(上接B190版)

七、基金合同当事人及权利义务	(五)基金管理人的义务 1.依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜; 9. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定; 12.编制中期和年度基金报告; 26.基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还投资人;	(五)基金管理人的义务 1.依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜; 9.采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定; 12.编制季度、半年度和年度基金报告; 30.根据投资的需要开立股指期货业务相关账户及交易编码;
七、基金合同当事人及权利义务	(六)基金托管人的权利 3.自基金合同生效日起,依法保管基金资产; 6.根据相关市场规则,为本基金开设证券账户、为本基金办理证券交易资金清算;	(六)基金托管人的权利 3.自基金合同生效日起,依法保管基金资产; 6.根据相关市场规则,为本基金开设资金账户和证券账户等投资所需账户,协助开立股指期货业务相关账户及交易编码,为本基金办理证券/期货交易资金清算;
七、基金合同当事人及权利义务	(七)基金托管人的义务 6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户; 8.对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施; 16.按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;	(七)基金托管人的义务 6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户,协助开立股指期货业务相关账户及交易编码; 8.对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施; 16.按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
七、基金合同当事人及权利义务	(八)基金份额持有人的权利 3.依法申请赎回其持有的基金份额; 4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会; 8.对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;	(八)基金份额持有人的权利 3. 依法并按照基金合同和招募说明书的规定申请赎回或转让其持有的基金份额; 4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会; 8.对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
七、基金合同当事人及权利义务	(九)基金份额持有人的义务 1.认真阅读并遵守基金合同; 3.了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险; 5.交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用; 9.返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;	(九)基金份额持有人的义务 1.认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件; 3. 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,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; 5.缴纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用; 9.返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人、销售机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;
八、基金份额持有人大会	(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。	(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。 本基金份额持有人大会不设日常机构。
八、基金份额持有人大会	(二)召开事由 1.当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上(含10%,下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)提议时,应当召开基金份额持有人大会;	(二)召开事由 1.当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有基金份额10%以上(含10%,下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)提议时,应当召开基金份额持有人大会;
八、基金份额持有人大会	(三)召集人和召集方式 2. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召开,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。 3.代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召开,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。	(三)召集人和召集方式 2. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。 3. 代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。
八、基金份额持有人大会	(四)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。 3.如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。	(四)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。 3.如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。
八、基金份额持有人大会	(五)基金份额持有人出席会议的方式 2.召开基金份额持有人大会的条件 ①现场开会方式 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。	(五)基金份额持有人出席会议的方式 2.召开基金份额持有人大会的条件 ①现场开会方式 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的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)。
八、基金份额持有人大会	(五)基金份额持有人出席会议的方式 2.召开基金份额持有人大会的条件 ①现场开会方式 2)召集人按基金合同规定通知基金托管人或和基金管理人(分别或共同称为"监督人")到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照公证通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如监督人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力; 4)本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上; 5)直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托证明等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与注册登记机构记录相符。 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。	(五)基金份额持有人出席会议的方式 2.召开基金份额持有人大会的条件 ①现场开会方式 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。
八、基金份额持有人大会	(六)议案内容与程序 1.议事内容及提案权 ①单独或合并持有权益登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其申间间隔不少于6个月,法律法规另有规定的除外。	(六)议案内容与程序 1.议事内容及提案权 ①单独或合并持有权益登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其申间间隔不少于6个月,法律法规另有规定的除外。
八、基金份额持有人大会	(六)议案内容与程序 2.议事程序 ②通讯方式开会 在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。	(六)议案内容与程序 2.议事程序 ②通讯方式开会 在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。
八、基金份额持有人大会	(七)议决形成的条件、表决方式、程序 2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议: ②特别决议 特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。	(七)议决形成的条件、表决方式、程序 2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议: ②特别决议 特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同、本基金与其他基金合并必须以特别决议通过方为有效。
八、基金份额持有人大会	(七)议决形成的条件、表决方式、程序 3.基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。 4.采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。	(七)议决形成的条件、表决方式、程序 3.基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。 4.采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
八、基金份额持有人大会	(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。	(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。
八、基金份额持有人大会	(十)法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。	(十)部分对基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。
九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	(一)基金管理人的更换 2.基金管理人的更换程序 ③略准:新任基金管理人产生之前,由中国证监会指定临时基金管理人;更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行; 6)公告:基金管理人更换后,由基金托管人在新任基金管理人获得中国证监会核准后2日内在指定媒体上公告;	(一)基金管理人的更换 2.基金管理人的更换程序 ③略准:新任基金管理人产生之前,由中国证监会指定临时基金管理人;更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行; 6)公告:基金管理人更换后,由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介上公告;
九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	(二)基金托管人的更换 2.基金托管人的更换程序 ③略准:新任基金托管人产生之前,中国证监会指定临时基金托管人,更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行; 6)公告:基金托管人更换后,由基金管理人在新任基金托管人获得中国证监会核准后2日内在指定媒体上公告。	(二)基金托管人的更换 2.基金托管人的更换程序 ③略准:新任基金托管人产生之前,由中国证监会指定临时基金托管人,更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行; 6)公告:基金托管人更换后,由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介上公告。
九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	(三)基金管理人与基金托管人同时更换 3.公告:新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后2日内在指定媒体上联合公告。	(三)基金管理人与基金托管人同时更换 3.公告:新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介上联合公告。
十、基金的托管	基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《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》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责,确保基金财产的安全,保护基金份额持有人的合法权益。	基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责,确保基金财产的安全,保护基金份额持有人的合法权益。

十一、基金份额的登记	(四)注册登记机构承担如下义务: 3. 保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等;	(四)注册登记机构承担如下义务: 3.妥善保存登记数据,并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构,其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年;
十二、基金的投资	(一)投资目标 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。	(一)投资目标 本基金通过重点投资于与消费服务相关的优质企业,把握经济转型背景下中国消费升级蕴含的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
十二、基金的投资	(二)投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,以沪深300行业分层等权重指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、新股(首次发行或增发)、债券、货币市场工具、回购、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会批准的允许本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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为: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%,投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%,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%。	(二)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上市的股票)、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金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为: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;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,基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。 如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。
十二、基金的投资	(三)投资策略 本基金为指数型基金,绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股在沪深300行业分层等权重指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 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%,其余资产可投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、新股(首次发行或增发)、债券、货币市场工具、回购、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具,其目的是在保证基金资产流动性的前提下,有效利用基金资产,更好地实现跟踪标的指数的投资目标。 (四)业绩比较基准 本基金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,以满足投资人已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,或出其他指数替代、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。 (五)风险收益特征 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。 (六)投资决策依据和投资流程 1.决策依据 有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。 2.决策和交易机制 本基金实行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决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。 基金经理的主要职责是决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策。 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.投资程序 研究、决策、组合构建、交易、评估及组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。 ①研究支持:量化投资部依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,以作为基金投资决策的重要依据。 ②投资决策:投资决策委员会定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。 ③组合构建:根据标的指数情况,结合研究支持,基金经理构建以目标指数成分股为主的证券组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低买入成本、控制投资风险。 ④交易执行:中央交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。 ⑤绩效评估:量化投资部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。 ⑥组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数变动、结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金、现券流量情况以及组合投资绩效评估的结果等,采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。 (七)投资组合管理 1.投资组合的建立 基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。 ①确定目标组合:基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。 ②确定建仓策略:基金经理根据对成份股流动性、公司行为、基本面等因素的分析,确定合理的建仓策略。 ③逐步调整:通过完全复制法最终确定目标组合之后,基金经理在规定时间内采用适当的手段构建和调整实际组合直至达到跟踪指数要求。 2.日常投资组合管理 ①成份股公司行为信息的跟踪与分析:跟踪标的指数成份股公司行为(如:股本变化、分红、停牌、复牌等)信息,以及成份股公司其它重大信息,分析这些信息对指数的影响,进而进行组合调整分析,为投资决策提供依据。 ②标的指数的跟踪与分析:由于各种原因,跟踪标的指数的编制方法可能会发生调整,分析这种调整对跟踪标的指数的影响,并制定相应的应对方案。 ③每日申购赎回情况的跟踪与分析:跟踪本基金申购和赎回信息,分析其对组合的影响。 ④组合持有证券、现金头寸及流动性分析:基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因,并进行成份股调整的流动性分析。 ⑤组合调整: 1)利用数量化分析方法,找出将实际组合调整到目标组合的最优方案,确定组合调整及交易策略。 2)如发生成份股变动、成份股公司合并及其它重大事项,可提请投资决策委员会召开会议,决定基金的操作策略。 3)调整组合,达到目标组合的持仓结构。 ⑥复制标的指数并核对,同时根据最新的公司行为信息预测下一交易日指数结构。 ⑦对比指数与组合的每日及累计的绩效数据,检测跟踪误差及其趋势。分析由于组合每只股票构成与指数构成的差异导致的跟踪误差的程度与趋势以找出跟踪误差的来源,进而决定需要对组合调整的部分及调整方法。 ⑧根据指数跟踪研究结果及当日最新组合情况进行指数分析及组合分析并进行组合调整计算,进而制定下一个交易日的交易内容与策略。 3.定期投资组合管理 ①每月 每月末、根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求,及时检查组合中现金的比例,进行支付现金的准备。 每月末、在基金经理会议上对投资操作、组合、跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合与标的指数间的跟踪偏离度情况,找出未能有效控制较大偏离的原因。 每月,投资决策委员会可对基金的操作进行指导与决策。基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。 ②标的指数调整 根据标的指数的编制规则及调整公告,基金经理依据投资决策委员会的决策,在指数成份股调整生效前,分析并确定组合调整策略,尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。 4.投资绩效评估 ①定期对基金的绩效进行评估,主要是对跟踪偏离度进行评估; ②量化投资部对本基金的运行情况进行量化评估; ③基金经理根据量化评估报告,重点分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。 在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。	(四)注册登记机构承担如下义务: 3.妥善保存登记数据,并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构,其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年; (一)投资目标 本基金通过重点投资于与消费服务相关的优质企业,把握经济转型背景下中国消费升级蕴含的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。 (二)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上市的股票)、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金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为: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;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,基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。 如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。
十二、基金的投资	(四)业绩比较基准 本基金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,以满足投资人已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,或出其他指数替代、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。 (五)风险收益特征 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。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,或出其他指数替代、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。 (六)投资决策依据和投资流程 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策,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,在各日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。	(八)投资限制 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