

山西证券裕恒一年持有期混合型发起式
证券投资基金清算报告

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

清算报告公告日期：2024年8月27日

一、重要提示

山西证券裕桓一年持有期混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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变更而来。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由山西证券股份有限公司依照有关法律法规及约定发起，经中国证券监督管理委员会 2019 年 12 月 2 日证监许可[2019]2634 号文准予注册，并经中国证券监督管理委员会 2022 年 5 月 20 日证监许可[2022]1052 号文准予变更注册。《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合同》（以下简称“基金合同”）于 2022 年 8 月 24 日起正式生效，本基金的基金管理人为山西证券股份有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，基金管理人于 2024 年 6 月 27 日发布《关于以通讯方式召开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份额持有人大会的公告》，审议《关于终止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合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2024 年 8 月 1 日计票表决通过了《关于终止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合同有关事项的议案》，决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日定为 2024 年 8 月 8 日，并于 2024 年 8 月 9 日进入清算程序。

本基金基金财产清算小组由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、中喜会计师事务所（特殊普通合伙）、上海源泰律师事务所组成，并由中喜会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	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
基金合同生效日	2022年08月24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
最后运作日基金份额总额	11,647,065.69
基金合同存续期	不定期
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。
主要投资策略	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。
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。

三、财务报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年8月8日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2024 年 8 月 8 日
资 产:	
货币资金	1,382,817.45
结算备付金	33,168.11
存出保证金	2,764.19
交易性金融资产	6,463,129.00
其中：股票投资	6,463,129.00
资产总计	7,881,878.75
负 债 和 净 资 产	最后运作日 2024 年 8 月 8 日
负 债:	
应付管理人报酬	2,094.46
应付托管费	174.54
应付交易费用	9,777.89
其他负债	15,000.00
应付清算款	0.07
负债合计	27,046.96
净 资 产:	
实收基金	11,647,065.69
未分配利润	-3,792,233.90
净资产合计	7,854,831.79
负债和净资产总计	7,881,878.75

注 1：本基金最后运作日 2024 年 8 月 8 日，基金份额净值 0.6744 元，基金份额

总额 11,647,065.69 份。

注 2：本基金的清算报告是在非持续经营的前提下按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金》约定的资产估值和会计核算方法编制。

四、清算事项说明

本基金的清算期间为 2024 年 8 月 9 日至 2024 年 8 月 20 日止。基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 1,382,817.45 元，其中活期存款本金为人民币 1,382,304.91 元，应计利息为人民币 512.54 元；截至清算期结束日银行存款余额为人民币 7,820,717.49 元，其中活期存款本金为人民币 7,819,479.10 元，应计利息为人民币 1,238.39 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 33,168.11 元，分别为上海证券交易所结算备付金人民币 17,624.89 元及其应计利息人民币 46.83 元、深圳证券交易所结算备付金人民币 15,461.13 元及其应计利息人民币 35.26 元；清算结束日结算备付金为人民币 33,185.99 元，分别为上海证券交易所结算备付金人民币 17,624.89 元及其应计利息人民币 56.31 元、深圳证券交易所结算备付金人民币 15,461.13 元及其应计利息人民币 43.66 元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 2,764.19 元，分别为上海证券交易所存出保证金人民币 1,618.09 元及其应计利息人民币 5.72 元、深圳证券交

易所存出保证金人民币 1,135.66 元及其应计利息人民币 4.72 元; 清算结束日存出保证金为人民币 2,765.63 元, 分别为上海证券交易所存出保证金人民币 1,618.09 元及其应计利息人民币 6.56 元、深圳证券交易所存出保证金人民币 1,135.66 元及其应计利息人民币 5.32 元。

(4) 本基金最后运作日持有交易性金融资产为股票投资, 投资金额为人民币 6,463,129.00 元(最后运作日估值市值), 已于清算期间全部变现, 相关证券清算款已最晚于 2024 年 8 月 13 日划入托管账户。

3、 负债处置情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 2,094.46 元, 清算期间未有变动。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 174.54 元, 该款项已在清算期间完成支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 9,777.89 元, 清算期间计提应付交易费用人民币 2,888.24 元, 于清算结束日应付交易费用余额为人民币 12,666.13 元。

(4) 本基金最后运作日应付清算款为人民币 0.07 元, 该款项已在清算期间完成支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债人民币 15,000.00 元, 为预提审计费, 该款项已在清算期间完成支付。

4、 清算期间的损益情况

报告期间: 2024 年 8 月 9 日(清算期起始日)-2024 年 8 月 20 日(清算终止日)

单位: 人民币元

项目	金额
一、清算收益	
1、利息收入(注 1)	745.17
2、投资收益(注 2)	-86,860.77

项目	金额
3、公允价值变动损益	88,212.33
清算收益小计	2,096.73
二、清算费用	
律师费	15,000.00
汇划费	20.00
清算费用小计	15,020.00
三、清算净损益	-12,923.27

注 1：利息收入系清算期间计提的银行存款利息。

注 2：投资收益系清算期间持有债券资产变现收益金额。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 8 月 8 日基金净资产	7,854,831.79
清算期间净损益	-12,923.27
二、2024 年 8 月 20 日（清算结束日）基金净资产	7,841,908.52

（1）根据《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用（基金财产清算小组费用由基金财产承担）、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（2）截止清算结束日 2024 年 8 月 20 日，本基金净资产为人民币 7,841,908.52 元，应分配给本基金全部基金份额持有人。

（3）清算结束日至清算款划出日前的银行存款应计利息、结算备付金应计利息及存出保证金应计利息归基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人可以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资

金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

6、其他需要说明的事项

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时分配。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金清算审计报告》

《上海源泰律师事务所关于山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金清算报告的法律意见书》

2、存放地点

基金管理人、基金托管人处

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅

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财产清算小组

二〇二四年八月二十七日