

山西证券裕辰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：2024年07月10日

送出日期：2024年07月11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	山西证券裕辰债券发起式	基金代码	015500
基金管理人	山西证券股份有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日	2022年04月27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	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
蓝烨	2022年09月26日	2013年07月30日	
倪伟杰	2024年07月10日	2022年07月28日	
其他	《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。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

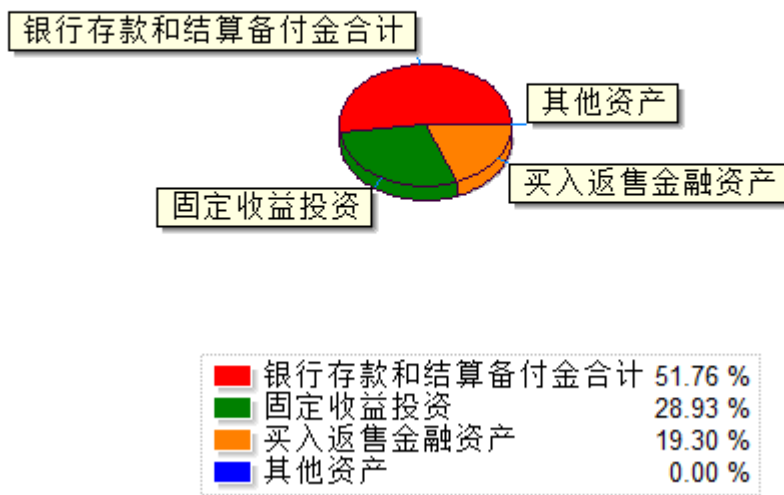
投资目标	在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的投资品种，包括债券（国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券及超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

	<p>本基金不投资于股票等资产，但可因投资于可转换债券、可交换债券而被动持有股票等资产。因投资于可转换债券、可交换债券而被动持有的股票等资产，本基金将在其可交易之日起10个交易日内卖出。</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> <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%。每个交易日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%，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>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
主要投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、收益率曲线策略 3、久期管理策略 4、利率债券投资策略 5、信用债券投资策略 6、回购策略 7、资产支持证券投资策略 8、可转换债券及可交换债券投资策略
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率×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，低于混合型基金、股票型基金。

注：请投资者详见《山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金招募说明书》第九部分

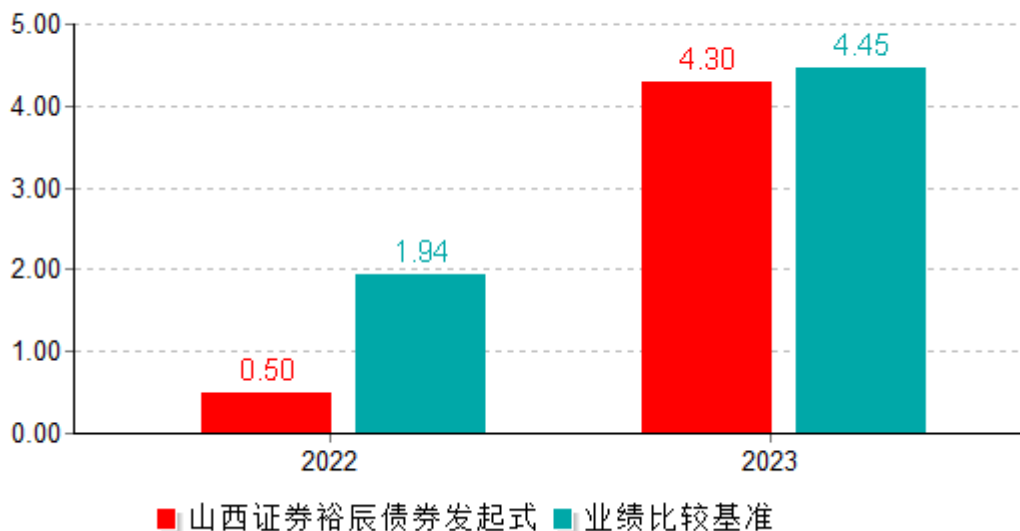
(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年03月31日



(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，数据截止日：2023年12月31日
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)	M < 100万	0.60%	
	100万 ≤ M < 500万	0.30%	
	M ≥ 500万	1000.00元/笔	
赎回费	N < 7天	1.50%	
	N ≥ 7天	0.00%	

注：本基金的申购费用由申购人承担，可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

(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/年费率或金额	收取方
管理费	0.30%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	15,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊

其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费、公证费和认证费，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，基金的银行汇划费用，基金的账户开户费用、账户维护费用，以及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。具体详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。	相关服务机构
------	---	--------

注：1、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。

2、审计费用、信息披露费和指数许可使用费（若有）为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

	基金运作综合费率（年化）
持有期	0.39%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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。

本基金的风险主要包括：

- 1、市场风险
- 2、管理风险
- 3、流动性风险（包含启用侧袋机制的风险）

4、本基金的特定风险：

（1）本基金为债券型基金，本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，因此，本基金需要承担债券市场的系统性风险，虽然本基金主要投资于信用评级较高的债券品种，但无法完全排除因个别债券违约所形成的信用风险。

（2）本基金是发起式基金，《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，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。若届时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、更改或补充时，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。因此，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

（3）本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券的风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险、法律风险等。信用风险指资产支持证券参与主体违约的风险，是资产支持证券最大的

风险。利率风险是指资产支持证券的价格受到利率波动发生逆向变动而造成的风险。流动性风险是由于资产支持证券不能迅速、低成本地变现的风险。法律风险是指因资产支持证券交易结构较为复杂、参与方较多、交易文件较多，而存在的法律风险和（4）本基金投资范围包括可转换债券品种，可转换债券的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，对这些条款研究不足导致的事件可能为本基金带来损失。例如，当可转换债券的价格明显高于其赎回价格时，若本基金未能在转债被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。

- 5、操作风险
- 6、合规性风险
- 7、其他风险

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，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、0351-95573

- 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