
山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月25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 | 5 |
| 3.1 主要财务指标 | 5 |
| 3.2 基金净值表现 | 5 |
| §4 管理人报告 | 6 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 | 6 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 公平交易专项说明 | 11 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 | 12 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现 | 12 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 | 13 |
| §5 投资组合报告 | 13 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 | 13 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 13 |
| 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 | 14 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 | 15 |
| 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 | 15 |
| 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 | 15 |
| 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 | 15 |
| 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 | 15 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 15 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 15 |
| 5.11 投资组合报告附注 | 16 |
| §6 开放式基金份额变动 | 16 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 | 16 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 17 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 17 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息 | 17 |
| 8.1 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 | 17 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 17 |
| §9 备查文件目录 | 17 |
| 9.1 备查文件目录 | 17 |
| 9.2 存放地点 | 18 |
| 9.3 查阅方式 | 18 |

§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月24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2022年07月01日起至2022年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 山证策略精选 |
| 基金主代码 | 003659 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年12月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 22,622,396.53份 |
| 投资目标 | 本基金积极通过大类资产的轮动配置，综合运用多种策略，精选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资，在把风险控制到较低水平的前提下，力争为基金份额持有人创造持续而稳健的超额回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金将采取积极的大类资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、企业盈利、市场估值以及市场</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>流动性等方面因素分析判断决定大类资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线，以事件驱动和红利投资作为核心的投资策略，通过对上市公司各类事件的深入分析来精选个股。</p> <p>3、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到管理投资组合风险的目的。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>6、其他金融工具投资策略</p> <p>权证投资策略：权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，力求稳健的投资收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中证综合债券指数收 |

| | |
|--------|---|
| | 益率*50% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。 |
| 基金管理人 | 山西证券股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

§ 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（2022年07月01日 - 2022年09月30日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -4,992,184.42 |
| 2. 本期利润 | -4,282,133.46 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1880 |
| 4. 期末基金资产净值 | 26,907,989.91 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1894 |

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 | -13.69% | 1.14% | -7.13% | 0.44% | -6.56% | 0.70% |
| 过去六个月 | -12.92% | 1.52% | -3.64% | 0.59% | -9.28% | 0.93% |
| 过去一 | -28.5 | 1.45% | -9.15% | 0.59% | -19.4 | 0.86% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 年 | 7% | | | | 2% | |
| 过去三年 | 28.42% | 1.36% | 7.94% | 0.63% | 20.48% | 0.73% |
| 过去五年 | 14.13% | 1.37% | 14.75% | 0.64% | -0.62% | 0.73% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.94% | 1.30% | 24.44% | 0.60% | -5.50% | 0.70% |

1、本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%。

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

山西证券策略精选灵活配置混合型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

(2016年12月29日-2022年09月30日)



1、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为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 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|----------|--------------------|---|---------|---|
| 李惟愚 | 本基金的基金经理 | 2019 -12- 25 | - | 15 年 | <p>李惟愚先生，清华大学政治经济学硕士，2007年进入证券投资行业，具有超过12年的投资管理经历。其中，2007年7月-2010年6月在汇添富基金管理有限公司担任研究员，2010年7月-2014年9月间在上海光大证券资产管理有限公司先后担任研究员和投资经理；2014年10月-2018年5月在光大证券股份有限公司金融市场总部担任权益投资总监，2018年8月-2019年4月，在中信建投证券股份有限公司资产管理部上海分部任权益投资部总经理，2019年7月至今，在山西证券股份有限公司公募基金部从事权益投资工作。2019年12月25日至今担任山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金、山西证券改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021年5月27日至今担任山西证券品质生活混合型证券投资</p> |
|-----|----------|--------------------|---|---------|---|

| | | | | | |
|----|----------|------------|---|-----|--|
| | | | | | <p>资基金基金经理。2022年4月起担任山西证券裕享增强债券型发起式证券投资基金基金经理。李惟愚先生具备基金从业资格。</p> |
| 杨旭 | 本基金的基金经理 | 2020-12-29 | - | 12年 | <p>杨旭先生，哥伦比亚大学数学金融硕士、运筹管理学硕士、纽约大学化学硕士，具有基金从业资格。2010年进入证券投资行业，具有10年的投资管理经历。其中，2010年6月-2012年7月在WSFA Group, Global Systematic Alpha Fund担任助理投资经理，2012年8月-2019年9月间在中信保诚基金管理有限公司先后担任助理投资经理、基金经理、量化投资副总监等职位。2015年1月至2018年5月担任信诚沪深300指数分级证券投资基金基金经理。2015年1月至2019年9月担任信诚中证800医药指数分级证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚中证800金</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | 融指数分级证券投资基金基金经理。2015年2月至2019年9月任信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金基金经理。2015年6月至2016年11月担任信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2015年6月至2019年9月任信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金基金经理。2015年8月至2016年7月担任信诚中证建筑工程指数分级证券投资基金基金经理。2016年5月至2017年10月任信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年11月27日起变更为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF))。2016年7月至2019年9月担任信诚中证建筑工程指数型证券投资基金(LOF)基金理。2016年9 |
|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>月至2017年10月任信诚至益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年9月起至2019年9月任信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年12月起至2019年9月任信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年2月起至2019年9月担任信诚新兴产业混合型证券投资基金基金经理。2017年3月至2018年6月担任信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017年6月至2018年9月担任信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月起至2019年9月任信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月至2017年12月任信诚至信灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年7月起至2019年9月担任信诚量化阿尔法股票型证券投资基金</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>基金经理。2017年8月至2018年6月任信诚至盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年6月起至2019年9月担任中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年1月至2018年9月担任信诚中证500指数分级证券投资基金基金经理。2019年10月加入山西证券股份有限公司公募基金部，担任权益投资总监。2020年12月29日至今担任山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|---|

- 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行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

投资策略：本基金将投资目标定为以基本面分析为基础，专注科技行业公司的商业模式，分析产业机会，寻找变化大，确定高的机会，以相对合理的价格买入并中长期持有，分享企业成长的投资收益。为实现此目标，本基金将精选具有鲜明时代特征并符合社会发展大趋势的产业，在其中寻找产品、服务、渠道或者商业模式上具有核心竞争优势的企业，依靠企业自身的成长获取绝对收益。

运作分析：三季度市场，美联储为对抗通胀的加息力度超市场预期，全球资本回流美国，美元指数不断创新高，海外部分国家出现股债汇三杀的情景，国内成长股经过五月到七月的反弹后又深度回调。虽然短期内市场仍会有反复，但基于未来三年视角，接下来几个季度市场将经历寻底阶段，待市场磨底后新一轮上升周期孕育出现。所以我们依旧积极寻找新技术和新场景带来的新的投资机会，只是由于未来市场不确定性增强，投资对安全边际要求增高。回顾三季度操作层面，投资方向没有发生转变，投资上聚焦于科技类公司（TMT为主），专注科技行业公司的商业模式，分析产业机会，以相对合理的价格买入并中长期持有。目前主要投资方向为半导体，数字经济，汽车智能化和其他代表未来科技发展方向的公司。

未来操作计划：长期关注的方向不变，进入四季度，市场开始对明年进行预期，我们积极寻找明年行业发展边际向上，业绩增速高的公司。由于海外风险仍有发酵的空间，所以基金整体仓位会择机增加，重心以调整组合结构为主。市场资金会在风险预期与行业发展反复，所以基金会适度增加波段交易。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山证策略精选基金份额净值为1.1894元，本报告期内，基金份额净值增长率为-13.69%，同期业绩比较基准收益率为-7.13%。

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，本基金连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，未出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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 | 21,082,251.58 | 77.99 |
| | 其中：股票 | 21,082,251.58 | 77.99 |
| 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 | 5,945,679.04 | 22.00 |
| 8 | 其他资产 | 3,572.70 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 27,031,503.32 | 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

| 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 19,454,201.18 | 72.30 |
| D | 电力、热力、燃气及水 | 531,300.00 | 1.97 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| | 生产和供应业 | | |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 745,760.00 | 2.77 |
| J | 金融业 | 350,990.40 | 1.30 |
| K | 房地产业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 21,082,251.58 | 78.35 |

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

| 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 | 002241 | 歌尔股份 | 35,000 | 927,500.00 | 3.45 |
| 2 | 688123 | 聚辰股份 | 11,500 | 877,220.00 | 3.26 |
| 3 | 002881 | 美格智能 | 25,000 | 855,000.00 | 3.18 |
| 4 | 688008 | 澜起科技 | 16,000 | 837,280.00 | 3.11 |
| 5 | 002594 | 比亚迪 | 3,300 | 831,633.00 | 3.09 |
| 6 | 688012 | 中微公司 | 7,000 | 755,090.00 | 2.81 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 7 | 300083 | 创世纪 | 85,000 | 724,200.00 | 2.69 |
| 8 | 300750 | 宁德时代 | 1,800 | 721,602.00 | 2.68 |
| 9 | 688063 | 派能科技 | 1,800 | 720,000.00 | 2.68 |
| 10 | 603239 | 浙江仙通 | 50,000 | 713,000.00 | 2.65 |

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投资。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关政策。

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。

5.10.3 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 | 3,373.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 199.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,572.70 |

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 | 22,823,220.80 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 266,735.53 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 467,559.80 |
| 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 | 22,622,396.53 |

§ 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

本报告期内本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 20220701-20220930 | 9,917,337.20 | - | - | 9,917,337.20 | 43.84% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、山西证券策略精选灵活配置混合型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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 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
2022年10月25日