

# 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 (2016 年第 2 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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 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 28.2873 亿元

联系人：王怡里

股权结构：

名称	持股数(万股)	占总股数
山西金融投资控股集团有限公司	860,395,355	30.4200
太原钢铁(集团)有限公司	282,605,635	9.99
山西国际电力集团有限公司	233,956,621	8.27
北京中吉金投资资产管理有限公司-中吉金投-稳赢 2	79,936,051	2.83

号投资基金		
河南省安融房地产开发有限公司	61,102,351	2.16
中欧盛世资产-民生银行-中欧盛世博恩晋源 1 号资产管理计划	49,560,351	1.75
中央汇金资产管理有限责任公司	40,619,400	1.44
申万菱信资产-招商银行-华润深国投信托-瑞华定增对冲基金 2 号集合资金信托计划	38,217,428	1.35
鹏华资产-宁波银行-鹏华资产山西证券定增资产管理计划	27,977,618	0.99
中国银行股份有限公司-招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金	19,607,967	0.69
合计	1,693,978,777	59.89

注：截止到 2016.9.30 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，1972 年 8 月出生，汉族，中共党员，硕士学位。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 2015 年 2 月任公司董事、总经理；2008 年 4 月至 2010 年 9 月任大华期货有限公司董事；2009 年 4 月至今任中德证券有限责任公司董事长；2008 年 2 月至 2014 年 12 月历任公司党委委员、党委副书记；2014 年 12 月至今任公司党委书记；2015 年 2 月至今任公司董事长、总经理。

柴宏杰先生，1973 年出生，大学本科，学士学位，中共党员，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，任山西国信投资集团有限公司董事会办公室主任、党委办公室主任；2014 年 12 月至 2016 年 6 月，任山西国信投资集团有限公司投资管理部总经理、投资总监；2016 年 6 月至今，任山西金融投资控股集团有限公司投资总监、投资管理部总经理；2015 年 1 月

至 2015 年 8 月，任中合盛资本管理有限公司董事长；2015 年 5 月至今任公司董事。

周宜洲先生，1958 年 10 月出生，汉族，中共党员，硕士学位。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；2015 年 4 月至今，任山西太钢集团先进材料工程技术研究院董事长；2008 年 2 月至今任公司董事。

傅志明先生，1957 年 12 月出生，大学本科，硕士学位，中共党员，高级经济师。2001 年 9 月至今任山西国际电力集团有限公司董事；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、纪委书记；2013 年 5 月至 2015 年 11 月任晋能有限责任公司监事会副主席；2014 年 11 月至今任公司董事。

樊廷让先生，1959 年 6 月出生，汉族，中共党员，硕士学位。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 12 月至今任公司财务负责人；2015 年 5 月至今任公司董事。

赵树林先生，1959 年 9 月出生，汉族，中共党员，研究生学历。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 月至今任公司董事。

朱海武先生，1966 年 3 月出生，硕士学位，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。2000 年 1 月至今，在瑞华会计师事务所工作，担任合伙人。现兼任三家上市公司（山西证券股份有限公司、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 月至今任公司董事。

容和平先生，1953 年 1 月出生，汉族，中共党员，本科毕业。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 2015 年 10 月任山西百圆裤业连锁经营股份有限公司独立董事；2013 年 6 月至今任太原化工股份有限公司独立董事；2011 年 5 月至今任公司独立董事。

王卫国先生，1951 年 5 月出生，汉族，中共党员，硕士研究生。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 2015 年 8 月，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；2016 年 1 月至今，任北京卓亚经济社会发展研究中心副主任；2011 年 5 月至今任公司独立董事。

蒋岳祥先生，1964 年 12 月出生，汉族，中共党员，硕士研究生。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；2014 年 7 月至今任国信证券股份有限公司独立董事；2015 年 8 月至今任英洛华科技股份有限公司独立董事；2016 年 7 月至今任荣安地产股份有限公司独立董事；2011 年 5 月至今任公司独立董事。

## 2、监事会成员基本情况

焦杨先生，1966 年 11 月出生，汉族，中共党员，本科学历，硕士学位。2010 年 2 月至 2014 年 12 月任山西信托股份有限公司常务副总经理；2014 年 12 月至 2016 年 6 月任山西国信投资集团有限公司风控总监兼审计风控部总经理；2016 年 6 月至今任山西金融投资控股集团有限公司运营总监、资本运营部总经理；2014 年 12 月至今任山西省产权交易中心股份有限公司监事长；2015 年 1 月至今任山西国际贸易中心有限公司、山西光信地产有限公司、山西国信融资再担保有限公司、山西股权交易中心有限公司、山西国信文化旅游投资发展有限公司、上海万方投资管理有限公司监事；2015 年 1 月至今任山西博爱医院监事长；2015 年 1 月至今任汇丰晋信基金管理有限公司、山西信托股份有限公司监事会主席；2010 年 10 月至 2011 年 5 月任公司监事；2011 年 5 月至今任公司监事会主席。

郭志宏先生，1966 年 5 月出生，本科学历，EMBA 高级工商管理硕士学位，中共党员，高级经济师。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，任山西信托股份有限公司监事、监事会主席；2015 年 3 月至今任山西信托股份有限公司副总裁、党委委员。2015 年 5 月至今任公司监事。

王国峰先生，1964 年 8 月出生，汉族，中共党员，本科学历。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 9 月至今，任中心主任。2015 年 5 月至今任公司监事。

高明先生，1963 年 8 月出生，汉族，中共党员，大专学历。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 月至今任公司监事。

关峰先生，1963 年 7 月出生，汉族，中共党员，本科学历。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集团副总会计师兼财务处处长。2015 年 5 月至今任公司监事。

罗爱民先生，1974 年 9 月出生，汉族，中共党员，本科学历。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 月至今任公司监事。

李国林先生，1972 年 8 月出生，汉族，中共党员，本科学历，学士学位。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 2016 年 8 月任科技基金公司副总经理、总法律顾问；2016 年 8 月至今任科技基金公司党支部书记、总经理。2011 年 11 月至今，任山西实地创业投资管理有限公司监事；2012 年 3 月至今，任晋城市富基新材料有限公司董事；2012

年 12 月至今，任运城市奥新纳米新技术有限公司董事；2014 年 4 月至今，任太原风华信息装备股份有限公司董事；2014 年 6 月至今，任山西澳坤生物农业股份有限公司董事；2014 年 12 月至今，任山西诺亚信创业投资有限公司董事；2015 年 1 月至今，任山西青山化工有限公司董事；2015 年 5 月至今，任山西中电科新能源技术有限公司董事；2015 年 5 月至今任公司监事。

刘奇旺先生，1963 年 4 月出生，汉族，中共党员，本科学历。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 月至今任公司监事。

闫晓华女士，1971 年 10 月出生，汉族，中共党员，学士学位。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 月至今任公司职工监事；2008 年 2 月至 2016 年 5 月任公司稽核考核部总经理。2016 年 5 月至今任公司合规管理部总经理。

尤济敏女士，1971 年 1 月出生，汉族，中共党员，硕士学位。2006 年 4 月至 2011 年 8 月，任山西证券党委办公室主任；2006 年 4 月至 2016 年 5 月任山西证券人力资源部总经理；2007 年 4 月至今任山西证券职工监事；2011 年 7 月至今任龙华启富董事；2016 年 5 月至今任龙华启富专职副董事长；2013 年 6 月至今任山证基金管理有限公司董事。

胡朝晖先生，1969 年 6 月出生，汉族，中共党员，学士学位。2008 年 2 月至今任公司职工监事；2008 年 2 月至 2016 年 5 月任公司风险控制部总经理；2016 年 5 月至今任公司稽核考核部总经理；2009 年 1 月起任公司监事会副主席。2011 年 7 月至今任龙华启富监事；2014 年 6 月任山证资本管理（北京）有限公司监事。

翟太煌先生，1964 年 12 月出生，汉族，中共党员，硕士学位。2008 年 2 月至今任公司研究所所长、职工监事；2011 年 7 月至今任龙华启富董事；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, 简历请参见董事会成员基本情况。

樊廷让先生, 简历请参见董事会成员基本情况。

赵树林先生, 简历请参见董事会成员基本情况。

孟有军先生, 1961 年 10 月出生, 汉族, 中共党员, 本科学历。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 月至今任公司党委委员、副总经理; 2008 年 11 月至 2015 年 2 月任公司合规总监。

乔俊峰先生, 1965 年 12 月出生, 汉族, 中共党员, 硕士学位。2008 年 10 月至 2010 年 9 月任大华期货有限公司总经理; 2010 年 9 月至 2013 年 9 月任大华期货有限公司董事长; 2013 年 9 月至今任格林大华期货有限公司董事长; 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 月至今任公司职工董事; 2016 年 1 月至今任山证国际金融控股有限公司董事长; 2010 年 2 月至今担任公司党委委员。

汤建雄先生, 1968 年 12 月出生, 汉族, 学士学位。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 月任大华期货有限公司董事; 2013 年 10 月至今任格林大华期货有限公司董事; 2009 年 4 月至今担任中德证券有限责任公司董事; 2010 年 4 月至 2015 年 12 月任公司财务总监; 2011 年 8 月至今任公司副总经理; 2011 年 7 月至今任龙华启富投资有限责任公司董事; 2015 年 2 月至 2016 年 1 月代为履行合规总监职责, 2016 年 1 月至今任公司合规总监。

王怡里先生, 1973 年 6 月出生, 汉族, 中共党员, 学士学位。2008 年 2 月至 2013 年 3 月任山西证券董事会办公室总经理; 2008 年 2 月至今任山西证券综合管理部总经理; 2010 年 2 月至今担任山西证券党委委员; 2010 年 4 月至今任山西证券董事会秘书; 2011 年 8 月至今任山西证券副总经理; 2013 年 6 月至今任山西中小企业创业投资基金(有限合伙)执行合伙人、山证基金管理有限公司董事长; 2014 年 6 月至今任山证资本管理(北京)有限公司董事长; 2014 年 10 月至今任龙华启富(深圳)股权投资基金管理有限公司董事长、北京山证并购资本投资合伙企业(有限合伙)执行合伙人; 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；2016 年 5 月任山西证券保本混合型证券投资基金基金经理；2016 年 8 月任山西证券裕利债券型证券投资基金基金经理。

#### 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。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

2、办理基金备案手续。

3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产。

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的

经营方式管理和运作基金财产。

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资。

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产。

7、依法接受基金托管人的监督。

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购和赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，各类基金份额的每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率，确定基金份额申购、赎回的价格。

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

10、编制季度、半年度和年度基金报告。

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务。

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露。

13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益。

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项。

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会。

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上。

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件。

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人。

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除。

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿。

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任。

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为。

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人。

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议。

26、建立并保存基金份额持有人名册。

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、本基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的活动，并承诺建立健全内部控制制度，

采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、本基金管理人依法禁止从事以下行为：

- (1) 将其自有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以提高自己；
- (10) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (11) 以不正当手段谋求业务发展；

(12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(13) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资；
- 6、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 六、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着勤勉谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

2、不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇他人或任何其他第三人谋取不当利益。

3、不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

4、不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 七、基金管理人的风险管理与内部控制制度

## 1、风险管理的原则

(1) 全面性原则：公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

(2) 独立性原则：公司设立独立的监察稽核部，监察稽核部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

(3) 相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性；

(5) 重要性原则：公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

## 2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部门负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 董事会：负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险；

(2) 合规总监：独立行使督察权利，直接对董事会负责，及时向审计与风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

(3) 投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

(4) 风险管理执行委员会：根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告；

(5) 合规管理部、稽核考核部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

(6) 风险控制部：通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制；

(7) 业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

### 3、内部控制制度综述

#### (1) 风险控制制度

公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；不断提高经营管理水平，在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化；建立行之有效的风险控制机制和制度，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整；维护公司信誉，保持公司的良好形象。针对公司面临的各种风险，包括政策和市场风险，管理风险和职业道德风险，分别制定严格防范措施，并制定岗位分离制度、空间分离制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

#### (2) 监察稽核制度

监察稽核工作是公司内部风险控制的重要环节。公司设合规总监、合规管理部和稽核考核部。合规总监全面负责公司的监察稽核工作，可在授权范围内列席任何会议，调阅公司任何档案材料，对基金资产运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核，出具监察稽核报告，报公司董事会和中国证监会。如发现公司有重大违规行为，应立即向公司董事会和中国证监会报告。合规管理部、稽核考核部具体执行合规管理与稽核考核工作，并协助合规总监工作。

合规管理部、监察稽核部具有独立的检查权、独立的报告权、知晓权和建议权。具体负责对公司内部风险控制制度提出修改意见，并提交风险管理执行委员会；检查公司各部门执行内部管理制度的情况；监督公司资产运作、财务收支的合法性、合规性、合理性；监督基金财产运作的合法性、合规性、合理性；调查公司内部违规事件；协助监管机关调查处理相关事项；负责员工的离任审计；协调外部审计事宜等。

### （3）内部会计控制制度

建立了基金会计的工作制度及相应的操作控制规程，确保会计业务有章可循；按照相互制约原则，建立了基金会计业务的复核制度以及与托管行相关业务的相互核查监督机制；为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度；为了确保基金资产的安全，公司严格规范基金清算交割工作，并在授权范围内，及时准确地完成基金清算；强化会计的事前、事中、事后监督和考核制度；为了防止会计数据的毁损、散失和泄密，制定了完善的档案保管和财务交接制度。

## 4、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立、健全内控体系，完善内控制度。公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制。公司建立、健全了各项制度，做到基金经理分开、投资决策分开、基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

（3）建立、健全岗位责任制。公司建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序。公司建立了风险管理执行委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自

下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度做出决策；

(5)建立内部监控系统。公司建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

(6)使用数量化的风险管理手段。采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示市场趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

(7)提供足够的培训。公司制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

#### 5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺将根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。本公司承诺将积极配合外部风险监督工作。

## 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：陆志俊

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，也是近代中国的发钞行之一。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 2015 年英国《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 17 位，较上年上升 2 位；根据 2015 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 190 位，较上年上升 27 位。

截至 2016 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 80,918.10 亿元。2016 年 1-9 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 525.78 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

截至 2016 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 206 只。此外，交通银行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。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

## （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

## （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部业务风险管理暂行办法》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分

工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行须报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 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、代销机构：

（1）北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室

办公地址：北京市海淀区海淀北二街 10 号泰鹏大厦 12 层

法定代表人：张琪

联系人：付文红

客服电话：010-62675369

网址：<http://www.xincai.com/>

（2）交通银行股份有限公司

注册地址：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

法定代表人：牛锡明

联系人：张宏革

客服电话：95559

网址：<http://www.bankcomm.com/>

（3）晋商银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座

办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座

法定代表人：阎俊生

联系人：董嘉文

客服电话：9510-5588

网址：www.jshbank.com

(4) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：苗明

客服电话：800-280-2899

网址：www.erichfund.com

(5) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

客服电话：4007009665

网址：www.ehowbuy.com

(6) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙欲镇安福街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟文

客服电话：4008188000

网址：www.myfund.com

(7) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(8) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3 C 座 7 楼

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

客服电话：4001818188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(9) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资空股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资空股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客服电话：4006-788-887

网址：<http://www.zlfund.cn>

(10) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

联系人：曹怡晨

客服电话：400-067-6266

网址：<http://a.leadfund.com.cn>

(11) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人：李悦

联系人：张晔

客服电话： 4007868868

网址： <http://www.chtfund.com>

(12) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址： 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆  
2105 室

办公地址： 上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人： 袁顾明

联系人： 赵明

客服电话： 400-92-82266

网址： <https://www.dtfunds.com>

(13) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址： 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址： 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人： 鲍东华

联系人： 宁博宇

客服电话： 4008219031

网址： [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

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 武丹

联系人：武丹

## 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 2016 年 10 月 18 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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日，本报告中财务资料未经审计。

### 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	2,310,108,637.62	83.30
	其中：债券	2,310,108,637.62	83.30
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	174,200,501.30	6.28
	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	243,820,437.24	8.79
4	其他资产	45,011,044.01	1.62
5	合计	2,773,140,620.17	100.00

### 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	0.64	
	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	1.10
	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%。

## 3. 基金投资组合平均剩余期限

### 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	113
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	89

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内，本基金投资组合的平均剩余期限未发生超过120天的情况。

### 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	22.57	1.10
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	17.16	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	6.58	—
	其中：剩余存续期超过397天	—	—

	的浮动利率债		
4	90天(含)–120天	7.66	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)–397天(含)	45.65	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	99.62	1.10

#### 4. 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：报告期内投资组合平均剩余存续期没有超过240天的情况。

#### 5. 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	—	—
5	企业短期融资券	2,289,989,199.64	83.62
6	中期票据	20,119,437.98	0.73
7	同业存单	—	—
8	其他	—	—
9	合计	2,310,108,637.62	84.36
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

#### 6. 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	041663004	16首钢CP002	1,500,000	150,014,374.18	5.48
2	041653025	16新兴铸管 CP002	1,100,000	109,934,670.37	4.01
3	041557005	15中色CP002	1,000,000	99,980,363.37	3.65
4	041664009	16甘公投CP001	900,000	89,907,970.92	3.28
5	041572017	15日照港CP002	700,000	70,012,810.04	2.56
6	011698268	16云能投 SCP005	600,000	59,976,702.33	2.19
7	011698023	16首钢SCP001	500,000	50,195,655.52	1.83
8	041682001	16忠旺CP001	500,000	50,166,718.64	1.83
9	041558111	15鲁宏桥CP004	500,000	50,098,290.27	1.83
10	011620001	16中铝SCP001	500,000	50,096,947.83	1.83

#### 7. “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	0.0678%
报告期内偏离度的最低值	-0.0327%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0380%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：无。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：无。

#### 8. 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。

#### 9. 投资组合报告附注

##### 9.1 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，按照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。

9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 9.3 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	44,998,001.01
4	应收申购款	13,043.00
5	其他应收款	—
6	其他	—
7	合计	45,011,044.01

### 9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

无

## 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。

本基金合同生效日 2015 年 5 月 14 日，基金业绩数据截至 2016 年 9 月 30 日。

### 一. 基金净值表现

#### 1. 本报告期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

##### 1.1 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
2015. 5. 14—2015. 12. 31	1. 8167 %	0. 0011 %	0. 2258 %	0. 0000 %	1. 5909 %	0. 0011 %
2016. 1. 1—2016. 9.	1. 8829 %	0. 0004 %	0. 2667 %	0. 0000 %	1. 6162 %	0. 0004 %

30						
自基金成立起至今	3.7338%	0.0009%	0.4932%	0.0000%	3.2406%	0.0009%

### 1.2 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
2015.5.14—2015. 12.31	0.6693 %	0.0001 %	0.0895 %	0.0000%	0.5798 %	0.0001 %
2016.1.1—2016.9. 30	2.0733%	0.0004%	0.2667%	0.0000%	1.8066%	0.0004%
自基金成立起至今	3.9106%	0.0017%	0.4932%	0.0000%	3.4174%	0.0017%

### 1.3 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
2015.5.19—2015. 12.31	0.2271 %	0.0002 %	0.0895 %	0.0000%	0.1376 %	0.0002 %
2016.1.1—2016.9. 30	0.7429%	0.0004%	0.2667%	0.0000%	0.4762%	0.0004%
自基金成立起至今	1.5664%	0.0008%	0.4883%	0.0000%	1.0781%	0.0008%

注：1、本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）；

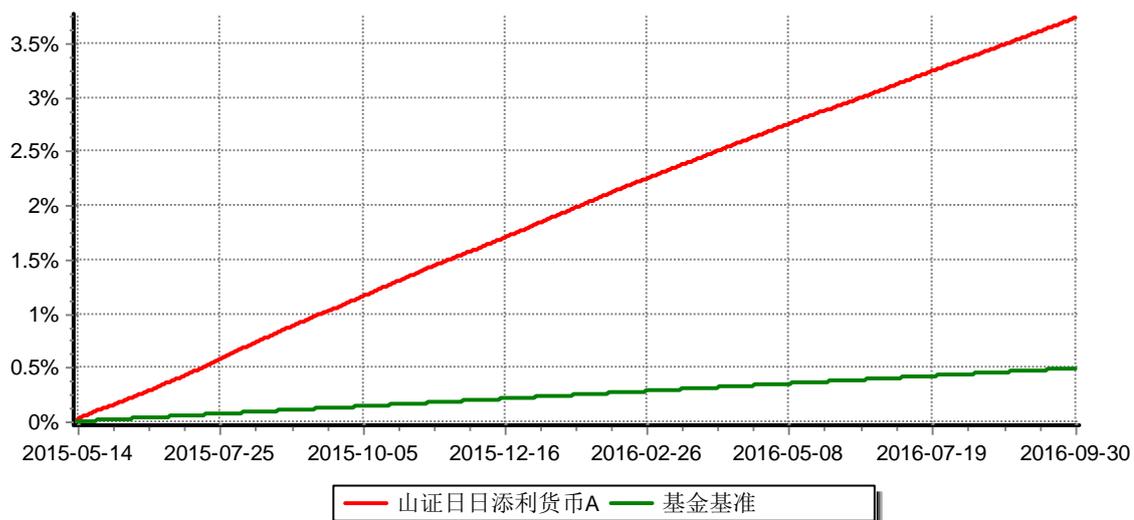
2、本基金收益分配是按日结转份额。

## 2. 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

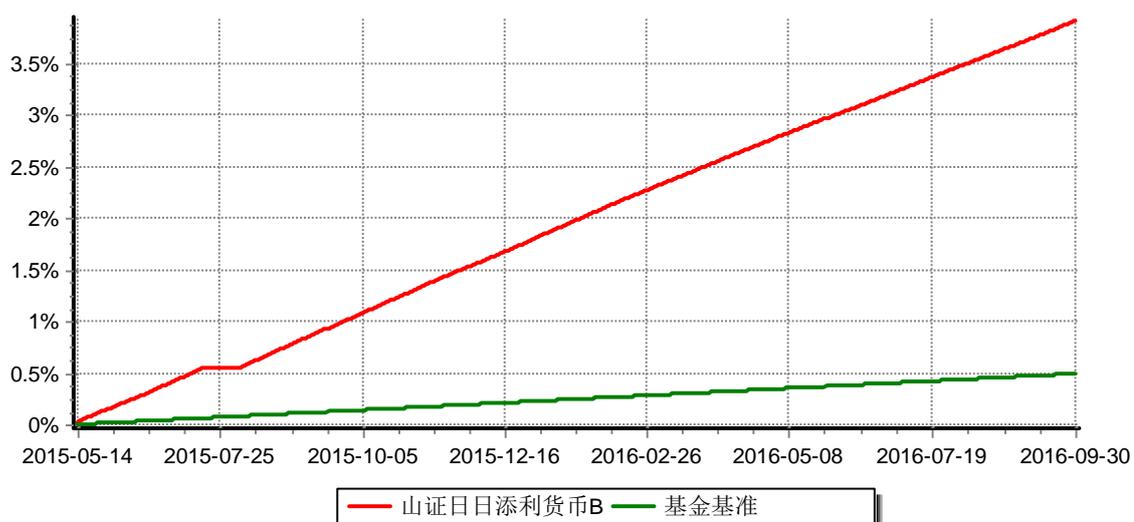
山证日日添利货币A

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

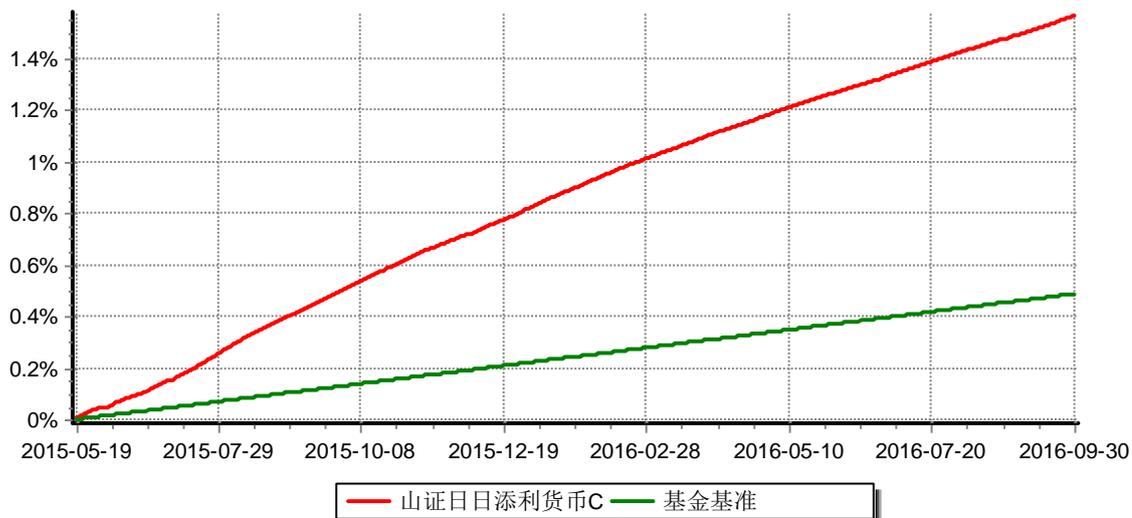
（2015年05月14日—2016年09月30日）



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-2016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-2016年09月30日)



注：1、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为基金合同生效之日起六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（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 2016 年 6 月 28 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“第三部分 基金管理人”中相关内容。
- 三、更新了“第四部分 基金托管人”中相关内容。
- 四、更新了“第五部分 相关服务机构”中相关内容。
- 五、更新了“第十部分 基金的投资”中相关内容。
- 六、更新了“第十一部分 基金的业绩”中相关内容。
- 七、更新了“第二十二部分 对基金持有人的服务”中相关内容。
- 八、更新了“第二十三部分 其他应披露事项”中相关内容。

山西证券股份有限公司

二〇一六年十二月三十日