

# 山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议的公告

为更好地满足投资者的投资需求，根据《中华人民共和国证券法》、《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规的规定及各基金基金合同的有关约定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，山西证券股份有限公司（以下简称“本基金管理人”）对旗下部分公募基金的投资范围增加存托凭证，并修订基金合同等法律文件。本次修订将自2021年6月2日起正式生效，现将基金合同等法律文件的修订情况公告如下：

## 一、 修订基金范围

基金主代码	基金产品名称
005226	山西证券改革精选灵活配置混合型证券投资基金
003659	山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金

## 二、 基金合同等法律文件的主要修订内容

（一）在基金合同的前言中增加投资存托凭证的风险揭示。

在“第一部分 前言”章节中增加：

“七、本基金的投资范围包括存托凭证，若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。”

（二）在基金份额的投资中明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制。

以策略精选为例，在“第十二部分 基金的投资”章节中增加：

1、在“二、投资范围”中增加“存托凭证”，将基金的投资组合比例的表述改为：“本基金将基金资产的0%~95%投资于股票资产及存托凭证，每个交易

日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,.....”

2、在“三、投资策略”中增加“3、存托凭证投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。”

3、在“四、投资限制”中增加“存托凭证”，将基金的投资组合应遵循以下限制表述为：“（1）股票资产及存托凭证占基金资产的比例为0%~95%；”，增加“（22）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，并与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管机构另有规定的从其规定；”

（三）在基金资产估值中增加存托凭证的估值。

以策略精选为例，在“第十四部分 基金的估值”章节中增加：

1、在“二、估值对象”中增加“存托凭证”

2、在“三、估值方法”、“1、证券交易所上市的有价证券的估值”中增加“（5）本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。”

（四）“第二十四部分 基金合同内容摘要”根据前述修订内容进行的修改。

（五）因上述修订导致的序号变化顺序调整。

（六）按照上述修订内容对托管协议、基金招募说明书（更新）、基金产品资料概要进行相应修改。

本次修订系根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》而作出，并已履行了监管规定的程序，符合相关法律法规的规定，修订自2021年6月2日起生效。投资者可登录投资者可登陆本基金管理人公募基金业务网站（<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅修订后的基金合同、托管协议、招募说明书（更新）、基金产品资料概要等法律文件，也可拨打客户服务电话（95573）咨询相关事宜。

风险提示：本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。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

2021年6月2日