大成基金管理有限公司关于召开大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的第二次提示性公告

大成基金管理有限公司于2014年1月23日在《证券时报》及本公司网站（www.dcfund.com.cn）发布了《大成基金管理有限公司关于召开大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的公告》，并于1月24日发布了第一次提示性公告。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、会议基本情况

为优化基金的投资目标与投资策略，维护基金持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》的有关规定，大成中证内地消费主题指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的管理人大成基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型方案等相关事宜，将本基金转型成为“大成消费主题股票型证券投资基金”。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：2014年2月22日起，至2014年3月7日17:00止（以本通知列明的公证机关指定的表决票收件人收到表决票的时间为准）

3、会议通讯表决票的寄达地点

收件人：大成基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心1601室

邮政编码：100035

联系人：刘宜

联系电话：400-888-5558，010-88009300

传真：010-85252282

请在信封背面注明：“大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”

其他形式的会议通讯表决票按本公告规定的方式提交或发送至基金管理人或其指定的系统，并在公证机关的监督下进行统计。

二、会议审议事项

本次持有人会议审议事项为《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型相关事项的议案》（见附件一）

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2014年2月21日，即该日在大成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或其委托代理人享有本次会议的表决权。

四、投票方式

（一）纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。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（www.dcfund.com.cn）等方式下载并打印表决票。

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正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“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行政机关、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）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件、护照或其他有效证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）基金份额持有人可根据本公告第五章节规定的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“第五章节第（三）条授权方式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，但下述“第（4）项”另有规定的除外；

（4）基金份额持有人通过本公告规定的电话授权方式或短信授权方式授权基金管理人投票的，接受有效委托的基金管理人应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。

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2014年2月22日起，至2014年3月7日17:00以前（以本次大会公证机关指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人：

收件人：大成基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心1601室

邮政编码：100035

联系人：刘宜

联系电话：400-888-5558，010-88009300

传真：010-85252282

（二）电话投票

为方便基金份额持有人参与大会投票，自2014年2月22日起，至2014年3月7日17:00以前（以基金管理人系统记录时间为准），基金份额持有人可拨打基金管理人客服电话并按提示转入工坐席进行投票。

基金管理人也将主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，由人工坐席根据客户意愿进行投票记录从而完成投票。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话投票的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

（三）短信投票

为方便基金份额持有人参与大会，自2014年2月22日起，至2014年3月7日17:00以前（以基金管理人系统记录时间为准），基金管理人提供以下短信通道供投资者进行投票。

基金管理人通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集投票短信，持有人回复短信表明表决意见。

基金份额持有人通过短信投票的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行投票。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行投票，请投资者采用纸质或电话方式进行投票。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，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符合以下规则：

（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。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的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可通过纸面、电话和短信等其他法律法规和中国证监会认可的授权方式授权受托人代为行使表决权。

基金份额持有人通过纸面方式授权的，授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（www.dcfund.com.cn）等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人通过非纸面方式授权的，授权形式及程序应符合本通知的规定。基金份额持有人通过非纸面方式授权仅限授权给基金管理人。

1、纸面方式授权

（1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

1）个人基金份额持有人委托他人授票的，受托人应提供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三的样本），并提供基金份额持有人的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、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

2）机构基金份额持有人委托他人授票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）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、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

2、电话授权方式

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人可拨打基金管理人客服电话并按提示转人工坐席进行授权。

基金管理人也将主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，由人工坐席根据客户意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。电话授权仅支持授权给基金管理人模式。

基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

3、短信授权

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人提供以下短信通道供投资者进行授权。

基金管理人将通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集授权短信，持有人回复短信表明表决意见。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。短信授权仅支持授权给基金管理人模式。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行授权。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行授权，请投资者采用纸质或电话方式进行授权。

4、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额在包括有效纸面方式授权和其他非纸面方式有效授权的，以有效的纸面授权为准。多次以有效纸面方式授权的，以时间在最后的一次纸面授权为准。同时多次以有效纸面方式授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

（2）如果同一基金份额在只存在有效纸面方式授权时，委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权；

（3）如果同一基金份额无有效纸面方式授权，但存在任意一种有效的其他非纸面方式授权的，以该种有效的其他非纸面方式的授权为准；

（4）如果同一基金份额以非纸面方式进行多次授权的，以时间在最后的授权为准。同时多次以非纸面方式进行授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

（5）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，视为无效授权。

（6）如委托人既进行委托授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

六、会议召开的条件和表决票数要求

本次会议召开的条件为：本人或委托他人代表出具有效表决意见的基金份额持有人持有的基金份额不少于权益登记日本基金基金总份额的50%（含50%）。

本会议表决的票数要求为：基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权，不足一份的基金份额不具有表决权。本次议案按一般决议处理，须经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效。

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或备案，基金份额持有人大会决定的事项自在中国证监会核准或完成备案手续之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

七、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（中国农业银行股份有限公司）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）纸面表决票通过专人送交、邮寄或传真送达本公告规定的收件人的，表决时间以收到时间为准；通过其他非纸面方式表决的，表决时间以系统记录时间为准。2014年3月7日17:00以后送达基金管理人的，为无效表决。

（2）如果同一基金份额存在包括有效纸面方式表决和其他非纸面方式有效表决的，以有效的纸面表决为准。

（3）纸面表决票的效力认定

纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，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。

如纸面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。

如纸面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，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，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。

基金份额持有人重复提交纸面表决票的，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，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准，传真的以本公告规定的收件人传真接收到的时间为准。

（4）如果同一基金份额以非纸面方式进行多次表决的，以时间在最后的表决为准。

八、本次大会相关机构

1、召集人：大成基金管理有限公司

联系地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

联系人：肖冰

联系电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

客户服务电话：400-888-5558

网址：www.dcfund.com.cn

2、监督人：中国农业银行股份有限公司

联系地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层

联系人：李芳菲

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

3、公证机构：北京市方圆公证处

地址：北京市东城区朝阳门内大街东水井胡同5号北京INN大厦B502室

联系人：张浩 甄真

电话：010-85197533

邮政编码：100010

4、见证律师：北京市金杜律师事务所

注册及办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

负责人：王玲

联系电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

联系人：冯艾

经办律师：靳庆军、冯艾

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-5558咨询。

3、本基金份额持有人大会召开期间，本基金日常申购赎回业务照常进行，投资者可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回。

4、本通知的有关内容由大成基金管理有限公司负责解释。

大成基金管理有限公司

二〇一四年一月二十七日

附件一：《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型相关事项的议案》

附件二：《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型方案说明书》

附件一：《关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型相关事项的议案》

大成中证内地消费主题指数证券投资基金份额持有人：

为优化基金的投资目标与投资策略，维护基金持有人利益，提高产品的市场竞争力，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》和《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定，基金管理人经与本基金的基金托管人中国农业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，审议本基金转型事宜，将本基金转型为大成消费主题股票型证券投资基金。基于此次基金转型事宜，需要对本基金基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款以及因法律法规、业务规则变更而对基金合同部分条款进行修改。《大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型方案说明书》见附件四。

为实施大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型，提议授权基金管理人办理本次大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型的有关具体事宜，包括但不限于可以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根据《大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型方案说明书》对《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》等法律文件进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：大成基金管理有限公司

二〇一四年一月二十三日

附件二：《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

基金份额持有人名称：

证件号码(身份证件号/营业执照号)：

基金帐号：

表决事项：关于大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型相关事项的议案

表决结果：

□同意　　□反对　　□弃权

机构基金份额持有人签章栏个人基金份额持有人签字栏

单位公章：签字：

日期：日期：

说明：

1、请就表决内容表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见，否则表决票无效；

2、未填、错填、字迹无法辨认或意愿无法判断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”。

3、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：《授权委托书》

兹全权委托　　先生／女士或　　单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为2014年3月7日17:00的以通讯方式召开的大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金份额持有人大会，并代为行使表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

委托人签名/盖章：

委托人身份证明名称及编号：

基金帐号（如有多个，请逐一填写）：

受托人签章（受托人为自然人则签字/受托人为机构则盖公章）：

受托人身份证号码或营业执照注册号：

委托日期：　年　月　日

（本授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效）

附件四：《大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型方案说明书》

大成中证内地消费主题指数证券投资基金（以下简称“本基金”）于2011年11月8日成立，大成基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）为本基金的管理人，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）为本基金的托管人。

鉴于目前基金市场需求的变化，为维护基金持有人利益，提高产品的市场竞争力，依照《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》和《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，提议对本基金实施转型。

本次大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型方案应当经参加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%)通过方为有效，故本转型方案存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会表决通过的决议需报告中国证监会核准或备案后生效。中国证监会对本次大成中证内地消费主题指数证券投资基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或基金的价值或者投资者的收益做出实质性判断或保证。

一、基金转型的方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“大成中证内地消费主题指数证券投资基金”变更为“大成消费主题股票型证券投资基金”。

（二）变更基金类别

基金类别由“股票型指数基金”变更为“股票型基金”

（三）修改投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、业绩比较基准等

1、投资目标

基金投资目标由“通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，紧密跟踪标的指数，追求指数投资偏离度和跟踪误差最小化。”

变更为“本基金主要投资于消费行业相关的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。”

2、投资理念

基金投资理念由“指数化投资可以在有效分散风险的基础上，以较低的成本获取市场平均回报，有助于投资人实现财富与中国经济及资本市场同步增长的目标。中国经济的持续较快发展、消费能力的提升和经济结构转型为消费行业发展以及以此为基础的行业指数化投资构筑了坚实基础。本基金通过完全复制法跟踪标的指数，力求获得标的指数所代表的平均收益率，以使投资者分享中国消费行业发展的中长期成长收益。”

变更为“中国经济结构的战略性转型，消费将逐渐成为我国经济增长的重要引擎，也将成为我国证券市场发展的重要驱动因素。本基金将精选具有良好基本面和成长潜力的消费行业相关的优质上市公司，通过基本面分析和积极的主动管理构建投资组合，以期取得基金资产的长期增值，分享经济结构转型中消费行业上市公司高成长带来的超额收益。”

3、投资范围

基金投资范围由“本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股（包括中小企业板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

其中，投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。”

变更为“本基金的投资对象为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中期票据）、权证、股指期货及法律、法规或监管机构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）。

本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于消费行业相关上市公司股票不低于非现金资产的80%；现金、债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为5%-40%，其中现金或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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。”

4、投资策略

由于基金类别、投资目标、投资范围、投资理念进行了变更，投资策略进行了相应修改，修改后的投资策略如下：

“本基金采用主动投资策略。以宏观经济分析和政策研究为基础，通过分析影响中国证券市场整体运行的内外部因素，实施大类资产配置；分析各个消费子行业在中国经济转型不同阶段行业景气度变化情况和发展趋势，实施行业配置；在各个行业内通过对公司基本面的考量，精选优质上市公司股票，构建投资组合。

为有效控制投资风险，本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资，股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。

（1）大类资产配置

本基金以股票投资为主，但为规避市场系统性风险，保障基金资产的长期稳健增值，本基金实施适度的战略或战术性类别资产配置。本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及现金等大类资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。在大类资产调整过程中，本基金将在法律法规和基金合同规定范围内，适度运用股指期货的套期保值功能，控制投资组合的系统性风险暴露。

本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、市场投资价值、资金供求因素、证券市场运行内在动量等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。宏观经济环境方面，主要是对证券市场基本面产生普遍影响的宏观经济环境进行分析，研判宏观经济运行趋势以及对证券市场的影响。政策因素方面，主要是对影响经济结构、金融和证券市场的政策进行前瞻性分析，研究政策对不同类别资产的影响。市场利率水平方面，主要分析市场利率水平的变化趋势及对固定收益证券的影响。资金供求因素方面，主要分析证券市场供求的平衡关系。投资价值方面，主要研究各类证券市场的整体内在价值的变化和估值水平的相对变化。市场运行内在动量方面，主要分析证券市场自身的内在运行惯性与回归（规律），发现驱动证券市场向上或向下的市场因素。

通过上述因素的综合分析，判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例。此外，本基金还将利用基金管理人在长期投资管理过程中所积累的经验，根据市场突发事件、市场非有效例外效应等所形成的市场波动做战术性资产配置调整。

（2）股票投资策略

本基金主要投资于消费行业相关的优质上市公司。本基金对消费行业的定义是指为居民日常生活提供商品或服务的行业，包括传统消费行业和外延消费行业。传统消费行业主要由必需消费和可选消费两个行业组成，必需消费行业指居民基本生活中必不可少的商品和服务，具体指按照中证行业分类体系定义的必需消费一级行业，包括食品与主要用品零售、饮料、食品、家常用品、个人用品等子行业；可选消费行业是指居民用于改善生活质量的商品和服务，具体指按照中证行业分类体系定义的可选消费一级行业，包括汽车与汽车零部件、家庭耐用消费品、休闲设备与用品、纺织品、服装与奢侈品、酒店、餐饮与休闲、综合消费者服务、媒体、经销商、百货商店和专营零售等子行业；外延消费行业是指居民日常生活中直接或间接使用的其他商品或服务，其主要的收入及盈利来源与居民消费具有较高的关联程度，包括中证医药卫生一级行业、中证金融地产一级行业、中证信息技术一级行业和中证电信业务一级行业。

本基金的股票策略采取自上而下为主、自下而上为辅的积极管理策略，深入分析消费行业的发展前景，挖掘受益于国家消费政策、行业规模增长和消费结构变化的子行业和上市公司，从而更好地分享消费需求提升、消费升级背景下公司高成长带来的超额收益。

公司基本面研究主要包括公司在内需增长背景下的成长性评估和投资价值评估。成长性评估将首先研究基于我国处于消费需求增加和消费升级背景下产业政策、消费趋势、供应商力量、行业壁垒、商业模式与技术变迁等因素对行业竞争格局演变的影响，然后分析公司战略、资源与能力等方面的优势，评判公司的行业竞争地位以及业绩驱动因素，最后运用主营业务收入、EBITDA、净利润等的预期增长率指标，结合公司营运指标（如固定资产周转率等）以及经营杠杆指标（如权益乘数等），对公司盈利的持续增长前景进行综合评价。投资价值评估是根据一系列历史和预期的财务指标，结合定性考虑，分析公司盈利稳固性，判断相对投资价值，主要指标包括：EV/EBITDA、EV/Sales、P/E、P/B、P/RNAV、股息率、ROE、经营利润率和净利润率等。分析师将根据行业特点选择合适的指标进行估值。

（3）债券投资策略

主要通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等策略配置债券资产，力求在保证资产总体的安全性、流动性的基础上获取稳定收益。

1）利率预测分析

准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益。当预期利率下调时，适当加大组合中长久期债券的投资比例，为债券组合获取价差收益；当预期利率上升时，减少长久期债券的投资，降低债券组合的久期，以控制利率风险。

2）收益率曲线变动分析

收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。通过预测收益率曲线形状的变化，调整债券组合内部品种的比例，获得投资收益。

3）债券信用分析

通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行深入、细致的调研，准确评价债券的违约概率，提早预测债券评级的改变，捕捉价格优势或套利机会。

4）收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间、不同市场的同一品种之间、不同市场不同板块之间的收益率利差的基础上，采取积极投资策略，选择适当品种，获取投资收益。

（4）权证投资

在控制投资风险和保障基金资产安全的前提下，对权证进行投资，争取获得较高的回报。权证投资策略主要为：采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资的价值基准，并根据权证标的股票基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证趋势投资。

（5）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

基金管理人依据对股市未来趋势的研判、本基金的风险收益目标以及投资组合的构成，决定是否对现有股票组合进行套期保值以及采用何种套期保值策略。

在套期保值过程中，基金管理人将不断精细和不断修正套保策略，动态管理套期保值组合。主要工作包括，基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理；对投资组合beta系数的实时监控，全程评估套期保值的效果和基差风险，当组合beta值超过事先设定的beta容忍度时，需要对套期保值组合进行及时调整；进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。”

5、修改投资决策程序、投资限制和禁止行为

根据对基金投资范围、投资策略的修改，相应调整了投资决策程序、投资组合限制和禁止行为条款。修改后的基金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）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

（3）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%。在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（4）本基金参与股票发行申购，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；

（5）任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金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%；

（6）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定。

（7）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%；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，不得超过该基金资产净值的10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%。

（8）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%；

（9）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100%；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；

（10）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%；

（11）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约价值不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（12）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的10%；

（13）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

（14）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

（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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

（5）向基金管理人、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、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

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其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。”

6、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准由“中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“中证内地消费主题指数×80%+中证综合债券指数×20%”

7、风险收益特征

风险收益特征由“本基金属股票基金，风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，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。”

变更为“本基金属于股票型基金，风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。”

（四）对基金管理费率、托管费率和申购费率进行了调整

基金费率水平调整。因基金的投资策略由被动型投资变更为主动投资，根据基金管理人和基金托管人的运作成本和行业收费水平，拟调高基金管理费率、托管费率和申购费率。

●管理费率由0.75%提高至1.5%。

●托管费率由0.15%提高至0.25%。

●取消基金指数许可使用费（0.02%，每季度5万元人民币下限）。

●申购费率由

申购金额（M，单位元）	申购费率
M<100万	1.20%
100万≤M<300万	0.80%
300万≤M<500万	0.50%
M≥500万	每笔1,000元

调整为：

申购金额（M，单位元）	申购费率
M<100万	1.50%
100万≤M<300万	1.00%
300万≤M<500万	0.50%
M≥500万	每笔1,000元

赎回费率以及其他费用收费水平不变。

（五）授权基金管理人修改基金合同等法律文件

首先，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人根据转型后基金运作的特点相应修订《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》等法律文件，并根据监管机构意见适时调整本转型方案说明书所载上述四点转型方案要点的文字表述，但该等调整不得实质性修改上述内容。

其次，自《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》生效以来，《基金法》、《证券投资基金销售管理办法》等法律法规陆续修改和实施，基金管理人需要根据法律法规要求修订《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》的相关内容。

第三，根据现行业务规则，删除基金合同中关于基金拒绝或暂停申购的情形第4点“基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；删除基金合同中关于基金暂停估值的情形第3点“占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值”和第4点“如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的”；对基金合同第二十章违约责任，在“对基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任”后添加“对损失的赔偿，仅限于直接损失。”

拟请持有人大会授权基金管理人根据上述事项修订基金合同等法律文件。修订后的基金合同等法律文件报中国证监会核准。

（六）大成消费主题股票型证券投资基金基金合同的生效

本次基金份额持有人大会决议经中国证监会备案后生效。法律法规另有规定的，从其规定。自基金持有人大会决议生效起，《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》生效，《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》同时失效，大成中证内地消费主题指数证券投资基金正式变更为大成消费主题股票型证券投资基金，本基金当事人将按照《大成消费主题股票型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。基金管理人应当自大成消费主题股票型证券投资基金基金合同生效之日起6个月内使大成消费主题股票型证券投资基金的投资组合比例符合该基金合同的有关约定。

二、基金管理人对基金转型相关情况的说明

（一）大成中证内地消费主题指数证券投资基金基本情况

大成中证内地消费主题指数证券投资基金于2011年8月1日获中国证监会证监许可【2011】1209号文批准募集。

大成中证内地消费主题指数证券投资基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。基金管理人于2011年11月8日获得中国证监会书面确认，大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同生效。

（二）基金转型法律可行性

本基金由被动型股票基金转型为主动股票型基金，变更了基金名称、基金类别、投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、基金投资组合比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、基金费率等，属于基金合同的变更。根据《大成中证内地消费主题指数证券投资基金基金合同》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，“变更基金类别，变更基金投资目标、投资范围或投资策略，提高基金管理人、基金托管人的报酬费率以及赎回费率等事项应经基金份额持有人大会决议通过”。因此，本基金管理人认为召开基金份额持有人大会审议本基金转型事宜具有法律依据和合同依据。

（三）基金转型