

**山西证券股份有限公司**  
**山西证券日日添利货币市场基金**  
**更新招募说明书摘要**  
**(2015 年第 1 号)**

**基金管理人：山西证券股份有限公司**

**基金托管人：交通银行股份有限公司**

**重要提示**

本基金募集申请已于 2015 年 3 月 19 日获中国证监会证监许可（2015）414 号文准予募集注册。本基金的基金合同于 2015 年 5 月 14 日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册审查以要件齐备和内容合规为基础，以充分的信息披露和投资者适当性为核心，以加强投资者利益保护和防范系统性风险为目标。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据本基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2015年11月14日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

成立日期：1988 年 7 月 28 日

法定代表人：侯巍

联系电话：(0351) 8686966

传真：(0351) 8686918

注册资本：人民币 25.187 亿元

联系人：王怡里

股权结构：

名称	持股数（万股）	占总股数
山西省国信投资（集团）公司	860,395,355	34.16%
太原钢铁（集团）有限公司	316,925,854	12.58%
山西国际电力集团有限公司	234,569,715	9.31%
河南省安融房地产开发有限公司	66,122,351	2.63%
中央汇金投资有限责任公司	40,619,400	1.61%
郑州市热力总公司	26,401,312	1.05%
工银瑞信基金-农业银行-工银瑞信中证 金融资产管理计划	20,663,000	0.82%
南方基金-农业银行-南方中证金融资产 管理计划	20,663,000	0.82%
中欧基金-农业银行-中欧中证金融资产 管理计划	20,663,000	0.82%
博时基金-农业银行-博时中证金融资产 管理计划	20,663,000	0.82%
合计	1,627,685,987	64.62%

注：截止到 2015.9.30 前十大股东持股情况

经营范围：证券经纪；证券自营；证券资产管理；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券；代销金融产品；公开募集证券投资基金管理业务。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员基本情况

侯巍先生：董事长，董事，硕士。1994 年 7 月至 2001 年 12 月，历任山西省信托投资公司南宫证券营业部职员、经理助理、监理、经理；期间兼任山西省信托投资公司证券业务部投资银行部经理；2001 年 12 月至 2007 年 4 月任山西证券有限责任公司党委委员、副总经理；2007 年 4 月至 2008 年 1 月任山西证券有限责任公司党委委员、董事、总经理；2008 年 2 月至 2010 年 1 月担任公司党委委员、党委副书记；2014 年 12 月至今担任公司党委书记；2008 年 4 月至 2010 年 9 月任大华期货董事；2009 年 4 月至今任中德证券董事长；2015 年 2 月至今任山西证券股份有限公司董事长、总经理。

周宜洲先生：董事，硕士。1980年12月至1996年6月在太原钢铁公司财务处先后担任成本科科员、成本科科长和副处长；1996年6月至2002年9月，在太原钢铁（集团）有限公司先后担任财务处处长、副总会计师兼财务处处长、总会计师兼财务处处长；自2002年9月至2011年10月任太原钢铁（集团）有限公司总会计师；2011年10月至今，担任太原钢铁（集团）有限公司副总经理；2008年2月至今任山西证券股份有限公司董事。

王拴红先生：董事，博士。1986年9月至1993年1月，任河南财经学院讲师、副主任；1993年2月至2011年1月，任格林期货有限公司董事长；1998年9月至今任格林集团投资有限公司董事长；2006年4月至今任格林大华期货（香港）有限公司董事；2013年12月至今任格林财富投资管理有限公司执行董事、总经理；2013年12月至今任永扬国际集团有限公司董事；2014年2月至今任山西证券股份有限公司董事。

傅志明先生：董事，硕士。2010年12月至2013年5月任山西国际电力集团有限公司董事，党委副书记，2013年5月至今任晋能有限责任公司监事会副主席。

柴宏杰先生：董事，学士。2009年4月至2014年8月历任晋商银行董事会办公室副主任、行长办公室副主任、董事会办公室主任、大同分行行长；2014年9月至2015年2月，任山西省国信投资（集团）公司董事会办公室主任、党委办公室主任；2014年12月至今，任山西省国信投资（集团）公司投资管理部总经理、投资总监；2015年1月至今，任中合盛资本管理有限公司董事长；2015年5月至今任山西证券股份有限公司董事。

樊廷让先生：董事，硕士。曾任职于中国工商银行山西省分行干校；1985年7月至1992年7月任职于山西省信托投资公司国际金融处，营业部和信贷处；1992年7月至1993年12月任山西省信托投资公司信贷处副处长；1993年12月至1997年3月任山西省信托投资公司证券业务部南宫证券营业部副经理（主持工作），并于1995年2月兼任证券业务部副经理；1997年3月至1998年3月任山西省信托投资公司证券业务部副经理兼上海证券营业部经理；1998年3月至1999年3月任山西省信托投资公司证券业务总部常务副总经理（主持工作）；1999年3月至2001年12月任山西省信托投资公司证券总部总经理；2001年12月至

2008年1月任山西证券有限责任公司党委委员；2001年12月至2007年4月任山西证券有限责任公司副总经理；2007年5月至2008年1月任山西证券有限责任公司常务副总经理；2008年2月至今任公司党委委员、常务副总经理；2015年5月至今任山西证券股份有限公司董事。

赵树林先生：董事，硕士。1982年2月至1988年12月任职于太原东风机械厂；1988年12月至1992年5月任山西省经济委员会干部处从事经济管理、人事、工资、职称管理等工作、主任科员；1992年5月至2002年6月历任山西省人民政府办公厅秘书、经济一处副处长，秘书二处副处长、正处调研员；2002年6月至2008年1月任山西证券有限责任公司党委副书记、纪检书记、工会主席；2004年7月至2008年1月任山西证券有限责任公司副总经理；2008年2月至今任公司党委副书记、副总经理、纪检书记、工会主席；2015年5月至今任山西证券股份有限公司董事。

蒋岳祥先生：独立董事，博士。1987年8月至1990年12月任浙江大学应用数学系助教、分团委书记；1991年1月至1991年4月任杭州缝纫机厂核心组成员；1991年5月至1997年8月任浙江大学研究生院科长；1997年9月至1998年1月任浙江大学党总支专职委员；1998年2月至1999年8月任浙江大学研究生管理处副处长；1999年8月至2000年10月任瑞士伯尔尼大学统计与保险精算研究所高级访问学者；2000年11月至2003年1月任瑞士伯尔尼大学统计与保险精算研究所助理教授；2003年2月至2005年11月任浙江大学经济学院副教授、副所长；2005年12月至2009年3月任浙江大学经济学院金融系教授、博导、系主任、院长助理；2009年4月至2013年7月，任浙江大学经济学院党委书记、副院长；2009年4月至今任浙江大学经济学院教授、博导、党委书记、副院长；2008年3月至2014年3月，任横店集团东磁股份有限公司独立董事；2008年5月至2014年5月，任普洛药业股份有限公司独立董事；2014年7月至今任国信证券股份有限公司独立董事；2011年5月至今任山西证券股份有限公司独立董事。

容和平先生：独立董事，本科。1971年7月至1978年9月任冶金部第十三冶金建筑公司工会干事；1982年8月至今任山西大学经济与工商管理学院助教、讲师、副教授、系教研室主任、系副主任、学院副院长、教授、研究室主任；2001

年6月至2010年6月任山西大学商务学院副院长、教授；2011年5月至今任山西工商学院副院长、教授；2012年4月至今任山西西山煤电股份有限公司独立董事；2012年9月至今任山西百圆裤业连锁经营股份有限公司独立董事；2011年5月至今任山西证券股份有限公司独立董事。

王卫国先生：独立董事，硕士。1969年2月至1972年12月重庆开县善字乡插队知青；1972年12月至1977年7月任解放军四川省军区独立第四营班长；1977年7月至1978年10月任重庆市文化局干事；1985年1月至1994年4月任西南政法大学副教授；1994年4月至今任中国政法大学教授；2008年9月至今兼任任中国银行法学研究会，现任会长；2011年10月至今，任山东力博重工科技股份有限公司独立董事；2014年10月至今，任格尔木藏格钾肥股份有限公司独立董事；2011年5月至今任山西证券股份有限公司独立董事。

朱海武先生：独立董事，硕士。中国注册会计师、高级会计师、中国注册税务师、澳洲资深会计师。1985年8月至1993年8月，在财政部商贸金融司工作；1993年8月至1999年12月，在中华会计师事务所工作，任项目经理、经理、副总经理。2000年1月至今，在瑞华会计师事务所工作，担任合伙人。现兼任两家上市公司（华远地产股份有限公司、中钢国际工程技术股份有限公司）和两家拟上市公司（唐山三孚硅业股份有限公司、广东天禾农资股份有限公司）独立董事 2015年5月至今任山西证券股份有限公司独立董事。

## 2、监事会成员基本情况

焦杨先生：监事会主席，监事，硕士。1990年8月至1993年2月，任职于太原化学工业集团硫酸厂；1993年3月至1997年2月，任职于山西省审计厅；1997年3月至2010年1月，历任山西信托计划处副处长、资金管理部副经理、公司副总经理兼资金管理部经理，2010年2月至今任山西信托常务副总经理；2014年12月至今任国信集团风控总监兼审计风控部总经理；2010年10月至2011年5月任山西证券股份有限公司监事；2011年5月至今任山西证券股份有限公司监事会主席。

胡朝晖先生：监事会副主席，本科。1992年12月至1997年2月任山西省信托投资公司证券部部门经理；1997年3月至2002年1月任山西省信托投资公司经营部经理、汾酒厂营业部经理、西矿街营业部经理；2002年2月至2007年

3月任山西证券有限责任公司坞城路营业部总经理、西安高新二路营业部总经理；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司风险控制部总经理；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工监事；2008年2月至今任公司风险控制部总经理、职工监事；2009年1月起任山西证券股份有限公司监事会副主席；2011年7月至今任龙华启富投资有限公司监事；2014年6月任山证资本管理（北京）有限公司监事。

高明先生：监事，专科。1984年9月至今历任汾酒集团有限责任公司基建出纳、会计、财务科副科长、科长、审计部副主任、主任、山西杏花村汾酒厂股份有限公司财务处处长、汾酒集团有限责任公司财务部主任、副总会计师；2013年8月至今任山西杏花村汾酒集团有限责任公司总会计师；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司董事；2008年2月至今任山西证券股份有限公司监事。

罗爱民先生：监事，本科。1996年2月至1998年3月任山西省经贸资产经营有限责任公司干事；1998年3月至2004年2月任山西省经贸资产经营有限责任公司业务主办；2004年2月至2005年3月任山西省经贸资产经营有限责任公司副处长；2005年3月至2010年3月任山西省经贸资产经营有限责任公司处长；2010年3月至今任山西经贸集团技改投资有限公司总经理；2007年6月至今，任太原重工股份有限公司监事；2011年5月至今任山西证券股份有限公司监事。

关峰先生：监事，本科。2001年6月至2013年6月，历任山西焦化集团有限公司审计处副处长，处长；2013年6月至2014年4月，任山西焦化集团有限公司财务处处长；2014年5月至今，任山西焦化集团有限公司财务处处长兼集团副总会计师；2015年5月至今任山西证券股份有限公司监事。

郭志宏先生：监事，硕士。1983年6月参加工作，曾任中国人民银行长子县支行副行长、人民银行长治分行政教科副科长、长治市城市信用中心社副主任、长治市城市信用社总经理、长治市商业银行副行长（主持工作）、行长；2012年5月至2015年3月，任山西信托股份监事、监事会主席；2015年3月至今任山西信托党委委员。

李国林先生：监事，本科。1996年7月至今，在山西省科技基金发展总公司（以下简称“科技基金公司”）工作。从事创业风险投资、科技项目投资管理、

历任科技基金公司部门副经理、部门经理、总经理助理；2011年12月至今，任科技基金公司总法律顾问；2012年4月至今任科技基金公司副总经理、总法律顾问；2015年5月至今任山西证券股份有限公司监事。

刘奇旺先生：监事，本科。1987年8月至今在吕梁市国有资产投资集团公司（原吕梁地区信托投资公司）工作；1987年8月至1992年10月，在财务部从事会计工作；1992年10月至2007年5月，历任办公室副主任、办公室主任；2007年5月至今任总会计师；2015年5月至今任山西证券股份有限公司监事。

王国峰先生：监事，本科。1997年3月至2010年1月，1990年2月至今在长治市行政事业单位国有资产管理中心（以下简称“中心”）工作；2005年3月至2015年3月，任中心副主任；2015年4月至今，全面主持中心工作；2015年5月至今任山西证券股份有限公司监事。

闫晓华女士：职工监事，本科。曾任职于山西省物资回收公司。1997年4月至2001年2月任职于山西证券有限责任公司五一路营业部和综合部；2001年2月至2005年7月任山西证券有限责任公司综合管理部总经理；2001年2月至2002年2月任山西证券有限责任公司西安营业部总经理（兼）；2005年7月至2006年7月任山西证券有限责任公司人力资源部总监；2006年7月至2008年1月任山西证券有限责任公司稽核考核部总经理；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工监事；2008年2月至今任山西证券股份有限公司稽核考核部总经理、职工监事。

尤济敏女士：职工监事，硕士。1993年7月至1996年12月任山西省信托投资公司证券营业部交易员、交易负责人；1997年1月至1998年3月任山西省信托投资公司证券总部投资银行项目经理；1998年4月至1999年3月任山西省信托投资公司证券总部经营部副经理；1999年4月至2001年12月任山西省信托投资公司证券总部经营部经理；2002年1月至2006年4月任山西证券有限责任公司资产经营部副总经理、总经理；2006年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司人力资源部总经理；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工监事；2008年2月至2011年8月任公司党办主任；2008年2月至今任山西证券股份有限公司人力资源部总经理、职工监事；2011年7月至今任龙华启富投资有限公司董事。



翟太煌先生：职工监事，硕士。曾任职于国营二四七厂。1998年至1999年任职于山西省信托投资公司证券总部投资银行部；1999年至2001年任山西省信托投资公司证券总部研究部副经理；2001年至2007年3月任山西证券有限责任公司研究发展部副总经理、总经理；2007年3月至2008年1月任山西证券有限责任公司研究所所长；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工监事；2008年2月至今任山西证券股份有限公司研究所所长、职工监事；2011年7月至今任龙华启富投资有限公司董事；2014年6月任山证资本管理（北京）有限公司董事。

### 3、高级管理人员基本情况

侯巍先生：董事长，总裁。简历参见董事会成员基本情况。

樊廷让先生：常务副总经理，硕士。曾任职于中国工商银行山西省分行干校。1985年7月至1992年7月任职于山西省信托投资公司国际金融处、营业部和信贷处；1992年7月至1993年12月任山西省信托投资公司信贷处副处长；1993年12月至1997年3月任山西省信托投资公司证券业务部南宫证券营业部副经理（主持工作），并于1995年2月兼任证券业务部副经理；1997年3月至1998年3月任山西省信托投资公司证券业务部副经理兼上海证券营业部经理；1998年3月至1999年3月任山西省信托投资公司证券业务总部常务副总经理（主持工作）；1999年3月至2001年12月任山西省信托投资公司证券总部总经理；2001年12月至2008年1月任山西证券有限责任公司党委委员；2001年12月至2007年4月任山西证券有限责任公司副总经理；2007年5月至2008年1月任山西证券有限责任公司常务副总经理；2008年2月至今任山西证券股份有限公司党委委员、常务副总经理。

乔俊峰先生：副总经理，硕士。曾任职于山西省轻工业学校、山西省信托投资公司迎泽大街证券营业部、大营盘营业部。1997年3月至1999年2月任山西省信托投资公司证券业务总部副总经理、副总监；1999年3月至2001年8月任山西省信托投资公司上海双阳路证券营业部总监、总经理；2001年9月至2005年8月任山西证券有限责任公司网络交易部总经理、兼任山西证券有限责任公司太原府西街证券营业部总经理、智信网络董事长兼总经理；2005年8月至2007年8月任山西证券有限责任公司经纪业务总部总经理；2007年11月至今任大华

期货董事；2008年2月至2008年9月任公司期货筹备组负责人；2008年10月至2010年9月任大华期货总经理；2010年9月至2013年10月任大华期货董事长；2013年10月至今任格林大华董事长；2010年12月至今任公司副总经理；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工董事；2008年2月至今任山西证券股份有限公司职工董事；2010年2月至今担任山西证券股份有限公司党委委员。

赵树林先生：副总经理，硕士。1982年2月至1988年12月任职于太原东风机械厂；1988年12月至1992年5月任山西省经济委员会干部处从事经济管理、人事、工资、职称管理等工作，主任科员；1992年5月至2002年6月历任山西省人民政府办公厅秘书、经济一处副处长、秘书二处副处长、正处调研员；2002年6月至2008年1月任山西证券有限责任公司党委副书记、纪检书记、工会主席；2004年7月至2008年1月任山西证券有限责任公司副总经理；2008年2月至今任山西证券股份有限公司党委副书记、副总经理、纪检书记、工会主席。

孟有军先生：副总经理，本科。曾任职于农行山西省应县支行、农行山西省雁北地区支行、农行山西省朔州市分行信用合作科副科长。1992年4月至1995年3月任农行山西信托公司朔州业务部总经理。1995年4月至2000年1月任山西证券有限责任公司朔州业务部总经理；2000年2月至2003年5月任山西证券有限责任公司研究发展部总经理；2003年6月至2004年6月任山西证券有限责任公司离石营业部总经理；2004年7月至2005年9月任山西证券有限责任公司法规部总经理；2005年9月至2007年8月任山西证券有限责任公司总经理助理兼风控部总经理；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司党委委员；2007年8月至2008年1月任山西证券有限责任公司副总经理；2008年2月至今任山西证券股份有限公司党委委员、副总经理；2008年11月至2015年1月兼任山西证券股份有限公司合规总监。

汤建雄先生：副总经理、财务总监、合规总监，本科。1991年7月至1996年1月任职于太原塑料一厂销售科；1996年1月至1996年12月任职于山西省信托投资公司计划财务处；1996年12月至1999年12月任山西省信托投资公司上海证券部财务经理；1999年12月至2001年9月任山西省信托投资公司证券总部清算部副总经理；2001年9月至2003年9月任山西证券有限责任公司资产

管理部副总兼总监理；2003年9月至2008年1月任山西证券有限责任公司计划财务部总经理；2008年2月至2013年3月任公司计划财务部总经理；2007年11月至2013年10月任大华期货董事；2013年10月至今任格林大华董事；2009年4月至今担任中德证券董事；2010年4月至今任山西证券股份有限公司财务总监；2011年8月至今任山西证券股份有限公司副总经理；2011年7月至今任龙华启富投资有限责任公司董事。

王怡里先生：副总经理、董事会秘书，本科。1994年8月至1999年4月任职于山西省电力局；1999年5月至2002年3月任山西卓根电力发展集团公司副总经理；2002年4月至2004年3月任山西证券有限责任公司资产管理部副总经理；2004年4月至2004年7月任山西证券有限责任公司资产管理太原部副总经理、总监；2004年8月至2007年3月任山西证券有限责任公司综合管理部（董事会办公室）副总经理；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司综合管理部（董事会办公室）总经理；2008年2月至2013年3月任公司董事会办公室总经理；2008年2月至今任公司综合管理部总经理；2010年2月至今担任公司党委委员；2010年4月至今任山西证券股份有限公司董事会秘书；2011年8月至今任山西证券股份有限公司副总经理；2013年6月至今任山证基金管理有限公司董事长；2013年6月至今任山西省中小企业创投基金执行合伙人；2014年6月至今任山证资本管理（北京）有限公司董事长；2015年2月至今任龙华启富投资有限责任公司董事长。

#### 4、本基金拟任基金经理

华志贵先生，复旦大学经济学硕士。2004年5月至2008年8月，在东方证券股份有限公司固定收益业务总部任高级投资经理；2008年9月至2009年8月，在中欧基金管理有限公司，从事研究、投资工作；2009年9月，加入华宝兴业基金管理有限公司，2010年6月至2011年9月担任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理；2010年6月至2013年4月担任华宝兴业增强收益债券型投资基金基金经理；2011年4月至2014年5月担任华宝兴业可转债基金基金经理。2014年11月加盟本公司公募基金部，任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。

## 5、投资决策委员会成员

主任委员：

孟有军，公司副总裁

委员：

薛永红，公募基金部总经理；

张立德，计划财务部副总经理；

王忠宁，运营管理部副总经理；

华志贵，基金经理；

刘俊清女士，研究员；

王磊，研究员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住 所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：汤嵩彦

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月，交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2014 年《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 19 位，跻身全球银行 20 强；根据《财富》杂志发布的“世界 500 强公司”排行榜，交通银行位列第 217 位。2014 年荣获《首席财务官》杂志评选的“最佳资产托管奖”。

截至 2015 年 9 月 30 日，交通银行资产总额达到人民币 7.21 万亿元，实现净利润人民币 520.40 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## （二）主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生 2013 年 10 月至今任本行董事长、执行董事，2013 年 5 月至 2013 年 10 月任本行董事长、执行董事、行长，2009 年 12 月至 2013 年 5 月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生 1983 年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997 年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999 年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金

投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截止 2015 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 139 只。此外，还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

1、直销机构：山西证券股份有限公司

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

董秘：王怡里

联系电话：（0351）8686966

传真：（0351）8686918

客服电话：95573

网址：www.i618.com.cn

2、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构新增为本基金的发售机构，并及时公告。

## 二、注册登记机构

名称：山西证券股份有限公司

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

董秘：王怡里

联系电话：（0351）8686966

传真：（0351）8686918

客服电话：95573

网址：www.i618.com.cn

## 三、律师事务所和经办律师

名称：国浩律师（上海）事务所

办公地址：上海市北京西路 968 号嘉地中心 23-25 层

负责人：黄宁宁

电话：（021）52341668

传真：（021）52433320

经办律师：林雅娜 方祥勇

联系人：林雅娜

#### 四、会计师事务所和经办注册会计师

名称：中喜会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市崇文区崇文门外大街 11 号新城文化大厦 A 座 11 层

办公地址：北京市崇文区崇文门外大街 11 号新城文化大厦 A 座 11 层

法定代表人：张增刚

电话：010-68085873

经办注册会计师：白银泉 张艳光

联系人：冀云娥

### 第四部分 基金的名称

本基金名称：山西证券日日添利货币市场基金。

### 第五部分 基金的类型

基金类型为货币市场型基金。

### 第六部分 基金的投资目标

在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。



## 第七部分 基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体如下：

- 1、现金；
- 2、通知存款；
- 3、短期融资券；
- 4、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
- 5、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；
- 6、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
- 7、期限在一年以内（含一年）的债券回购；
- 8、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期票据；
- 9、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；
- 10、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 第八部分 基金的投资策略

### 一、投资策略

本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。

#### 1、资产配置策略

本基金根据宏观经济运行状况、财政与货币政策形势、信用状况、市场结构变化和短期资金供给等因素的综合判断，结合各类资产的流动性特征、风险收益、

估值水平特征，决定各类资产的配置比例和期限匹配量，并适时进行动态调整。

## 2、个券选择策略

本基金将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值，发掘出具备相对价值的个券。

## 3、银行存款投资策略

本基金根据不同银行的银行存款收益率情况，结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析，以及对整个利率市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。

## 4、久期策略

本基金根据对未来短期利率走势的研判，结合货币市场基金资产的高流动性要求及其相关的投资比例规定，动态调整组合的久期。当预期市场短期利率上升时，本基金将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期，以降低组合跌价风险；当预期市场短期利率下降时，则通过增持剩余期限较长的债券等方式提高组合久期，以分享债券价格上升的收益。

## 5、回购策略

根据回购市场利率走势变化情况，在回购利率较低时，本基金在严格遵守相关法律法规的前提下，利用正回购操作循环融入资金进行债券投资，提高基金收益水平。另一方面，本基金将把握资金供求的瞬时效应，积极捕捉收益率峰值的短线机会。如新股发行期间、年末资金回笼时期的季节效应等短期资金供求失衡，导致回购利率突增等。此时，本基金可通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。

## 6、套利策略

不同交易市场或不同交易品种受参与群体、交易模式、环境冲击、流动性等因素影响而出现定价差异，从而产生套利机会。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上，适度进行跨市场或跨品种套利操作，提高资产收益率。如跨银行间和交易所的跨市场套利，期限收益结构偏移中的不同期限品种的互换操作

(跨期限套利)。

## 7、现金流管理策略

本基金作为现金管理工具，具有较高的流动性要求，本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。

## 二、投资限制

### 1、组合限制

(1) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天；

(2) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(3) 投资于定期存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但如果基金投资有固定期限但协议中约定可以提前支取且利息没有损失的存款，不受该比例限制；

(4) 存款银行仅限于有基金托管资格、基金销售业务资格以及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。其中，存放在具有基金托管资格的同一家商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一家商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；

(5) 除发生巨额赎回的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整；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；基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(6) 通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天；

(7) 持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；

(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%，中国证监会规定的特殊品种除外；

(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%；本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%；

(11) 投资于同一公司发行的短期融资券及企业债券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；

(12) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：①国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；②根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：A. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；B. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。（同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准）；本基金持有短期融资券期间，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 20 个交易日内予以全部减持；

(13) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级；本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级；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，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除上述（12）、（13）项外，由于证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金的上述限制相应变更或取消。

## 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，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、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、行政法规和中国证监会禁止的其他活动。

## 3、本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票、股指期货、国债期货；
- (2) 可转换债券；
- (3) 剩余期限超过 397 天的债券；
- (4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券；
- (5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化后另有规定的，从其规定；
- (6) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；
- (7) 流通受限证券；
- (8) 权证；

(9) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。

#### 4、关联交易原则

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的同意，并按法律法规予以披露。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

人民币活期存款利率（税后）

活期存款是具备最高流动性的存款，本基金期望通过科学严谨的管理，使本基金达到类似活期存款的流动性以及更高的收益，因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

## 第十一部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 10 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

### 投资组合报告

#### 1.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,213,928,378.45	57.98
	其中：债券	1,213,928,378.45	57.98
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	167,002,130.50	7.98
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	676,192,970.84	32.30
4	其他资产	36,641,095.68	1.75
5	合计	2,093,764,575.47	100.00

#### 1.2 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	5.38
	其中：买断式回购融资	—

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	29,999,835.00	1.46
	其中：买断式回购融资	—	—

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 1.3 基金投资组合平均剩余期限

### 1.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 1.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	13.74	1.46
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	23.30	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	17.98	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—



4	90天(含)–180天	29.24	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)–397天(含)	15.57	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		99.83	1.46

#### 1.4 报告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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	1,213,928,378.45	58.91
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	同业存单	—	—
8	其他	—	—
9	合计	1,213,928,378.45	58.91
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

#### 1.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041560013	15陕有色CP001	500,000	50,251,065.41	2.44
2	041558001	15营口港CP001	500,000	50,218,293.94	2.44
3	041559021	15京机电CP001	500,000	50,173,038.08	2.44
4	011574003	15陕煤化	500,000	50,111,347.61	2.43

		SCP003			
5	041564036	15常熟发投 CP001	500,000	50,077,175.58	2.43
6	011599530	15云能投 SCP005	500,000	49,975,743.84	2.43
7	041553017	15兖州煤业 CP001	400,000	40,208,896.69	1.95
8	041556014	15桂交投CP001	400,000	40,201,082.93	1.95
9	041553014	15冀中CP001	400,000	40,194,596.94	1.95
10	041553003	15大丰海港 CP001	400,000	40,149,751.22	1.95

### 1.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0995%
报告期内偏离度的最低值	-0.0101%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0441%

### 1.7 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。

### 1.8 投资组合报告附注

#### 1.8.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

#### 1.8.2

本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

#### 1.8.3

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

## 1.8.4 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	35,089,416.68
4	应收申购款	1,551,679.00
5	其他应收款	—
6	其他	—
7	合计	36,641,095.68

## 第十二部分 基金的业绩

本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、基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

## 1、山证日日添利货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.7460 %	0.0005 %	0.0895 %	0.0000%	0.6565 %	0.0005 %

## 2、山证日日添利货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.6299	0.0035	0.0895	0.0000%	0.5404	0.0035

	%	%	%		%	%
--	---	---	---	--	---	---

### 3、山证日日添利货币C

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 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
过去三个月	0.3656 %	0.0006 %	0.0895 %	0.0000%	0.2761 %	0.0006 %

注：1、本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）；

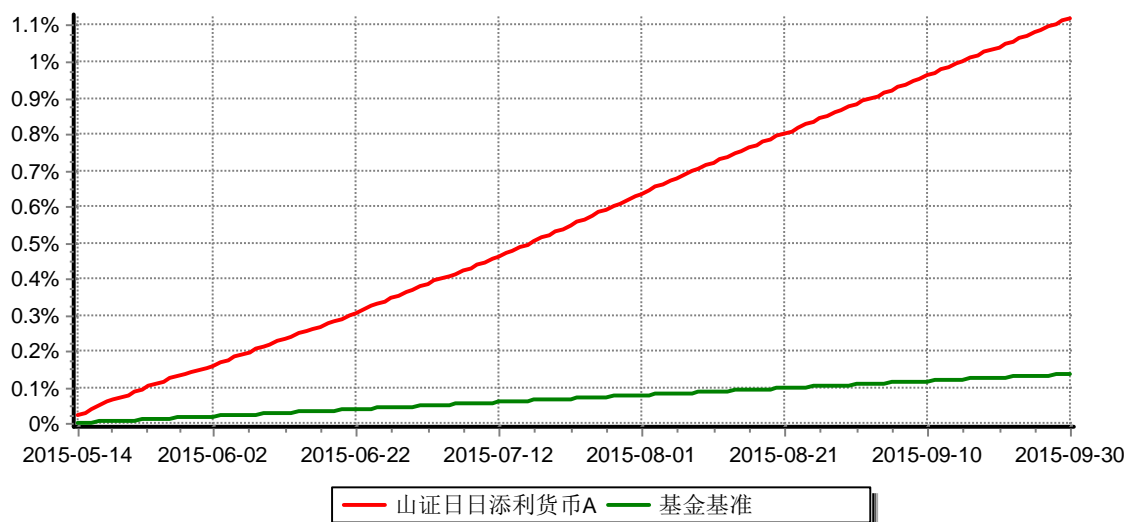
2、本基金收益分配是按日结转份额。

## 二、自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

### 山证日日添利货币A

#### 累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

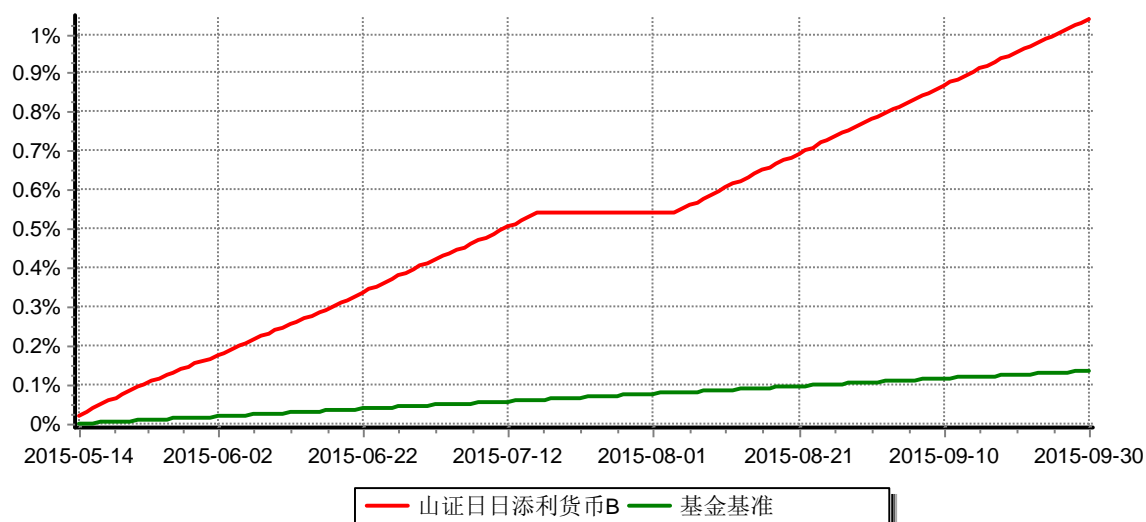
（2015年05月14日-2015年09月30日）



## 山证日日添利货币B

## 累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

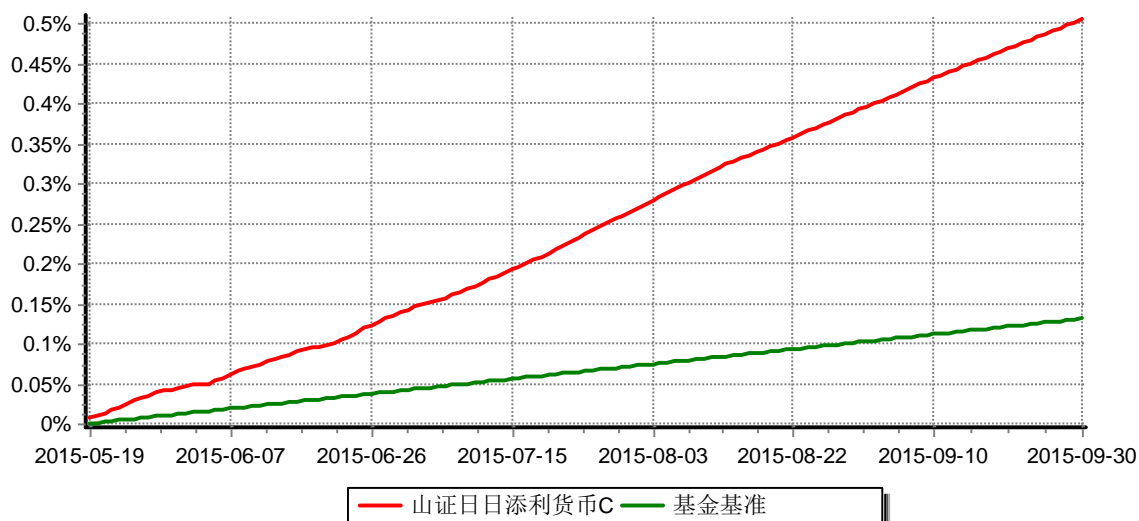
(2015年05月14日-2015年09月30日)



## 山证日日添利货币C

## 累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年05月19日-2015年09月30日)



注：1、本基金基金合同生效日为2015年5月14日，至本报告期末，本基金运作时间未满一年；

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

## 第十三部分 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、销售服务费。
- 4、增值服务费。
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费。
- 7、基金份额持有人大会费用。
- 8、基金的证券交易费用。
- 9、基金的银行汇划费用。
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、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 A 类基金份额的管理费为年费率 0.3%，B 类基金份额的管理费为年费率 0.3%，C 类基金份额的管理费为年费率 0.3%。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金管理费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 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、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。C 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%。三类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支

付。

#### 4、增值服务费

本基金 C 类基金份额为投资者提供了增值服务。山西证券日日添利货币市场基金增值服务是指根据投资者证券账户的指令为其提供货币市场基金的自动申购和赎回等操作。

对于接受增值服务的本基金 C 类基金份额,每日应收取的增值服务费以 1.5% 的年费率、按其持有的前一日基金资产净值进行计算。增值服务费率如有调降,将通过基金管理人公告的方式对外予以通知。具体计算方式如下:

$$H=E \times \text{年增值服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金增值服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金增值服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金增值服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 5 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、公休假等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 5—10 项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、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;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项



目。

#### 四、费用调整

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、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在至少一种指定媒体上公告。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

山西证券日日添利货币市场基金(以下简称“本基金”)招募说明书(更新)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》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于 2015 年 4 月 23 日刊登的本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

- 一、更新了“重要提示”中相关内容。
- 二、更新了“第一部分 绪言”中相关内容。
- 三、更新了“第二部分 释义”中相关内容。
- 四、更新了“第三部分 基金管理人”中相关内容。

- 五、更新了“第四部分 基金托管人”中相关内容。
- 六、更新了“第五部分 相关服务机构”中相关内容。
- 七、更新了“第七部分 基金的募集”中相关内容。
- 八、更新了“第八部分 基金合同的生效”中相关内容。
- 九、更新了“第十部分 基金的投资”中相关内容。
- 十、更新了“第十一部分 基金的业绩”中相关内容。
- 十一、更新了“第二十三部分 其他应披露事项”中相关内容。
- 十二、更新了“第二十五部分 备查文件”中相关内容。

山西证券股份有限公司

二〇一五年十二月十四日