

# 山西证券股份有限公司关于山西证券保本混合型证券投资基金 基金合同终止并进行基金财产清算的第一次提示性公告

山西证券股份有限公司已于 2018 年 4 月 28 日在《证券日报》及山西证券股份有限公司公募基金业务网站发布了《山西证券股份有限公司关于山西证券保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。为了更好地提醒投资者相关事宜，现发布关于山西证券保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第一次提示性公告。

山西证券保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2016 年 5 月 4 日成立，即将于 2018 年 5 月 4 日结束首个保本周期。根据《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》、《关于避险策略基金的指导意见》等法律法规的有关规定及《山西证券保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本基金首个保本周期到期后，不再符合保本基金的存续条件，触发《基金合同》终止事由，本基金将依法对基金财产进行清算。现将相关事项公告如下：

## 一、本基金基本信息

基金名称	山西证券保本混合型证券投资基金
基金简称	山西证券保本基金
基金主代码	002589
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 4 日
基金管理人名称	山西证券股份有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司
基金担保人	中国投融资担保股份有限公司
第一个保本周期到期日	2018 年 5 月 4 日
公告依据	《山西证券保本混合型证券投资基金基金合同》、《山西证券保本混合型证券投资基金招募说明书》等

## 二、基金合同终止事由

根据2017年1月24日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的《关于避险策略基金的指导意见》有关规定及《基金合同》的约定,本基金不再符合保本基金的存续条件,我司经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,本基金拟于首个保本周期到期后进入清算程序,《基金合同》自基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日起终止。

### 三、保本周期到期日的安排

#### (一) 保本周期到期后的赎回安排

本基金保本周期为2年,第一个保本周期自2016年5月4日起至2018年5月4日止。

本基金的到期期间为保本周期到期日及之后5个工作日(含第5个工作日),即2018年5月4日(含)至2018年5月11日(含)。在到期期间基金份额持有人可选择将持有的基金份额赎回或转换转出。投资者在本基金到期期间未赎回或转换转出的基金份额,将全部进入清算程序,按照相关法律法规及本基金《基金合同》约定基金财产清算的期限为6个月,清算款项到达基金份额持有人账户时间以实际到账时间为准。

鉴于本基金将触发基金合同终止事由,为保护基金份额持有人的权益,本基金于2018年5月4日起将不再开放申购、转换转入业务。

#### (二) 保本周期到期后的费用

对于在保本周期到期日后赎回的,本基金(包括基金份额A和基金份额C)不收取赎回费用;对于在保本周期内赎回的,基金份额A、基金份额C按照其基金份额持有人持有该基金份额的期限所对应的赎回费率收取赎回费。到期日和到期期间,赎回费率为0。赎回费率如下:

持有基金份额期限(Y)	赎回费率
$Y < 1$ 年	2.00%
$1\text{年} \leq Y < 2$ 年	1.60%
$Y \geq 2$ 年	0.00%

赎回费用由赎回或转换转出基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回或转换转出基金份额时收取。基金管理人应当将赎回费按法律法规规定

的比例纳入基金财产，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

### （三）保本周期到期日的赎回机构

基金份额持有人可在第一个保本周期到期期间正常交易时间内，办理基金份额赎回或转换转出。通过直销渠道购买本基金的基金份额持有人，可通过我司直销机构办理；通过其他销售渠道购买本基金的基金份额持有人，可在原销售渠道办理。

### （四）赎回的处理原则

（1）“未知价”原则，即赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

（2）“份额赎回”原则，即赎回以份额申请；

（3）当日的赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

（4）基金份额持有人赎回时，除基金合同另有规定外，基金管理人按“后进先出”的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即登记确认日期在前的基金份额后赎回，登记确认日期在后的基金份额先赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率。

### （五）第一个保本周期到期的保本条款

在保本周期到期日，如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的保本金额的部分（即保本赔付差额），则基金管理人应补足该差额，在保本周期到期日后4个工作日内将该差额支付至本基金在基金托管人处开立的指定账户，并在保本周期到期日后20个工作日（含第20个工作日）内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

## 四、基金财产清算

### （一）基金财产清算安排

1、自本基金第一个保本周期到期期间结束的次日，即2018年5月12日起，本基金进入清算程序，本基金进入清算程序后不开放申购赎回或转换业务。

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用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

(二) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算费用将由基金管理人代为承担。

(三) 基金财产清算剩余资产的分配

1、依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2、如保本到期日交易时间结束仍有持仓证券停牌，基金进入清算程序后，为了最大化保护基金份额持有人利益，提高清算效率，基金管理人将以自有资金按照基金所持有证券资产最后运作日的估值价格垫付基金未能变现的证券资产，具体清算规则按照相关规定办理。待停牌证券复牌后，为保证基金资产流动性，基金管理人将及时变现停牌证券。待全部停牌证券复牌并卖出变现后，若变现金额高于基金管理人垫付的金额，则将差额按基金份额持有人持有的基金份额比例追偿给基金份额持有人；若变现金额小于基金管理人垫付的金额，则由基金管理人承担相应损失。

3、基金管理人将以自有资金先行垫付最低结算备付金和交易单元保证金、应收款项以及清算期间产生的应收利息等，该垫付资金及垫付资金到账日起孳生的利息将于收回款项、结息后返还给基金管理人。

#### （四）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （五）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 五、特别提示

未于本基金的到期期间，即 2018 年 5 月 4 日(含)至 2018 年 5 月 11 日(含)，赎回或转换转出成功的基金份额将全部进入基金清算程序，清算期间无法办理赎回或转换转出，基金份额持有人将面临基金份额不能迅速变现的风险。

本公告的解释权归山西证券股份有限公司所有。投资者欲了解详情，可以登陆山西证券公募基金业务网站 (<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>)，或拨打客户服务热线 95573 进行咨询。

#### 风险提示：

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资本公司管理的基金时，应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并注意投资风险。

特此公告。

山西证券股份有限公司

二〇一八年五月二日