

山西证券品质生活混合型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023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:2023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	16
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	17
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2023年10月20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2023年07月01日起至2023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	227,337,200.82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	<p>1、大类资产配置</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p>

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，

	<p>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	205,656,064.26份	21,681,136.56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(2023年07月01日 - 2023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	-1,648,242.66	-198,698.58
2.本期利润	-5,493,377.76	-559,022.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0263	-0.0244
4.期末基金资产净值	147,105,094.05	15,290,728.88
5.期末基金份额净值	0.7153	0.7053

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	-3.62%	1.11%	-3.45%	0.76%	-0.17%	0.35%
过去六个月	-14.71%	1.02%	-6.53%	0.73%	-8.18%	0.29%
过去一年	-8.15%	1.29%	0.23%	0.86%	-8.38%	0.43%
自基金合同生效起至今	-28.47%	1.20%	-23.40%	0.91%	-5.07%	0.29%

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	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
----	--------	-----------	-----------	-----------	-----	-----

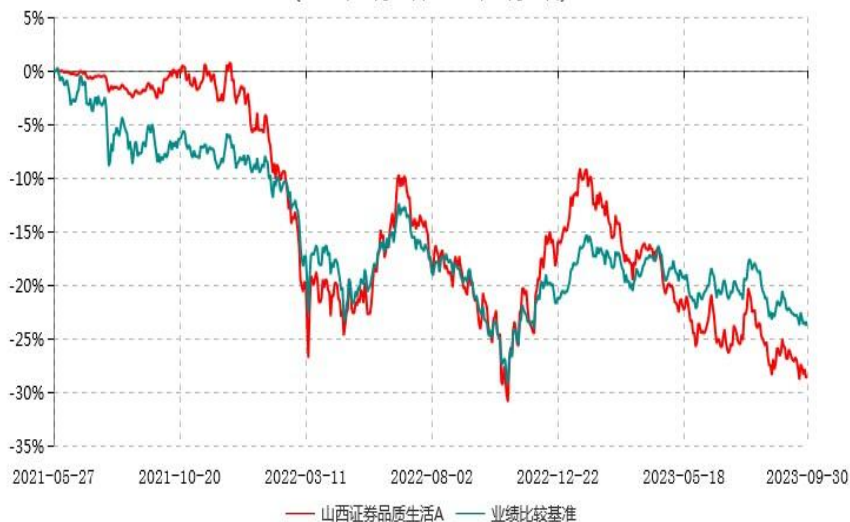
			③	标准差 ④		
过去三 个月	-3.74%	1.11%	-3.45%	0.76%	-0.29%	0.35%
过去六 个月	-14.9 5%	1.02%	-6.53%	0.73%	-8.42%	0.29%
过去一 年	-8.68%	1.29%	0.23%	0.86%	-8.91%	0.43%
自基金 合同生 效起至 今	-29.4 7%	1.20%	-23.4 0%	0.91%	-6.07%	0.29%

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-2023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	-	16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和投资经理；2014年10

				<p>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：三季度随着油价的快速反弹和对美国通胀预期的加剧，美国的长期国债收益率迅速上升，达到近些年来新高，海外资金也在此影响下出现了继续大幅流出的局面。国内虽然“政策底”态势比较明显，但是冰冻三尺非一日之寒，无论是消费者信心还是对未来的收入预期改善都需要一定的时间，因此市场指数继续下跌。三季度沪深300指数下跌3.98%，恒生指数下跌5.85%，山证品质生活净值下跌3.91%，基本跑平沪深300指数。

回头反思我们今年年初的判断，市场在去年年底的预期推动下经历过大幅反弹之后，需要一段时间来等待实体经济的修复和基本面的改善，这个我们是有所预估的。但是我们没有预估到的是，过去几年无论是国内还是国际发生的种种对于企业家和消费者的中长期预期产生了如此大的打击，放开之后我们首先迎来的是在中长期预期恶化之后的资产负债表的再平衡而非消费的迅速反弹，企业的首选也是“高筑墙、广积粮”而非迅速扩大投资。由此我们可以看到，尊重客观的规律，无论是科学规律还是经济规律是

多么重要，不符合规律的雷霆手段可能会见到短期的成效，但一定会在更长的时间期限内埋下被客观规律反噬的种子。正是：人生最不幸处，是偶一失言，而祸不及；偶一失谋，而事倖成；偶一恣行，而获小利。后乃视为故常，而恬不为意。则莫大之患，由此生矣。

站在三季度末展望未来，我们首先可以肯定的是，政策底已经出现。无论是实体经济的政策底还是股市的政策底，管理层都已经明确的通过接二连三的政策来给予支持。现在唯一不确定的是，实体经济的底部什么时候可以出现。年初在市场预期极度乐观的时候，我们认为，才出ICU，又要去蹦迪的情况只会在想象中出现，但是在现在这个时点上，我们要说的是，只要政策得当，只要给予经济本身以相对宽松的自由成长的环境，修复虽然需要时间且有斜率高低，但最终还是要回归正常的。出了ICU可能修养的时间比想象的时间长，但在用药得当逐步恢复健康的情况下，最终喜欢蹦迪的还是要去蹦迪的。2008年金融危机时，美国居民端的负债率远比我们现在要高，一度让我们觉得是灭顶之灾。但是在经过一年的修复之后，依然走上了经济重新增长之路。所以我认为，站在当下，在看到政策的各种精心呵护的情况下，看到经济指标已经重新开始步入扩张区间的情况下，对未来可以适当的乐观一些。

市场风格上看，由于今年以来投资者对于未来的持续悲观，市场一直在追求与国际关系相对较紧而与国内脱钩的公司。其中一类是周期类的公司，由于这类公司的产品是国际定价而与国内实体经济的基本面关系不大，在海外经济保持了足够韧性的情况下周期品的价格还出现了大幅度的上涨，因此受到市场的追捧；另一类是在海外人工智能革命的影响下，我们产业链上的部分出口导向型公司订单出现了比较大幅度的好转，因此也受到了追捧。而以内需为主的公司则毫无例外遭到了抛弃。这种极端的市场风格的演绎未来一旦对经济发展的预期出现了一定的变化，是难以持续下去的。相反，不论如何，我们这么大的内需存量市场放在这里，而且无论从任何一个发达国家的发展历程来看，从出口导向型向内需为主的消费型转变都是必由之路，在市场对整体经济的悲观导致板块出现下跌时我们反而认为机会越来越近了。

因此，我们未来仍将心怀猛虎，细嗅蔷薇。抱着对未来经济一定会恢复且继续发展的预期，寻找那些商业模式强大、现金流量好、资产负债表健康，能够扛得过不知道多久的严冬的企业。对我们比较有利的是，我们看中的这些企业其实在过去三年非常不利的环境下依然保持了相对稳健的增长，虽然由于市场情绪的变化并没有体现在股价上，但是站在当下来看，这些企业由于自身良好的商业模式和优秀的现金流，这些增长都会反馈到不断增加的股息收入上。展望明年，我们持有的一些消费龙头企业股息率甚至已经达到了2.5%以上，而且本身杠杆率极低没有坏账风险，这种股息率我们认为跟银行理财相比都已经具有一定的吸引力，而经济预期一旦好转市场重新将其当成成长股来看的话，潜在的收益空间是很大的。

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0.7153元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.62%，同期业绩比较基准收益率为-3.45%；截至报告期末山西证

券品质生活C基金份额净值为0.7053元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.74%，同期业绩比较基准收益率为-3.45%。

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	147,572,727.78	90.65
	其中：股票	147,572,727.78	90.65
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	14,494,340.03	8.90
8	其他资产	732,237.15	0.45
9	合计	162,799,304.96	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	75,815,581.79	46.69
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	-	-
H	住宿和餐饮业	3,000,480.00	1.85
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,939,347.20	1.19
J	金融业	2,820,720.00	1.74
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,247,815.00	2.62
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	6,473,806.08	3.99
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	94,297,750.07	58.07

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	4,771,442.74	2.94
日常消费品	3,047,105.42	1.88
金融	13,903,928.29	8.56
医疗保健	16,903,416.30	10.41
电信服务	14,649,084.96	9.02
合计	53,274,977.71	32.81

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	8,600	15,467,530.00	9.52
2	H00700	腾讯控股	52,136	14,649,084.96	9.02
3	H00388	香港交易所	51,784	13,903,928.29	8.56
4	000858	五粮液	58,700	9,163,070.00	5.64
5	300294	博雅生物	251,600	7,847,404.00	4.83
6	H03690	美团-W	45,373	4,771,442.74	2.94
7	H01801	信达生物	134,700	4,727,882.11	2.91
8	002027	分众传媒	594,100	4,247,815.00	2.62
9	600276	恒瑞医药	93,900	4,219,866.00	2.60
10	300015	爱尔眼科	220,864	3,968,926.08	2.44

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	8,733.27
2	应收证券清算款	722,154.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,349.48
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	732,237.15

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	212,139,900.36	24,047,590.01
报告期期间基金总申购份 额	304,352.38	978,500.56
减：报告期期间基金总赎 回份额	6,788,188.48	3,344,954.01
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	205,656,064.26	21,681,136.56

§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：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
2023年10月25日