
山西证券品质生活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:交通银行股份有限公司

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	6
3.1 主要财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
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	11
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	16
5.11 投资组合报告附注	16
§6 开放式基金份额变动	17
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	17
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	18
9.1 备查文件目录	18
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。

基金托管人交通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	山西证券品质生活
基金主代码	011917
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年05月27日
报告期末基金份额总额	255,831,618.38份
投资目标	本基金主要投资于品质生活相关的优质上市公司，在精选个股、合理控制风险并保持基金资产流动性良好的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、大类资产配置 本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适

时地做出相应的调整。

2、股票投资策略

本基金主要运用股票研究分析方法等投资分析工具，在把握宏观经济运行趋势和股票市场行业轮动的基础上，充分发挥公司股票研究团队“自下而上”的主动选股能力，基于对个股深入的基本面研究和细致的实地调研，精选股票构建股票投资组合。

(1) “品质生活”主题的界定

“品质生活”主题涵盖能够为居民提供优质的产品、服务或解决方案，用以直接或间接提升居民生活品质的相关上市公司。本基金就主要投资于那些提供的产品或服务能够切实地提升民众生活品质的企业，这些产品和服务包括但不限于：

大消费、大健康、物联网以及其它由新技术所推动的产品和服务。落实到行业层面，包括申万一级行业的食品饮料、家用电器、农林牧渔、商业贸易、休闲服务、汽车、医药生物、电子、传媒、计算机、通信及非银行金融等行业。

本基金调整界定范围应及时告知基金托管人，并在更新的招募说明书中进行公告。

(2) 个股投资策略

首先，使用定性分析的方法，从技术能力、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司的基本情况进行分析。

1) 在技术能力方面，选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广阔并且在技术上具有一定护城河的公司。

2) 在市场前景方面，需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、进而开拓市场、创造利润增长的能力。

3) 在公司治理结构方面，将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系等方面进行评价，公司治理能力的优劣对公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。其次，使用定量分析的方法，通过财务和运营数据对企业价值进行评估。本基金主要从行业景气度、盈利能力、

成长能力以及估值水平等方面进行考量。

（3）港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。

本基金将遵循品质生活相关股票的投资策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

3、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

4、债券投资策略

在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用放大操作、骑乘操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。

5、资产支持证券投资策略

本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

6、金融衍生品投资策略

为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。

（1）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套

	<p>期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，以达到降低投资组合整体风险的目的。</p> <p>(2) 国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>7、参与融资业务投资策略</p> <p>本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。</p>	
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）*20%+中债综合财富（总值）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，高于债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	山西证券品质生活A	山西证券品质生活C
下属分级基金的交易代码	011917	011918
报告期末下属分级基金的份额总额	231,583,033.32份	24,248,585.06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(2022年07月01日 - 2
--------	---------------------

	022年09月30日)	
	山西证券品质生活A	山西证券品质生活C
1. 本期已实现收益	-205,215.98	-51,675.61
2. 本期利润	-28,408,307.99	-2,956,401.09
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1211	-0.1213
4. 期末基金资产净值	180,364,405.96	18,727,760.28
5. 期末基金份额净值	0.7788	0.7723

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

山西证券品质生活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	-13.44%	1.15%	-12.31%	0.74%	-1.13%	0.41%
过去六个月	-2.28%	1.34%	-7.87%	0.96%	5.59%	0.38%
过去一年	-21.61%	1.32%	-17.13%	0.97%	-4.48%	0.35%
自基金合同生效起至今	-22.12%	1.14%	-23.57%	0.94%	1.45%	0.20%

山西证券品质生活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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

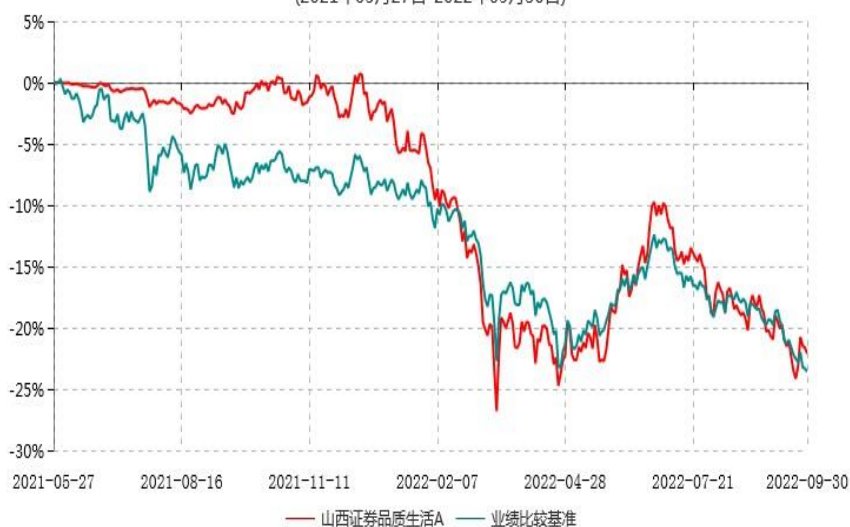
		准差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去三 个月	-13.5 6%	1.15%	-12.3 1%	0.74%	-1.25%	0.41%
过去六 个月	-2.59%	1.33%	-7.87%	0.96%	5.28%	0.37%
过去一 年	-22.0 9%	1.32%	-17.1 3%	0.97%	-4.96%	0.35%
自基金 合同生 效起至 今	-22.7 7%	1.14%	-23.5 7%	0.94%	0.80%	0.20%

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）*20%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%

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

山西证券品质生活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

(2021年05月27日-2022年09月30日)



山西证券品质生活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

(2021年05月27日-2022年09月30日)



注：1、按基金合同和招募说明书的约定，本基金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	2021-05-27	-	15年	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

				<p>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>
--	--	--	--	--

- 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

投资策略：本基金将投资目标定为以基本面分析为基础，寻找优秀的成长型企业，以相对合适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龙头企业，依靠企业自身的成长获取稳健收益。

运作分析：三季度市场在经过二季度的反弹之后，再度出现了大幅下跌的局面，并接近年内的新低位置。整体上看，上证综指三季度下跌11.01%，深成指三季度下跌16.42%，恒生指数三季度下跌21.21%，山证品质生活三季度下跌13.44%，跑赢业绩基准。

三季度月份对我们而言是非常艰难的，不仅仅是因为指数的大幅度下跌，上证接近低点，恒生再创新低，更加是因为实体经济里面临的内外交困的局面。内部，疫情依旧呈现出多点散发的局面，虽然我们做到了尽可能的精准化，但是持续不断的静默，尤其是人口聚集数量较多的一二线大城市的局部连绵不绝的静默对于投资者的心理影响以及经济的实际影响都是肉眼可见的；外部，美联储持续加息，上限一再超出大家预期，

造成了美元指数上涨、人民币持续贬值以及外汇的不断流出，对于国内的资金面也形成了比较大的压力。内外交困之下，市场出现大幅度的下跌不足为奇。

我们这里把内外两个因素分开来谈。首先，从外部因素来说，我们必须搞清楚美联储这次持续不断加息并一再超出预期的动因是什么。非常明显，是由于通胀的不断超预期。而通胀超预期的根源则来自于能源价格的持续上涨，并进而影响到了食品、工业品、农产品等一系列产品的价格。但我们必须说明的是，欧洲今年所面临的是很极端的情况，不仅仅是缺气，风电、水电和核电均出力不足导致矛盾集中爆发。未来，在气、风、水和核当中，如果有两个哪怕有一个在朝着好的方向发展，欧洲的问题至少都会得到缓解。同时，美联储的加息对能源价格的控制作用已经非常明显，如果当前的能源价格能够保持到明年，海外的通胀压力就会减轻很多。所以我们觉得，海外因素是短期的扰动因素，但并不是决定我们市场中长期走势的最关键因素。

我们认为，打铁仍需自身硬，真正决定市场中长期走势的还是我们自身。现在展望四季度尤其是明年，我们的经济面临非常多以及非常大的挑战，最为核心的一点就在于如何更好的处理防控与经济之间的平衡关系。经济的三驾马车中，由于海外经济的不景气以及需求的下降，出口可能从8月份开始就进入了一个逐步下滑的通道；投资方面，虽然政府投资在发力，但是毕竟面临这赤字等诸多约束，而房地产方面，即使局面出现缓和也很难短期之内带动投资出现大幅度好转，所以投资最多能起到一个稳定的作用。最后看起来，对于四季度乃至明年的经济而言，必须依靠消费的发力来保持经济大盘的稳定。而如果需要消费的话，那最关键的一点则是消费者信心和人员流动性的问题了，这可能需要我们把防控和经济发展之间的关系处理的更加精准。我们会密切观察后续的政策走势及动向。不过总体而言，我们相信管理层的智慧以及能力，一定能够把这二者的关系处理好。

从市场策略来看，现在无论是A股还是港股都已经达到了冰点。除了少部分热门的赛道行业还处于高位外，很多行业无论是从市盈率还是从分红率而言都跌出了很大的吸引力，港股9%以上股息率的股票已经比比皆是。我相信，如果说现在市场是个中长期的底部区域可能并没有太多人会反对，大多数人只是更加担心会在底部区域呆多久。说实话，这个命我们很难算，因为毕竟与后续的政策走向直接相关，我们难以给出明确的判断。但是我们清楚的是，在一个亏时间的概率远大于亏钱概率的区域，放弃不是一个明智的选择。从历史上看，港股连跌三年的时候只有2000~2002，然后在2003年非典时期的终极一跌之后，迎来了5年的大升浪，5年涨幅达到了400%。历史不是一定会重演，但是以史为鉴，我们相信，在弹簧极力的压缩之后，只要后续政策到位，不把弹簧压折，反弹也必将是非常猛烈的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山西证券品质生活A基金份额净值为0.7788元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.44%，同期业绩比较基准收益率为-12.31%；截至报告期末山西证券品质生活C基金份额净值为0.7723元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.56%，同期业绩比较基准收益率为-12.31%。

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或者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	167,588,024.05	84.00
	其中：股票	167,588,024.05	84.00
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	31,890,242.46	15.99
8	其他资产	22,500.34	0.01
9	合计	199,500,766.85	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	82,557,292.34	41.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,730,042.00	2.38
H	住宿和餐饮业	3,816,430.00	1.92
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,106,933.22	2.06
J	金融业	3,317,890.00	1.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,995,928.00	2.01
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	7,946,054.22	3.99
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	110,470,569.78	55.49

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	14,860,377.72	7.46
金融	13,020,897.08	6.54
医疗保健	15,237,401.86	7.65
电信服务	13,998,777.61	7.03
合计	57,117,454.27	28.69

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	600519	贵州茅台	10,500	19,661,25	9.88

				0.00	
2	H03690	美团-W	96,300	14,423,357.92	7.24
3	H00700	腾讯控股	58,100	13,998,777.61	7.03
4	H00388	香港交易所	53,400	13,020,897.08	6.54
5	000858	五粮液	65,800	11,135,334.00	5.59
6	600809	山西汾酒	30,900	9,359,301.00	4.70
7	300294	博雅生物	284,400	9,100,800.00	4.57
8	H02269	药明生物	126,000	5,401,677.46	2.71
9	300760	迈瑞医疗	17,100	5,112,900.00	2.57
10	603345	安井食品	31,600	4,906,848.00	2.46

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 报告期内基金投资的前十名证券除美团（3690.HK）外的其他证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。国家市场监督管理总局于2021年10月8日对美团出具行政处罚决定书。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	4,984.20
2	应收证券清算款	17,516.14
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	22,500.34

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

	山西证券品质生活 A	山西证券品质生活 C
报告期期初基金份额总额	237,729,404.77	24,959,074.41
报告期期间基金总申购份 额	284,397.14	132,791.54
减：报告期期间基金总赎 回份额	6,430,768.59	843,280.89
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	231,583,033.32	24,248,585.06

§ 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固有资金投资本基金。

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**

本基金本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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、山西证券品质生活混合型证券投资基金基金合同；
- 3、山西证券品质生活混合型证券投资基金托管协议；
- 4、山西证券品质生活混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、山西证券品质生活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