

# 山西证券90天滚动持有短债债券型证券投资基金 基金份额发售公告

## 重要提示

1、山西证券90天滚动持有短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会[2021]11月17日证监许可[2021]3664号文注册。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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2、本基金类别为债券型证券投资基金，运作方式为契约型开放式。

3、本基金的基金管理人和登记机构为山西证券股份有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”），基金托管人为交通银行股份有限公司。

4、本基金募集期自2021年12月27日至2022年1月14日，通过基金管理人和其他销售机构面向投资者公开发售。基金管理人委托的其他销售机构详见本公告“七、（三）基金销售渠道”。本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。本公司也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

5、本基金的募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买投资基金的其他投资人。

本基金暂不向机构投资者公开发售（公募资产管理产品除外）。如未来本基金开放向机构投资者公开发售或对发售对象的范围予以进一步限定，基金管理人另行公告。

6、本基金首次募集规模不设上限。

7、投资人欲购买本基金，需开立本公司基金账户。基金募集期内本公司和其他销售机构的销售网点均可为投资人办理基金账户开立手续。投资人在办理基金账户开立手续时可同时办理认购申请，但认购申请的确认须以开户确认成功为前提条件。除法律法规另有规定外，一个投资人只能开立和使用本公司的一个基金账户，已经开立本公司基金账户的投资人无须重新开户。

8、投资人应保证用于认购的资金来源合法，投资人应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他方面的障碍。投资人不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。投资人已提交的身份证明文件如已过有效期，请及时办理相关更新手续，以免影响认购。

9、本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购费或申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购费或申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。A类、C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

投资人可自行选择认购或申购基金份额类别。

10、本基金对单一投资人认购期间累计认购金额不设上限。

在基金募集期内，投资者通过代销机构或山西证券股份有限公司网上直销首次认购单笔最低限额为人民币1元（含认购费，下同），追加认购单笔最低限额为人民币1元；投资者通过直销中心柜台首次认购单笔最低限额为人民币20,000元，追加认购单笔最低限额为人民币1,000元。各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

本基金募集期间单个投资人的累计认购规模没有限制，但对于可能导致单一投资人持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形，基金管理人有权采取控制措施。

基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对认购的金额限制，并及时公告。

11、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请，申请是否有效应以登记机构的确认结果为准。对于T日交易时间内受理的认购申请，登记机构将在T+1日内就申请的有效性进行确认，但对申请有效性的确认仅代表确实接受了投资人的认购申请，认购份额的计算需由登记机构在募集期结束后确认。投资人应在基金合同生效后及时到各销售网点查询最终成交确认情况和认购份额，并妥善行使合法权利。

12、本公司仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明，投资人欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在基金管理人的公募基金业务网站（<http://publiclyfund.sxzxq.com:8000>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csirc.gov.cn/fund/>）上的招募说明书、基金产品资料概要、基金合同及托管协议等法律文件。本基金的基金合同及招募说明书提示性公告以及本公司将同时刊登在《中国证券报》。

13、投资人可拨打本公司的客户服务电话（95573）垂询认购事宜。

14、本公司单位的“元”均指人民币元。

## 15、风险提示

投资有风险，投资人投资基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各种风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金管理者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，自主判断基金的投资价值，充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金对于每份基金份额，设定90天的滚动运作期，基金管理人仅在该基金份额的每个运作期到期日为基金份额持有人办理赎回。每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未提出赎回申请，则自该运作期到期日次一起该基金份额进入下一个运作期。投资人将面临在运作期到期后无法办理赎回的风险，以及错过运作期到期日以至未能赎回而进入下一运作期的风险。本基金设定90天的滚动运作期，但由于周末、法定节假日等非工作日原因，每份基金份额的每个实际运作期期限或有可能，可能长或短于90天，投资者应当在熟悉并了解本基金运作规则的基础上，结合自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策，及时行使赎回权利。

基金管理生后，连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金份额净值低于5000万元情形的，则基金管理人应当终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。因此，基金份额持有人将可能面临基金合同自动终止的风险。

本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

本基金可投资国债期货，可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券是一种债权性质的金融工具。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。

本基金可投资信用衍生品，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等。流动性风险是指信用衍生品在交易转让过程中，因无法找到交易对手或交易对手较少，导致难以将其以合理价格变现的风险。偿付风险是在信用衍生品的存续期内，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营情况不佳，或创设机构的现金流与预期出现一定的偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。价格波动风险是由创设机构或所受保护债券主体，经营情况或利率环境发生变化，引起信用衍生品交易价格波动的风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金管理的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

本基金仅向个人投资者、公募资产管理产品公开销售，如未来本基金开放向机构投资者公开销售，基金管理人将另行公告。

16、基金管理人可综合各种情况对发售安排及募集期其他相关事项做适当调整并及时公告。本公司拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

## 一、本次募集基本情况

### （一）基金名称及代码

基金名称：山西证券90天滚动持有短债债券型证券投资基金

基金代码：A类份额：014476 C类份额：014477

### （二）基金类型

债券型证券投资基金

### （三）基金运作方式

契约型开放式

对于每份基金份额，第一个运作期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申赎确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至基金合同生效日或基金份额申赎确认日后的第90天（即第一个运

## 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

期到期日，如该日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至基金合同生效日或基金份额申赎确认日后的第180天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。

正常情况下本基金每个交易日开放申购，但对于每份基金份额，每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。在每份基金份额的每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则该基金份额将在该运作期到期后自动进入下一个运作期。

如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

### （四）基金份额类别

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购费或申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购费或申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。A类、C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

### （五）基金存续期限

不定期

### （六）初始面值、发售价格

本基金的基金份额初始面值为人民币1.00元，按初始面值发售。

### （七）最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为2亿份。

### （八）发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

本基金暂不向机构投资者公开发售（公募资产管理产品除外）。如未来本基金开放向机构投资者公开发售或对发售对象的范围予以进一步限定，基金管理人另行公告。

### （九）销售机构

直销机构：山西证券股份有限公司

代销机构：详见本公告“七、（三）代销机构”。

### （十）发售时间安排

本基金的募集时间为2021年12月27日至2022年1月14日。基金管理人可根据认购的情况，依据法律法规和基金合同的规定适当延长或缩短募集期，但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

### （十一）认购方式及相关规定

#### （一）基金份额的发售面值

本基金的基金份额初始面值为人民币1.00元，按初始面值发售。

#### （二）认购的方式

本基金认购以金额申请，采取全额缴款认购的方式。投资人认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额交付认购款项。

#### （三）认购金额的限制

本基金对单一投资人认购期间累计认购金额不设上限。

认购最低限额：在基金募集期内，投资者通过代销机构或山西证券股份有限公司网上直销首次认购单笔最低限额为人民币1元（含认购费，下同），追加认购单笔最低限额为人民币1元；投资者通过直销中心柜台首次认购单笔最低限额为人民币20,000元，追加认购单笔最低限额为人民币1,000元。各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

基金管理人有权采取控制措施。

基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对认购的金额限制，并及时公告。

#### （四）基金份额认购价格及认购费用

本基金分为A类和C类基金份额。投资人认购A类基金份额时支付认购费用，认购C类基金份额不支付认购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费用。

募集期内投资人可多次认购本基金，认购费用按每笔认购申请单独计算。本基金A类基金份额的认购费率如下：

金额(M,含认购费)	认购费率
M < 100万	0.20%
100万 ≤ M < 500万元	0.10%
M ≥ 500万元	1000/笔

A类基金份额的基金认购费用应在投资人认购 A类基金份额时收取，基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规及《基金合同》约定的情况下，对基金的认购费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他销售机构届时发布的相关公告或通知。

#### （五）基金认购份额的计算

当认购本基金采用金额认购方式认购。计算公式如下：

1、若投资人选择认购本基金A类基金份额，则认购份额的计算公式为：

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

（注：对于认购金额在500万元（含）以上适用固定金额认购费的认购，净认购金额=认购金额-固定认购金额）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额面值

例一：某投资人投资资本基金A类基金份额100,000元，假设该笔认购最后按照100%比例全部予以确认，认购费率0.2%，假定该笔有效认购申请金额对应的利息为20元，则认购基金份额为：

净认购金额=100,000/(1+0.2%)=99,800.40元

认购费用=100,000-99,800.40=19.60元

即：该投资人投资100,000元认购本基金A类基金份额，假设该笔认购最后按照100%比例全部予以确认，假定该笔有效认购申请金额对应的利息为20元，可得到99,820.40份A类基金份额。

2、若投资人选择认购本基金C类基金份额，则认购份额的计算公式为：

认购份额=(认购金额+认购利息)/基金份额面值

例二：某投资人投资资本基金C类基金份额100,000元，假设该笔认购最后按照100%比例全部予以确认，假定该笔有效认购申请金额对应的利息为50元，可得到100,050.00份C类基金份额。

#### （六）认购确认

基金管理机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请，申请是否有效应以登记机构的确认结果为准。对于T日交易时间内受理的认购申请，登记机构将在T+1日内就申请的有效性进行确认，但对申请有效性的确认仅代表确实接受了投资人的认购申请，认购份额的计算需由登记机构在募集期结束后确认。投资人应在基金合同生效后及时到各销售网点查询最终成交确认情况和认购份额，并妥善行使合法权利。

投资人可在募集期内可以多次认购，但认购申请一经登记机构有效性确认，不得撤销。认购费按每笔认购申请单独计算。

若认购申请被确认为无效，基金管理人应当将投资人已支付的认购金额退还给投资人。

#### （七）募集资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，计入投资者的基金账户，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

### 三、个人投资者的开户与认购程序

#### （一）直销机构

基金管理人直销柜台受理个人投资者的开户与认购申请。

#### 1、业务受理时间

（1）开户受理时间：正常交易日：

（2）认购受理时间：基金发售日的 9:30-17