

山西证券裕享增强债券型发起式证券投资基金

2023年第1季度报告

2023年03月31日

基金管理人:山西证券股份有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2023年04月21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	4
§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	10
4.3 公平交易专项说明	10
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	15
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	16
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	16
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	16
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	16
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	17
5.11 投资组合报告附注	17
§6 开放式基金份额变动	18
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	18
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	18
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	19
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	19
§9 影响投资者决策的其他重要信息	19
9.1 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	19
9.2 影响投资者决策的其他重要信息	20
§10 备查文件目录	20
10.1 备查文件目录	20
10.2 存放地点	20
10.3 查阅方式	20

§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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年4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01月01日起至2023年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	山西证券裕享增强发起式
基金主代码	015239
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年04月29日
报告期末基金份额总额	42,105,696.82份
投资目标	在严格控制风险的前提下，综合考虑基金资产的收益性、安全性、流动性，通过积极主动地投资管理，合理配置债券等固定收益类资产和权益类资产，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、债券投资策略：（1）普通债券投资策略（2）可转换债券及可交换债券投资策略（3）证券公司短期公司债券投资策略 3、股票投资策略：（1）个股投资策略（2）港股通标的股票投资策略（3）存托凭证投资策略 4、回购策略 5、资产支持证券投资策略 6、国债期货投资策略 7、信用衍生品投资策略

业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×2%	
风险收益特征	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，低于混合型基金、股票型基金。	
基金管理人	山西证券股份有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	山西证券裕享增强发起式A	山西证券裕享增强发起式C
下属分级基金的交易代码	015239	015240
报告期末下属分级基金的份额总额	24,059,223.87份	18,046,472.95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01月01日 - 2023年03月31日)	
	山西证券裕享增强发起式A	山西证券裕享增强发起式C
1.本期已实现收益	183,346.22	86,663.00
2.本期利润	455,584.92	254,051.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0189	0.0205
4.期末基金资产净值	24,387,431.46	18,224,786.18
5.期末基金份额净值	1.0136	1.0099

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

山西证券裕享增强发起式A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	--------	--------	--------	--------	-----	-----

		准差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去三 个月	1.83%	0.14%	0.64%	0.08%	1.19%	0.06%
过去六 个月	1.09%	0.17%	0.58%	0.11%	0.51%	0.06%
自基金 合同生 效起至 今	1.36%	0.13%	0.95%	0.11%	0.41%	0.02%

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%

山西证券裕享增强发起式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	1.73%	0.14%	0.64%	0.08%	1.09%	0.06%
过去六 个月	0.89%	0.17%	0.58%	0.11%	0.31%	0.06%
自基金 合同生 效起至 今	0.99%	0.13%	0.95%	0.11%	0.04%	0.02%

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%

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

山西证券裕享增强发起式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

(2022年04月29日-2023年03月31日)



山西证券裕享增强发起式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

(2022年04月29日-2023年03月31日)



- 1、本基金基金合同生效日为 2022 年 4 月 29 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，
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		

刘凌云	本基金的基金经理	2022-04-29	-	16年	<p>刘凌云女士，上海交通大学管理科学与工程专业硕士。2007年6月29日至2013年6月28日任光大证券股份有限公司固定收益总部债券交易员。2013年7月，在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理；2014年8月5日至2015年4月27日任富国富钱包货币市场基金基金经理；2014年8月5日至2015年4月27日任富国天时货币市场基金基金经理。2016年8月3日至2017年3月起担任中欧货币市场基金基金经理；2016年8月3日至2017年3月担任中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理；2016年12月至2017年3月担任中欧骏泰货币市场基金基金经理。2017年4月加入山西证券股份有限公司资管固收部担任投资主办；2018年7月转入山西证券公募基金部；2019年1月起担任山西证券超短债债券型证券投资基金基金经理；2019年6月至2022年7月担任山西证券裕睿6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2020年7月至2023年3月担任山西证券日日添利货币市场基金基金经理；2021年7月至2022年7月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</p>
-----	----------	------------	---	-----	---

				<p>资基金基金经理。2022年1月起任山西证券90天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理。2022年4月起担任山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金、山西证券裕亨增强债券型发起式证券投资基金基金经理。2022年12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、山西证券裕泽债券型发起式证券投资基金基金经理。2023年3月起担任山西证券丰盈180天滚动持有中短债债券型证券投资基金、山西证券裕鑫180天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理。刘凌云女士具备基金从业资格。</p>	
李惟愚	本基金的基金经理	2022-04-29	-	16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</p>

					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。
缪佳	本基金的基金经理	2022-05-10	-	9年	缪佳女士，新西兰梅西大学金融学硕士。2012年2月至2014年8月任上海国际货币经纪有限公司利率互换经纪。2014年8月至2016年7月任海通证券股份有限公司债券融资部债券销售交易经理。2016年7月至2017年11月，在长城证券股份有限公司任投资主办，管理定向专户。2017年11月加入山西证券股份有限公司资管固收部任投资主办，管理恒利系列集合资产管理计划和启睿系列集合资产管理计划，管理规模约50亿。2021年8月调入山西证券股份有限公司公募基金部。2021年12月起担任山西证券超短债债券型证券投资基金、山西证券裕睿6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2021年12月至2023年3月担任山西证券日日添利货币市场基金、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、山西证券裕丰

				一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022年1月起担任山西证券90天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理。2022年5月起担任山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金、山西证券裕享增强债券型发起式证券投资基金基金经理。2022年12月起担任山西证券裕泽债券型发起式证券投资基金基金经理。缪佳女士具备基金从业资格。	
严撼	本基金的基金经理	2022-08-08	-	9年	严撼先生，本科厦门大学数学专业，上海社科院经济学硕士。2014年7至2020年9月，任中银基金固定收益投资部固收研究员。2020年10月加入山西证券资管固收部任投资经理助理，2021年9月任山西证券公募基金部基金经理助理。2022年8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。2023年3月起担任山西证券裕鑫180天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理。严撼先生具备基金从业资格。

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

从已公布的数据看，一季度经济修复动能较强，但持续性仍待进一步的观察。1-2月经济增长的环比动能较强，体现了疫情消退后经济的补偿性修复，生产、社零、地产投资、地产销售环比均超过疫情前同期。但是我们认为经济补偿性修复的持续性仍待观察：第一，服务性、接触性消费明显好于其他分项。第二，农村消费环比弱于季节性而城镇消费较强。第三，失业率较去年12月上升；上述三点表明1-2月消费的复苏更多依赖消费场景的打开，居民收入和（低收入群体的）消费意愿仍偏低。第四，3月的高频数据显示，社零当月同比在低基数支撑下依然较2月回落，说明消费环比修复最快的时间已经过去。第五，1-2月土地成交面积较12月下行，3月可能进一步回落，叠加土地溢价率始终处于历史低位，说明房企信心仍有待修复，后续地产投资和新开工修复的持续性存疑。第六，3月美国零售高频数据较1-2月回落，出口对经济的拖累将会增大。因此，虽然二季度经济同比读数高增无疑，但环比大概率弱于一季度。

政府对经济的政策基调总体较为克制。两会制定的经济增速为5%，处于市场预期的下沿。我们认为经济目标偏保守的原因有：第一，相比量的增长，国家更注重经济质的提升；第二，疫情仍有二次爆发可能，海外“硬着陆”风险仍存；第三，为地产向“新发展模式”转变、经济结构转型、地方债务化解创造空间。

货币政策坚持稳健基调，预计后续流动性将继续保持合理充裕，资金利率围绕政策利率波动。3月17日，央行超预期降准，我们认为此时降准的原因有：第一，为银行补充低成本长期的资金，维持银行放贷能力；第二，提前应对海外金融风险蔓延的可能；第三，央行或有将降准改为常规流动性投放工具的想法（类似MLF），此时降准可能有

缓解跨季资金面的意图。虽然经济持续修复，但鉴于目前复苏还不稳固，失业率仍然较高，短期内央行大概率仍将保持稳健的基调。

预计二季度核心通胀上行空间有限，暂时构不成对货币政策的掣肘。在内需环比补偿性修复的1-2月，内需依然未能带动核心通胀环比超季节性，说明供给端的恢复同样良好。那么，逻辑上看，在需求环比高峰过后，二季度核心通胀上行空间不大。事实上，结合疫情达峰后强劲的线下出行和走高的失业率，我们认为当前劳动力处于供过于求的局面，这可能是居民收入和核心通胀难以上行的原因。

二季度仍需密切跟踪基本面和政策演变带来的机会和风险。第一，当前居民收入信心和消费意愿回升速度偏慢、今年的汽车消费需求被提前透支，二季度消费环比可能不高；第二，出口回落压力将逐渐增大；第三，出行和各行业生产的高频数据也显示经济正在由一季度的补偿性修复向季节性回归。第四，美国银行危机的后续发展和美联储的政策选择或对市场带来扰动。

总体上而言，虽然经济持续修复，地产明显好转，但受出口等多种因素拖累，复苏或许没有预期中强劲，同时外部风险事件导致全球风险偏好回落，货币政策短期内大概率仍将保持友好，对债市形成支撑。

23年一季度转债市场整体回暖，中证转债指数涨幅为3.53%，表现明显好于各类债券指数，但相比于股票指数转债表现相对偏弱，在主要股票指数中中证转债指数表现仅好于创业板指。一季度转债市场大致可以划分为3阶段：1月份，疫情感染高峰褪去，经济复苏的强预期推动权益市场单边上行，转债市场在正股和估值的双向作用下迎来上涨；2月至3月中旬，市场对经济预期分歧加大，后续保守的经济增长目标进一步降低了市场预期，权益市场开始震荡下跌，转债指数受此影响同步走弱；3月下旬，AIGC主题走热等因素带动市场情绪略有回暖，转债市场由跌转涨。相比于2022年底，目前转债市场价格和估值均出现了明显回升，市场整体情绪也有所回暖，未来转债市场机会可能更多来自正股推动。

本基金一季度，债券方面仍维持短久期、票息积累的投资策略，在注重流动性、安全性的基础上，精选中高等级个券，严控信用风险。转债方面，转债市场相比于2022年年底已经有了一定的涨幅，但是在国内经济逐步复苏叠加海外因素大幅改善的前提下国内权益市场有望继续回暖，因此我们依然看好今年后续的转债市场表现。在当前背景下本基金将延续前期的积极操作，在回避高估值转债的前提下优选高性价比转债个券，在收益增厚的同时，兼顾回撤的控制。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山西证券裕享增强发起式A基金份额净值为1.0136元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.83%，同期业绩比较基准收益率为0.64%；截至报告期末山西证券裕享增强发起式C基金份额净值为1.0099元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.73%，同期业绩比较基准收益率为0.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金自2023年01月01日到2023年03月31日未出现连续二十个工作日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。

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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	1,849,659.17	4.18
	其中：股票	1,849,659.17	4.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,210,680.77	88.57
	其中：债券	39,210,680.77	88.57
	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	2,142,303.08	4.84
8	其他资产	1,070,124.69	2.42
9	合计	44,272,767.71	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	1,153,341.00	2.71
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	101,688.00	0.24
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	68,013.00	0.16
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	149,136.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,472,178.00	3.45

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	7,537.28	0.02

金融	60,963.55	0.14
医疗保健	106,340.43	0.25
电信服务	202,639.91	0.48
合计	377,481.17	0.89

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	500	910,000.00	2.14
2	H00700	腾讯控股	600	202,639.91	0.48
3	300015	爱尔眼科	4,800	149,136.00	0.35
4	002327	富安娜	15,900	128,631.00	0.30
5	601398	工商银行	22,800	101,688.00	0.24
6	H01801	信达生物	2,500	76,926.65	0.18
7	600276	恒瑞医药	1,700	72,794.00	0.17
8	002027	分众传媒	9,900	68,013.00	0.16
9	H00388	香港交易所	200	60,963.55	0.14
10	300294	博雅生物	1,200	41,916.00	0.10

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	3,093,478.03	7.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	27,840,152.69	65.33
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,277,050.05	19.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,210,680.77	92.02

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	127430	16淮城资	150,000	3,102,877.97	7.28
2	149157	20欣旺01	30,000	3,078,299.01	7.22
3	175156	20恒信G2	30,000	3,070,928.22	7.21
4	185890	22网租04	30,000	3,035,842.19	7.12
5	162400 8	16宁棚改项 目债01	100,000	2,084,735.56	4.89

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，本基金投资的前十名证券的发行主体，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	11,140.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,058,984.17
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,070,124.69

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110061	川投转债	898,661.34	2.11
2	127027	靖远转债	820,094.49	1.92
3	127058	科伦转债	739,084.66	1.73
4	132018	G三峡EB1	682,856.16	1.60
5	110089	兴发转债	637,202.34	1.50

6	127017	万青转债	626,496.41	1.47
7	110088	淮22转债	521,959.79	1.22
8	127018	本钢转债	462,759.98	1.09
9	127020	中金转债	431,509.93	1.01
10	113060	浙22转债	334,766.52	0.79
11	128048	张行转债	327,357.64	0.77
12	113631	皖天转债	280,369.68	0.66
13	113057	中银转债	268,435.77	0.63
14	123107	温氏转债	128,346.58	0.30
15	113047	旗滨转债	122,901.90	0.29

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

	山西证券裕享增强 发起式A	山西证券裕享增强 发起式C
报告期期初基金份额总额	25,256,829.54	13,814,738.41
报告期期间基金总申购份 额	1,944,418.98	8,649,740.96
减：报告期期间基金总赎 回份额	3,142,024.65	4,418,006.42
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	24,059,223.87	18,046,472.95

§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

	山西证券裕	山西证券裕
--	-------	-------

	享增强发起 式A	享增强发起 式C
报告期期初管理人持有的本基金份 额	10,007,500.75	-
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	10,007,500.75	-
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例（%）	23.77	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份 额占基 金总份 额比例	发起份额总 数	发起份 额占基 金总份 额比例	发起份 额承诺 持有期 限
基金管理 人固有资 金	10,007,500. 75	23.77%	10,007,500. 75	23.77%	三年
基金管理 人高级管 理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理 等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理 人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,007,500. 75	23.77%	10,007,500. 75	23.77%	三年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20230101-20230331	10,007,500.75	-	-	10,007,500.75	23.77%
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>							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予山西证券裕享增强债券型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2、山西证券裕享增强债券型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、山西证券裕享增强债券型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、山西证券裕享增强债券型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、山西证券裕享增强债券型发起式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。

10.2 存放地点

除第7项存放于基金托管人的住所外，其余存放于基金管理人的住所。

10.3 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

2023年04月21日