（上接B49版）

网址：http://licaike.hexun.com
（103）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人：汪静波
办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼
联系人：徐诚
联系电话：021-38509639
网站：www.noah-fund.com
客户服务电话：400-821-5399
（104）深圳众禄基金销售有限公司
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I_J单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
网址：www.zlfund.cn
客服电话：4006-788-887
（105）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：潘世友
电话：021-54509998
传真：021-64383798
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
（106）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
（107）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：徐映菲
电话：021-60897840
传真：0571-26698533
客户服务电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn
（108）上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人：郭坚
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
联系人：宁博宇
网站：www.lufunds.com
客户服务电话：4008219031
（109）珠海益米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人：肖雯
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
联系人：黄敏嫦
网站：www.yingmi.cn
客户服务电话：020-89629066
（110）奕丰金融服务（深圳）有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系人：叶健
电话：0755-89460507
传真：0755-21674453
客户服务电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
（111）深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址：深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-1102
办公地址：深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼
法定代表人：陈姝坚
联系人：张烨
电话：0755-84034499
传真：0755-84034477
客服电话：400-950-0888
网址：http://www.jfzinv.com
（112）北京葱次方资产管理有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
客服电话：010-61840688
联系人：袁永娇，
电话：010-61840688
传真：010-61840699
网址：www.ncfj.com
（113）徽商期货有限责任公司
注册地址：合肥市芜湖路258号
法人代表人：吴国华
联系人：蔡芳
传真：0551-62862801
客服电话：4008878707
网址：http://www.hsqh.net
（114）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼
法人代表：凌顺平
联系人：林海明
电话：0571-88911818-8580
传真：0571-88911818-8002
客户服务电话：4008-773-772
网站地址：www.5ifund.com
（115）北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦（丹棱soho）1008
法定代表人：赵荣春
联系人：魏争
网站：www.qianjing.com
客户服务电话：400-893-6885
（116）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人：陈继武
客服电话：4000178000
联系人：葛佳蕊
电话：021-63333319
传真：021-63332523
网址：www.lingxianfund.com
（117）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号
法定代表人：陶捷
联系人：杨帆
电话：027-87006003、87006009
网站：www.buyfunds.cn
公司传真：027-87006010
客户服务电话：400-027-9899
（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33层
法定代表人：刘卓
电话：0755-83183388
传真：0755-83195229
联系人：范璞
（三）律师事务所和经办律师
名称：北京市广盛律师事务所
注册地址：建国路99号中服大厦25层
办公地址：建国路99号中服大厦25层
负责人：夏善胜
电话：010-65813529
传真：010-65816534
经办律师：吴军、孟娟娟
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：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
执行事务合伙人：李丹
经办注册会计师：薛竟、俞伟敏
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：俞伟敏

四、基金的名称

大成策略回报混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资目标

追求基金资产的长期稳健增值，兼顾当期收益；同时，实施积极的分红政策，回报投资者。

八、基金的投资方向

本基金投资于国内依法公开发行的股票、权证、债券、资产支持证券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。

九、基金的投资策略

本基金在控制风险的前提下，采取趋势投资策略进行总体资产配置：在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心－卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略，以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益；同时，强调收益管理，实施收益管理策略，以期在增长期及时锁定收益，制度性的减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。

1. 总体资产配置策略

本基金以股票投资为主、债券投资为辅进行积极资产配置。其中，股票资产占基金资产的比例范围为60%－95%；债券资产占基金资产的比例范围为0%－35%；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%。

本基金采取趋势投资策略进行总体资产配置，即通过对宏观经济运行状况及其政策动态、货币金融运行状况及其政策动态、证券市场运行状况及其政策动态等因素“自上而下”的定量和定性分析，形成对各个市场的趋势判断，在此基础上基于稳健的战略资产配置策略和积极的战术资产配置策略，确定组合中股票、债券和货币市场工具的投资比例。

2. 资产配置策略

本基金采用行业轮动投资策略进行行业配置，即紧密跟踪国家产业和行业经济运行状况及其政策动态，关注产业结构调整，通过行业周期分析、行业特征指标分析、行业内竞争结构分析以及国际产业迁移进程分析等确定本基金各行业的投资比例，当预计某个行业的投资收益率发生变化时，动态调整各行业的投资比例。同时，利用数量化模型优化行业组合，增强本基金行业配置效率。

本基金将重点投资于符合国家宏观经济和产业发展政策、与国民经济增长高度相关，能够适应、满足、推动消费升级及产业升级等需要，具有垄断特征以及高附加值等行业，适时采用行业集中或者行业分散策略，获取行业超额收益，平抑宏观经济的周期性变化对投价波动带来的影响，保持基金分红水平与净值的长期协调稳定增长。

3. 个股选择策略

本基金采用核心－卫星策略，进行股票资产配置，即本基金股票资产主要投资于红利股，同时兼顾成长股的投资，以实现基金资产的长期资本增值；本基金投资于红利股不低于基金股票资产的80%。

本基金对于红利股、成长股分别采用价值投资策略、买入并持有策略进行投资。

（1）红利股

对于红利股投资，本基金采用价值投资策略，即适时评估红利股的内在价值，并与其市场价格进行比较，投资处于合理估值范围内的红利股。红利股是指过去两年有分红记录的上市公司。本基金将综合考察企业的历史分红记录、现有分红能力、流动性等特征，挖掘具有长期分红潜力的红利股企业进行投资。主要考核标准包括：

① 历史分红记录良好，过去两年连续分红；

② 现金红利派息率高于市场平均水平；

③ 短期负债率较低，长期负债率处于合理范围以内，自由现金流良好。

（2）成长股

对于成长股的投资，本基金采用买入并持有投资策略，即通过精选具备持续成长潜力的股票进行长期投资，充分分享由于股票市场价值不断上升所带来的收益。本基金将综合考察企业估值水平、盈利能力、管理层能力、核心竞争力等特征，选择具有持续增长能力的企业投资。主要考核标准包括：

① 主营业务清晰、成长性良好

企业的盈利能力取决于主营业务的盈利能力。主营业务突出、成长性良好的企业具有较高的投价值。本基金将深入分析企业的利润构成，通过对每股收益、每股收益增长率、净资产收益率等指标的定量分析，评价企业的盈利能力。

② 具备高效的管理团队，重视股东利益

企业的管理团队对企业的发展方向、资源的配置效率起着重要作用。本基金将通过实地调研、高层访谈等方式对企业管理层的管理能力、团队氛围、是否重视股东利益、是否具有制定和调整企业发展战略的能力等特征进行定性分析。

③ 具备核心竞争优势

资源独占、技术领先、品牌优势、企业凝聚力等特质所形成的核心竞争力是企业长期积累的结果，也是企业宝贵的无形资产，有助于企业以较低的成本获取较高的收益。本基金将通过定性和定量相结合的方法深入挖掘企业的核心竞争优势。

本基金将密切跟踪市场变化，结合本基金收益实现情况，适时调整（1）、（2）两个层面的权重分配，以期达至最优组合绩效。

4. 债券投资策略

本基金的债券投资将采取较为积极的策略，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，力求在保证基金资产总体的安全性、流动性的基础上获取一定的稳定收益。

（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。本基金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

本基金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

本基金将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。

5. 其他金融工具投资策略

本基金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：主要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；根据权证对应公司基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证的趋势投资；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来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、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略。

本基金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策略投资资产支持证券，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较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

本基金将在充分考虑收益性、流动性和风险特征的基础上，积极运用监管机构允许基金投资的其他金融工具，以期降低组合风险，锁定既有收益，在一定程度上实现基金资产的保值、增值。

6. 收益管理策略

本基金强调对收益的管理，以期在增长期及时锁定收益、制度性的减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。

本基金的收益管理策略分别体现在类属资产配置、股票投资、风险管理工具的运用和定期收益监控四个方面。本基金在类属资产配置过程中重视趋势预测，及时调整组合风险水平；本基金在股票投资过程中，重视短期收益和长期资本增值的匹配；本基金采用积极策略运用风险管理工具，对冲风险、锁定收益；本基金在运作过程中将制度性的按季监控收益实现状态，综合考虑证券市场趋势、投资计划安排等因素，在法律法规以及基金合同规定的范围内，最大限度的积极分配收益。

十、基金的业绩比较基准

80%×沪深300指数＋20%×中债综合指数

本基金作为混合型基金，股票投资比例范围为60%－95%，债券投资比例范围为0%－35%，所以采用股票指数和债券指数加权复合的方法构建业绩比较基准。由于沪深300指数是反映沪深两市A股综合表现的跨市场成份指数，中债综合指数是全面反映债券市场价格变动趋势的指数，两者均具有良好的市场代表性，因此，选择沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准，同时，选取中债综合指数作为债券投资部分的比较基准。

十一、基金的风险收益特征

本基金属于风险收益水平适中的混合型基金品种，其长期平均的预期收益和风险低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同规定，于2016年6月24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截至2016年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	280,236,507.81	74.97
	其中：股票	280,236,507.81	74.97
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	1,895,378.00	0.51
	其中：债券	1,895,378.00	0.51
	资产支持证券	–	0.00
4	贵金属投资	–	0.00
5	金融衍生品投资	–	0.00
6	买入返售金融资产	–	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	91,384,307.78	24.45
8	其他资产	274,127.42	0.07
9	合计	373,790,321.01	100.00

2. 报告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	4,245.50	0.00
B	采矿业	17,670,749.80	4.75
C	制造业	216,946,769.31	58.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,200.56	0.02
E	建筑业	475.95	0.00
F	批发和零售业	37,833,715.85	10.16
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	331,642.64	0.09
J	金融业	3,922.51	0.00
K	房地产业	6,037.80	0.00
L	租赁和商务服务业	9,783.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	7,200,954.80	1.93
N	水利、环境和公共设施管理业	77.11	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	161,932.98	0.04
S	综合	–	0.00
	合计	280,236,507.81	75.26

（1）报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无

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	600885	宏发股份	1,555,661	37,646,996.20	10.11
2	002126	银轮股份	2,452,508	36,468,793.96	9.79
3	600998	九州通	1,736,374	28,997,445.80	7.79
4	002422	科伦药业	1,945,660	28,445,549.20	7.64
5	002127	南极电商	1,551,973	27,159,527.50	7.29
6	002475	立讯精密	793,292	23,203,791.00	6.23
7	002138	顺络电子	1,618,866	22,469,860.08	6.03
8	002588	史丹利	749,500	20,311,450.00	5.45
9	600759	洲际油气	2,262,580	17,670,749.80	4.75
10	000333	美的集团	294,175	9,075,298.75	2.44

4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

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	–	0.00
2	央行票据	–	0.00
3	金融债券	–	0.00
	其中：政策性金融债	–	0.00
4	企业债券	–	0.00
5	企业短期融资券	–	0.00
6	中期票据	–	0.00
7	可转债（可交换债）	1,895,378.00	0.51
8	同业存单	–	0.00
9	其他	–	0.00
10	合计	1,895,378.00	0.51

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	110034	九州转债	15,310	1,895,378.00	0.51

6. 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序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序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股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

10. 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。

11. 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。

本基金投资的前十名证券之一科伦药业，2015年4月22日，公司收到《中国证券监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书》；（一）科伦药业未按照规定披露临时报告；（二）科伦药业《2011年年度报告》和《2012年年度报告》存在重大遗漏。本基金认为，对科伦药业的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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

（3）基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	101,506.22
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	19,953.76
5	应收申购款	152,667.44
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	274,127.42

（4）报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600759	洲际油气	17,670,749.80	4.75	临时停牌

（6）由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

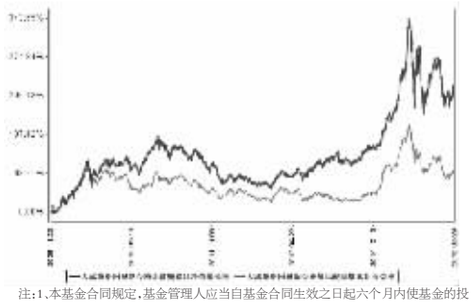
十三、基金业绩

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）自基金合同生效以来（2008年11月26日）至2016年3月31日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	净值增长率①	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
2008.11.26—2008.12.31	0.4%	0.05%	-0.61%	1.82%	1.01%	-1.77%
2009.1.1—2009.12.31	91.23%	1.81%	73.37%	1.65%	17.86%	0.16%
2010.1.1-2010.12.31	12.04%	1.32%	-9.34%	1.27%	21.38%	0.05%
2011.1.1-2011.12.31	-26.97%	1.19%	-19.71%	1.04%	-7.26%	0.15%
2012.01.01-2012.12.31	2.02%	1.13%	7.18%	1.02%	-5.16%	0.11%
2013. 1. 1-2013. 12.31	24.19%	1.19%	-5.49%	1.12%	29.68%	0.07%
2014.1.1-2014.12.31	26.22%	1.06%	42.46%	0.98%	-16.24%	0.08%
2015.1.1-2015.12.31	43.75%	2.76%	7.09%	1.99%	36.66%	0.77%
2016.1.1-2016.3.31	-10.67%	2.40%	-10.70%	1.94%	0.03%	0.46%
2008.11.26-2016.3.31	222.60%	1.62%	73.05%	1.38%	149.55%	0.24%

（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（2008年11月26日至2016年3月31日）



注：1、本基金合同规定，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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末，本基金投资的“宏发股份（600885）”因市场行情波动剧烈，导致单个股票的投资比例被动超标，在报告期末该股票停牌。除此之外，报告期内本基金的其他各项投资比例符合基金合同规定。

2、本基金业绩比较基准自2015年9月14日起由原“沪深300指数×80%＋中信全债指数×20%”变更为“沪深300指数×80%＋中债综合指数×20%”。

十四、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1. 基金费用种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）基金的证券交易费用；

（4）基金合同生效以后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；

（7）基金银行汇划费用；

（8）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2. 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

本基金的管理费按基金资产净值的1.50%年费率计提，即本基金的年管理费率为1.50%。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

管理费每日计提，逐日累计。对于已确认的管理费，由基金托管人于次月前5个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提，即本基金的年托管费率为0.25%。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为前一日的基金资产净值

托管费每日计提，逐日累计。对于已确认的托管费，由基金托管人于次月前5个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支取。

（3）本条第1款第（3）至第（8）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（二）与基金销售有关的费用

1. 申购与赎回的费用

本基金目前开通前端收费模式，将来根据市场发展状况和法律法规、监管机构的规定，可能增加新的收费模式，也可能相应增加新的基金份额种类，并可能需计算新基金份额类别的基金份额净值。增加新的收费模式，应当按照法律法规、监管机构的规定，履行适当的程序，并及时公告。新的收费模式的具体业务规则，请见有关公告、通知。

（1）申购费用

本基金申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、客户服务等各项费用。

申购金额M	申购费率
M<50万	1.50%
50万≤M<200万	1.00%
200万≤M<500万	0.60%
M≥500万	每笔1000元

基金申购份额的计算：

净申购金额=申购金额/（1＋申购费率）

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

申购份额、净申购金额的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

（2）赎回费用

本基金赎回费用由基金赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费在扣除手续费后，余额不低于赎回费总额25%的部分，应当归入基金财产。

持有基金时间T	赎回费率
T<1年	0.50%
1年≤T<2年	0.25%
T≥2年	0

基金净赎回金额的计算：

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

赎回总额、净赎回金额的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

（3）基金份额净值的计算

T日基金份额净值=T日基金资产净值 / T日基金份额总数

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

2. 基金转换费用

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

（三）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。基金合同生效前的相关费用，包括但不限于律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支，其他具体不得列入基金费用的项目依据相关法律法规执行。

（四）费率的调整

基金管理人和基金托管人等可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率或改变收费模式。调高基金管理费率、基金托管费率等相关费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非获得监管机构的豁免、基金合同或相关法律法规另有规定；调低基金管理费率、基金托管费率等相关费率或在不提高整体费率水平的情况下改变收费模式，无须召开基金份额持有人大会。

若将来法律法规或监管机构许可本基金或本类型的基金采取持续性销售服务费模式，则本基金可以依法引入持续性销售服务费收费模式；若引入该类收费模式没有增加现有基金份额持有人的费用负担，则无须召开基金份额持有人大会，法律法规或监管机构另有规定的除外。

基金管理人最迟于新的费率实施日前2日在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告，并报中国证监会备案。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照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

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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2016年1月11日公布的《大成策略回报股票型证券投资基金更新的招募说明书（2015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，主要更新的内容如下：

1. 根据最新资料，更新了“三、基金管理人”部分。
2. 根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。
3. 根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。
4. 根据最新数据，更新了“九、基金的投资”部分。
5. 根据最新数据，更新了“十、基金的业绩”部分。
6. 根据最新公告，更新了“二十三、其他应披露的事项”。
7. 根据最新情况，更新了“二十四、对招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司
二〇一六年七月八日

证券代码：000875　证券简称：吉电股份　公告编号：2016—062

吉林电力股份有限公司
关于向全资子公司增资的公告

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、本次增资概述

1、安徽吉电新能源有限公司（以下简称“安徽吉电公司”）是本公司全资子公司，公司拟以现金方式对安徽吉电公司增加注册资本金750万元，用于向叶县将军山新能源有限公司增资，以取得其30%股权。

2、本次增资议案经公司第六届董事会第五十八次会议审议通过。根据公司《章程》的相关规定，本次增资事项属董事会决策权限范围，无需提交股东大会审批。

3、本次交易不涉及关联交易。

二、投资主体介绍

投资主体为吉林电力股份有限公司，无其他投资主体。

三、增资标的的基本情况

类　型：有限责任公司（自然人投资或控股的法人独资）

住　所：合肥市高新区柏堰科技园明珠大道198号

法定代表人：曹乐凡

注册资本：叁仟贰佰壹拾玖万圆整

经营范围：新能源及可再生能源项目开发、投资、建设、检修维护、安装、技术研究、技术咨询、培训咨询、碳汇销售。

2、最近一年又一期的主要财务指标

单位:万元

序号	截止日期	资产总额	负债总额	净资产	营业收入	净利润
1	2015.12.31	12350	8994	3356	289	137
2	2016.3.31	12802	9344	3458	283	102

四、投资合同主要内容

本公司对全资子公司增资，故无需签订对外投资合同。

五、增资目的和对公司的影响

公司与安徽吉电公司拟向叶县将军山新能源有限公司（以下简称“叶县将军山公司）投资，以取得河南叶县将军山48MW风力发电项目的建设权。为使安徽吉电公司具备投资的能力，满足增资条件，现对安徽吉电公司增加注册资本金750万元。有利于加快公司新能源发展战略的实施，有利于加快公司在河南地区新能源项目的建设步伐，有利于公司进一步优化产业结构，增强盈利能力。

六、对外投资存在的主要风险

该增资事项尚需取得当地工商机关的审批。

七、备查文件

第六届董事会第五十八次会议决议。

特此公告。

吉林电力股份有限公司董事会
二〇一六年七月七日

证券代码：000875　证券简称：吉电股份　公告编号：2016—063

吉林电力股份有限公司
对外投资公告

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、对外投资概述

1、对外投资的基本情况

根据公司新能源发展战略，公司拟以现金方式向叶县将军山新能源有限公司（以下简称“叶县将军山公司”）增资750万元，取得其30%股权；同时公司全资子公司——安徽吉电新能源有限公司（以下简称“安徽吉电公司”）以现金方式向对叶县将军山公司增资750万元，取得其30%股权。

2、董事会审议投资议案的表决情况

公司第六届董事会第五十八次会议以九票同意、0票反对、0票弃权，审议通过了《关于拟向叶县将军山新能源有限公司增资的议案》。根据公司《章程》的相关规定，本次增资事项属董事会决策权限范围，无需提交股东大会审批。

3、是否构成关联交易

本次投资不购成关联交易。

二、投资标的基本情况

1、基本情况

叶县将军山新能源有限公司成立于2016年5月9日，是国电河南中投盈科新能源有限公司（以下简称“盈科公司”）的全资子公司，注册资本金1000万元，公司类型：有限责任公司。注册地址：叶县常村镇政府院内。法定代表人冯钊。经营范围：风力发电、太阳能发电、新能源开发、农业开发。《企业法人营业执照》：91410422337220340G。

叶县将军山公司的股权比例如下：

序号	股东名称	出资金额(万元)	实缴金额(万元)	持股比例
1	国电河南中投盈科新能源有限公司	1000	0	100%
2	合计：	1000	0	100%

2、经营情况和主要财务数据

中准会计师事务所（特殊普通合伙）对叶县将军山公司基准日为2016年4月30日的财务报表进行了审计，并出具了《2016年1-4月财务报表审计报告》（中准审字[2016]1933号），审计结果为总资产0元，负债0元，所有者权益0元。

三、对外投资的主要内容

1、公司拟向叶县将军山公司增资750万元以取得其30%股权，安徽吉电公司拟对叶县将军山公司增资750万元以取得其30%股权；盈科公司按叶县将军山公司原注册资本金1000万元实缴资本，以持有其40%股权。

增资完成后，叶县将军山公司的股权比例如下：

序号	股东名称	出资金额(万元)	持股比例
1	吉林电力股份有限公司	750	30%
2	安徽吉电新能源有限公司	750	30%
3	国电河南中投盈科新能源有限公司	1000	40%
4	合计：	2500	100%

投资各方按持股比例实缴注册资本金。

四、对外投资的目的

公司和公司全资子公司——安徽吉电新能源有限公司（以下简称：“安徽吉电公司”）拟与盈科公司共同开发建设河南叶县将军山48MW风力发电项目。

五、备查文件目录

1、公司第六届董事会五十八次会议决议；

2、中准会计师事务所（特殊普通合伙）《叶县将军山新能源有限公司专项审计报告》（中准审字[2016]1933号）。

六、其他

本次公告披露后，公司将及时披露此次对外投资的进展或变化情况。

吉林电力股份有限公司董事会
二〇一六年七月七日

证券代码：000875　证券简称：吉电股份　公告编号：2016—064

关于公司投资建设天津静海30MW屋顶分布式光伏发电站项目的投资公告

公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、对外投资概述

1、对外投资的基本情况

根据吉林电力股份有限公司（以下简称：公司）“北稳西征南扩”的新能源发展战略，为调整公司产业结构，提升清洁能源比重，促进公司健康、可持续发展，拟投资建设天津静海30MWp分布式光伏发电项目。

2、董事会审议表决情况

公司第六届董事会第五十八次会议，以9票同意、0票反对、0票弃权，审议通过了《关于投资建设天津静海30MWp屋顶分布式光伏发电站项目的议案》。此次投资不构成重大资产重组，无需提交公司股东大会审议批准。

3、是否构成关联交易

本次投资不购成关联交易。

二、投资标的基本情况

项目由公司控股子公司——合肥光成投资管理有限公司（以下简称“合肥光成”）的全资子公司——天津市阳东新能源发电科技有限公司（以下简称“天津阳东”）投资建设。项目位于天津市静海县经济技术开发区北区，项目规划建设容量30MWp，分别为赛尔特石油钻具有限公司屋顶20MWp、双蚨隆实业有限公司厂区屋顶10MWp，本期一次性建成。项目设计在赛尔特石油钻具有限公司26个厂房屋顶安装75460块265W/块的多晶硅光伏组件，配置20座1MW箱式逆变器，配套建设一座35kV开关站；双蚨隆实业有限公司10个厂房屋顶共安装36982块265W/块的多晶硅光伏组件，配置10座1MW箱式逆变器，配套建设一座35kV开关站。均经一回T接至赛尔特35kV变电站电源线（洋特线）。