
山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 年 09 月 30 日

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

报告送出日期:2021 年 10 月 26 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	6
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 公平交易专项说明	9
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	12
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	12
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	13
5.11 投资组合报告附注	13
§6 开放式基金份额变动	14
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	14
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	14
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	15
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	15
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	16
10.3 查阅方式	16

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月22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2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	山西证券裕丰一年定开发起式
基金主代码	009567
基金运作方式	契约型定期开放式、发起式
基金合同生效日	2020年06月11日
报告期末基金份额总额	509,403,792.84份
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。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金通过宏观周期研究、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。本基金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。首先，本组合宏观周期研究的基础上，决定整体组合的久期、杠杆率策略。</p>

一方面,本基金将分析众多的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等),并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面,本基金将对债券市场整体收益率曲线变化进行深入细致分析,从而对市场走势和波动特征进行判断。在此基础上,确定资产在非信用类固定收益类证券(现金、国家债券、中央银行票据等)和信用类固定收益类证券之间的配置比例,整体组合的久期范围以及杠杆率水平。

其次,本组合将在期限结构策略、行业轮动策略的基础上获得债券市场整体回报率,通过息差策略、个券挖掘策略获得超额收益。

1、期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势,对各类型债券进行久期配置;当收益率曲线走势难以判断时,参考基准指数的样本券久期构建组合久期,确保组合收益超过基准收益。具体来看,又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

(1)骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。

(2)子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点,适用于收益率曲线较陡时;杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端,适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动;梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线,适用于收益率曲线水平移动。

2、行业配置策略。债券市场所涉及行业众多,同样宏观周期背景下不同行业的景气度的发生,本基金分别采用以下的分析策略:

(1)分散化投资:发行人涉及众多行业,本组合将保持在各行业配置比例上的分散化结构,

	<p>避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。</p> <p>(2) 行业投资：本组合将依据对下一阶段各行业景气度特征的研判，确定在下一阶段在各行业的配置比例，卖出景气度降低行业的债券，提前布局景气度提升行业的债券。</p> <p>3、息差策略。通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。本组合将采取低杠杆、高流动性策略，适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报，选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种，灵活控制杠杆组合仓位，降低组合波动率。</p> <p>4、个券挖掘策略。本部分策略强调公司价值挖掘的重要性，在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定投资策略，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，争取提高组合超额收益空间。</p> <p>5、资产支持证券投资策略。本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> <p>(二) 开放期投资策略</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。
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

§ 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（2021年07月01日 - 2021年09月30日）
1. 本期已实现收益	5,659,510.92
2. 本期利润	5,458,932.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0107
4. 期末基金资产净值	517,658,706.08
5. 期末基金份额净值	1.0162

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	1.06%	0.02%	1.52%	0.05%	-0.46%	-0.03%
过去六个月	2.27%	0.02%	2.69%	0.04%	-0.42%	-0.02%
过去一年	3.88%	0.02%	4.76%	0.04%	-0.88%	-0.02%
自基金合同生效起至今	5.06%	0.03%	4.32%	0.05%	0.74%	-0.02%

本基金的业绩比较基准为：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%。

3.2.2 自基金合同生效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

山西证券裕丰一年定期开放债券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



1、按基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自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		
刘相鹏	本基金的基金经理	2020-06-11	2021-07-20	9年	刘相鹏先生，上海财经大学金融硕士。2012年1月至2013年9月任上海易序资产管理有限公司债券交易员；2013年10月至2015年2月任江苏大丰农商行债券交易员；2015年4月加入山西证券公募基金部，从事债券交易工作，2018年5月3日至2021年7月20日任

					山西证券日日添利货币市场基金基金经理。2019年5月30日至2021年7月20日任山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020年6月11日至2021年7月20日担任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经理。2021年4月14日至2021年7月20日担任山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
刘凌云	本基金的基金经理	2021-07-20	-	14年	刘凌云女士，上海交通大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格。2007年6月至2013年6月任光大证券股份有限公司固定收益总部债券交易员，2013年7月，在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理；2014年8月至2015年4月任富国富钱包货币市场基金基金经理；2014年8月至2015年4月任富国天时货币市场基金基金经理。2016年8月至2017年3月起担任中欧货币市场基金基金经理；2016年8月至2017年3月担任中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理；2016年12月至2017年3月担任中欧骏泰货币市场基金基金经理。2017年4月加入山西证券股份有限公司资管固收

				部担任投资主办, 2018年7月转入山西证券公募基金部; 2019年1月至今任山西证券超短债债券型证券投资基金基金经理, 2019年6月起任山西证券裕睿6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020年7月1日起至今担任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。2021年7月20日起担任山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	---

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

中国经济内生动能放缓。三季度外生扰动较多，不断散点复发的疫情、极端天气和限电限产政策短期内都对经济造成一定影响。

工业生产：1-8月工业增加值累计同比13.1%，比2019年同期增长13.6%，两年平均增长6.6%，依然属于较高水平，但较二季度回落。由于受到极端天气扰动和限电限产的制约，工业生产环比从6月份开始连续弱于历史同期均值，且差距有扩大趋势。由于部分地区能耗强度达标压力仍大，局部地区和局部行业的限产政策可能持续到年底。

内需受疫情冲击。1-8月社零同比18.1%，比2019年1-8月份增长7.9%，两年平均增长3.90%，自6月以来连续回落，修复趋势放缓，较疫情前的8%中枢差距明显。受到散点疫情不断爆发的影响，二季度的消费在总量上弱于季节性，商品零售增速连续回落，服务业受到的冲击更加严重。

固定资产投资不及预期。1-8月份，固定资产投资增速为8.9%，两年均值4.0%，略不及市场预期和前值。地产、制造业和基建（不含电力）投资累计同比分别为10.9%、15.7%和2.9%，均较上月回落；两年平均增速分别为7.7%，3.3%和0.2%。

基建投资：尽管基建累计增速回落，但8月份当月投资增速小幅回升，不含电力口径和全口径增速升至-1.66和-0.02%。从基本面来看，建筑业PMI重返高景气区间，新订单回升且成本压力有所缓解。从资金面来看，8月政府债券发行量依然偏低，但财政支出加快。结合专项债发完和“形成实物工作量”的要求，基建改善或出现在年末至明年年初；与我们对基建节奏的判断较为一致。

房地产投资：房地产投资方面，后周期特征依然明显，竣工依然对房地产投资起到支撑作用。土地市场方面，成交清淡，土地溢价率降至个位数，土地成交面积也属极低水平。销售平稳回落，调控政策影响持续体现。今年1-8月房地产销售面积同比增5.87%，销售金额增速11.70%，两者之差持续收窄；资金来源方面，今年2月以来，定金及预收款项增速开始超过按揭贷款增速，居民部门中长期贷款同比也逐步降低。

制造业投资：制造业增速由负转正后，修复逐步加快。从已公布的数据看，行业分化明显：中游原材料行业增速回落，包括有色、化工相关行业，而中下游行业增速均上行。对于制造业，总体依然保持乐观。积极因素包括企业盈利的持续修复，产能利用率已达历史新高，且有政策呵护，但也应看到，企业中长期贷款增长持续放缓，外部环境仍有不确定性。

进出口：8月份进出口数据双双超预期和季节性。出口超预期主要源自疫情反复带来的防疫物资需求增长和对东盟的生产替代效应，海外耐用品需求将持续支撑我国出口。进口高增体现了经济韧性和价格的合力，短期价格因素仍将支撑进口，而基于“跨周期调节”的思路，内生动能和进口回落速度或较为平缓。

货币及财政政策：三季度货币政策呈现稳健略宽松局面，央行进行了全面降准。从7月30日的政治局会议可以看出，政府体现出了对于经济下行的担忧，强调了政策的跨周期调节问题。货币政策更侧重结构性的中小企业，而对运动式“减碳”的纠正或缓解工业品通胀的压力。财政政策强调形成实物工作量，相应财政支出或加快，而根据媒体报道，部分专项债12月发行，并在2022年使用。

四季度经济或面临一定挑战，但政策或予以一定对冲，而疫情反复或成为常态，同时四季度美联储缩减购债临近，中美货币政策分化。四季度财政政策或温和发力，但形成实物工作量或在明年年初；而在地产持续调控下，宽信用到来仍需时间；四季度流动性或有MLF到期、双11备付金以及跨年等扰动，央行或再度采用数量型供给进行对冲。

本基金三季度把握市场节奏，在控制账户久期的基础上，买入证券公司债等资产，通过杠杆套息策略来增厚账户收益。

本基金在报告期内坚持谨慎投资原则、严控信用风险，增加高流动性资产占比，在保证流动性安全的基础上，提高组合的整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山西证券裕丰一年定开发起式基金份额净值为1.0162元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.06%，同期业绩比较基准收益率为1.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金自2021年07月01日到2021年09月30日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，未出现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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	727,499,000.00	97.04

	其中：债券	727,499,000.00	97.04
	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	4,345,783.87	0.58
8	其他资产	17,862,910.04	2.38
9	合计	749,707,693.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	39,988,000.00	7.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,188,000.00	15.49
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	398,134,000.00	76.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	111,994,000.00	21.63
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	97,195,000.00	18.78

9	其他	-	-
10	合计	727,499,000.00	140.54

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112110136	21兴业银行CD136	500,000	48,610,000.00	9.39
2	112109111	21浦发银行CD111	500,000	48,585,000.00	9.39
3	175197	20国都G1	445,000	44,500,000.00	8.60
4	155607	19华福G1	400,000	40,368,000.00	7.80
5	188414	21湘财01	400,000	40,076,000.00	7.74

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金本报告期末未投资股票，没有出现投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,493.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,837,416.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	17,862,910.04

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中不存在流通受限情况。

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	509,403,792.84
报告期期间基金总申购份额	-
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	509,403,792.84

§ 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	10,339,345.50
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	10,339,345.50
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	2.03

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	10,339,345.50	2.03%	10,000,513.94	1.96%	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	10,339,345.50	2.03%	10,000,513.94	1.96%	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	20210701-20210930	499,064,447.34	0.00	0.00	499,064,447.34	97.97%

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丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；

- 2、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合同；
- 3、山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、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；
- 5、山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金产品资料概要；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内本基金披露的各项公告；
- 9、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
- 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
2021年10月26日