

易方达重组分级 (161123) 基金概况：

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。

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（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、银行存款等固定预期年化预期收益类品种，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。

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、实现保值和锁定预期年化预期收益。

(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。

预期年化预期收益分配原则

本基金存续期内不进行预期年化预期收益分配。

易方达重组分级（161123）基金费率：

前端认购费率：

0.0≤万元 < 100.0	100.0≤万元 < 200.	200.0≤万元 < 500.	500.0≤万元
	0	0	
1.00%	0.60%	0.30%	1000.0元

申购限制：

100元	100元	--
100元	100元	

前端赎回费率：

0≤日≤364	365≤日≤729	730≤日
0.50%	0.25%	0.00%

赎回限制：

100份
0份

其他费用：

0.00%
1.00%
0.22%

拓展阅读

[易方达科讯基金重仓股及基金持仓一览](#)
[易方达并购重组等三只分级基金今日上市](#)
[易方达重组分级\[161123\]历史基金净值一览](#)