《关于准予易方达标普500指数证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可【2016】2193号）进行募集。本基金基金合同于2016年12月2日正式生效。

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，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

本基金投资于股票的比例不低于基金资产的80%；本基金投资标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的公募基金的资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金投资于证券期货市场、基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括：（1）本基金特有的风险，主要包括标的指数的风险、标的指数波动的风险、基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、退市风险、第三方机构服务的风险、管理风险、创新风险、关于引入境外托管人的相关风险等；（2）投资风险，主要包括市场风险、政府管制风险、监管风险、政治风险、流动性风险、汇率风险、利率风险、衍生品风险、金融模型风险、信用风险等；（3）运作风险，主要包括操作风险、会计核算风险、法务及税务风险、交易结算风险、证券借贷/正回购/逆回购风险等；（4）其他风险，包括不可抗力风险、第三方风险等等。本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金跟踪境外市场股票指数，基金净值会因境外证券市场波动等因素而产生波动，同时面临汇率风险等投资境外市场的特殊风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金由易方达基金管理有限公司独立管理，未聘请境外投资顾问。

投资有风险，投资者投资本基金时应认真阅读本招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2017年6月2日，有关财务数据截止日为2017年3月31日，净值表现截止日为2017年3月31日。（本报告中财务数据未经审计）

一、 基金的名称

易方达标普500指数证券投资基金（LOF）

二、 基金的类型

契约型、上市开放式（LOF）、境外股票指数基金

三、 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的最小化。

四、 基金的投资方向

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金、依法发行上市的其他股票、债券、存托凭证（包括全球存托凭证、美国存托凭证等）、银行存款、货币市场工具、经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，在履行适当程序后，本基金可以将其纳入投资范围，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。

本基金投资于股票的比例不低于基金资产的80%；本基金投资标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的公募基金的资产不低于非现金基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金可对上述资产配置比例进行调整。

五、 基金的投资策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，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。

1、资产配置策略

本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将酌配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金可能将一定比例的基金资产投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金以及股指期货等金融衍生品，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。

本基金在实际管理过程中可能由于投资者申购赎回增加的资金可能不能及时地转化为目标指数的成份股票、或为了应对可能发生的较大规模赎回而持有较多现金，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金可适当投资于固定收益品种和货币市场工具。

2、权益类品种投资策略

本基金主要采取组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪。同时，本基金可适当借出证券，以更好实现本基金的投资目标。

（1）组合复制策略

本基金主要采取完全复制法进行投资，即参考标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。

（2）替代性策略

当市场流动性不足、法律法规限制投资某只股票、基金管理人认定不适合投资的股票等情况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股进行替代，并以降低跟踪误差为目标，优化投资组合的配置结构。在进行替代投资时，本基金所持有基金或金融衍生品应符合相关投资比例的限制。

3、固定收益品种和货币市场工具投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将适当投资于固定收益品种和货币市场工具，主要目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

4、金融衍生品投资策略

（1）减少现金拖累

考虑到申购赎回资金流动冲击、外汇汇兑、资金划转等操作问题，本基金将保留一定的现金，用于满足赎回资金及证券交易的交收要求，可能形成现金拖累，影响指数跟踪。为更好地实现投资目标，本基金可通过金融衍生品降低现金持仓对跟踪效果的影响。

（2）投资替代

如因法律法规限制、基金规模制约或流动性制约，导致本基金不能完全按照标的指数的构成投资于指数成份股，或出现境外市场相关法规、规则禁止本基金投资相关股票的情形时，为更好地实现投资目标，本基金可投资于个股期权、互换等金融衍生品，进行投资替代。

5、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。

六、 基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为标普500指数（价格指数）。

本基金业绩比较基准为：

标普500指数收益率×（使用估值汇率折算）×95%+活期存款利率（税后）×5%。

七、 基金的风险收益特征

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

八、 基金投资组合报告(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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	533,671,101.64	91.64
	其中：普通股	518,419,447.11	89.02
	存托凭证	–	–
	优先股	–	–
	房地产信托	15,251,654.53	2.62
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中：远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
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	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	44,587,376.00	7.66
8	其他资产	4,072,197.07	0.70
9	合计	582,330,674.71	100.00

2.报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	533,671,101.64	91.91
合计	533,671,101.64	91.91

注：（1）国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

（2）ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

3.报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	34,986,936.10	6.03
材料	15,144,943.83	2.61
工业	53,938,019.05	9.29
非必需消费品	65,768,263.81	11.33
必需消费品	49,803,068.88	8.58
保健	74,362,416.61	12.81
金融	76,800,725.81	13.23
信息技术	117,736,730.35	20.28
电信服务	12,690,360.47	2.19
公用事业	16,913,871.77	2.91
房地产	15,525,764.96	2.67
合计	533,671,101.64	91.91

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

4.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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Apple Inc	–	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	20,038	19,860,732.59	3.42
2	Microsoft Corp	–	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	29,583	13,442,157.19	2.32
3	Amazon.com Inc	–	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	1,500	9,174,758.13	1.58
4	Exxon Mobil Corp	–	XOM US	纽约证券交易所	美国	15,777	8,926,809.50	1.54
5	Johnson & Johnson	–	JNJ US	纽约证券交易所	美国	10,350	8,893,835.89	1.53
6	Facebook Inc	–	FB US	纳斯达克证券交易所	美国	8,906	8,728,285.80	1.50
7	Berkshire Hathaway Inc	–	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	7,224	8,307,421.74	1.43
8	JPMorgan Chase & Co	–	JPM US	纽约证券交易所	美国	13,614	8,250,553.85	1.42
9	General Electric Co	–	GE US	纽约证券交易所	美国	33,658	6,920,055.85	1.19
10	AT&T Inc	–	T US	纽约证券交易所	美国	23,364	6,697,662.44	1.15

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9.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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

10.投资组合报告附注

（1）2016年11月，美国证券交易委员会宣布，摩根大通同意支付总计2.64亿美元的罚款，以和解对于其在中国及其他亚洲国家雇佣政府高官或客户的亲属朋友的指控。

2017年1月，摩根大通承认其在2015年5月操纵汇率的罪名，公司同意向美国司法部支付5.5亿美元罚款。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除摩根大通外，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(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	496,790.85
4	应收利息	8,167.09
5	应收申购款	3,567,239.13
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,072,197.07

（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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

九、 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2016年12月2日，基金合同生效以来（截至2017年3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)
自基金合同生效日至2016年12月31日	0.54%	0.19%	2.65%	0.55%	-2.11%	-0.36%
2017年1月1日至2017年3月31日	2.71%	0.43%	4.71%	0.46%	-2.00%	-0.03%
自基金合同生效日至2017年3月31日	3.26%	0.38%	7.49%	0.48%	-4.23%	-0.10%

注：（1）同期业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

（2）上述净值表现数据按照《证券投资基金信息披露编报规则第2号:基金净值表现的编制及披露》的相关规定编制。

十、 基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1.基金管理人：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

设立日期：2001年4月17日

法定代表人：刘晓艳

联系电话：400 881 8088

联系人：贺晋

注册资本：12,000万元人民币

批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号

经营范围：基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务

2.股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总 计	100%

（二）主要人员情况

1. 董事、监事及高级管理人员

詹余引先生、工商管理博士、董事长。曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理；平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理（主持工作）、国债部副总经理（主持工作）、资产管理部副总经理、总经理；中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理（主持工作）；全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士、董事、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理；易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁，现任易方达基金管理有限公司总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事。

麦力先生，经济学博士、董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资银行部常务副总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理，广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长。现任广发证券股份有限公司执行董事、常务副总经理；广发控股（香港）有限公司董事。

杨力先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理；佛山顺德百年科技有限公司行政总监；美的空调深圳营销中心区域经理；佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理；长虹空调广州营销中心营销总监；广东益峰投资控股集团有限公司战略总监、副总裁；益峰资本管理有限公司总经理，并兼证券股份有限公司副董事长。现任益峰投资控股集团有限公司董事、执行副总裁兼首席投资官；益峰资本管理有限公司董事长；广东民营投资股份有限公司董事。

王海先生，经济学、工商管理（国际）硕士，董事。曾任工商银行江西省分行法律顾问室科员；工商银行珠海分行法律顾问室办事员、营业部计划信贷部信贷员、办公室行长室秘书、信贷管理部业务主办、资产风险管理部经理助理兼法律室副主任、资产风险管理部副总经理兼法律室主任、资产风险管理部总经理；招商银行总行法律事务部行员；工商银行珠海分行资产风险部总经理兼特殊资产管理部负责人、公司业务部总经理、副行长；工商银行广东省分行公司业务部副总经理（主持工作）、总经理；工商银行韶关分行行长、党委书记。现任广东粤财信托有限公司总经理。

刘韧先生，经济学硕士、董事。曾任湖南证券发行部经理助理；湘财证券投资银行总部经理助理；财富证券投资银行总部副总经理；五矿二十三冶建设集团副总经理、党委委员；深圳市中金岭南有色金属股份有限公司监事；新晟期货有限公司副董事长；广东省广晟资产经营有限公司总经理助理、资本运营部部长。现任东江环保股份有限公司董事长。

朱征夫先生，法学博士、独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所金融房地产部主任；广东大陆律师事务所合伙人；广东省国土厅广东地产法律咨询服务中心副主任。现任广东东方昆仑律师事务所主任。

忻榕女士，工商行政管理博士、独立董事。曾任中科院研究生院讲师；美国加州高温橡胶公司市场部经理；美国加州大学讲师；美国南加州大学助理教授；香港科技大学副教授；中欧国际工商学院教授；瑞士洛桑管理学院教授。现任中欧国际工商学院教授。

谭劲松先生，管理学博士（会计学）、独立董事。曾任邵阳市财政学校教师；中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任中山大学管理学院教授。

陈国祥先生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理；广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李韵金先生，经济学硕士、监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记；中国证监会广州证管办处长；广州市广永国有资产经营有限公司董事长；广州股权交易中心有限公司董事长；广州立根小额再贷款股份有限公司董事长；广州银行副董事长；广州中盈（三明）基金管理有限公司董事长；广州汽车集团股份有限公司独立董事。现任广州金融控股集团有限公司董事长；万联证券有限责任公司董事长；广州金控资本管理有限公司董事长；广永期货有限公司董事；立根融资租赁有限公司董事长；广州金控花都金融投资有限公司董事长；广州农村商业银行股份有限公司董事。

廖智先生，经济学硕士、监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管；易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理、互联网金融部总经理。现任易方达基金管理有限公司总裁助理；广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

张优造先生，工商管理硕士(MBA)，常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理；广东证券公司发行上市部经理；深圳证券业务部总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁；易方达国际控股有限公司董事；易方达资产管理（香港）有限公司董事。

陈形先生，经济学博士、副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员；易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员；深圳众大投资有限公司投资部副总经理；广发证券有限责任公司研究员；易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、现金管理部总经理、固定收益总部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官、基金科讯基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达资产管理有限公司副总裁；易方达资产管理有限公司董事；易方达资产管理（香港）有限公司董事、人民币合格境外投资者（RQFII）业务负责人、证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、ROFII/OFII产品投资决策委员会委员；中储资信评估有限责任公司独立董事。

吴炼荣先生，工学硕士、副总裁。曾任易方达基金管理有限公司研究员、投资管理部经理、基金投资部副总经理、研究部副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、公募基金投资部总经理、权益投资总部总经理、总裁助理、权益投资总监、基金科瑞基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

张南女士，经济学博士、督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长；易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士(MBA)，首席产品官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员；深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理；深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品官；易方达资产管理（香港）有限公司董事、另类投资决策委员会委员。

关秀霞女士，财务硕士、工商管理硕士，首席国际业务官。曾任中国银行（香港）分析员；Daniel Dennis高级审计师；美国道富银行波士顿及亚洲总部大中华地区高级副总裁、董事总经理、中国区行长、亚洲区（除日本外）副总裁、机构服务主管、美国共同基金业务风险经理、公司内部审计部高级审计师。现任易方达基金管理有限公司首席国际业务官。

高松凡先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），首席养老金业务官。曾任招商银行总行人事部高级经理、企业年金中心副主任、浦东发展银行总行企业年金部总经理，长江养老保险公司首席市场总监，易方达基金管理有限公司养老金业务总监。现任易方达基金管理有限公司首席养老金业务官。

2.基金经理

林伟斌先生，经济学博士。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部指数量化研究员、基金经理助理兼任指数量化研究员、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（自2013年3月6日至2017年6月22日）、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理（自2013年11月14日至2017年6月22日）、易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2015年8月27日至2017年6月22日）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理（自2013年11月29日至2017年7月6日）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理（自2016年5月26日至2017年7月6日）、现任易方达基金管理有限公司量化基金组合部副总经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年11月28日起任职）、易方达标普500指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月2日起任职）、易方达普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月13日起任职）、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月13日起任职）、易方达纳斯达克100指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年6月23日起任职）、兼任易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

张胜记先生，管理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司投资经理助理、基金经理助理、行业研究员、指数与量化投资部总经理助理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原易方达沪深300指数证券投资基金）基金经理（自2011年1月1日至2013年11月13日）。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2010年3月29日起任职）、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2010年3月31日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2012年8月9日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2012年8月21日起任职）、易方达50指数证券投资基金基金经理（自2012年9月28日起任职）、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理（自2014年9月13日起任职）、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年11月2日起任职）、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月3日起任职）、易方达标普500指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月6日起任职）、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)基金经理（自2016年12月15日起任职）、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理（自2016年12月15日起任职）、易方达原油证券投资基金(QDII)基金经理（自2016年12月19日起任职）、兼任易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

FAN BING(范冰)先生，商学硕士。曾任里家加拿大银行托管部核算专员、美国道富集团Middle Office中台交易支持专员、巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、主管，新加坡金融数据部主管，贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。现任易方达基金管理有限公司易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普500指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达原油证券投资基金(QDII) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达纳斯达克100指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年6月27日起任职）。

3.指数与量化投资决策委员会成员

本公司指数与量化投资决策委员会成员包括：林飞先生、张胜记先生、王建军先生。

林飞先生，经济学博士。曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、易方达沪深300指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资管理总部总经理、指数与量化投资部总经理、量化基金组合部总经理、投资经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、证券交易负责人员（RO）、RQFII/OFII产品投资决策委员会成员。

张胜记先生，同上。

王建军先生，经济学博士。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金基金经理、易方达开拓回报指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理、投资经理。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

十一、 费用概览

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费（包括基金管理人委托境外投资顾问所收取的费用）；

2、基金托管人的托管费，含境外托管费；

3、基金的指数许可使用费与指数数据费；

4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、清算、登记等各项费用以及为了加快清算向券商支付的费用）；

5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

6、《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；

7、基金份额持有人大会费用；

8、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用（基金托管人及境外托管人垫付资金所产生的合理费用）

9、基金的证券交易费用；

10、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；

11、证券账户开户费用、相关账户维护费用；

12、除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用；

13、基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、证费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费等；

14、为了基金利益，除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的、与基金有关的诉讼、仲裁、追索费用；

15、基金上市初费和基金上市月费；

16、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

（二）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0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.80%÷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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法，按前一日基金资产净值每日计提标的指数许可使用费。具体计算方法如下：

H=E×0.06%÷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

若一个季度累计计提指数许可使用费金额小于指数使用许可协议规定的费用下限，则基金于季度末最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。指数许可使用费收取下限为每季度1万美元或等值人民币，即不足1万美元时按照1万美元收取。

指数许可使用费每日计提，按年支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后，从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中按需本基金最新适用的方法，此项调整无须召开基金份额持有人大会审议。

上述“一、基金费用的种类中第4－16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。

（三）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。

（四）与基金销售有关的费用

1、申购费

（1）申购费率

1）场外申购费率

场外人民币基金份额申购金额M（含申购费）	美元基金份额申购金额M（含申购费）	场外申购费率
M＜100万元	M＜20万美元	1.2%
100万元≤M＜200万元	20万美元≤M＜100万美元	0.8%
200万元≤M＜500万元	100万美元≤M＜200万美元	0.5%
M≥500万元	M≥200万美元	人民币基金份额1,000元/笔 美元基金份额200美元/笔

本基金对通过直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者采取差别的申购费率。

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。通过直销中心申购本基金的特定投资群体具体费率如下：

场外人民币基金份额申购金额M（含申购费）	美元基金份额申购金额M（含申购费）	场外申购费率
M＜100万元	M＜20万美元	0.12%
100万元≤M＜200万元	20万美元≤M＜100万美元	0.08%
200万元≤M＜500万元	100万美元≤M＜200万美元	0.05%
M≥500万元	M≥200万美元	人民币基金份额1,000元/笔 美元基金份额200美元/笔

2）场内申购费率

本基金场内人民币基金份额的申购费率比照场外人民币基金份额其他投资者（非特定投资群体）的申购费率执行。

（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。

本基金的申购费