(上接B58版)

传真:0755-82080798
网址:www.zlfund.cn
(94)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴永良
客服电话:400-1022-011
网址:www.zszq.com.cn
(95)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:万建华
客服电话:95521
联系人:芮敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38670161
网址:www.gtja.com
(96)中信建投股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
客服电话:4008888108
联系人:权唐
电话:010-85130577
传真:010-65182261
网址:www.csc108.com
(97)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906
法定代表人: 杨文斌
客服电话: 400-700-9665
联系人: 张茹
联系电话: 021-58870011
传真: 021-68596916
网址: www.ehowbuy.com
(98)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:祝献忠
联系人:黄恒
联系电话:010-58568062
传真:010-58568062
客户服务电话:010-58568118
网址:www.hrsec.com.cn
(99)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:常春艳
联系电话:0755-82721122
传真:0755-82029055
客户服务电话:4009200022
网址:http://licaike.hexun.com
(100)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法人代表:其实
联系人:高莉莉
电话:021-54509988
传真:021-64383798
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
(101)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
法人代表:陈柏青
联系人:张裕
电话:0571-2882935
传真:0571-26698533
客户服务电话:4000-766-123
网址: www.fund123.cn
(102)中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40层-43层
法人代表:赵大建
联系人:李微
客户服务电话:400-889-5618
网址:www.e5618.com
(二)注册登记机构
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83195229
联系人:范瑛
(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
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
电话:0755-22163333
传真:0755-22163390
经办律师:靳庆军、冯艾
联系人:冯艾
(四)会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法人代表:杨绍信
经办注册会计师:薛竞、叶尔甸
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:刘莉

四、基金的名称

本基金名称:大成强化收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:债券基金

六、基金的运作方式

本基金运作方式:契约型开放式

七、基金的投资目标

在保持资产流动性基础上通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,力争获取超过业绩比较基准的投资业绩。

八、基金的投资范围

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债券、股票、权证及法律、法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。

本基金是债券基金,对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%,主要投资于企业主体债券,包括金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券等以企业为发债主体的固定收益品种以及国债、央行票据、回购等高流动性固定收益品种。本基金投资于企业主体债券的比例范围为债券资产的30%—95%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

在满足债券投资比例要求的基础上,本基金可以投资于非债券类金融工具,包括一级市场的新股申购或增发新股、因可转债转股所形成的股票、因持仓股票所派发或因投资可分离债券而产生的权证、二级市场股票和权证等法律法规或监管机构允许投资的其他非债券类品种,用以强化本基金的获利能力,提高预期收益水平。其中,直接通过二级市场购买的股票限于沪深300指数成份股,且股票投资比例不高于基金资产的20%;权证投资比例不高于基金资产净值的3%。

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。

九、基金的投资策略

本基金将在严格控制组合风险的前提下,基于收益的要求,在资产配置、个券选择和交易策略层面上实施积极管理策略,以期在承担有限风险的前提下获得较高投资收益。

1. 资产配置

本基金将在基金合同约定的投资范围内实施稳健的战略资产配置,确保投资组合整体的安全性和流动性,并在此基础上进行积极的战术资产配置,通过预测各类别资产(包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等)中短期回报率变化,不断优化各类别资产配置比例,规避市场短期波动风险,获取超额收益。

2. 固定收益类资产投资策略

本基金对固定收益类资产实施自上而下的、积极的投资策略。在确定目标久期、类属资产配置后,综合采用多种投资策略甄选个券,构建固定收益类资产组合。

(1)利率预期策略

利率风险是债券投资面临的主要风险,衡量债券利率风险最有效的指标是久期。本基金将以“目标久期”管理作为利率预期策略的核心内容,通过深入分析宏观经济运行状况、财政政策、货币政策,判断利率变化的方向和时间。利用情景分析,模拟利率变化幅度的各种情形,考察投资基准和投资组合在收益率曲线变化时的风险收益特征及久期情况,根据组合的风险承受能力确定组合的目标久期区间。通过对利率变化方向和时间、目标久期区间的分析,借助市场收益率曲线结构分析和市场信用利差结构分析,确定资产配置的组合久期,有效控制风险,获取投资收益。

(2)类属配置策略

类属配置的结果决定了债券组合在不同风险类属资产之间的分配比例和债券的期限配置,是影响债券投资业绩的重要因素。本基金将在确定目标久期后,通过对宏观经济、市场利率、债券供求等的分析,预测各类属资产预期风险及收益情况,综合考虑债券品种期限和不同债券市场流动性及收益性现状,制定债券品种期限配置策略,确立不同债券市场投资比例,确定债券组合资产在政府债券、企业主体债券、货币资产之间的分配比例。

(3)信用利差策略

本基金主要投资于企业主体债券,包括金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券等以企业为发债主体的固定收益品种,因而信用风险将是本基金投资管理所面临的另一主要风险。本基金将根据宏观经济运行状况、发行主体所属行业发展周期、业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评估发行主体信用风险,确定信用产品的信用风险利差,有效管理组合的整体信用风险。

随着债券市场的发展,各种级别的信用产品(主要是政府信用债券与企业主体债券、各类企业主体债券之间)会形成一个不同收益率水平的利差结构体系。在正常条件下,由信用风险形成的收益率利差是稳定的,但在特定条件下,比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时,这种稳定关系将被打破。提前预测并进行交易,就可能获得套利收益或者减少损失。本基金将主要利用定性与定量相结合的方式,综合考虑监管环境、市场供求关系、行业分析,并运用财务数据统计模型和现金流分析模型等对整个市场的信用利差结构进行全面分析,在有效控制整个组合信用风险的基础上,采取积极的投资策略,发现价值被低估的信用类债券产品,挖掘投资机会,获取超额收益。

(4)敏感度指标策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种,兼具股性和债性的双重特征,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换债券条款和发行主体基本面进行深入研究的基础上,以敏感度指标(Delta等)作为市场风险控制的主要技术指标,利用可转换债券溢价率来判断转债的股性,积极管理,获取超额收益。

(5)套利交易策略

套利交易策略主要包括跨市场债券套利策略、回购套利策略和利差交易策略。本基金将在法律法规和监管机构许可的条件下,积极运用套利交易策略,提高组合收益。

1)跨市场债券套利策略。通过在交易所市场和银行间市场买卖同时在两市托管的债券,或者在两市之间买卖到期期限相同但收益率不同的债券,可以获取二者之间可能存在的差价。

2)回购套利策略。利用回购进行无风险或低风险套利的主要策略包括回购跨市场套利、回购与现券的套利以及不同回购期限之间的套利等;利用回购进行高风险套利的主要策略包括正回购杠杆操作、逆回购卖空操作等。

3)利差交易策略。利差交易是指同时买进涨多(跌少)/卖出涨少(跌多)的债券,达到不受市场涨跌的直接影响、规避市场风险的效果。同时,也可以将利差交易作为一种债券用于组合投资,是增加组合投资回报率的重要手段。最常见的利差交易为增斜交易与扁平交易。当预期收益率曲线将变陡峭时,进行增斜交易,即买入短期债,卖空长期债,同时保持久期中性,获取收益率曲线增斜带来的利差收益,规避了收益率曲线平移带来的风险(反之则进行扁平交易)。

(6)个券选择策略

本基金将在以上投资策略的基础上实施精细化的个券选择,充分评估每一只债券的到期收益率、信用风险、流动性风险、税收、含权等各种因素,选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。具有以下一项或多项特征的债券,是本基金构建固定收益类资产组合的重点投资对象:

1)符合上述投资策略的品种;
2)具有套利空间的品种;
3)价值低估的品种;
4)符合风险管理指标的品种。

3. 权益类资产投资策略

(1)新股申购投资策略

本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股。在进行新股申购时,本基金将充分考虑新股在资本市场不同阶段的风险特征,根据内外部研究成果评估股票的内在价值,对于拟发行上市的新股(或增发新股)等权益类资产的投资价值进行深入发掘,结合市场资金利率水平和预期中签率,得出新股申购预期收益率,作为参与新股申购的决策依据。

(2)股票二级市场投资策略

本基金可以进行适当的股票二级市场投资以强化组合获利能力,提高预期收益水平。基于安全性和收益性考虑,本基金二级市场股票的投资对象限于沪深300指数成份股中的高分红型股票。沪深300指数成份股中满足以下一项或多项特性的股票可以入选本基金股票初选库:

1)具有稳定的分红历史:最近三年内至少有两次现金分红的股票;
2)具有较好的分红价值:实际或预期现金股息率(税后)大于当期银行活期存款利率(税后)的股票;
3)公司投资研究团队在选股模型支持下认为具有特别投资价值的股票。

本基金将通过对企业发展战略、企业所属行业周期、业务状况、公司治理结构、财务状况等多种因素的综合评估,评价企业竞争优势和行业地位,从股票初选库中筛选出符合要求的股票构成股票备选库。在此基础上结合内外部研究、实地调研、价值评估等方法,根据本基金的风险收益要求进行股票投资。

4. 其他投资策略

本基金将在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下,对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面:1)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;2)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;3)利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略等。

十、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中债综合指数。

本基金属于债券基金,应采用债券指数作为业绩比较基准。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类,具有广泛的市场代表性,能够反应中国债券市场的总体走势,适合作为本基金的业绩比较基准。

在本基金的运作过程中,如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益,则经基金管理人与基金托管人协商一致,可以对业绩比较基准进行适当调整,并在报中国证监会核准后,公告并予以实施。

十一、基金的风险收益特征

本基金定位于满足追求较高稳定回报的基金持有人的投资需求,风险收益水平高于货币市场基金,低于混合基金和股票基金。

十二、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行根据基金合同规定,于2015年2月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金2014年第4季度报告,截至2014年12月31日。(财务数据未经审计)。

1. 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	380,653,917.27	13.12
	其中:股票	380,653,917.27	13.12
2	固定收益投资	2,211,444,570.73	76.21
	其中:债券	2,211,444,570.73	76.21
	资产支持证券	–	0.00
3	贵金属投资	–	0.00
4	金融衍生品投资	–	0.00
5	买入返售金融资产	219,805,929.71	7.58
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	55,845,010.38	1.92
7	其他资产	33,840,509.72	1.17
8	合计	2,901,589,937.81	100.00

2. 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	0.00
B	采矿业	7,096,000.00	0.32
C	制造业	75,934,510.84	3.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	0.00
E	建筑业	10,192,000.00	0.45
F	批发和零售业	–	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	–	0.00
H	住宿和餐饮业	–	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	0.00
J	金融业	262,038,086.93	11.66
K	房地产业	25,393,319.50	1.13
L	租赁和商务服务业	–	0.00
M	科学研究和技术服务业	–	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	–	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	–	0.00
P	教育	–	0.00
Q	卫生和社会工作	–	0.00
R	文化、体育和娱乐业	–	0.00
S	综合	–	0.00
	合计	380,653,917.27	16.94

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	6,399,985	106,175,751.15	4.73
2	002465	海格通信	3,000,096	57,961,854.72	2.58
3	000728	国元证券	999,919	31,167,475.23	1.39
4	000776	广发证券	1,200,097	31,142,517.15	1.39
5	601628	中国人寿	900,000	30,735,000.00	1.37
6	601688	华泰证券	1,099,920	26,915,042.40	1.20
7	002146	荣盛发展	1,600,000	25,392,000.00	1.13
8	600031	三一重工	1,799,944	17,963,441.12	0.80
9	000001	平安银行	1,096,000	17,360,640.00	0.77
10	601166	兴业银行	1,042,000	17,193,000.00	0.77

4. 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,352,929.00	0.46
2	央行票据	–	0.00
3	金融债券	172,142,100.00	7.66
	其中:政策性金融债	172,142,100.00	7.66
4	企业债券	552,063,229.57	24.57
5	企业短期融资券	251,930,000.00	11.21
6	中期票据	124,554,000.00	5.54
7	可转债	1,100,402,312.16	48.98
8	其他	–	0.00
9	合计	2,211,444,570.73	98.43

5. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110027	东方转债	1,038,430	177,789,600.30	7.91
2	113001	中行转债	1,003,620	157,156,855.80	6.99
3	110029	浙能转债	1,000,000	139,960,000.00	6.23
4	110023	民生转债	861,080	119,061,531.60	5.30
5	113501	洛钼转债	884,640	112,260,816.00	5.00

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

(3)本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

10. 投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期无被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

(3)基金的其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	106,986.10
2	应收证券清算款	7,488.08
3	应收股利	–
4	应收利息	33,632,785.25
5	应收申购款	93,250.29
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	33,840,509.72

(4)报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	157,156,855.80	6.99
2	110023	民生转债	119,061,531.60	5.30
3	110020	南山转债	99,825,338.30	4.44
4	113005	平安转债	90,210,000.00	4.02
5	110018	国电转债	82,460,000.00	3.67
6	110015	石化转债	26,984,000.00	1.20
7	113002	工行转债	26,555,820.00	1.18

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

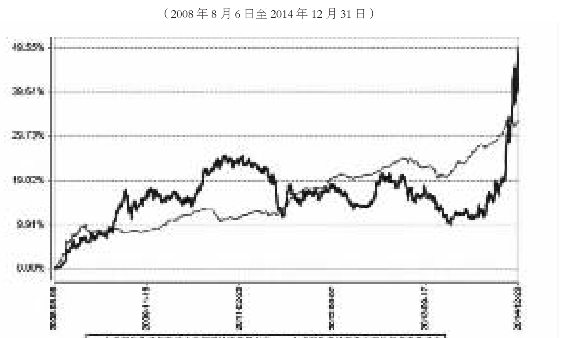
(一)基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2008.8.6-2008.12.31	6.24%	0.22%	9.31%	0.22%	-3.07%	0.00%
2009.1.1-2009.12.31	10.56%	0.33%	-0.32%	0.07%	10.88%	0.26%
2010.1.1-2010.12.31	5.82%	0.29%	2.05%	0.07%	3.77%	0.22%
2011.1.1-2011.12.31	-7.35%	0.33%	5.33%	0.08%	-12.68%	0.25%
2012.1.1-2012.12.31	0.36%	0.24%	3.60%	0.06%	-3.24%	0.18%
2013.1.1-2013.12.31	-3.30%	0.35%	-0.47%	0.09%	-2.83%	0.26%
2014.1.1-2014.12.31	33.75%	0.74%	10.34%	0.11%	23.41%	0.63%
2008.8.6-2014.12.31	49.47%	0.41%	33.26%	0.10%	16.21%	0.31%

(二)自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较

本基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008年8月6日至2014年12月31日)



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。在建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

十四、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类
1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;
3. 基金财产拨划支付的银行费用;
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用;
5. 基金份额持有人大会费用;
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
7. 基金的证券交易费用;
8. 在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;
9. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3. 与基金销售有关的费用

(1)申购费用

本基金申购费用由投资者承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

1)A类基金份额(采用前端收费模式)申购费率如下:

申购金额M	申购费率
M<100万	0.8%
100万≤M<300万	0.5%
300万≤M<500万	0.3%
M≥500万	1000元/笔

申购份额的计算:

净申购金额=申购金额÷(1+申购费率)

(注:申购金额在500万元(含)以上适用绝对数额的申购费金额,即净申购金额=申购金额-申购费用)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额÷T日基金份额净值

2)B类基金份额(采用后端收费模式)申购费率如下:

持有基金时间T	申购费率
T<1年	1.0%
1年≤T<3年	0.6%
3年≤T<5年	0.4%
T≥5年	0%

申购份额的计算:

申购份额=申购金额÷T日基金份额净值

投资者多次申购,须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

说明:投资者以同样的金额申购本基金时,选择B类收费模式得到的申购份额将比选择A类收费模式多,但需在赎回时交纳申购费。

(2)赎回费用

本基金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。不低于赎回费总额的25%应归基金财产,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:

持有基金时间T	赎回费率
T<1年	0.1%
1年≤T<2年	0.05%
T≥2年	0%

投资者通过日常申购所得的基金份额,持有期限自注册登记机构确认登记之日起计算。

赎回金额的计算:

1)A类基金份额(采用前端收费模式)

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

2)B类基金份额(采用后端收费模式)

赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

后端认购/申购费用=赎回份额×认购/申购申请日的基金份额净值×该部分份额对应的后端认购/申购费率

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-后端认购/申购费用-赎回费用

3)上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4. 除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人最迟于新的费率实施前2日在至少一种指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,,对2014年9月19日公布的《大成强化收益债券型证券投资基金更新招募说明书(2014年第2期)》进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,本更新的招募说明书,主要更新的内容如下:

1. 根据最新情况,对“三、基金管理人”部分内容进行了更新。
2. 根据最新情况,对“四、基金托管人”部分内容进行了更新。
3. 根据相关公告,对“五、相关服务机构”等相关信息进行了更新。
4. 根据相关财务数据和公告,对“八、基金的投资”部分的“(十一)投资组合报告”相关内容进行了更新。
5. 根据相关财务数据,对“九、基金的业绩”进行了更新。
6. 根据相关公告,对“二十二、其他应披露的事项”部分进行了更新。

大成基金管理有限公司

二〇一五年三月二十日

(上接B57版)

会期一天。出席者食宿交通费自理。

(三)网络投票系统异常情况的处理方式:网络投票期间,如网络投票系统遇突发重大事件的影响,则本次股东大会的进程按当日通知进行。

七、备查文件

1、公司第五届董事会第二十九次会议决议。

特此公告。

新疆天山水泥股份有限公司董事会

二〇一五年三月十九日

附件:

授权委托书

兹委托　　先生(女士)代表本人(单位)出席新疆天山水泥股份有限公司2014年年度股东大会,并对会议议案行使如下表决权:

一、本人(或本单位)对本次董事会议案一至议案十的投票意见如下:

序号	议案名称	同意	反对	弃权
1	新疆天山水泥股份有限公司2014年度董事会工作报告			
2	新疆天山水泥股份有限公司2014年度监事会工作报告			
3	新疆天山水泥股份有限公司2014年度财务决算报告和2015年度财务预算报告			
4	新疆天山水泥股份有限公司2014年度利润分配预案			
5	新疆天山水泥股份有限公司2014年年度报告及摘要			
6	关于本公司发行中期票据和私募债的议案			
7	新疆天山水泥股份有限公司关于2015年日常关联交易事项的议案			
8	新疆天山水泥股份有限公司关于修改《公司章程》的议案			
9	新疆天山水泥股份有限公司关于修改《股东大会议事规则》的议案			
10	新疆天山水泥股份有限公司关于修改《董事会议事规则》的议案			

备注:委托人应在委托书中“同意”、“反对”、“弃权”意见中仅选一项划“√”。

二、本人(或本单位)对本次董事会议案十一、十二、十三的投票意见如下(本次选举实行累计投票制):

序号	审议事项	表决意见
11	关于选举公司第六届董事会董事的议案	董事选举实施累积投票,请填票数(如果同意直接打√,代表将拥有的表决票总数平均分配给打勾的候选人),有效投票总数为4×持股数
	①选举彭建新先生为公司第六届董事会董事	票
	②选举张丽荣女士为公司第六届董事会董事	票
	③选举赵新军先生为公司第六届董事会董事	票
	④选举王鲁岩先生为公司第六届董事会董事	票
12	关于选举公司第六届董事会独立董事的议案	独立董事选举实施累积投票,请填票数(如果同意直接打√,代表将拥有的表决票总数平均分配给打勾的候选人),有效投票总数为3×持股数
	①选举边新俊先生为公司第六届董事会独立董事	票
	②选举高云飞先生为公司第六届董事会独立董事	票
	③选举李薇女士为公司第六届董事会独立董事	票
13	关于选举公司第六届监事会监事的议案	监事选举实施累积投票,请填票数(如果同意直接打√,代表将拥有的表决票总数平均分配给打勾的候选人),有效投票总数为3×持股数
	①选举李敬梅女士为公司第六届监事会监事	票
	②选举危波先生为公司第六届监事会监事	票
	③选举李雪芹女士为公司第六届监事会监事	票

委托人(签字或法人单位盖章):　　法定代表人签字:

委托人深圳证券帐户卡号码:　　委托人持有股份:

代理人签字:　　代理人身份证号码:

委托日期:　　二〇一五年　月　日

证券代码:000877　　证券简称:天山股份　　公告编号2015-013号

新疆天山水泥股份有限公司第五届监事会第十一次会议决议公告

本公司及监事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司于2015年3月19日在公司二楼会议室,以现场会议方式召开第五届监事会第十一次会议,会议应参会监事5人,实际参会监事5人。监事于凯军、曲孝利、李敬梅、高云亲自出席了会议,监事居来提·吐尔地委托监事李敬梅代为出席会议并行使表决权。会议召开符合《公司法》和《公司章程》的有关规定。经与会全体监事审议,形成了如下决议:

一、审议通过了《新疆天山水泥股份有限公司2014年度监事会工作报告的议案》

该议案需提交公司2014年度股东大会审议。

该议案表决情况:5 票同意,0票反对,0票弃权。

二、审议通过了《新疆天山水泥股份有限公司2014年度财务决算报告和2015年度财务预算报告的议案》

该议案需提交公司2014年度股东大会审议。

该议案表决情况:5票同意,0票反对,0票弃权。

三、审议通过了《新疆天山水泥股份有限公司2014年年度报告及摘要的议案》

监事会成员保证公司2014年年度报告及摘要所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

该议案需提交公司2014年度股东大会审议。

该议案表决情况:5票同意,0票反对,0票弃权。

四、审议通过了《新疆天山水泥股份有限公司2014年度内部控制评价报告的议案》

该议案表决情况:5票同意,0票反对,0票弃权。

五、审议通过了《关于提名公司第六届监事候选人的议案》

公司监事会由五名监事组成,其中员工监事两名。第五届监事会任期届满。根据《公司法》和《公司章程》的有关规定,拟对公司监事会进行换届。经公司股东推荐,现提名李敬梅、危波、李雪芹为公司第六届监事会监事候选人(上述人员简历附后)。

该议案需提交公司2014年度股东大会审议。

该议案表决情况:5票同意,0票反对,0票弃权。

特此公告。

新疆天山水泥股份有限公司

监事会

二〇一五年三月十九日

附:本公司第六届监事会监事候选人简历

李敬梅,女,汉族,1965年11月出生,中共党员,本科学历,高级经济师、高级政工师,现任天山股份党委副书记、纪委书记、监事兼党群人力资源部部长。1983年7月-1995年10月新疆水泥厂子弟学校教师;1995年11月-1998年10月任新疆水泥厂宣传处干事;1998年11月-2000年8月任天山股份党委工作部党委秘书;2000年8月—2001年9月任天山股份团委书记,2001年10月—2002年3月任天山股份党委工作部副部长,2002年4月—2003年12月任天山股份党委工会办公室主任,2004年1月-2009年2月任天山股份党政部副部长、部长;2009年2月至今任天山股份党委副书记、纪委书记兼党群人力资源部部长。

危波,男,汉族,1962年7月出生,中共党员,研究生学历,硕士学位,现任天山股份总裁助理兼物流中心主任。1986年1月至1987年1月任新疆水泥厂出纳、专用基金会计;1987年1月至1998年1月任新疆建材局科员、副主任科员、副处长、处长;1998年1月至2000年1月任天山股份财务总监;2000年1月至2008年7月任北京中天高科特种车辆有限责任公司(天山股份参股)副总经理;2008年7月至今任天山股份物流部部长;2012年3月至今任天山股份总裁助理。

李雪芹,女,汉族,1978年11月28日出生,本科学历,在职研究生在读,企业法律顾问,现任天山股份总裁办公室主任。2001年至2004年任天山股份销售公司法律顾问,2005年至2007年任天山股份市场部法务科长,2008年至2010年天山股份销售总公司法律风险管理部副部长,2011年-2012年1月任天山股份销售总公司综合管理部副部长,2012年2月至今任天山股份司总裁办公室副主任、主任。

证券代码:000877　　证券简称:天山股份　　编号:2015—011号

新疆天山水泥股份有限公司2015年日常关联交易公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

一、预计2015年全年日常关联交易情况

根据《深圳证券交易所股票上市规则》(2014年修订)(以下简称“股票上市规则”)的相关规定,结合本公司实际情况,对公司2015年度日常关联交易进行了预计。

2015年度公司日常关联交易预计:

单位:元

关联交易类别	关联人	2014年预计总金额	2014年实际发生的总金额	2015年预计总金额
采购商品、接受劳务等	新疆天山建材实业有限责任公司	不超过25,000,000	1,002,339.62	不超过 15,000,000
	新疆天山建材机械有限责任公司	不超过20,000,000	6,128,919.78	不超过 20,000,000
	新疆建化实业有限责任公司	不超过210,000,000	22,128,903.83	不超过 130,000,000
	中国中材国际工程股份有限公司及其所属公司	不超过919,000,000	87,095,907.96	不超过 590,000,000
	中国非金属材料南京矿山工程有限公司	不超过60,000,000	47,178,890.44	不超过 90,000,000
	新疆天山建材实业有限责任公司白杨河石膏矿	不超过16,000,000	2,748,415.96	不超过 5,000,000
	中国建筑材料工业建设西安工程有限公司	不超过46,000,000	12,762,502.21	不超过 100,000,000
	中国建筑材料工业地质勘查中心江苏总队	不超过300,000	235,849.05	不超过 3,000,000
	中国建筑材料工业地质勘查中心新疆总队	不超过32,000,000	7,979,886.71	不超过 25,000,000
	中材节能股份有限公司	不超过571,000,000	121,917,100.00	不超过 220,000,000
	建材乌鲁木齐地质工程勘察院	不超过1,000,000	45,000.00	不超过 1,000,000
	新疆中材精细化工有限责任公司	不超过39,000,000	17,950,762.38	不超过 25,000,000
	中材科技股份有限公司及其所属公司	不超过42,000,000	20,135,811.04	不超过 40,000,000
	兖州中材建设有限公司	不超过54,000,000	30,691,358.03	不超过 50,000,000
	新疆天山建材集团耐火材料有限责任公司	不超过109,000,000	37,761,818.08	不超过 80,000,000
	新疆天山建材集团铸造有限责任公司	不超过46,000,000	13,083,372.07	不超过 50,000,000
	苏州开普岩土工程有限公司	不超过20,000,000	–	不超过 15,000,000
	天津矿山工程有限公司	不超过47,000,000	5,617,460.68	不超过 60,000,000
	新疆天山建材(集团)房地产开发有限责任公司	–	–	不超过 5,000,000
	咸阳非金属矿研究设计院	–	–	不超过 8,000,000
	中材集团科技开发中心有限公司	–	30,000.00	不超过 1,000,000
	总计	不超过2,257,300,000	434,494,297.84	不超过 1,533,000,000
销售水、电、汽、水泥、商混等	新疆天山建材机械有限责任公司	不超过1,000,000	1,128.05	不超过 3,000,000
	新疆天山建材(集团)房地产开发有限责任公司	不超过19,000,000	1,792,422.40	不超过 60,000,000
	新疆建化实业有限责任公司	不超过21,000,000	8,598,134.46	不超过 25,000,000
	新疆天山建材(集团)有限责任公司	不超过500,000	–	不超过 5,000,000
	新疆天山建材实业有限责任公司	不超过77,000,000	4,446,491.22	不超过 40,000,000
	新疆国统管道股份有限公司	不超过400,000	4,209,729.94	不超过 20,000,000
	中国中材国际工程股份有限公司及其所属公司	不超过9,000,000	177,144.02	不超过 3,000,000
	中建西部建设股份有限公司及其所属公司(原新疆西部建设股份有限公司)	不超过133,000,000	26,711,948.27	不超过 60,000,000
	苏州开普岩土工程有限公司	不超过5,000,000	1,322,191.71	不超过 4,000,000
	中材节能股份有限公司	不超过20,000,000	14,106.84	不超过 8,000,000
	总计	不超过285,900,000	47,273,296.91	不超过228,000,000
收到搬迁补偿款	新疆天山建材(集团)房地产开发有限责任公司	–	127,587,853.37	不超过92,278,963.60

注1:2014年与关联人新疆国统管道股份有限公司预测的日常关联交易发生额为40万元,实际发生额为420.97万元。

注2:2014年关联人新疆天山建材(集团)房地产开发有限责任公司通过政府招拍挂获得本公司位于乌鲁木齐仓房沟生产厂区搬迁的四宗土地,按协议分六年期向本公司支付搬迁补偿款。2014年收到搬迁补偿款及前期垫付费用共计32,531.88万元,其中政府返还补偿款19,773.10万元。

二、关联方介绍和关联关系

1、中国中材国际工程股份有限公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:宋寿顺 ,注册资本:109,329.73万元,

经营范围: 许可经营范围:对外派遣实施境外建材行业工程所需的劳务人员。一般经营项目:非金属新材料、建筑材料及非金属矿的研究、开发、技术咨询、工程设计、装备制造、建设安装、工程总承包;民用建筑工程设计、工程勘测、监理;工业自动化控制系统集成、制造及以上相关产品的生产、销售;承包境外建材行业工程和境内国际招标工程;承包上述境外工程的勘测、咨询、设计和监理项目;进出口业务。

(2)与公司的关联关系:该公司是公司第一大股东所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司拥有强大的技术和工程总承包能力,其向公司提供项目设计及提供设备,具备较好的履约能力。

(4)中国中材国际工程股份有限公司下属天津水泥工业设计研究院有限公司、成都建筑材料工业设计研究院有限公司、中材建设有限公司、苏州中材建设有限公司、天津天安机电设备安装工程有限公司、中天仕名科技有限公司、常熟仕名重型机械有限公司、中天仕名(徐州)重型机械有限公司、中天仕名(淄博)重型机械有限公司、天津鼎盛工程有限公司、天津仕名粉体技术装备有限公司、天津仕名机电备件有限公司、江苏中材水泥技术装备有限公司、溧阳中材重型机器制造有限公司、扬州中材机器制造有限公司、唐山中材重型机械有限公司、中国建材装备有限公司等,在项目设计、设备制造、安装领域均属国内领先。

2、中国建筑材料工业地质勘查中心江苏总队

(1)基本情况:该公司法定代表人:王伟,开办资金(事业单位):1068万元, 经营范围:地质矿产调查勘查 区域地质调查 工程地质勘察 水文地质勘查 环境地质勘查 灾害地质勘查 地质测绘与工程测量 岩石矿物和水质分析鉴定　矿产资源研究开发　地质资料收集分析 地质技术研究推广

(2)与公司的关联关系:该公司是公司第一大股东所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供地勘服务,具备较好的履约能力。

3、中国非金属材料南京矿山工程有限公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:孟庆好 ,注册资本:3575万元, 经营范围:普通货运,矿山工程建筑施工(二级),工业、民用场地平整,公路、隧道、桥梁工程施工,土石方工程施工,城市、工厂建筑物爆破拆除工程施工,建材工业安装工程施工,石灰石销售。

(2)与公司的关联关系:该公司是公司第一大股东所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司有丰富的矿山工程经验和施工能力,向公司提供项目服务及销售原材料,具备较好的履约能力。

4、中国建筑材料工业地质勘查中心新疆总队

(1)基本情况:

法定代表人:冯晓飞 注册资本:1073万元, 经营范围:固体矿产勘查、岩土工程勘察、区域地质调查、岩矿测试验、岩土试验、工程测绘、地质灾害治理工程勘查、危险性评估、地质灾害设计、施工、地球物理勘查、水文地质、工程地质、环境地质调查、地质钻探、地基与基础工程施工、矿山储量动态监督管理资质。

(2)与公司的关联关系:该公司是公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该单位向公司提供矿山地质勘查服务,具备较好的履约能力。

5、建材乌鲁木齐地质工程勘察院

(1)基本情况:该公司法定代表人冯晓飞,注册资金:600.09万元。

经营范围:岩土工程勘察、岩土工程设计、岩土工程治理、岩土工程咨询、岩土工程监理、地基基础专业施工(基坑支护、地基处理、桩基础施工)、工程与地形测量、各类岩土样品测试实验。

(2)与公司的关联关系:该公司是公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该单位向公司提供矿山地质勘查服务,具备较好的履约能力。

6、苏州开普岩土工程有限公司

(1)基本情况:

法定代表人:马元海

注册资本:1500万元人民币

住　　所:苏州市劳动路28号华亭大厦601-604室

企业类型及经济性质: 有限公司

经营范围:一般经营项目:承担工程造价1500万元以下的地基与基础工程施工、岩土工程的勘察、设计、测试、检测、咨询、监理、治理、地基处理、桩基检测、工程测绘、水文地质及凿井业务(上述项目凭资质证书经营)。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供桩基工程、地勘等业务,属于专业生产服务企业,具备履约能力。

7、中材科技股份有限公司

(1)基本情况:公司法定代表人薛忠民,注册资本:40,000万元,经营范围:玻璃纤维、复合材料、过滤材料、矿物棉、其他非金属新材料、工业铂铑合金、浸润剂及相关设备研究、制造与销售;技术转让、咨询服务;工程设计与承包;建筑工程、环境污染防治专项工程、轻工、市政工程设计;玻璃纤维、复合材料、其他非金属新材料工程设计与承包;压力容器、贵金属材料、机械设备、工业自控产品、计算机软件的销售(以上国家有专项专营规定的除外).经营本企业自产产品的出口业务和本企业所需的机械设备、零配件、原辅材料的进口业务(国家限定公司经营或禁止进出口的商品及技术除外)。

(2)与公司的关联关系:该公司是公司第一大股东所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司拥有国内先进的滤膜技术,向本公司提供收尘滤袋,具备较好的履约能力。

8、兖州中材建设有限公司

(1)基本情况:法定代表人郭正勇　注册资本:3387万元。经营范围:矿山、铁路、公路、隧道、桥梁、堤坝、电站、码头工程施工;基础工程施工;地面建筑工程施工;线路、管道、设备安装工程施工;建筑、构筑物拆除;矿山勘测;非标设备加工;工程机械配件加工;工程机械修理;工程机械配件销售;房屋租赁。以下限分支机构经营:石灰石、矿石开采、加工、销售。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司。属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供设备安装服务,具备履约能力。

9、中材节能股份有限公司

(1)基本情况:法定代表人:张奇　注册资本 407,000,000元:经营范围:余热发电项目的投资、开发、建设;余热发电工程技术开发、设计、咨询及工程总承包;相关建筑材料、金属材料、保温材料、机械电器批发、零售;提供清洁发展机制项目的开发方案及技术咨询;代理清洁发展机制项目产生的减排额销售业务;从事国家法律法规允许经营的进出口业务;开展合同能源管理服务;承包与其实力、规模、业绩相适应的国外工程项目;对外派遣实施上述境外工程所需的劳务人员。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司。属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供余热发电项目的投资、技术开发、工程设计与咨询、系统集成与设备成套、项目建设管理及工程总承包服务,该公司是国内余热发电领域领先的全方位服务公司和投资商具备履约能力。

10、新疆天山建材机械有限责任公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:陈小东,注册资本:500万元,经营范围:一般经营项目(国家法律,行政法规规定有专项审批的项目除外:需要取得专项审批的项目待取得有关部门的批准文件和颁发的许可证,资质证后方可经营,具体经营项目和期限以有关部门的批准文件和颁发的许可证、资质证为准):建材机械设备制造、安装和技术服务,环保设备的制造、销售;汽车配件、橡胶、五金交电产品、金属材料、机电产品的销售;房屋租赁;耐火材料的制造、销售及废旧物资的回收。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供设备安装服务,以往交易均能按照协议履约,具备履约能力。

11、天津矿山工程有限公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:张汉武,注册资本:6096万元,经营范围:承担矿山、土建、道路工程,场地平整,填海筑坝建筑;工程测量、拆除爆破服务;建材工业线路、管道、设备安装;建筑钢结构架的制作、安装;工程机械修理;普通货运。以下限分支机构经营:石灰石、矿石开采;石灰石矿石加工销售。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向本公司提供矿山建设服务,具备履约能力。

12、咸阳非金属矿研究设计院有限公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:雷建斌,注册资本:1291万元,经营范围:非金属矿行业的基础理论研究及新技术、新工艺、新产品、新装备的研究、开发、设计、生产及经营;非金属矿采、选、深加工、制品、综合利用、环境保护等方面的技术和工艺研究;专用设备开发研究和加工;工业矿物及其制品的性能测试与研究;非金属矿技术信息资料的收集编撰及技术咨询。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向本公司提供矿山设计建设服务,具备履约能力。

13、新疆天山建材(集团)房地产开发有限责任公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:沈海涛,注册资本:5,000万元,经营范围:房地产开发及经营,二手房交易。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向本公司采购水泥,以往交易能够按照采购合同支付款项,具备较好的履约能力。

14、新疆建化实业有限责任公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:迟明珠,注册资本:5000万元,经营范围:许可经营项目:锅炉安装、改造、维修,压力管道安装。一般经营项目:房屋建筑工程施工总承包贰级;市政公用工程施工总承包贰级;机电设备安装工程专业承包贰级;防腐保温工程专业承包贰级;钢结构工程专业承包贰级;建筑装修装饰工程专业承包贰级;

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供项目土建施工,以往的项目施工均能保质保量按时完成,具备较好的履约能力

15、新疆中材精细化工有限责任公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:华刚,注册资本:3,000万元,经营范围:许可经营项目:无。一般经营项目:混凝土外加剂、石油助剂的研究、开发、生产、销售,以及其他建筑材料、建筑设备、仪器仪表的研究、开发、销售;销售:化工原料。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供混凝土外加剂,属于专业生产企业,具备履约能力。

16、新疆天山建材集团铸造有限责任公司

(1)基本情况:法定代表人:刘崇生;注册资本:4248万元人民币;单位地址:乌鲁木齐市米东区铁厂沟镇林泉路北侧城东工业区;企业类型及经济性质: 有限责任公司

经营范围:一般经营项目(国家法律,行政法规规定有专项审批的项目除外:需要取得专项审批的项目待取得有关部门的批准文件和颁发的许可证、资质证后方可经营,具体经营项目和期限以有关部门的批准文件和颁发的许可证、资质证为准);金属加工机械制造销售、专业技术服务。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供,磨机钢球等耐磨材料,属于专业生产企业,具备履约能力。

17、新疆天山建材集团耐火材料有限责任公司

(1)基本情况:法定代表人:闫新革;注册资本:4000万元人民币;单位地址:乌鲁木齐市铁厂沟林泉路北侧工业园

经营范围:一般经营项目(国家法律,行政法规规定有专项审批的项目除外:需要取得专项审批的项目待取得有关部门的批准文件和颁发的许可证、资质证后方可经营,具体经营项目和期限以有关部门的批准文件和颁发的许可证、资质证为准);耐火材料技术开发、生产、销售、和技术服务;经营本企业或成员企业自产产品;经营本企业和本企业成员企业生产、科研所需原辅材料;企业的进料加工和“三来一补”业务。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供,浇注料、耐火砖等耐火材料,属于专业生产企业,具备履约能力。

18、新疆天山建材(集团)有限责任公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:刘崇生,注册资本:74,543万元,经营范围:许可经营项目(具体经营项目以有关部门批准文件或颁发的许可证、资质证书为准):汽车运输。一般经营项目(国家法律、行政法规有专项审批规定的项目除外):建材行业的投资;建筑材料、化工产品的销售;货物及技术的进出口经营。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司。属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:根据其财务状况和资信状况,该关联人能够按时、足额向上市公司支付关联交易款项。

19、新疆天山建材实业有限责任公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:刘天奇,注册资本:34,025.58万元,经营范围:一般经营项目:(国家法律、行政法规规定有专项审批的项目除外:需要取得专项审批的项目待取得有关部门的批准文件和颁发的许可证,取得资质证后方可经营,具体经营项目和期限以有关的批准文件和颁发的许可证、资质证为准):水泥、建筑材料的销售,房屋租赁、仓储服务。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:本公司向其采购原材料,以往交易均能按照协议履约,具备较好的履约能力。

20、中国建筑材料工业建设西安工程有限公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:董焕民,注册资本:5,600万元,经营范围:矿山工程施工;采掘施工作业;矿石开采作业;土石方爆运;土建工程施工;工业与民用建筑拆除:公路、桥梁、隧道的施工;机电设备、电气自动化设备的安装、调试;工业筑炉保温;机械设备的制作;气缸垫生产;提供劳务服务;提供以上范围的技术咨询服务;自营和代理各类商品及技术的进出口业务(国家限定或禁止进出口的商品和技术除外);经营进料加工和“三来一补”业务;开展对销贸易和转口贸易。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向公司提供设备安装服务,具备履约能力。

21、中建西部建设股份有限公司

(1)基本情况: 法定代表人:吴文贵 注册资本:51,611.70万元人民币。经营范围:高性能预拌砼的生产销售及其新技术、新工艺的研究开发与推广;新型建材及化工材料的研究及生产应用。

(2)与公司的关联关系:该公司是属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向本公司采购水泥、矿渣微粉,以往交易能够按照采购合同支付款项,具备较好的履约能力。

22、新疆国统管道股份有限公司

(1)基本情况:该公司法定代表人:徐永平,注册资本:11615万元,经营范围:预应力钢筒砼管、各种输水管道的制造; 运输及其异型管件、配件开发制造; 水泥制品的生产;普通货物运输和大型货物运输; 水工金属结构(钢结构、机械设备)及化工建材的生产。

(2)与公司的关联关系:该公司是本公司实际控制人所属集团内公司,属《股票上市规则》10.1.3条规定的情形。

(3)履约能力分析:该公司向本公司采购水泥,以往交易能够按照采购合同支付款项,具备较好的履约能力。

三、定价政策和定价依据

本公司及所属公司向关联方销售定价政策参考同地区市场价格,采用协议定价。本公司向关联方采购定价政策参考同地区市场价格、国内同类设备价格和同行业水平,部分采购通过议标、招标的方式进行确定。保证各项交易均遵循公平、公开、公允的市场价格和条件进行。

四、交易目的和交易对上市公司的影响

本公司及控股子公司是基于实际生产经营及项目建设需要与上述关联交易人签署合同,合同价格按照同类市场公允价格确定,因此,该等关联交易不会对公司造成不利影响,不构成对上市公司独立性的影响,本公司主要业务也不会因此而对关联方形成依赖或者被其控制。

五、关联交易的回避表决情况

鉴于上述事宜属于关联交易,根据有关规定,本公司关联董事王广林、张丽荣、赵新军、王鲁岩回避表决。

六、独立董事事前认可和独立意见

本公司独立董事在董事会召开之前对公司2015年日常关联交易事项进行了审核,同意将上述关联事项提交公司董事会审议;并在公司五届二十九次董事会审议时发表独立意见,认为:公司及公司的控股子公司分别与公司的关联方发生的采购商品、接受劳务及矿山托管,销售水、电、汽,水泥、商品混凝土等持续性关联交易是公司满足正常生产经营所必需;公司因仓房沟厂区搬迁与关联方发生的搬迁补偿事宜均能严格按照双方签订的补偿协议实施。交易价格以市场定价为依据,按照等价有偿、公允市价的定价原则,未违反公开、公平、公正的原则,符合关联交易规则;同意《关于公司2015年日常关联交易事项的议案》。

上述关联交易事项需提交公司股东大会审议,与上述关联交易有利害关系的关联股东将放弃在股东大会上对上述相关交易事项的表决权。

七、备查文件

1、公司第五届董事会第二十九次会议决议

2、独立董事意见