

山西证券股份有限公司关于旗下 4 只基金修订基金合同、托管协议的公告

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“管理规定”)及基金合同和托管协议的有关规定,经与基金托管人协商一致并履行相关备案程序,山西证券股份有限公司决定对《山西证券日日添利货币市场基金》等 4 只基金的基金合同、托管协议进行修订,并对部分基金赎回费率进行调整。现将相关事宜公告如下:

一、基金名称和托管协议修订

本次修订所涉基金详见下表,基金合同、托管协议具体内容详见附件《山西证券股份有限公司旗下 4 只基金基金合同、托管协议修改对照表》。本次修订属于基金合同约定的基金管理人可与基金托管人可以协商一致变更基金合同的事项,并已履行相关规定程序,符合相关法律法规及基金合同的规定。

Table with 2 columns: 序号, 基金名称. Lists the 4 funds being revised.

二、部分基金赎回费率调整

鉴于《管理规定》规定“基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理,除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金,对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产”,部分基金或份额类别的赎回费率或赎回费计入基金财产比例将相应调整。

1. 基金管理人将下述基金或份额类别持续持有期少于 7 日(不含)对应的赎回费率调整为 1.5%,并将上述对投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

Table with 2 columns: 序号, 基金份额类别名称. Lists the funds and their categories with new redemption rates.

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,赎回费 100% 计入基金财产。

Table with 2 columns: 序号, 赎回费率. Shows the new redemption rates for the affected funds.

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,赎回费 100% 计入基金财产。

2. 转换业务涉及的转出基金赎回费率等事项按上述规则进行调整。 三、上述基金合同、托管协议的修订及部分基金赎回费率调整等相关事宜自 2018 年 3 月 31 日起生效。对于 2018 年 3 月 30 日 15:00 之前的赎回申请,适用调整前的赎回费率;对于 2018 年 3 月 30 日 15:00 之后的赎回申请,适用调整后的赎回费率。

四、其他事项

1. 投资者可通过以下途径咨询有关详情: 客户服务热线:95577

网址: http://publicfundfund.uszq.com/8000/

2. 风险提示:基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见,投资者在投资前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择适合的基金产品。

特此公告。 附件:《山西证券股份有限公司旗下 4 只基金基金合同、托管协议修改对照表》

山西证券股份有限公司 2018 年 3 月 30 日

山西证券股份有限公司旗下 4 只基金基金合同、托管协议修改对照表

Main table with columns: 章节, 原文条款, 修订后条款, 修订理由. Contains the detailed contract and agreement amendments for all four funds.

《山西证券日日添利货币市场基金托管协议》

按照流动性新规修改前后文对照表

Table with columns: 章节, 原文条款, 修订后条款, 修订理由. Focuses on amendments to the custody agreement for the '日日添利' fund.

山西证券保本混合型证券投资基金基金合同

按照流动性新规修改前后文对照表

Table with columns: 章节, 原文条款, 修订后条款, 修订理由. Focuses on amendments to the fund contract for the '保本混合' fund.

山西证券保本混合型证券投资基金托管协议

按照流动性新规修改前后文对照表

Table with columns: 章节, 原文条款, 修订后条款, 修订理由. Focuses on amendments to the custody agreement for the '保本混合' fund.

(下接 D136 版)

(上接 D136 版) 5) 本基金在任何交易日日内交易(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%;

(19) 本基金投资流通受限证券,基金管理人应根据中国证监会相关规定进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和合规风险等风险;

(20) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等本基金资产净值之外的因素致使基金不符合上述比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(21) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(22) 法律法规及中国证监会规定和《基金合同》约定的其他投资比例限制。 除第(2)、(14)、(20)、(21)项外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资组合不符合上述规定比例限制的,基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。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。期间,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监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易必须经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。

如果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。

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、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

1. 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. 中小企业私募债,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

3. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

4. 本基金法律法规及监管机构另有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任由基金管理人承担,因此,就由与基金相关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致意见的,按照基金管理人对基金净值计算的结果对外予以公布。

(四) 估值程序 1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到 0.0001 元,小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。 2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金托管人对外公布。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 (一) “基金合同”的变更 1. 变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

2. 关于“基金合同”变更的基金份额持有人大会决议须经中国证监会备案并自决议通过之日起生效,且自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。 (二) “基金合同”的终止事由 有下列情形之一,“基金合同”应当终止: 1. 基金份额持有人大会决定终止的;

2. 基金管理人、基金托管人职责终止,在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

3. “基金合同”约定的其他情形; 4. 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。 (三) 基金财产的清算 1. 基金财产清算小组:自出现“基金合同”终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2. 基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘请必要的工作人员。