（上接B174版）

本基金将充分发挥研究团队自下而上的选股能力，基于对个股深入的基本面研究和细致的实地调研，精选股票构建股票投资组合。具体分以下几个层次：

1）品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的公司，构建备选股票池。主要筛选指标包括：

●盈利能力指标（如P/E、P/Cash Flow、P/FCF、P/S、P/EBIT等）

●经营效率指标（如ROE、ROA、Return on operating assets等）

●财务状况指标（如D/A、流动比率等）

2）价值评估

股票估值水平的高低将最终决定投资回报率的高低。由于驱动公司价值创造的因素不同，本基金将借鉴市场通用估值理念，针对不同类型公司以及公司发展中所处的不同阶段，采用不同的价值评估指标（如PE、PB、EV/EBITDA、DCF模型等）对公司的内在价值进行评估，筛选出估值具有吸引力的公司作为投资目标。

最后，本基金根据对个股价值的评估和市场机会的判断构建股票组合，其中投资于消费服务类行业的公司股票不低于非现金基金资产的80%。

3、债券投资

在债券投资方面，本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金的债券投资采取主动的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。

在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

4、权证投资

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

5、资产支持证券投资

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

6、股指期货投资

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。”

4、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：“沪深300行业分层等权重指数收益率×95%＋银行活期存款利率(税后)×5%。

沪深300行业分层等权重指数由中证指数有限公司编制和计算，沪深300行业分层等权重指数与沪深300指数拥有相同的成份股。不同的是，沪深300指数采用自由流通调整市值加权，而沪深300行业分层等权重指数采用了行业分层等权重加权，具体做法是：它先将行业等权，然后将行业内的个股再等权。沪深300行业分层等权重指数展现出了与沪深300指数不同的风险收益特征，以满足投资人日益多元化的投资选择。

由于本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，因此本基金业绩比较基准中同时加入了银行活期存款利率(税后)。本基金认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后本基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数；或者今后证券市场中有其他代表性更强的业绩比较基准推出时，本基金管理人在征得基金托管人同意的情况下，履行适当程序后按实际情况变更基金的标的指数和业绩比较基准。”

转型后的业绩比较基准拟修改为：“85%×中证内地消费主题指数+15%×中信标普全债指数

其中股票投资比较基准为中证内地消费主题指数，债券投资比较基准为中信标普全债指数。

本基金股票部分主要投资于消费服务行业股票。中证内地消费主题指数从中证 800成份股中，选取可选消费、主要消费板块中市值最大的50 只消费类股票组成，主要覆盖食品饮料、交运设备、商业贸易、农林牧渔、纺织服装、医药生物等行业，反映沪深A 股市场中消费主题类公司股票的整体表现，较为适合作为本基金股票组合的业绩比较基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。”

5、风险收益特征

本基金的风险收益特征为：“本基金属于股票基金，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。”

转型后的风险收益特征拟修改为：“本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。”

6、鉴于投资策略进行了修改，投资决策依据和投资流程也不再适用，需进行相应修改，转型后的投资决策依据和投资流程拟修改为：

“1、投资决策依据

（1）国家有关法律法规和基金合同的有关规定；

（2）公司投资及风险控制政策；

（3）宏观经济发展态势、证券市场运行环境和走势，以及上市公司的基本面；

（4）投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系，本基金将在承担适度风险的范围内，选择收益风险配比最佳的品种进行投资。

2、投资决策机制

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会的主要职责是对基金的资产配置提出指导性意见，审批重大单项投资决定，审视投资组合风险状况等。投资总监是投资决策委员会的执行代表。

基金经理的主要职责是在投资决策委员会确定的资产配置范围内构建和调整投资组合，并向中央交易室下达投资指令。

中央交易室负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控功能，保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

3、投资管理流程

投资决策委员会是本基金的最高决策机构，投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下：

（1）研究部宏观分析师、策略分析师、行业分析师、信用分析师、数量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资决策提供依据；

（2）投资决策委员会每月召开投资决策会议，对资产配置比例提出指导性意见，并讨论股票、债券的投资重点等；

（3）基金经理根据投资决策委员会决议，依据宏观分析师、策略分析师的宏观经济分析和策略建议、行业分析师的行业分析和个股研究、信用分析师的债券市场研究和券种选择、数量分析师的定量投资策略研究，结合本基金产品定位及风险控制的要求，在权限范围内制定具体的投资组合方案；

（4）基金经理根据基金投资组合方案，向中央交易室下达交易指令；

（5）交易指令通过风控系统的自动合规核查后，由中央交易室执行，中央交易室对交易情况及时反馈；

（6）基金经理对每日交易执行情况进行回顾，并审视基金投资组合的变动情况；

（7）风险管理部定期完成有关投资风险监控报告，量化投资部定期完成基金业绩评估报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序作出调整。”

7. 鉴于投资目标、投资范围、投资策略进行了修改，原“(七)投资组合管理”不适用于转型后的新基金，将一并删去。

8、投资限制

本基金的投资限制是：

“1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

(2)本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

(6)本基金投资于沪深300行业分层等权重指数的成份股及其备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%，持有现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；

(7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(8)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

(10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(11)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(12)基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(13) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

(14)本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

如果法律法规或监管部门对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效日起开始。

2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1)承销证券；

(2)向他人贷款或者提供担保；

(3)从事承担无限责任的投资；

(4)买卖其他基金份额，但是法律法规或国务院另有规定的除外；

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8)依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。”

转型后的投资限制拟修改为：

“1.组合限制

本基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产占基金资产的80%－95%，其中投资于消费服务类行业的公司股票不低于非现金基金资产的80%；其余资产投资于债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、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证券品种；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（7） 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（10）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（14）基金总资产不超过基金净资产的140%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购到期后不得展期；

（15）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

（16）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（17）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（18）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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即占基金资产的80%－95%；

（19）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（20）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

因证券/期货市场波动、上市公司/证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金转型实施日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效日起开始。

法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1)承销证券；

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3)从事承担无限责任的投资；

(4)买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5)向其基金管理人、基金托管人出资；

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则在履行适当程序后，本基金投资不再受上述规定的限制。”

（四）调整基金资产的估值方法

1、在估值对象中增加“股指期货合约”，并在估值方法中新增股指期货合约的估值方法：

“本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。”

2、删除“基金资产的估值”章节项下“(八)特殊情况的处理”中的第2点：“2.对于因当季已计提的标的指数许可使用费累计不足该项费用的收取下限而在当季补提差额部分的情形，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。”

（五）调整基金费用

1、基金费用的种类中删除“3.基金标的指数许可使用费”，基金费用计提方法、计提标准和支付方式部分删除“3.基金标的指数许可使用费”。

2、基金管理人的管理费

本基金管理费的计算为：“在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值”

转型后拟修改为：“自基金转型实施日起，在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值”

3、基金托管人的托管费

本基金托管费的计算为：“在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值”

转型后拟修改为：“自基金转型实施日起，在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值”

4、申购费用

本基金的前端申购费率为：

	申购金额(含申购费)	前端申购费率
申购费率(前端)	50万元以下	1.2%
	50万元(含)至100万元	0.8%
	100万元(含)至200万元	0.6%
	200万元(含)至500万元	0.4%
	500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

通过基金管理人直销柜台申购本基金前端基金份额的养老金客户特定申购费率如下表：

	申购金额(含申购费)	前端特定申购费率
特定申购费率(前端)	50万元以下	0.48%
	50万元(含)至100万元	0.32%
	100万元(含)至200万元	0.24%
	200万元(含)至500万元	0.16%
	500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

转型后拟修改为：

	申购金额(含申购费)	前端申购费率
申购费率(前端)	50万元以下	1.5%
	50万元(含)至100万元	1.2%
	100万元(含)至200万元	0.8%
	200万元(含)至500万元	0.5%
	500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

通过基金管理人直销柜台申购本基金前端基金份额的养老金客户特定申购费率如下表：

	申购金额(含申购费)	前端特定申购费率
特定申购费率(前端)	50万元以下	0.6%
	50万元(含)至100万元	0.36%
	100万元(含)至200万元	0.16%
	200万元(含)至500万元	0.12%
	500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

本基金的后端申购费率为：

	持有期限	后端申购费率
申购费率(后端)	1年以内(含)	1.4%
	1年—3年(含)	1.0%
	3年—5年(含)	0.5%
	5年以上	0

转型后拟修改为：

	持有期限	后端申购费率
申购费率(后端)	1年以内(含)	1.8%
	1年—3年(含)	1.2%
	3年—5年(含)	0.6%
	5年以上	0

5、赎回费用

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，赎回费用的25%归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率如下：

	持有期限	赎回费率
赎回费率	1年以内(含)	0.5%
	1年—2年(含)	0.2%
	2年以上	0

转型后拟修改为：

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，对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费，对持续持有期大于等于7日但少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于30日但少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期大于等于3个月但少于6个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产；其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率如下：

	持有期限	赎回费率
赎回费率	7日以内	1.5%
	7日(含)—30日	0.75%
	30日(含)—1年	0.5%
	1年(含)—2年	0.25%
	2年以上(含)	0

（六）修改“基金份额持有人大会”章节部分条款

1、增加“持有人大会二次召集”相关内容

根据2013 年6 月1 日生效的《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)，在“(五)基金份额持有人出席会议的方式”中将现场开会方式和通讯开会方式如下内容：“未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在25个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。”分别修改为：“若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效基金份额应不少于在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。”和“若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表基金总份额三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。”

2、修改份额持有人大会决议生效相关内容

根据2014 年8月8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》，将“(九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式：1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效并执行。”修改为：“(九)基金份额持有人大会决议的生效与公告：1.基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。”，并相应修改基金合同涉及的其他有关持有人大会决议的生效、备案条款。

（七）其他修改内容

为使《基金合同》适应新的法律法规要求和业务需要，在根据上述转型方案的要点修改《基金合同》的同时，对《基金合同》其他部分条款一并进行了修改。修改内容具体见附录的“《基金合同》修改对照表”。

（八）本次基金转型及基金合同修改如获得基金份额持有人大会审议批准，为了基金转型期间平稳运作，基金管理人提请基金份额持有人大会同意，在基金份额持有人大会决议生效日起至基金转型实施日止的期间，本基金的股票投资比例可不受《基金合同》约定的“本基金投资于沪深300行业分层等权重指数的成份股及其备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%”的比例限制。

（九）授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同修改的有关具体事宜

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人在转型实施前预留不少于二十个开放日供基金份额持有人选择赎回的前提下，办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金基金合同》经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章，自基金转型实施日起生效，《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

三、基金管理人对基金转型及基金合同修改相关情况的说明

（一）交银施罗德300等权指数基金基本情况

交银施罗德300等权指数基金于2012 年5 月7日获中国证监会证监许可【2012】626号文批准募集。

交银施罗德300等权指数基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，交银施罗德300等权指数基金《基金合同》于2012年11月7日生效。

（二）基金转型法律方面的可行性

本基金由被动型股票基金转型为主动管理型股票基金，变更了基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、投资限制、基金的估值、基金的费用等，属于《基金合同》的变更。根据《基金合同》第十九章“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”一章的规定，“基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意”。且本次基金份额持有人大会决议按一般决议处理，需经参加本次持有人大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方可生效。因此，本次基金转型相应修改《基金合同》不存在法律方面的障碍。

（三）基金转型运作方面的可行性

为实现基金转型的平稳过渡，本基金管理人已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备方面进行了深入研究，经与基金托管人的沟通和协作，做好了基金转型的相关准备。本次基金转型不存在技术方面的障碍。

（四）基金管理人修订合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订《基金合同》。

三、基金转型的主要风险及预备措施

（一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要参加大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）方可举行。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将通过各种渠道联系基金份额持有人，积极邀请基金份额持有人自行或委托他人进行投票。

如有必要，基金管理人将推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如在投票表决截止日后，因不符合上述条件本次基金份额持有人大会确实未能成功召开，那么根据2013年6 月1 日生效的《基金法》，基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就该次大会议案二次召集基金份额持有人大会。

（二）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范《基金合同》的修订方案被持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对《基金合同》的修订方案进行适当的调整，并重新公告。基金管理人可以在必要的情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

本次基金份额持有人大会如确实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。

（三）基金转型后投资相关内容和风险收益特征发生变化的风险

本基金转型成为主动管理的股票型基金，与原基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制将不同，风险收益特征也将发生变化，提示投资者关注基金转型事项。

（四）基金转型后遭遇大规模赎回的流动性风险

为应对基金转型可能引发的大规模赎回，本基金会尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性以应对可能的赎回，降低净值波动率。

在全部基金份额均被赎回的情形下，本基金将进入财产清算程序。

（五）预防及控制基金转型过程中的操作及市场风险

为维护基金份额持有人利益，对于基金转型过程中可能发生的较大规模的申购赎回或市场风险对基金净值造成大幅波动，基金管理人将根据申购赎回情况及时对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制基金的市场风险。

五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理：

交银施罗德基金管理有限公司

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），(021)61055000

网址：www.fund001.com，www.bocomschroder.com

特此说明。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一五年四月二十二日

附录：《基金合同》修改对照表

原《基金合同》与调整后《基金合同》前后条文对照表

章节	原《基金合同》条款	调整后《基金合同》条款
全文	指定媒体	指定媒介
一、前言	2.订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2.订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。
一、前言	(三) 交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。 中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。	(三) 交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金由交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型而来，交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金经中国证监会变更注册，转型为交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金。 中国证监会对本基金募集的核准以及变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。 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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。 投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。
一、前言	(四)基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。基金合同应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致基金合同的内容与届时有效的法律法规的规定存在冲突之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准。	(四)基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。
一、前言		(五) 本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。
二、释义	1.基金或本基金：指交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金	1.基金或本基金：指交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金，本基金由交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型而来
二、释义	4.基金合同或本基金合同：指《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充	4.基金合同或本基金合同：指《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充，本基金合同由《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同》修订而成，本基金合同中与基金募集发售等相关的内容仅适用于原交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金，对变更后的交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金不适用
二、释义	5.托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《交银施罗德证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充	5.托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充，本基金托管协议由《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金托管协议》修订而成
二、释义	6.招募说明书：指《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新	6.招募说明书：指《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新，本基金招募说明书由《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金（更新）招募说明书》修订而成
二、释义	7.基金份额发售公告：指《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金份额发售公告》	删除。
二、释义	9.《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订	8.《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，并经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及其后颁布机关对其不时做出的修订
二、释义	10.《销售办法》：指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	9.《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
二、释义	12.《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	11.《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
二、释义	19.合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者	18.合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
二、释义	增加。	19.人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行中国境内证券投资的境外机构投资者
二、释义	20.投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称	20.投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
二、释义	22.基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金、发售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务	22.基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金、销售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
二、释义	23.销售机构：指直销机构和代销机构	23.销售机构：指交银施罗德基金管理有限公司以及