

山西证券中债1-3年国开行债券指数证券投资基金

2024年第3季度报告

2024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:上海银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月24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.....	4
3.1 主要财务指标.....	4
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合规守信情况的说明.....	8
4.3 公平交易专项说明.....	8
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....	9
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	10
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 投资组合报告.....	11
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	11
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	11
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.....	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	11
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.....	12
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.....	12
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.....	12
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.....	12
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	12
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	13
5.11 投资组合报告附注.....	13
§6 开放式基金份额变动.....	14
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	14
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	14
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	14
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	14
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.....	14
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	15
§9 备查文件目录.....	15
9.1 备查文件目录.....	15
9.2 存放地点.....	15
9.3 查阅方式.....	15

§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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月22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2024年07月01日起至2024年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	山西证券中债1-3年国开债指数
基金主代码	019081
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年04月24日
报告期末基金份额总额	358,494,374.02份
投资目标	本基金通过指数化投资，力争获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、优化抽样复制策略</p> <p>本基金为指数基金，采用优化抽样复制法。通过对标的指数中各成份债券的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的债券构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，</p>

	<p>导致标的指数成份债券和备选成份债券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份债券和备选成份债券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。</p> <p>替代组合的构建将以债券流动性为约束条件，按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>对于非成份券的债券，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。另外，本基金债券投资将适当运用杠杆策略，通过债券回购融入资金，然后买入收益率更高的债券以获得收益。</p>	
业绩比较基准	中债-1-3年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	<p>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，但低于混合型基金、股票型基金。</p> <p>本基金跟踪中债-1-3年国开行债券指数，主要投资于标的指数成份券及备选成份券，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。</p>	
基金管理人	山西证券股份有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	山西证券中债1-3年国开债指数A	山西证券中债1-3年国开债指数C
下属分级基金的交易代码	019081	019082
报告期末下属分级基金的份额总额	54,764,993.34份	303,729,380.68份

§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(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	山西证券中债1-3年国开债指数A	山西证券中债1-3年国开债指数C

1.本期已实现收益	444,720.53	1,670,910.67
2.本期利润	254,667.94	-110,308.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0101	-0.0011
4.期末基金资产净值	56,594,216.40	315,635,473.56
5.期末基金份额净值	1.0334	1.0392

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

山西证券中债1-3年国开债指数A净值表现

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	2.86%	0.22%	0.53%	0.03%	2.33%	0.19%
自基金合同生效起至今	3.34%	0.17%	1.10%	0.03%	2.24%	0.14%

山西证券中债1-3年国开债指数C净值表现

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	2.79%	0.22%	0.53%	0.03%	2.26%	0.19%
自基金合同生效起至今	3.92%	0.18%	1.10%	0.03%	2.82%	0.15%

本基金的业绩比较基准为：中债-1-3年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

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

山西证券中债1-3年国开债指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年04月24日-2024年09月30日)



山西证券中债1-3年国开债指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年04月24日-2024年09月30日)



- 1、本基金基金合同生效日为2024年4月24日，至本报告期末，本基金运作时间未满一年；
- 2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起六个月，报告期末本基金建仓期尚未结束。

§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		

蓝焯	基金经理	2024-04-27	-	-	<p>蓝焯女士，厦门大学金融学硕士。2013年7月至2017年2月在光大证券股份有限公司担任债券交易员。2017年3月至2020年3月在太平基金管理有限公司担任债券投资经理助理。2020年3月至2020年9月在太平基金管理有限公司担任产品经理。2020年9月加入山西证券股份有限公司公募基金部担任基金经理助理。2022年8月起担任山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022年9月起任山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金基金经理。2023年2月起担任山西证券裕景30天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理。2023年3月起担任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。蓝焯女士具备基金从业资格。</p>
倪伟杰	基金经理	2024-07-10	-	2年	<p>倪伟杰先生，会计与金融学硕士，CFA。曾任中银基金债券交易员，2022年7月至2024年6月任山西证券股份有限公司公募基金部基金经理助理，2024年7月起任山证（上海）资产管理有限公司公募固定收益投资部基金经理，并自2024年7月</p>

					起任山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金、山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券汇利一年定期开放债券型证券投资基金、山西证券中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。倪伟杰先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

- 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

三季度，随着海外主要经济体通胀数据的持续回落，叠加美国经济韧性仍存和部分新兴经济体展现出良好增长势头，全球经济“硬着陆”风险降低，但是长期来看仍面临挑战。

美联储政策在三季度出现明显变化，虽然在7月保持按兵不动，但是会议纪要显示部分官员在7月会议上支持降息，并且后续披露的劳动力数据未纳入考量。9月，美联储虽然超市场预期降息50BP，但是对于降息幅度仍存在一定分歧，主要原因为仍有部分官员坚持认为通胀风险依然较高，需要保持政策利率处于限制性水平，而其余大部分官员均表达了对劳动力市场转弱的担忧。需要注意的是，在当前美国大选进程不断推进之际，政治压力对美联储决策的影响开始凸显。美联储9月降息之后，包括拜登、耶伦和特朗普在内的主要政治角色均在各自立场上表达了观点，在11月大选前，美联储货币政策决策面临的压力或将进一步提升。

国内方面，7月下旬在海外主要经济体货币政策变化及预期影响下，人民币对美元汇率迅速升值，期间结汇盘增多短期内加快了升值速度。9月，央行、国家金融监管总局和证监会举办联合新闻发布会，提出一揽子金融增量措施；26日，政治局会议超预期对经济工作做出指示，国内外对于政策刺激下经济升温的预期大幅回升，中国资产的吸引力也促使部分海外资金回流国内，综合促使人民币汇率出现一波明显上涨。四季度，美联储年内预计至少仍有一次25bp的降息操作，国内各大会议陆续召开，叠加设备更新和消费刺激政策效果逐步显现，可能阶段性提振人民币汇率。

三季度，基本面总体上延续了二季度的疲软状态。出口方面，全球制造业景气度连续下行，外需回落，但是我国出口份额仍有较强韧性，可能是获益于国内产业链齐全、“朋友圈”扩大以及转口贸易等可持续的积极因素。消费方面，社零同比仍在低位震荡，财产缩水与工资下降仍是近期消费持续疲软的主要原因，70城新建和二手住宅销售价格同比降幅扩大，城镇失业率也持续走高，也验证了居民财产性收入的缩水和工资收入的下降。地产方面，5月地产新政以来销售逐步回升，8月商品房销售面积当月同比升至了年内新高，但是房价环比依然没有显著的回升，仍处于以价换量的阶段。当前商品房广义库存去化时间仍在拉长，销售端的短暂回升未能明显缩短库存量的去化时间，因此房价可能仍有下跌的空间。基建方面，二季度以来基建不含电力口径当月同比持续下行至8月的1.2%，创22年以来新低，而全口径增速冲高回落、相对韧性（8月录得6.2%），7月二者增速差录得15年5月以来新高，8月虽有所回落但依然处于高位。二者严重分化说明电力投资是基建的重要支撑，而电力投资更多由中央主导，即二者分化源于中央与地方财力的分化。地方财力的低景气源于土地财政的大幅

收缩，化债背景下城投融资受限以及今年1-4月专项债发行速度较慢的影响。制造业方面，今年以来制造业投资与出口同步，虽然3季度制造业投资增速有所回落，但在设备更新政策的支撑下，设备更新改造对制造业投资的提振将持续显现。

通胀方面，3月以来CPI震荡回升，8月录得0.6%为年内次高，食品分项触底快速回升是主要贡献。23年以来能繁母猪持续去化，本轮猪价上升周期从今年4月开始；另外，高温、强降雨、台风等天气因素使得鲜菜和鲜果价格波动较大，8月二者都大幅涨价。5月以来，能源和核心CPI以回落为主。由于外需走弱，国际油价带动交通工具燃料持续下滑；收入信心不足的情况下，核心CPI连续下降至21年二季度以来新低，无论是房租还是此前韧性的旅游分项都连续下降，表明内需不足的范围正在扩大。今年前8个月，PPI环比仅在5月录得正增长，8-9月环比跌幅明显扩大，5月的环比正增长是国内政策预期发酵导致黑色系价格上行，国外经济韧性、全球制造业景气度扩张导致原油、铜价上升。但进入三季度上述逻辑出现转变：“517”新政投入的资金规模有限，外加地产供需两端无明显好转，黑色系绝对价格从5月下旬开始由涨转跌；

三季度，7月份的二十届三中全会主要是为未来五年改革锚定了方向，7月降息后也未有大规模刺激政策的出台。9月下旬中央政治局会议的定调以及一系列金融增量政策，彻底扭转了市场对于基本面的预期，9月24日货币政策大幅发力，年内再次发力的概率不高，甚至一定程度上透支了明年年初的政策空间。随着存款准备金率的下调，我国货币政策操作框架转型预计将加快，央行买卖国债或将逐步放量并替换MLF基础货币投放的作用。在地方财政压力加大、国债发行进度偏慢的情况下，财政政策仍可期待，但是需要结合相关政策出台需要的必备流程以及实际所需资金量与国际观瞻进行综合权衡。

三季度央行的监管手段不再局限于口头“喊话”，而是通过直接或间接（指导大行）参与二级市场买卖以及行政措施控制长端利率下行速度。上述行为确实导致债市阶段性调整，其中8月的调整引发一定程度上的赎回负反馈，对信用债的影响更大，然而在经济下行压力增大、货币宽松预期增强、稳增长政策迟迟不兑现的情况下，利率下行幅度明显大于二季度。9月中旬利率下破2.1%并于中秋前逼近2.0%，924政策力度较大，利率明显上行。当前信用债性价比有所提高，在资产荒的大背景下，信用利差再度明显走阔的概率不大。并且9月R-DR经历了冲高回落的过程，后续资金分层现象预计有所缓和。

总体来看，四季度债券市场预计以低位较大幅度震荡为主，财政政策具体的实施力度，美国大选和降息进程的扰动，以及年末的中央经济工作会议均可能对债券市场产生较大波动。

本基金报告期内重点配置流动性较高的国债及政金债，根据监管政策以及市场波动灵活调整久期以及杠杆比例，积极参与波段交易的投资机会，力求准确跟踪基准业绩表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山西证券中债1-3年国开债指数A基金份额净值为1.0334元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.86%，同期业绩比较基准收益率为0.53%；截至报告期末山西证券中债1-3年国开债指数C基金份额净值为1.0392元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.79%，同期业绩比较基准收益率为0.53%。

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

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	417,847,709.18	83.55
	其中：债券	417,847,709.18	83.55
	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	82,256,755.87	16.45
8	其他资产	7,920.00	0.00
9	合计	500,112,385.05	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

本基金报告期末未持有股票。

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

本基金报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	181,936,161.23	48.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	235,911,547.95	63.38
	其中：政策性金融债	235,911,547.95	63.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	417,847,709.18	112.26

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	220208	22国开08	600,000	61,805,145.21	16.60
2	220202	22国开02	600,000	61,100,991.78	16.41
3	160210	16国开10	500,000	51,809,753.42	13.92
4	210208	21国开08	500,000	51,066,410.96	13.72
5	019735	24国债04	400,000	40,651,287.67	10.92

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。

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 本基金本报告期末投资股票，没有出现投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,920.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,920.00

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中不存在流通受限情况。

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

	山西证券中债1-3年国开 债指数A	山西证券中债1-3年国开 债指数C
报告期期初基金份额总额	10,055,428.53	961,348.34
报告期期间基金总申购份额	58,848,711.32	785,147,881.33
减：报告期期间基金总赎回份额	14,139,146.51	482,379,848.99
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	54,764,993.34	303,729,380.68

§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

单位：份

	山西证券中债1-3年国 开债指数A	山西证券中债1-3年国 开债指数C
报告期期初管理人持有的本基金份 额	10,000,450.05	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份 额	10,000,450.05	-
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例(%)	2.79	-

7.2 基金管理人运用固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固有资金投资本基金。

§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

别							
机构	1	20240701-20240807	10,000,450.05	-	-	10,000,450.05	2.79%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，由于持有人结构比较集中，资金易呈现"大进大出"特点。在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能造成基金净值的波动，甚至可能引发基金的流动性风险。</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、中国证监会准予山西证券中债1-3年国开行债券指数证券投资基金注册的文件；
- 2、山西证券中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金合同；
- 3、山西证券中债1-3年国开行债券指数证券投资基金托管协议；
- 4、山西证券中债1-3年国开行债券指数证券投资基金招募说明书；
- 5、山西证券中债1-3年国开行债券指数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、0351-95573
- 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

2024年10月24日