

山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新

招募说明书（2018年第2号）

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 1 【重要提示】

山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经 中国证监会 2016 年 10 月 14 日证监许可[2016]2343 号《关于准予山西证券策略 精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册募集。本基金的基金合同于 2016 年 12 月 29 日正式生效。 基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中 国证监会注册，但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。 证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分 散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能 够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基 金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。 本基金投资于证券市场，基金净值会因证券市场波动等因素而波动，投资者 在投资本基金前，应全面了解本基金产品特性，充分考虑自身风险承受能力，理 性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金特有风险等。 本基金是混合型基金，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。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读 本基金的 招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分 考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。 投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金。本基金在募集期 内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买 基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元、从而遭受损失的风险。 本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩 及其净值高 低并不预示其未来业绩表现。 本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负” 原则，在做出投资决策后， 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 负担。投资有风险， 投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号） 2 露文件。 本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 12 月 28 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 月 30 日。本 招募说明书所载的财务数据未经审计。 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号） 3 目录 【重要提示】1

第一部分绪言4	第二部分释义9
第三部分基金管理人9	第四部分基金托管人23
第五部分相关服务机构25	第六部分基金份额的发售31
第七部分基金合同的生效32	第八部分基金份额的申购与赎回33
第九部分基金的投资43	第十部分基金58
第十部分基金的业绩60	第十一部分基金的财产61
第十二部分基金资产的估值61	第十三部分基金的收益分配66
第十四部分基金费用与税收68	第十五部分基金的会计与审计70

第十

六部分基金的信息披露	71	第十七部分风险揭示
.....77		第十八部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算
.....80		第十九部分基金合同的内容摘要
.....111		第二十部分基金托管协议的内容摘要
.....124		第二十一部分对基金份额持有人的服务
.....126		第二十二部分其他应披露的事项
.....127		第二十三部分招募说明书的存放及查阅方式
.....128		第二十四部分备查文件

山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号）

4 第一部分绪言 《山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性规定》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号》等有关法律、法规以及《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》（以下简称“基金合同”）编写。基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号）

5 第二部分释义 本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指山西证券股份有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同或《基金合同》：指《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》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《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》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《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》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等以及颁布机关对其不时做出的修订
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员 会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员 会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员 会第十四次会议《全国人民代表 大会常务委员 会关于修改等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的

修订 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号） 6 13、《流动性规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其 不时做出的修订 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会 16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人 17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人 18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内 合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织 19、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内 依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者 20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以 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的合称 21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资 人 22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额， 办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 23、销售机构：指山西证券股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监 会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务 代理协议，代为办理基金销售业务的机构 24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括 投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结 算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等 25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为山西证券股份有 限公司或接受山西证券股份有限公司委托代为办理登记业务的机构 26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、由该登记机构 办理登记的基金份额余额及其变动情况的账户 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号） 7 27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机 构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资业务而引起的基金份额变 动及结余情况的账户 28、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件， 基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的 日期 29、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财 产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期 30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长 不得超过 3 个月 31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限 32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日 33、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的 开放日 34、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日） 35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日 36、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段 37、《业务规则》：指《山西证券股份有 限公司开放式基金业务规则》，是 规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理 人和投资人共同遵守 38、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同及招募说明书的规定申 请购买基金份额的行为 39、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申 请购买基金份额的行为 40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规 定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为 41、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有公告

规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

42、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所

山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号）

8 持基金份额销售机构的操作

43、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申 购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账 户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

44、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数 加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入 申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

45、元：指人民币元

46、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银 行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

47、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收 申购款及其他资产的价值总和

48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

50、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净 值和基金份额净值的过程

51、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站 及其他媒介

52、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观 事件。

53、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法 以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购 与银行定期存款（含协议约 定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受 限的新股及非公开发行股票、资产支 持证券、因发行人债务违约无法进行转让或 交易的债券等

山西证券策略精选灵活配置混 合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号）

9 第三部分基金管理人 一、基金管 理人基本情况 名称：山西证券股份有限公司 住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际 贸易中心东塔楼 办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 法定代 表人：侯巍 成立日期：1988 年 7 月 28 日 批准设立机关及批准设立文号：中国人民 银行复[1988]315 号 组织形式：股份有限公司 存续期限：持续经营 注册资本：人民币 28.2873 亿元 联系电话：（0351）8686966 传真：（0351）8686918 股权结构： 序号 股 东名称 持股数量 持有比例（%）

1	山西金融投资控股集团有限公司	865314455.00	30.59
2	太原钢铁（集团）有限公司	282605635.00	9.99
3	山西国际电力集团有限公司	199268856.00	7.04
4	北京中吉金投资产管理有限公司一中 吉金投一稳赢 2 号投资基金	48693500.00	1.72
5	中央汇金资产管理有限责任公司	40619400.00	1.44
6	河南省安融房地 产开发有限公司	33340351.00	1.18
7	郑州市热力总公司	26401342.00	0.93
8	山西省科技基 金发展有限公司	17000000.00	0.60
9	西藏鹏华投资管理有限公司	14580000.00	0.52
10	山西杏花村汾酒集团有限责任 公司	12376232.00	0.44

注：截止到 2018.09.30 前十大股东持 股情况 经营范围：证券经纪；证券自营；证券资产管理；证券投资咨询；与证券交 易、 证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介 绍业务；融资 融券；代销金融产品；公开募集证券投资基金管理业务。

山西证券策略精选灵活配置混 合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号）

10 二、主要人员情况 1、董事会成 员基本情况 侯巍先生，中共党员，硕士学位。2007 年 4 月至 2008 年 1 月任山西证券有限 责任公司党委委员、董事、总经理；2008 年 2 月至 2015 年 2 月任公司董事、总经理； 2008 年 4 月至 2010 年 9 月任大华期货有限公司董事；2009 年 4 月至今任中德证券有 限 责任公司董事长；2008 年 2 月至 2014 年 12 月历任公司党委委员、党委副书记； 2014 年 12 月至今任公司党委书记；2015 年 2 月至今任公司董事长、总经理；2016 年 12 月至今 任山西股权交易中心有限公司董事长。 朱海武先生，硕士学位，中国注册会计师、高级会 计师、中国注册税务师、 澳洲资深会计师。2000 年 1 月至今，在瑞华会计师事务所工作，

担任合伙人。2014年10月至今，任华远地产股份有限公司独立董事；2015年5月至今任公司董事。容和平先生，中共党员，本科毕业。2001年6月至2010年6月任山西大学商务学院副院长、教授；2011年5月至今任山西工商学院副院长、教授；2012年4月至2017年10月任山西西山煤电股份有限公司独立董事；2013年6月至今任太原化工股份有限公司独立董事；2011年5月至今任公司独立董事。王卫国先生，中共党员，硕士研究生。1994年4月起任中国政法大学教授（2016年5月退休）；2008年9月至今兼任任中国银行法学研究会会长；2014年10月至今任藏格控股股份有限公司独立董事；2016年11月至今任陕西宝光真空电器股份有限公司董事；2011年5月至今任公司独立董事。蒋岳祥先生，中共党员，硕士研究生。2005年12月至2009年3月任浙江大学经济学院金融系教授、博士生导师、系主任、院长助理；2009年4月至2013年7月，任浙江大学经济学院党委书记、副院长；2009年4月至今任浙江大学经济学院教授、博士生导师；2014年7月至今任国信证券股份有限公司独立董事；2015年8月至今任英洛华科技股份有限公司独立董事；2016年7月至今任荣安地产股份有限公司独立董事；2011年5月至今任公司独立董事。杨增军，男，1966年出生，本科学历，高级会计师，1988年7月至2004年3月，在中国工商银行工作，历任长治八一办事处会计科科员、副科长、科长，长治分行营业部副主任，长治分行潞州办事处副主任，长治分行计划财会部副主任、主任，长治分行计划财务科科长；2004年3月至2008年6月，在上海浦东发展银行太原分行工作，历任资金财务部负责人、资金财务管理部副总经理（主持山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018第2号）11持工作）；2008年6月至2009年3月在渤海银行工作，任财务部高级经理兼太原分行财务团队负责人；2009年3月至2015年5月，在晋商银行股份有限公司工作，历任财务总监、首席财务官；2015年5月至2016年7月，在山西国信投资集团有限公司工作，任财务总监兼计划财务部总经理、科技信息部总经理（兼）、投资决策委员会委员、财务审查委员会副主任；2016年7月至今在山西金融投资控股集团有限公司工作，任财务总监兼财务管理部总经理；2017年2月至今兼任山西省产权交易中心股份有限公司监事、监事会主席，山西省农业信贷融资担保有限公司监事。杨增军先生符合《公司法》、《证券法》、《证券公司董事、监事、高级管理人员任职资格监管办法》等相关法律法规规定的证券公司董事任职基本条件，与持有公司股份5%以上股东存在关联关系；未持有本公司股份；未受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒。经在最高人民法院网核查，杨增军先生不属于“失信被执行人”。李华，男，1972年8月生，大学学历，会计师。1995年7月至2002年3月在太钢财务处成本科从事会计工作；2002年4月至2008年6月担任太钢计财部成本管理室科长；2008年7月至2011年9月担任山西太钢不锈钢股份有限公司计财部副部长；2011年10月至2017年7月担任山西太钢不锈钢股份有限公司计财部部长；2016年4月至2017年7月担任山西太钢不锈钢股份有限公司财务总监；2016年11月至2017年7月担任山西太钢不锈钢股份有限公司董事会秘书；2016年10月至今担任山西太钢不锈钢股份有限公司董事；2017年8月至今担任太原钢铁（集团）有限公司副总经理，兼任太原钢铁（集团）国际经济贸易有限公司、山西太钢投资有限公司、山西太钢能源有限公司、太钢进出口（香港）有限公司、太钢集团财务有限公司董事长，太钢（天津）融资租赁有限公司、太钢（天津）商业保理有限公司董事长、总经理，山西晋煤太钢能源有限责任公司、太钢集团临汾钢铁有限公司董事。2017年12月至今担任山西太钢保险代理有限公司董事长。李华先生符合《公司法》、《证券法》、《证券公司董事、监事、高级管理人员任职资格监管办法》等相关法律法规规定的证券公司董事任职基本条件，已取得证券公司董事任职资格，与持有公司股份5%以上股东存在关联关系；未持有本公司股份；未受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证

券交易所 惩戒。经在最高人民法院网核查，李华先生不属于“失信被执行人”。 夏贵所，男，1963 年 2 月生，大学学历。1996 年 11 月至 1998 年 1 月任山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号）12 西通宝能源股份有限公司财务部副经理，1998 年 1 月至 2000 年 8 月任山西通宝 能源股份有限公司总经理助理、财务部经理，2001 年 11 月至 2004 年 3 月任山西通宝能源股份有限公司总会计师，2004 年 3 月至 2008 年 2 月任山西通宝能源 股份有限公司副总经理兼会计师，2008 年 2 月至 2010 年 7 月任山西国际电力配 电管理公司总会计师、党委委员，2010 年 7 月至今任山西国际电力集团有限公 司财务部经理（期间：2014 年 2 月至 2017 年 3 月任晋能电力集团有限公司总会 计师、党委委员职务），2016 年 5 月至今任山西通宝能源股份有限公司董事。夏 贵所先生符合《公司法》、《证券法》、《证券公司董事、监 事、高级管理人员任职 资格监管办法》等相关法律法规规定的证券公司董事任职基本条件，已取得证 券 公司董事任职资格，与持有公司股份 5%以上股东存在关联关系；未持有本公 司 股份；未受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒。经在最高人 民法院网核查，夏贵所先生不属于“失信被执行人”。 王怡里先生，1973 年 6 月出生，汉族，中共党员，学士学位。2008 年 2 月 至 2013 年 3 月任山西证券董事会办公室总经理；2008 年 2 月至 2016 年 5 月任 山西证券综合管理部总经理；2010 年 2 月至今担任山西证券党委委员；2010 年 4 月至今任山西证券董事会秘书；2011 年 8 月至今任山西证 券副总经理；2013 年 6 月至今任山西中小企业创业投资基金（有限合伙）执行合伙人、山证基金管 理有限公司董事长；2014 年 6 月至今任山证资本管理（北京）有限公司董事 长；2014 年 10 月至今任龙华启富（深圳）股权投资基金管理有限公司董事长、北京 山 证并购资本投资合伙企业执行合伙人；2015 年 2 月至今任龙华启富投资有限 责任公司董 事长；2016 年 11 月至今担任中德证券有限责任公司董事。王怡里先 生符合《公司法》、《证券法》、《证券公司董事、监事、高级管理人员任职资格监 管办法》等相关法律法规规定的证券公司董事任职基本条件，与持股 5%以上股 份的股东、实际控制人、公司其他董事、监事、高级管理人员不存在关联关系， 未持有本公司股份，未受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒。 经在最高人民法院网核查，王怡里先生不属于 “失信被执行人”。 2、监事会成员基本情况 焦杨先生，中共党员，本科学历，硕士学位。2010 年 2 月至 2014 年 12 月任山 西信托股份有限公司常务副总经理；2014 年 12 月至 2016 年 6 月任山西国信投资集 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募 说明书（2018 第 2 号）13 团有限公司风控总监兼审计风控部总经理；2016 年 6 月至 2018 年 2 月任山西金融投 资控股集团有限公司运营总监、资本运营部总经理；2018 年 2 月至今任山西金融 投资控股集团有限公司投资管理部总经理；2015 年 1 月至今任汇丰晋 信基金管理 有限公司监事会主席；2015 年 1 月至 2016 年 12 月，任山西股权交易中心有 限公司 监事；2016 年 12 月至今，任山西股权交易中心有限公司监事会主席；2010 年 10 月至 2011 年 5 月任公司监事；2011 年 5 月至今任公司监事会主席。 郭志宏先生，中共党 员，本科学历，EMBA 高级工商管理硕士学位，高级经 济师。2012 年 5 月至 2015 年 3 月，任山西信托股份有限公司监事、监事会主席；2015 年 3 月至 2017 年 1 月任山西信托股份 有限公司党 委委员；2017 年 1 月至今任山西省 融资再担保有限公司党委书记、董事长； 2015 年 5 月至今任公司监事。 王国峰先生，中共党员，本科学历。2005 年 3 月至 2015 年 3 月，任长治市行政 事业单位国有资产管理中心副主任；2015 年 9 月至 2017 年 10 月，任长治市行政事 业单位国有资产管理中心主任；2017 年 10 月至今，任长治市经 济建设投资服务中 心主任；2015 年 5 月至今任公司监事。 高明先生，中共党员，大专学 历。1984 年 9 月至今历任汾酒集团有限责任公 司基建出纳、会计、财务科副科长、科长、 审计部副主任、主任、山西杏花村汾 酒厂股份有限公司财务处处长、汾酒集团有限责任公

司财务部主任、副总会计师；2013年8月至今任山西杏花村汾酒集团有限责任公司总会计师；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司董事；2008年2月至今任公司监事。

关峰先生，中共党员，本科学历。2001年6月至2013年6月，历任山西焦化集团有限公司审计处副处长、处长；2013年6月至2014年4月，任山西焦化集团有限公司财务处处长；2014年5月至2017年5月，任山西焦化集团有限公司集团副总会计师兼财务处处长；2017年2月至今任山西焦煤集团飞虹化工股份有限公司总经理助理、财务部部长；2015年5月至今任公司监事。

罗爱民先生，中共党员，本科学历。2005年3月至2010年3月任山西省经贸资产经营有限责任公司处长；2010年3月至2017年5月任山西经贸集团技改投资有限公司总经理，2017年5月至今任山西经贸集团技改投资有限公司执行董事；2007年6月至今，任太原重工股份有限公司监事；2011年5月至今任公司监事。

李国林先生，中共党员，本科学历，学士学位。2012年4月至2016年5月任山西省科技基金发展总公司副总经理；2016年5月至2016年8月，任山西省科技基金山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018第2号）14发展总公司常务副总经理；2016年8月至2017年12月任山西省科技基金发展总公司总经理；2016年9月至2017年12月任山西省科技基金发展总公司党支部书记。2017年12月至今任山西省科技基金发展有限公司(原山西省科技基金发展总公司)党支部书记、执行董事、总经理。2014年9月至今，任山西久晖股权投资管理有限公司执行董事；2014年6月至今，任山西澳坤生物农业股份有限公司董事；2014年4月至今，任太原风华信息装备股份有限公司董事；2015年5月至2017年7月，任山西中电科新能源技术有限公司董事；2012年3月至今，任晋城市富基新材料有限公司董事；2014年12月至今，任山西诺亚信创业投资有限公司董事；2012年12月至今，任运城市奥新纳米新技术有限公司董事；2015年1月至今，任山西青山化工有限公司董事；2015年5月至今任公司监事。

刘奇旺先生，中共党员，本科学历。1987年8月至今在吕梁市国有资产投资集团公司（原吕梁地区信托投资公司）工作，1987年8月至1992年10月，在财务部从事会计工作；1992年10月至2007年5月，历任办公室副主任、办公室主任；2007年5月至2017年12月任总会计师；2017年12月至今任吕梁国投集团有限公司（原吕梁市国有资产投资集团公司）总会计师；2015年5月至今任公司监事。

胡朝晖先生，中共党员，学士学位。2008年2月至今任公司职工监事；2008年2月至2016年5月任公司风险控制部总经理；2016年5月至今任公司稽核考核部总经理；2009年1月起任公司监事会副主席。2011年7月至今任龙华启富监事；2014年6月任山证资本管理（北京）有限公司监事。

翟太煌先生，中共党员，硕士学位。2008年2月至今任公司研究所所长、职工监事；2011年7月至今任龙华启富投资有限责任公司董事；2014年6月任山证资本管理（北京）有限公司董事。

尤济敏女士，中共党员，硕士学位。2006年4月至2016年5月任公司人力资源部总经理；2006年4月至2011年8月，任公司党委办公室主任；2008年2月至今任公司职工监事；2011年7月至今任龙华启富投资有限责任公司董事；2013年6月至今任山证基金管理有限公司董事；2016年6月至今任龙华启富投资有限责任公司专职副董事长。

闫晓华女士，中共党员，学士学位。2006年7月至2008年1月任公司稽核考核部总经理，2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工监事；2008年2月至今任公司职工监事；2008年2月至2016年5月任公司稽核考核部总经理。2016年山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018第2号）15年5月至2017年7月任公司合规管理部总经理。2017年2月至今任公司总裁助理。

3、高级管理人员基本情况

侯巍先生，请参见本节“董事工作经历及任职情况”。

孟有军先生，中共党员，本科学历。2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司党委委员；2007年8月至2008年1月任山西证券有限责任公司副总经理；2008年2月至今任公司

党委委员、副总经理；2008年11月至2015年2月任公司合规 总监；2017年1月至今，任格林大华期货有限公司董事长。 乔俊峰先生，中共党员，硕士学位。2007年4月至2008年1月任山西证券 有限责任公司职工董事；2008年2月至2015年5月任公司职工董事；2008年10月至2010年9月任大华期货有限公司总经理；2010年9月至2013年9月任 大华期货有限公司董事长；2010年2月至今担任公司党委委员。2010年12月至 今任公司副总经理；2013年9月至2017年1月任格林大华期货有限公司董事长； 2016年1月至今任山证国际金融控股有限公司董事长。2017年6月至今任公司上海资产管理分公司总经理。 汤建雄先生，学士学位。2008年2月至2013年3月任公司计划财务部总经 理；2007年11月至2013年10月任大华期货有限公司董事；2009年4月至今担 任中德证券有限责任公司董事；2010年4月至2015年12月任公司财务总监； 2011年8月至今任公司副总经理；2011年7月至今任龙华启富投资有限责 任公 司董事；2013年10月至今任格林大华期货有限公司董事；2015年2月至2016年1月代为履行合规总监职责，2016年1月至2017年6月任公司合规总监。 2017年7月至今任公司首席风险官。 王怡里先生，请参见本节“董事工作经历及任职情况”。 高晓峰先生，学士学位。1996年8月至1999年8月任职于山西省证券管理 办公室证信证券培训中心；1999年8月至2010年3月先后任职于中国证监会山 西监管局机构处、期货处和上市处；2010年3月至2014年8月先后任中国证监 会山西监管局办公室副主任（主持工作）、主任；2014年8月至2015年11月任 中国证监会山西监管局期货处处长；2015年11月至2017年3月任中国证监会 山西监管局法制处处长（期间，2016年8月至2017年1月挂职山西金控集团投 资管理部副总经理）； 2017年6月至今，任公司副总经理、合规总监。 4、基金经理 山西证券策略精选灵活配 置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号） 16 蔡文先生，复旦大学管理学 硕士。2006年12月至2008年11月在毕马威财 务咨询担任财务咨询师；2008年11 月至2009年12月在美国 Cowen Group 投资 银行担任行业分析师；2010年2月至 2012年6月在汇丰晋信基金管理有限公司 担任研究员；2012年7月，在华宸未来基 金管理有限公司担任高级研究员、投 资决策委员会委员。2014年10月至2015年12 月任华宸未来沪深 300 指数增强 型发起式证券投资基金(LOF)基金经理。2016年2月加 盟山西证券公募基金部， 目前担任权益投资总监。2016年7月1日至2018年7月 21 日任山西证券保本 混合型证券投资基金基金经理。2016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。2018年1月12日至今担任山 西证券改 革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。蔡文先生具备基金从业资格。

5、投资决策委员会成员 主任委员： 乔俊峰，公司副总裁 委员： 薛永红，公募基金部总 经理； 张立德，计划财务部副总经理； 王忠宁，运营管理部副总经理； 华志贵，基金经 理； 郭熠，财富管理部副总经理； 蔡文，基金经理； 上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代 为办理基 金份额的发售、申购、赎回和登记事宜； 2、办理基金备案手续； 3、自《基金 合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用 基金财产； 4、配备足够的 具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的 经营方式管理和运作基金财产； 5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保 山西证券策略 精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号） 17 证所管理的基金 财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管 理，分别记账，进行证券 投资； 6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财 产为自己 及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产； 7、依法接受基金托管人的监 督； 8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方 法符合

《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格； 9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告； 10、编制季度、半年度和年度基金报告； 11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务； 12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露； 13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益； 14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项； 15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会； 16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上； 17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件； 18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配； 19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人； 20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018 第 2 号） 18 益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除； 21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿； 22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任； 23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为； 24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人； 25、执行生效的基金份额持有人大会的决议； 26、建立并保存基金份额持有人名册； 27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018 第 2 号） 19 取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的风险管理与内部控制制度

1、风险管理的原则

（1）全面性原则：公司风险管理必须覆盖公司的

所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；（2）独立性原则：公司设立独立的监察稽核部，监察稽核部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；（3）相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性；（5）重要性原则：公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部门负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险；山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018第2号）20

（2）合规总监：独立行使督察权利，直接对董事会负责，及时向审计与风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

（3）首席风险官：负责组织、协调、落实全面风险管理工作；

（4）风险管理执行委员会：根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告；

（5）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

（6）合规管理部：负责对公募基金管理业务相关制度、合同和流程进行合规性审核；按照监管机构的要求和公司的规定定期、不定期地进行合规检查，组织落实公募基金管理业务的业务隔离和反洗钱工作；负责处理公募基金管理业务相关法律诉讼事务；

（7）风险管理部：负责对整体业务进行全程监控，拟定和完善公募基金管理业务风险管理制度和风险控制流程；建立和完善公募基金管理业务风险监控指标体系；监控和检查公募基金管理业务运行情况；分析、评估公募基金管理业务的风险状况，并向公司总经理办公会及相关部门提交风险评估报告；

（8）稽核审计部：负责对公募基金管理业务进行全面的审计与监察、稽核，检查各部门对公募基金管理业务相关制度的执行情况，并出具监察稽核报告；

（9）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、内部控制制度综述

（1）风险控制制度 公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；不断提高经营管理水平，在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化；建立行之有效的风险控制机制和制度，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全。山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018第2号）21

完整；维护公司信誉，保持公司的良好形象。针对公司面临的各种风险，包括政策和市场风险，管理风险和职业道德风险，分别制定严格防范措施，并制定岗位分离制度、空间分离制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

（2）监察稽核制度 监察稽核工作是公司内部风险控制的重要环节。公司设合规总监、合规管理部和稽核审计部。合规总监全面负责公司的监察稽核工作，可在授权范围内列席任何会议，调阅公司任何档案材料，对基金资产运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行内部监察、稽核，出具监察稽核报告，报公司董事会和中国证监会。如发现公司有重大违规行为，应立即向公司董事会和中国证监会报告。合规管理部、稽核审计部具体执行合规管理与稽核审计工作，并协助合规总监工作。合规管理部、稽核审计部具有独立的检查权、独立的报告权、知晓权和建议权。具体负责对公司内部风险控制制度提出修改意

见，并提交风险管理执行委员会；检查公司各部门执行内部管理制度的情况；监督公司资产运作、财务收支的合法性、合规性、合理性；监督基金财产运作的合法性、合规性、合理性；调查公司内部的违规事件；协助监管机关调查处理相关事项；负责员工的离任审计；协调外部审计事宜等。（3）内部会计控制制度建立了基金会计的工作制度及相应的操作控制规程，确保会计业务有章可循；按照相互制约原则，建立了基金会计业务的复核制度以及与托管行相关业务的相互核查监督机制；为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度；为了确保基金资产的安全，公司严格规范基金清算交割工作，并在授权范围内，及时准确地完成基金清算；强化会计的事前、事中、事后监督和考核制度；为了防止会计数据的毁损、散失和泄密，制定了完善的档案保管和财务交接制度。

4、风险管理和内部风险控制的措施（1）建立、健全内控体系，完善内控制度。公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018第2号）22（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制。公司建立、健全了各项制度，做到基金经理分开、投资决策分开、基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；（3）建立、健全岗位责任制。公司建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序。公司建立了风险管理执行委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度做出决策；（5）建立内部监控系统。公司建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；（6）使用数量化的风险管理手段。采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示市场趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；（7）提供足够的培训。公司制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书 本公司确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺将根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018第2号）23

第四部分基金托管人（一）基本情况 名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号 首次注册登记日期：1983年10月31日 注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整 法定代表人：陈四清 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号 托管部门信息披露联系人：王永民 传真：（010）66594942 中国银行客服电话：95566（二）基金托管部门及主要人员情况 中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。（三）证券投资基金托管情况 截至2018年9月30日，中国银行已

托管 679 只证券投资基金，其中境内基金 642 只，QDII 基金 37 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模 位居同业前列。（四）托管业务的内部控制制度 中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号） 24 组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。 中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险 控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、 全程的风险管控。 2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控 制审阅工作。先后获得基于 “SAS70”、“AAF01/06” “ISAE3402”和“SSAE16” 等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国 银行继续获 得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管 业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。（五）托管人对管理人 运作基金进行监督的方法和程序 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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、 行政法规 和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人， 并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据 交易程序 已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基 金合同约定的， 应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报 告。山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号） 25 第五部分相关服务机构 一、基金份额发售机构 1、直销机构：山西证券股份有限公司 办公地址：山西省太原市府 西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人：侯巍 董秘：王怡里 联系电话： （0351）8686966 传真：（0351）8686918 客服电话：95573 网址：www.i618.com.cn 2、 代销机构：（1）北京新浪仓石基金销售有限公司 注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室 办公地址：北京市海淀区海淀北二街 10 号泰鹏大厦 12 层 法定代表人： 张琪 联系人： 付文红 客服电话：010-62675369 网址：<http://www.xincai.com/>（2）交通 银行股份有限公司 注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号 办公地址：上海市浦东新 区银城中路 188 号 法定代表人：彭纯 联系人：王菁 客服电话：95559 网址：<http://www.bankcomm.com/>（3）晋商银行股份有限公司 注册地址：山西省太原市万柏 林区长风西街一号丽华大厦 A 座 办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大 厦 A 座 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书（2018 第 2 号） 26 法定代表人：阎俊生 联系人： 董嘉文 客服电话：9510-5588 网址：www.jshbank.com（4）上海长量基金销售投资顾问有限公司 注册地址：上海市浦东新区 高翔路 526 号 2 幢 220 室 办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层 法定代 表人：张跃伟 联系人：苗明 客服电话：800-820-2899 网址：www.erichfund.com（5）上 海好买基金销售有限公司 注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号 办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室 法定代表人：杨文斌 联系人：张茹 客服电话：4007009665 网址：www.ehowbuy.com（6）北京展恒基金销售 股份有限公司 注册地址：北京市顺义区后沙欲镇安福街 6 号 办公地址：北京市朝阳区安 苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层 法定代表人：闫振杰 联系人：翟文 客服电话： 4008188000 网址：www.myfund.com（7）诺亚正行基金销售有限公司 注册地址：上海 市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室 办公地址：上海市杨浦区长阳 1687 号 2 号楼 法定代表人：汪静波 联系人：张裕 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新 招募说明书（2018 第 2 号） 27 客服电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com（8）上海天天基金销售有限公司 注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 26 层 法定代表人：其实 联系人：黄妮娟 客服电话：4001818188 网址：www.1234567.com.cn (9) 深圳众禄基金销售股份有限公司 注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801 办公地址：深圳市罗湖区梨园路号 HALO 广场 4 楼 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 客服电话：4006-788-887 网址：<http://www.zlfund.cn> (10) 上海利得基金销售有限公司 注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼 法定代表人：沈继伟 联系人：陈孜明 客服电话：400-067-6266 网址：<http://a.leadfund.com.cn> (11) 北京恒天明泽基金销售有限公司 注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层 法定代表人：李悦 联系人：张晔 客服电话：4007868868 网址：<http://www.chtfund.com> 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书 (2018 第 2 号) 28 (12) 大泰金石基金销售有限公司 注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室 办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼 法定代表人：袁顾明 联系人：王骅 客服电话：400-92-82266 网址：<https://www.dtfunds.com> (13) 上海陆金所基金销售有限公司 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼 法定代表人：鲍东华 联系人：宁博宇 客服电话：4008219031 网址：www.lufunds.com (14) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司 注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室 办公地址：杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 法定代表人：陈柏青 联系人：韩爱彬 客服电话：400-766-123 网址：<http://www.fund123.cn> (15) 中国银行股份有限公司 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：田国立 联系人：刘川 客服电话：95566 网址：www.bankofchina.com (16) 北京汇成基金销售有限公司 注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书 (2018 第 2 号) 29 办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号 法定代表人：王伟刚 联系人：熊小满 客服电话：400-619-9059 网址：<http://www.hcjijin.com/> (17) 通华财富(上海)基金销售有限公司 注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼 法定代表人：马刚 联系人：杨徐霆 客服电话：4006695156 网址：<https://www.tonghuafund.com/> 基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构新增为本基金的发售机构，并及时公告。二、登记机构 名称：山西证券股份有限公司 办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人：侯巍 董秘：王怡里 联系电话：(0351) 8686966 传真：(0351) 8686918 客服电话：95573 网址：www.i618.com.cn 三、出具法律意见书的律师事务所 名称：国浩律师(上海)事务所 办公地址：上海市北京西路 968 号嘉地中心 23-25 层 负责人：黄宁宁 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书 (2018 第 2 号) 30 电话：(021) 52341668 传真：(021) 52433320 经办律师：雷丹丹、曹江玮 联系人：曹江玮 四、审计基金财产的会计师事务所 名称：中喜会计师事务所(特殊普通合伙) 住所：北京市崇文区崇文门外大街 11 号新城文化大厦 A 座 11 层 办公地址：北京市崇文区崇文门外大街 11 号新城文化大厦 A 座 11 层 法定代表人：张增刚 电话：010-68085873 经办注册会计师：白银泉、武丹 联系人：武丹 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书 (2018 第 2 号) 31 第六部分基金份额的发售 一、基金募集的依据 本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。 本基金募集申请已经中国证监会 2016 年 10 月 14 日证

监许可[2016]2343号文注册。二、基金募集情况 本基金募集期为2016年11月21日至2016年12月21日。经会计师事务所验资,按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,基金募集期共募集499,921,635.62份基金份额(其中包括利息转份额372,872.83份),有效认购户数为6,679户。其中山西证券股份有限公司的基金从业人员认购份额为0.00份(含募集期利息结转的份额),占比例为0.00%。山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2018第2号)32第七部分基金合同的生效一、基金合同的生效 本基金合同于2016年12月29日正式生效。自基金合同生效日起,本基金管理人正式开始管理本基金。二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 基金合同生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或 者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续六十个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决,但基金合同另有约定的除外。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2018第2号)33第八部分基金份额的申购与赎回一、申购与赎回的场所 本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。二、申购与赎回办理的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。2、申购、赎回开始日及业务办理时间 本基金已于2017年2月28日开放申购和赎回业务。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。三、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算; 2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请; 3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销; 4、场外赎回遵循“先进先出”原则,即基金份额持有人在赎回基金份额,基金管理人对该基金份额持有人的基金份额进行赎回处理时,申购确认日期在前的基金份额先赎回,申购确认日期在后的基金份额后赎回,以确定所适用的赎回费率;山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2018第2号)345、基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。四、申购与赎回的数额限制 1. 申请申购基金的金额 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申购单笔最低限额为人民币1,000元,投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元;追加申购单笔最低限额为人民币1,000元。投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时,不受最低申购金额的限制。投资者可多次申购,对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。2. 申请赎回基金的份额 单笔赎回不得少于1,000份(如该账户在该销售机构托管的基金余额不足1,000份,则必须一次性赎回基金全部份额);若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足1,000份时,基金管理人有权将投资者在该销售机

构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

3. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

4. 基金管理人可根据市场情况，调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定的媒介上刊登公告并报中国证监会备案。

五、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式 投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付 投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账，则申购不成立。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认 基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。本基金登记机构确认申购或赎回的，申购或赎回生效。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项本金退还给投资人。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

六、申购费率、赎回费率

1、本基金基金份额前端申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下： 申购金额（含申购费） 申购费率 M