
山西证券超短债债券型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 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:2021 年 10 月 26 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 | 7 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 公平交易专项说明 | 9 |
| 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 | 12 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 | 12 |
| 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 13 |
| 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 | 15 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息 | 15 |
| 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 | 15 |
| 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021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2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | | | |
|-------------|---|--------|--------|
| 基金简称 | 山证超短债基金 | | |
| 基金主代码 | 006626 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2019年01月21日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 3,861,686,569.88份 | | |
| 投资目标 | 本基金在保持基金资产较高流动性的前提下，力争取得超过比较基准的稳定回报。 | | |
| 投资策略 | 本基金将在有效管理风险、保持资产较高流动性的基础上，实现超过比较基准的稳定回报。本基金的投资策略包括资产配置策略、目标久期策略及凸性策略、收益率曲线策略、信用债投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、杠杆投资策略和国债期货交易策略。 | | |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（1年以下）指数收益率 | | |
| 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 | 交通银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 山证超短债基 | 山证超短债基 | 山证超短债基 |

| | 金A | 金C | 金E |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|
| 下属分级基金的交易代码 | 006626 | 006627 | 012423 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,489,962,29 1.67份 | 2,367,268,07 9.33份 | 4,456,198.88 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(2021年07月01日 - 2021年09月30日) | | |
|-----------------|--------------------------------|------------------|--------------|
| | 山证超短债基金A | 山证超短债基金C | 山证超短债基金E |
| 1. 本期已实现收益 | 15,639,882.73 | 17,227,779.18 | 34,660.89 |
| 2. 本期利润 | 14,355,060.96 | 15,653,035.97 | 31,742.89 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0111 | 0.0101 | 0.0102 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,595,213,989.63 | 2,513,185,079.56 | 4,509,137.65 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0706 | 1.0616 | 1.0119 |

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

山证超短债基金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 | 1.09% | 0.01% | 0.68% | 0.01% | 0.41% | 0.00% |
| 过去六个月 | 2.33% | 0.01% | 1.46% | 0.01% | 0.87% | 0.00% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 月 | | | | | | |
| 过去一年 | 4.21% | 0.02% | 2.98% | 0.01% | 1.23% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.43% | 0.02% | 7.96% | 0.02% | 3.47% | 0.00% |

山证超短债基金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 | 0.99% | 0.01% | 0.68% | 0.01% | 0.31% | 0.00% |
| 过去六个月 | 2.13% | 0.01% | 1.46% | 0.01% | 0.67% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.80% | 0.02% | 2.98% | 0.01% | 0.82% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.51% | 0.02% | 7.96% | 0.02% | 2.55% | 0.00% |

山证超短债基金E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 | 1.04% | 0.01% | 0.68% | 0.01% | 0.36% | 0.00% |
| 自基金合 | 1.19% | 0.01% | 0.80% | 0.01% | 0.39% | 0.00% |

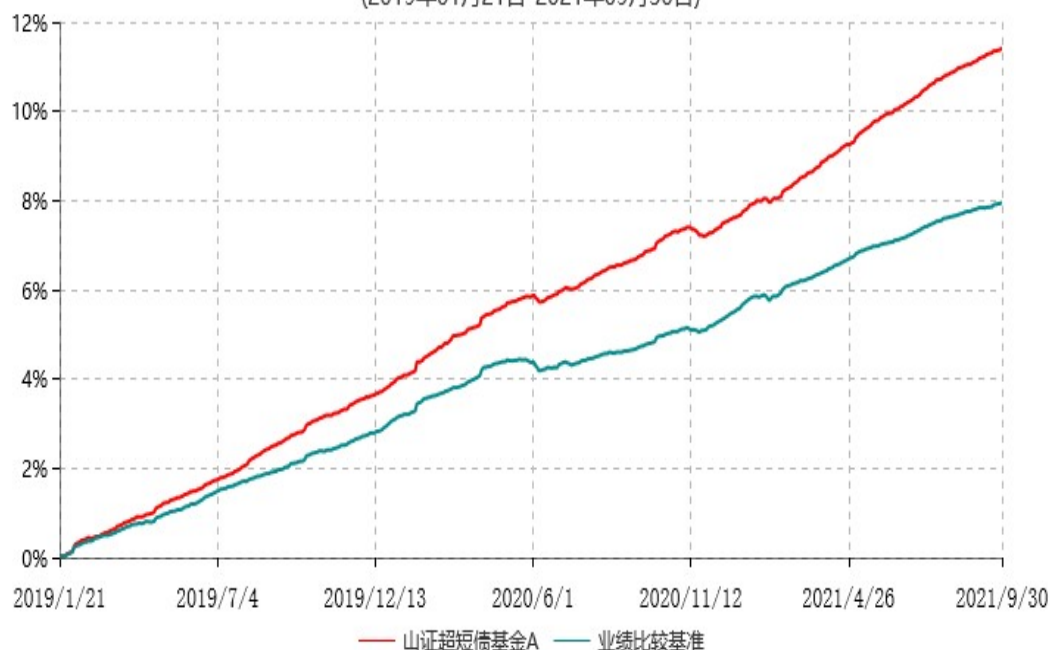
| | | | | | | |
|----------------|--|--|--|--|--|--|
| 同生 效起 至今 | | | | | | |
|----------------|--|--|--|--|--|--|

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（1 年以下）指数收益率。

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

山证超短债基金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

(2019年01月21日-2021年09月30日)

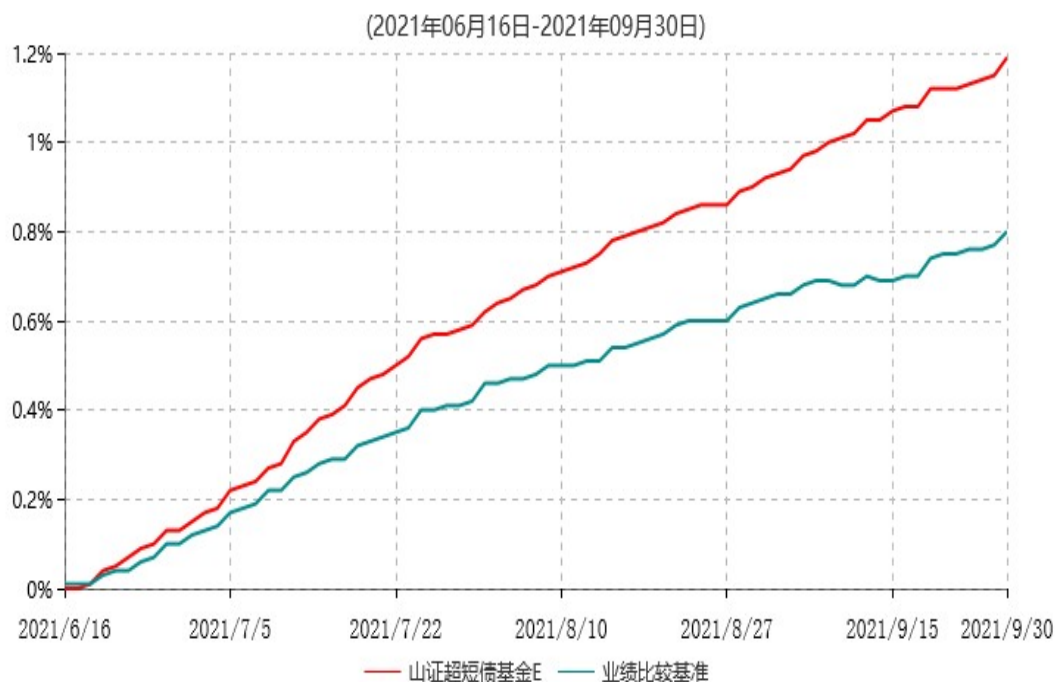


山证超短债基金C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年01月21日-2021年09月30日)



山证超短债基金E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



1、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 | 2019-01-21 | - | 14年 | 刘凌云女士，上海交通大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格。2007年6月至2013年6月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月至2015年4月任富国富钱包 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>货币市场基金基金经理；2014年8月至2015年4月任富国天时货币市场基金基金经理。2016年8月至2017年3月起担任中欧货币市场基金基金经理；2016年8月至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月至今任山西证券超短债债券型证券投资基金基金经理，2019年6月起任山西证券裕睿6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020年7月1日起至今担任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。2021年7月20日起担任山西证券裕泰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、山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。</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

中国经济内生动能放缓。三季度外生扰动较多，不断散点复发的疫情、极端天气和限电限产政策短期内都对经济造成一定影响。

工业生产：1-8月工业增加值累计同比13.1%，比2019年同期增长13.6%，两年平均增长6.6%，依然属于较高水平，但较二季度回落。由于受到极端天气扰动和限电限产的制约，工业生产环比从6月份开始连续弱于历史同期均值，且差距有扩大趋势。由于部分地区能耗强度达标压力仍大，局部地区和局部行业的限产政策可能持续到年底。

内需受疫情冲击。1-8月社零同比18.1%，比2019年1-8月份增长7.9%，两年平均增长3.90%，自6月以来连续回落，修复趋势放缓，较疫情前的8%中枢差距明显。受到散点疫情不断爆发的影响，二季度的消费在总量上弱于季节性，商品零售增速连续回落，服务业受到的冲击更加严重。

固定资产投资不及预期。1-8月份，固定资产投资增速为8.9%，两年均值4.0%，略不及市场预期和前值。地产、制造业和基建（不含电力）投资累计同比分别为10.9%、15.7%和2.9%，均较上月回落；两年平均增速分别为7.7%，3.3%和0.2%。

基建投资：尽管基建累计增速回落，但8月份当月投资增速小幅回升，不含电力口径和全口径增速升至-1.66和-0.02%。从基本面来看，建筑业PMI重返高景气区间，新订单回升且成本压力有所缓解。从资金面来看，8月政府债券发行量依然偏低，但财政支出加快。结合专项债发完和“形成实物工作量”的要求，基建改善或出现在年末至明年年初；与我们对基建节奏的判断较为一致。

房地产投资：房地产投资方面，后周期特征依然明显，竣工依然对房地产投资起到支撑作用。土地市场方面，成交清淡，土地溢价率降至个位数，土地成交面积也属极低水平。销售平稳回落，调控政策影响持续体现。今年1-8月房地产销售面积同比增5.87%，销售金额增速11.70%，两者之差持续收窄；资金来源方面，今年2月以来，定金及预收款项增速开始超过按揭贷款增速，居民部门中长期贷款同比也逐步降低。

制造业投资：制造业增速由负转正后，修复逐步加快。从已公布的数据看，行业分化明显：中游原材料行业增速回落，包括有色、化工相关行业，而中下游行业增速均上行。对于制造业，总体依然保持乐观。积极因素包括企业盈利的持续修复，产能利用率已达历史新高，且有政策呵护，但也应看到，企业中长期贷款增长持续放缓，外部环境仍有不确定性。

进出口：8月份进出口数据双双超预期和季节性。出口超预期主要源自疫情反复带来的防疫物资需求增长和对东盟的生产替代效应，海外耐用品需求将持续支撑我国出口。进口高增体现了经济韧性和价格的合力，短期价格因素仍将支撑进口，而基于“跨周期调节”的思路，内生动能和进口回落速度或较为平缓。

货币及财政政策：三季度货币政策呈现稳健略宽松局面，央行进行了全面降准。从7月30日的政治局会议可以看出，政府体现出了对于经济下行的担忧，强调了政策的跨周期调节问题。货币政策更侧重结构性的中小企业，而对运动式“减碳”的纠正或缓解工业品通胀的压力。财政政策强调形成实物工作量，相应财政支出或加快，而根据媒体报道，部分专项债12月发行，并在2022年使用。

四季度经济或面临一定挑战，但政策或予以一定对冲，而疫情反复或成为常态，同时四季度美联储缩减购债临近，中美货币政策分化。四季度财政政策或温和发力，但形成实物工作量或在明年年初；而在地产持续调控下，宽信用到来仍需时间；四季度流动性或有MLF到期、双11备付金以及跨年等扰动，央行或再度采用数量型供给进行对冲。

本基金三季度保持短久期、票息积累的投资策略，维持合意的资产收益及杠杆水平；在注重流动性、安全性基础上，精选个券，严控信用风险，同时通过杠杆套利增厚账户收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山证超短债基金A基金份额净值为1.0706元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.09%，同期业绩比较基准收益率为0.68%；截至报告期末山证超短债基金C基金份额净值为1.0616元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.99%，同期业绩比较基准收益率为0.68%；截至报告期末山证超短债基金E基金份额净值为1.0119元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.04%，同期业绩比较基准收益率为0.68%。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,839,340,575.70 | 96.90 |
| | 其中：债券 | 4,702,351,376.80 | 94.16 |
| | 资产支持证券 | 136,989,198.90 | 2.74 |
| 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 | 16,874,746.92 | 0.34 |
| 8 | 其他资产 | 137,779,998.97 | 2.76 |
| 9 | 合计 | 4,993,995,321.59 | 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

本基金本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

本基金本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 | 211,763,360.00 | 5.15 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 7,056,700.00 | 0.17 |
| | 其中：政策性金融债 | 7,056,700.00 | 0.17 |
| 4 | 企业债券 | 771,796,366.80 | 18.77 |
| 5 | 企业短期融资券 | 2,422,457,950.00 | 58.90 |
| 6 | 中期票据 | 1,289,277,000.00 | 31.35 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,702,351,376.80 | 114.33 |

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 | 019628 | 20国债02 | 1,000,000 | 99,970,000.00 | 2.43 |
| 2 | 012102365 | 21晋路桥SCP002 | 1,000,000 | 99,940,000.00 | 2.43 |
| 3 | 042100215 | 21国宏投资CP001 | 900,000 | 90,360,000.00 | 2.20 |
| 4 | 175197 | 20国都G1 | 870,000 | 87,000,000.00 | 2.12 |
| 5 | 012103541 | 21如皋经贸SCP004 | 800,000 | 80,336,000.00 | 1.95 |

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

| 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 | 0.73 |

| | | | | | |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|
| 2 | 137078 | 时誉01优 | 210,000 | 20,867,958.90 | 0.51 |
| 3 | 179513 | 天联01优 | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.49 |
| 4 | 168529 | 时宁01优 | 200,000 | 19,954,600.00 | 0.49 |
| 5 | 179381 | 申程02优 | 200,000 | 19,940,600.00 | 0.48 |
| 6 | 179565 | 光耀05A | 100,000 | 10,002,700.00 | 0.24 |
| 7 | 169614 | 龙联07A | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.24 |
| 8 | 168808 | 时宁02优 | 60,000 | 5,937,540.00 | 0.14 |
| 9 | 138143 | 狮桥JX1B | 100,000 | 260,000.00 | 0.01 |

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
本基金本报告期末未持有股指期货。

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 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。

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 | 50,157.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | 11,780,179.15 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 125,949,662.27 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 137,779,998.97 |

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

| | 山证超短债基金A | 山证超短债基金C | 山证超短债基金E |
|---------------------------|------------------|------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 868,194,959.84 | 978,342,993.36 | 1,101,347.79 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,288,298,779.76 | 2,609,308,969.52 | 6,660,881.55 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 666,531,447.93 | 1,220,383,883.55 | 3,306,030.46 |
| 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 | 1,489,962,291.67 | 2,367,268,079.33 | 4,456,198.88 |

§ 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自有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

§ 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、山西证券超短债债券型证券投资基金基金合同；
- 3、山西证券超短债债券型证券投资基金托管协议；
- 4、山西证券超短债债券型证券投资基金招募说明书；
- 5、山西证券超短债债券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

2021年10月26日