

山西证券裕桓一年持有期混合型发起式证券投资基金

2024年第2季度报告

2024年06月30日

基金管理人:山西证券股份有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月18日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 公平交易专项说明	10
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	10
4.5 报告期内基金的业绩表现	11
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	11
§5 投资组合报告	11
5.1 报告期末基金资产组合情况	11
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	12
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细	13
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	13
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	13
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	13
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	13
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	13
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	13
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	14
5.11 投资组合报告附注	14
§6 开放式基金份额变动	15
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	15
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	15
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	15
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	15
§9 影响投资者决策的其他重要信息	16
9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	16
9.2 影响投资者决策的其他重要信息	16
§10 备查文件目录	16
10.1 备查文件目录	16
10.2 存放地点	17
10.3 查阅方式	17

§1 重要提示

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月16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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年04月01日起至2024年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	山西证券裕恒一年持有
基金主代码	009595
基金运作方式	契约型开放式； 本基金设置基金份额持有人最短持有期限。基金份额持有人持有的每份基金份额最短持有期限为一年，在最短持有期限内该份基金份额不可赎回或转换转出。基金份额持有人持有的每份基金份额需在基金合同生效日（对当日持有的基金份额而言）、基金份额申购确认日（对申购份额而言）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）一年后的年度对应日（含该日，若该对应日期为非工作日或该公历年不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日）起方可办理赎回或转换转出业务。
基金合同生效日	2022年08月24日
报告期末基金份额总额	11,647,192.33份
投资目标	在严格控制风险并保持资产流动性的前提下，充分利用量化投资策略，力争为投资者提供持续、稳定的回报。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据

基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、存托凭证投资策略、金融衍生品投资策略、资产支持证券投资策略和参与融资业务投资策略组成。

1、大类资产配置策略

本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析、国际市场变化情况等因素的深入研究，主动判断市场时机和发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例。并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。

2、股票投资策略

本基金以中证800指数、中证1000指数标的作为基础股票池，采用定量与定性分析相结合的方式确定股票初选库，最终选出约200只股票作为核心股票池，并定期调整。

（1）定量分析

本基金采用智能选股模型对基础股票池中的标的进行分析和筛选，以过去60天为基础时间段，从其周围寻找最符合优化函数的参数。最优化的函数并非仅是夏普比率等，而是包含同区间的胜率、回撤率、波动率和夏普比率等因素的一个集合函数，因此通过这样的过滤能使投资结果更加稳定。本基金还结合了Alpha选股策略对个股进一步筛选。Alpha模型主要对各个组成因子的历史数据进行归因分析找到长期稳定、短期出色的因子，这些表现优异的因子便成为下一次选股的筛选标准。其组成因子包括个股的估值、规模、盈利状况、成长性等，并融入

部分衍生品概念的新信息因子，如波动率等。同时，本基金根据指数波动率进行股票仓位控制，一般波动率越高，相应的股票仓位越低。

（2）定性分析

本基金在定量分析选取出的股票基础上，通过进一步定性分析。基金管理人根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适当调整各因子类别的具体组成及权重，并自上而下地分析宏观经济环境、市场情绪、行业增长前景等分析把握其投资机会。

3、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

4、债券投资策略

在进行债券投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券及可交换债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。

（1）利率预期策略

通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标。本基金将根据对市场利率变化趋势的预期，制定出组合的目标久期：预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

（2）信用债券投资策略

根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平

	<p>和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券、公司债券的信用风险利差。</p> <p>债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息，同时需要考虑企业的经营环境等外部因素，着重分析企业未来的偿债能力，评估其违约风险水平。</p> <p>(3) 套利交易策略</p> <p>在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的。但是在某种情况下，比如若某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时这种稳定关系便被打破，若能提前预测并进行交易，就可进行套利或减少损失。</p> <p>(4) 可转换债券及可交换债券投资策略</p> <p>可转换债券/可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换债券/可交换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，综合考虑可转换债券/可交换债的债性和股性，利用定价模型进行估值分析，并最终选择合适的投资品种。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	山西证券股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年04月01日 - 2024年06月30日）
1.本期已实现收益	121,359.22
2.本期利润	-257,929.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0221
4.期末基金资产净值	8,296,779.90
5.期末基金份额净值	0.7123

1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	-3.02%	0.75%	-4.81%	0.91%	1.79%	-0.16%
过去六个月	1.54%	0.94%	-6.22%	1.28%	7.76%	-0.34%
过去一年	-10.69%	0.84%	-12.97%	1.02%	2.28%	-0.18%
自基金合同生效起至今	-21.67%	0.83%	-17.45%	0.90%	-4.22%	-0.07%

1、本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

2、本基金合同转型后于2022年8月24日生效。

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率
历史走势对比图
(2022年08月24日-2024年06月30日)



- 1、本基金于2022年8月24日由山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型而来，截至报告期期末，本基金转型已满一年；
- 2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
章海默	本基金的基金经理	2020-06-09	-	21年	章海默女士,复旦大学管理学院工商管理硕士,具有基金从业资格。2003年进入华安基金管理有限公司,2009年12月至2012年12月任华安上证180ETF以及联接基金基金经理助理,2011年9月至2012年12月任华安深证300指数证券投资基金(LOF)基金经理,2012年12月至2015年9月任华安上证180交易型开放式指数证券投资

					基金及联接基金基金经理，2013年6月至2015年9月任华安基金指数与量化投资部总监助理，2013年12月至2015年9月任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2014年11月至2015年9月任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2015年9月入西部证券股份有限公司上海第一分公司，2016年1月至2018年1月，于西部证券股份有限公司上海第一分公司负责投资管理公司港股自营投资账户；2018年3月至今，任山西证券公募基金部研究总监。2020年1月17日至今担任山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年6月9日至今担任山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（自2022年8月24日起转型为山西证券裕桓一年持有期混合型发起式证券投资基金）基金经理。
--	--	--	--	--	--

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为本基金管理人对外披露的离任日期；
- 2、除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别为本基金管理人对外披露的任职日期和离任日期；
- 3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公募基金管理业务公平交易管理细则》、《公募基金管理业务集中交易管理细则》、《公募基金管理业务异常交易管理细则》，对公司公募基金管理业务的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。公司公募基金管理业务建立了投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司公募基金管理业务拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易，未出现清算不到位的情况，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在一季度的报告中，管理人认为资金流出是当前市场面临的主要问题之一。由于各种因素的综合影响，包括全球经济不确定性、贸易摩擦等，投资者对于风险资产的偏好有所下降，导致资金流向了相对较为保守的资产类别。在今年上半年，随着全球的大选年逐步展开，势必会面临经济增速的短暂停滞以及对于前景的进一步波动加剧。然而，我们相信随着经济的稳定增长和政策的支持，以及估值和历史持仓的出清，投资者的信心将逐渐恢复，资金也会重新流入市场。

美国大选的关键阶段将对全球市场产生深远的影响，尤其是在局面逐渐明朗时，可能会迫使局势发生重大变化。从海外角度来看，汇率的波动将是一个值得关注的重点，尤其是在全球经济复苏的背景下，各国货币政策的差异化可能导致显著的汇率变动。

在下半年的大选关键期，我们将面对一系列重要变化。选举结果不仅会影响国内政策方向和经济前景，还可能对国际关系和全球贸易产生影响。因此，我们需要保持高度警惕，密切关注选举结果、政策变化以及市场动态。

首先，选举结果可能导致政策转变，这可能会影响税收、监管、外交政策等多个方面。例如，新的贸易政策或关税调整可能会影响跨国公司的盈利前景，而基础设施支出的增加可能会提振某些行业。

其次，汇率波动将是一个关键因素。美国经济政策的不确定性和全球其他主要经济体的货币政策差异可能会导致美元和其他货币之间的汇率大幅波动。

最后，市场情绪和投资者预期也将在大选期间发生变化。政治不确定性可能会导致市场波动性增加，而投资者对于未来政策的预期可能会在选举结果出炉前后迅速调整。

在这个过程中，我们将密切关注市场的变化和投资者的情绪，灵活调整投资组合的配置，以获取更好的回报。同时，我们也会继续加强风险管理和合规监管，确保投资者的利益得到最大化的保护。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山西证券裕恒一年持有基金份额净值为0.7123元，本报告期内，基金份额净值增长率为-3.02%，同期业绩比较基准收益率为-4.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,942,265.30	83.09
	其中：股票	6,942,265.30	83.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,403,193.25	16.79
8	其他资产	10,120.31	0.12
9	合计	8,355,578.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	369,196.00	4.45
B	采矿业	334,833.00	4.04
C	制造业	3,874,091.30	46.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	153,750.00	1.85
E	建筑业	146,048.00	1.76
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	148,428.00	1.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	486,784.00	5.87
J	金融业	821,014.00	9.90
K	房地产业	243,588.00	2.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	364,533.00	4.39

S	综合	-	-
	合计	6,942,265.30	83.67

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	49,900	230,538.00	2.78
2	601088	中国神华	4,700	208,539.00	2.51
3	002475	立讯精密	5,200	204,412.00	2.46
4	002594	比亚迪	700	175,175.00	2.11
5	600150	中国船舶	4,300	175,053.00	2.11
6	300433	蓝思科技	9,400	171,550.00	2.07
7	600989	宝丰能源	9,600	166,368.00	2.01
8	603501	韦尔股份	1,600	158,992.00	1.92
9	688256	寒武纪	800	158,936.00	1.92
10	688169	石头科技	400	157,040.00	1.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金投资股指期货是根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头

套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关政策。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金本报告期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,120.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,120.31

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	11,647,053.53
报告期期间基金总申购份额	138.80
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	11,647,192.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,646,754.90
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,646,754.90
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	99.996

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,646,754.90	99.996%	11,646,754.90	99.996%	三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

合计	11,646,754.90	99.996%	11,646,754.90	99.996%	三年
----	---------------	---------	---------------	---------	----

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240401-20240630	11,646,754.90	-	0.00	11,646,754.90	99.996%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，由于持有人结构比较集中，资金易呈现"大进大出"特点。在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能造成基金净值的波动，甚至可能引发基金的流动性风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2、山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金产品资料概要；
- 6、中国证监会准予山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 7、山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 8、山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 9、山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 10、山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金产品资料概要；
- 11、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 12、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 13、报告期内本基金披露的各项公告；
- 14、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者可以通过以下途径咨询相关事宜：

- 1、客服热线：95573、0351-95573
- 2、公司公募基金业务网站：<http://publiclyfund.sxzq.com>:8000

山西证券股份有限公司

2024年07月18日