易方达沪深300量化增强证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2022年8月8日

送出日期：2022年8月9日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	易方达沪深 300 量化增强	**基金代码**	110030
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
基金合同生效日	2012-07-05		
基金类型	股票型	**交易币种**	人民币
运作方式	普通开放式	**开放频率**	每个开放日
基金经理	杜才鸣	**开始担任本基金基金经理的日期**	2021-03-20
		证券从业日期	2012-07-01
	王建军	**开始担任本基金基金经理的日期**	2021-09-04
		证券从业日期	2007-07-16

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

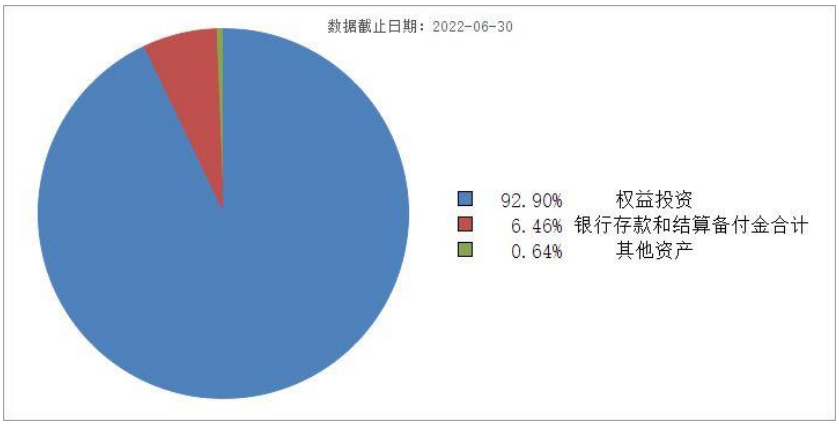
投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、权证等权益类品种，国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类品种，股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，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%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。本基金的标的指数为沪深300指数，及其未来可能发生的变更。

主要投资策略	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。本基金可投资存托凭证。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
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。

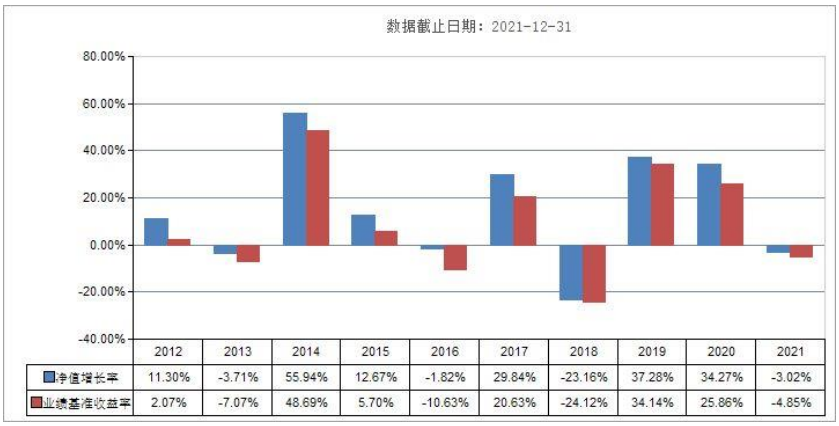
注：投资者可阅读《招募说明书》基金的投资章节了解详细情况。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
净值增长率	11.30%	-3.71%	55.94%	12.67%	-1.82%	29.84%	-23.16%	37.28%	34.27%	-3.02%
业绩基准收益率	2.07%	-7.07%	48.69%	5.70%	-10.63%	20.63%	-24.12%	34.14%	25.86%	-4.85%

注：根据中国证监会2013年6月7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7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、基金的费用、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7日生效。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。
基金合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算。基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额（S）或金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
申购费（前收费）	0 元 ≤ M < 100 万元	1.50%	非特定投资群体
	100 万元 ≤ M < 500 万元	1.20%	非特定投资群体
	500 万元 ≤ M < 1,000 万元	0.30%	非特定投资群体
	M ≥ 1,000 万元	按笔收取，1000 元/笔	非特定投资群体
	0 元 ≤ M < 100 万元	0.15%	特定投资群体
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.12%	特定投资群体
	500 万元 ≤ M < 1,000 万元	0.03%	特定投资群体
	M ≥ 1,000 万元	按笔收取，1000 元/笔	特定投资群体
赎回费	0 天 < N ≤ 6 天	1.50%	
	7 天 ≤ N ≤ 364 天	0.50%	
	365 天 ≤ N ≤ 729 天	0.25%	
	N ≥ 730 天	0.00%	

注：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。

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.80%
托管费	0.15%
其他费用	指数许可使用费、信息披露费、审计费等，详见招募说明书“基金的费用与税收”章节。

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资本基金可能遇到的风险包括：本基金特有风险、市场风险、管理风险、流动性风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险、交易对手风险、其他风险等。本基金特有风险包括：1、与指数化投资相关的特定风险，包括标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、标的指数变更的风险、量化增强策略的风险等；2、采用量化

策略进行投资管理可能引致的特定风险，包括数据错误风险、模型风险等；3、本基金投资特定品种（包括股指期货、资产支持证券、科创板股票、存托凭证等）的特有风险等。

（二）重要提示

中国证监会对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核准，并不表明其对本基金的价值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。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。各方当事人因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商未能解决的最终将通过仲裁方式处理，详见《基金合同》。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.efunds.com.cn][客服电话:4008818088]

1、基金合同、托管协议、招募说明书

2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料