

## 山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2021年09月10日

送出日期：2021年09月14日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	山西证券裕丰一年定开发起式	基金代码	009567
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
基金合同生效日	2020年06月11日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	每年开放一次。开放期最短不少于5个工作日、最长不超过10个工作日。
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
刘凌云	2021年07月20日		2007年06月29日
其他（若有）	《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金在履行适当程序后可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。本基金在《基金合同》生效满三年后继续存续的，在任一开放期最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），如基金资产净值低于5000万元，《基金合同》终止，无需召开基金份额持有人大会审议。		

注：本基金不向个人投资者公开销售。

### 二、基金投资与净值表现

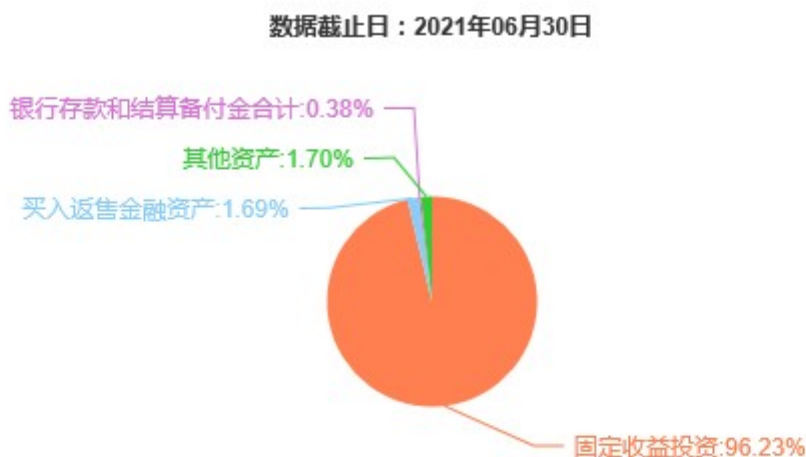
#### （一）投资目标与投资策略

投资目标	在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	<p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的投资品种，包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券及超短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、信用衍生品等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券、可交换债券。</p>

	<p>基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前1个月、开放期及开放期结束后1个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，封闭期内，本基金不受上述5%的限制，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
主要投资策略	<p>本基金在封闭期内，通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以尽量获取最大化的信用溢价。</p> <p>本基金封闭期采用的投资策略包括：期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债综合指数（总财富）收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

注：请投资者详见《山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》第九部分

## （二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

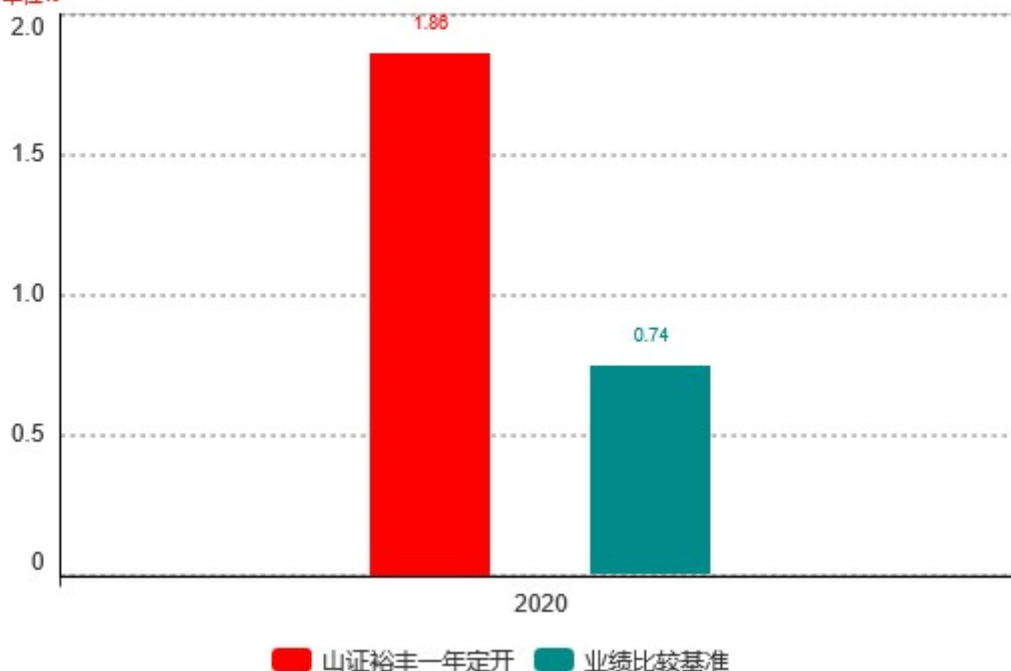


## （三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现。

合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限（2020年06月11日-2020年12月31日）计算净值增长率。

单位%



### 三、投资本基金涉及的费用

#### （一）基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	$0 \leq M < 100$ 万	0.80%	
	$100 \text{万} \leq M < 300 \text{万}$	0.50%	
	$300 \text{万} \leq M < 500 \text{万}$	0.30%	
	$M \geq 500 \text{万}$	1000.00元/笔	
赎回费	$0 \text{天} \leq N < 7 \text{天}$	1.50%	
	$7 \text{天} \leq N < 90 \text{天}$	0.10%	
	$N \geq 90 \text{天}$	0.00%	

#### （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	按日计提0.30%
托管费	按日计提0.10%
其他费用	信息披露费用、会计师费、律师费、审计费等

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、 风险揭示与重要提示

### （一） 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资于本基金的主要风险有：

1、市场风险：证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、通货膨胀风险、再投资风险。

2、信用风险。

3、流动性风险（含启用侧袋机制的相关风险）。

4、操作风险。

5、管理风险。

6、合规风险。

7、本基金的特有风险

（1）本基金为债券型基金，债券的投资比例不低于基金资产的80%，该类债券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。债券的投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、货币政策、市场需求变化、行业波动等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个券价格表现低于预期的风险。

（2）本基金以定期开放方式运作，在封闭期内，本基金不办理申购、赎回业务，也不上市交易。在本基金的封闭期，基金份额持有人面临不能赎回基金份额的风险。

（3）本基金是发起式基金，《基金合同》生效之日起满3年之日，若基金资产净值低于2亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续；本基金在《基金合同》生效满三年后的存续期内，在任一开放期最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），如基金资产净值低于5000万元，《基金合同》终止，无需召开基金份额持有人大会审议。因此，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

（4）本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券的风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险源于资产本身，包括价格波动风险、流动性风险等。证券化风险主要表现为信用评级风险、法律风险等。

（5）本基金投资信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险。

（6）本基金允许单一投资者持有的基金份额达到或者超过50%，且本基金不向个人投资者公开销售，法律法规或监管机构另有规定约定的除外。本基金特定机构投资者赎回可能会给现有的中小基金份额持有人造成损失。

### （二） 重要提示

中国证监会对本基金的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费、律师费由败诉方承担。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站

网址：<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>

客服电话：95573

- 1、《基金合同》、《托管协议》、《招募说明书》
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

## 六、 其他情况说明

无。