

关于山西证券日日添利货币市场基金

修改基金合同的公告

2015年12月17日，中国证监会和中国人民银行联合颁布了《货币市场基金监督管理办法》（证监会令【第120号】）、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》（证监会公告【2015】30号）。进一步完善了货币市场基金投资范围、期限及比例等监管要求，针对货币市场基金投资组合的风险控制、偏离度控制等方面做出了新的规定。

为符合新颁布的《货币市场基金监督管理办法》的规定，在不违反《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》等相关法律法规、基金合同的有关约定，山西证券股份有限公司（以下简称“本公司”）作为山西证券日日添利货币市场基金（以下简称“本基金”）基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）协商一致，并报中国证监会备案，本公司对《山西证券日日添利货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的相关内容进行了修订。本次修订的内容属于因相应的法律法规发生变动而作出的修改，对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会决定，现将具体事宜公告如下：

一、《基金合同》的具体修订内容如下：

《基金合同》 目录	《基金合同》原条款	《基金合同》修改后条款
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办

	<p>管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《货币市场基金管理暂行规定》(以下简称“《暂行规定》”)和其他有关法律法规。</p>	<p>法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《货币市场基金监督管理办法》(以下简称“《管理办法》”)和其他有关法律法规。</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>45、摊余成本法：指估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益</p> <p>59、《暂行规定》：指《货币市场基金管理暂行规定》</p>	<p>45、摊余成本法：指计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益</p> <p>59、《管理办法》：指《货币市场基金监督管理办法》</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>6、在满足相关流动性风险要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>13、当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本</p>

	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>法计算的基金资产净值的正偏离度达到 0.5%时。</p> <p>14、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、13、14 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。对于上述第 8、9、10、11、12 项暂停申购情形，本公司将每一交易日设定并在基金管理人网站上公布申购上限。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>6、当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人决定履行适当程序终止基金合同的。</p> <p>7、为公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益，单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额 10%的，基金管理人可以采取延期办理部分赎回申请或者延缓支付赎回款项的措施。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p>
--	---	---

		<p>3、单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额 10%的，基金管理人可以采取延期办理部分赎回申请或者延缓支付赎回款项的措施。具体可参照巨额赎回中关于延期办理、延缓支付赎回款项的规则办理，并予以公告。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p>	<p>(一)基金管理人简况 注册资本：251872.5153 万元人民币</p>	<p>(一)基金管理人简况 注册资本：282872.5153 万元人民币</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>二、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</p>	<p>二、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； 2.一年以内(含一年)的银行定期存款、同业存单； 3.剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券与非金融企业债务融资工具； 4.期限在一年以内(含一年)的中央银行票据； 5.期限在一年以内(含一年)的债券回购；</p>

	<p>期票据</p> <p>9、剩余期限在 397 天以内 (含 397 天) 的资产支持证券 ;</p> <p>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。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1)本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天 ;</p> <p>(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% ;</p> <p>(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提前支取利率不变的存款 , 不受该比例限制 ;</p> <p>(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商业银行的存款 , 不得超过基金资产</p>	<p>6.剩余期限在 397 天以内 (含 397 天) 的资产支持证券 ;</p> <p>7.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。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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 , 平均剩余存续期不得超过 240 天 ;</p> <p>(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% ;</p> <p>(3)投资于固定期限银行存款的比例 , 不得超过基金资产净值的 30% , 但投资于有存款期限 , 根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制 ;</p> <p>(4)投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20% ; 投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5% ;</p>
--	---	---

	<p>净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同 一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>(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的 20%的，基金管理人应当在 5 个工作日内进行 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%；</p> <p>(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；</p> <p>(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%；</p> <p>(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；</p> <p>(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%；</p>	<p>(5)除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上 的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净 值的比例不得超过 20%；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%；</p> <p>(6)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；</p> <p>(7)本基金投资于同一机构发行的债券、非金融企 业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持 证券占基金资产净值的比例合计不超过 10%，国</p>
--	---	---

	<p>(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%；</p> <p>(11)投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例，合计不得超过基金资产净值的10%；</p> <p>(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：</p> <p>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；</p> <p>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：</p> <p>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；</p> <p>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</p>	<p>债、中央银行票据、政策性金融债券除外；</p> <p>(8)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%；</p> <p>(9)本基金投资组合中的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%；</p> <p>(10)本基金投资于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%；</p> <p>(11)本基金投资于到期日在10个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%；</p>
--	---	---

	<p>有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用评级级别为准)；</p> <p>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；</p> <p>(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。</p> <p>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。</p> <p>3、本基金不得投资于以下金融工具：</p>	<p>(12)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，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 3 个月内对其予以全部卖出；《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。</p> <p>除上述 (9)、(12) 项外，因证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>3、本基金不得投资于以下金融工具：</p>
--	--	---

<p>(1) 股票、股指期货、国债期货；</p> <p>(2) 可转换债券；</p> <p>(3) 剩余期限超过 397 天的债券；</p> <p>(4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(7) 流通受限证券；</p> <p>(8) 权证；</p> <p>(9) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> <p>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。</p> <p>七、投资组合平均剩余期限的计算</p> <p>1、平均剩余期限（天）的计算公式如下：</p> <p>$(\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}) / (\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购})$</p>	<p>(1) 股票；</p> <p>(2) 可转换债券、可交换债券；</p> <p>(3) 信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具；</p> <p>(4) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；</p> <p>(5) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> <p>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。</p> <p>七、投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期计算方法</p> <p>1、投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期计算公式为：</p> <p>平均剩余期限的计算公式为：</p> <p>$[\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum$</p>
--	---

	<p>2、各类资产和负债剩余期限的确定</p> <p>(1) 银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为 0 天；证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；买断式回购履约金的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；</p> <p>(2) 一年以内(含一年)银行定期存款、大额存单的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限以存款协议中约定的通知期计算；</p> <p>(3) 组合中债券的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：允许投资的浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算；允许</p>	<p>投资于金融工具产生的负债×剩余期限 + 债券正回购×剩余期限] / [投资于金融工具产生的资产 - 投资于金融工具产生的负债 + 债券正回购]</p> <p>平均剩余存续期限的计算公式为：</p> $\frac{[\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余存续期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余存续期限}]}{[\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}]}$ <p>2、各类资产和负债剩余期限及剩余存续期限的确定</p> <p>(1) 银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为 0 天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算。</p> <p>(2) 回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限，待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。</p> <p>(3) 银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余</p>
--	---	---

	<p>投资的含回售条款债券的剩余期限以计算日至回售日的实际剩余天数计算；</p> <p>(4) 回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；</p> <p>(5) 中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；</p> <p>(6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限为该基础债券的剩余期限；</p> <p>(7) 买断式回购产生的待返售债券的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；</p> <p>(8) 短期融资券的剩余期限以计算日至短期融资券到期日所剩余的天数计算；</p>	<p>存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算。</p> <p>(4) 中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。</p> <p>(5) 组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：</p> <p>允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。</p> <p>允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际</p>

	<p>平均摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。</p> <p>2、为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值的偏离达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过 0.5%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估。</p>	<p>利率法摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。</p> <p>2、为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。</p>
--	---	---

<p>第十八部分 基金的信息 披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>(六)临时报告</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>(六)临时报告</p> <p>26.当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值的正负偏离度绝对值达到 0.5%的情形；</p>
-------------------------------	---	---

根据修订的基金合同, 本公司对《山西证券日日添利货币市场基金托管协议》等文件进行了相应修订。

二、重要提示

1、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的山西证券日日添利货币市场基金基金合同及托管协议。本基金将在最近一次定期更新招募说明书及摘要时对上述修改内容进行相应更新。

2、本公告的解释权归山西证券股份有限公司。投资者欲了解基金的详细情况, 可登陆本公司公募基金业务网站 (<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>) 查询, 或拨打本公司的客户服务电话 (95573) 垂询相关事宜。

三、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。投资者投资上述基金前应认真阅读上述基金的基金合同、招募说明书等法律文件, 投资与自身风险承受能力相适应的基金。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

山西证券股份有限公司
2018年3月17日