

山西证券超短债债券型证券投资基金

2021年第2季度投资组合报告

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	2,382,905,062.47	930
	其中：债券	2,168,173,721.10	86.71
	资产支持证券	214,731,341.37	8.59
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	15,686,044.07	0.63
8	其他资产	101,913,830.34	4.08
9	合计	2,500,504,936.88	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	99,955,710.00	13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	499,987,111.10	265
5	企业短期融资券	760,654,500.00	39.03
6	中期票据	807,576,400.00	41.43
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,168,173,721.10	111.24

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	143644	18复地01	609,630	60,944,711.10	3.13
2	101660078	16甘公投MTN003	600,000	59,982,000.00	3.08
3	101801115	18荆门高新MTN002	500,000	50,340,000.00	2.58
4	101801156	18粤珠江MTN001	500,000	50,330,000.00	2.58
5	042100042	21淮北建投CP001	500,000	49,960,000.00	2.56

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	179758	光耀06A	300,000	30,025,800.00	1.54
2	137078	时誉01优	210,000	20,867,958.90	1.07

3	179513	天联01 优	200,000	20,000,000. 00	1.03
4	137158	荣耀09A	200,000	19,989,342. 47	1.03
5	168529	时宁01 优	200,000	19,954,600. 00	1.02
6	179381	申程02 优	200,000	19,940,600. 00	1.02
7	168842	璀璨15A	200,000	19,926,400. 00	1.02
8	165897	联融01 优	200,000	19,866,400. 00	1.02
9	179565	光耀05A	100,000	10,002,700. 00	0.51
10	169614	龙联07A	100,000	10,000,000. 00	0.51
11	168955	赤兔06 优	100,000	10,000,000. 00	0.51

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。

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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内，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。

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,343.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	69,571,864.95
5	应收申购款	32,317,621.94
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	101,913,830.34

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。

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。

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。