
山西证券日日添利货币市场基金

2019年第3季度报告

2019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:2019年10月25日

§ 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2019年10月18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2019年07月01日起至2019年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	山证日日添利货币		
基金主代码	001175		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年05月14日		
报告期末基金份额总额	3,018,394,691.57份		
投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。		
业绩比较基准	人民币活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。		
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	山证日日添利货币A	山证日日添利货币B	山证日日添利货币C

下属分级基金的交易代码	001175	001176	001177
报告期末下属分级基金的份额总额	15,374,614.79 份	332,593,865.9 5份	2,670,426,21 0.83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(2019年07月01日 - 2019年09月30日)		
	山证日日添利货币 A	山证日日添利货币 B	山证日日添利货币 C
1. 本期已实现收益	88,705.22	3,942,575.46	7,290,324.56
2. 本期利润	88,705.22	3,942,575.46	7,290,324.56
3. 期末基金资产净值	15,374,614.79	332,593,865.95	2,670,426,210.83

注：1、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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配为“每日分配、按日支付”。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

山证日日添利货币A净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6253%	0.0002%	0.0895%	0.0000%	0.5358%	0.0002%

山证日日添利货币B净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6886%	0.0002%	0.0895%	0.0000%	0.5991%	0.0002%

山证日日添利货币C净值表现

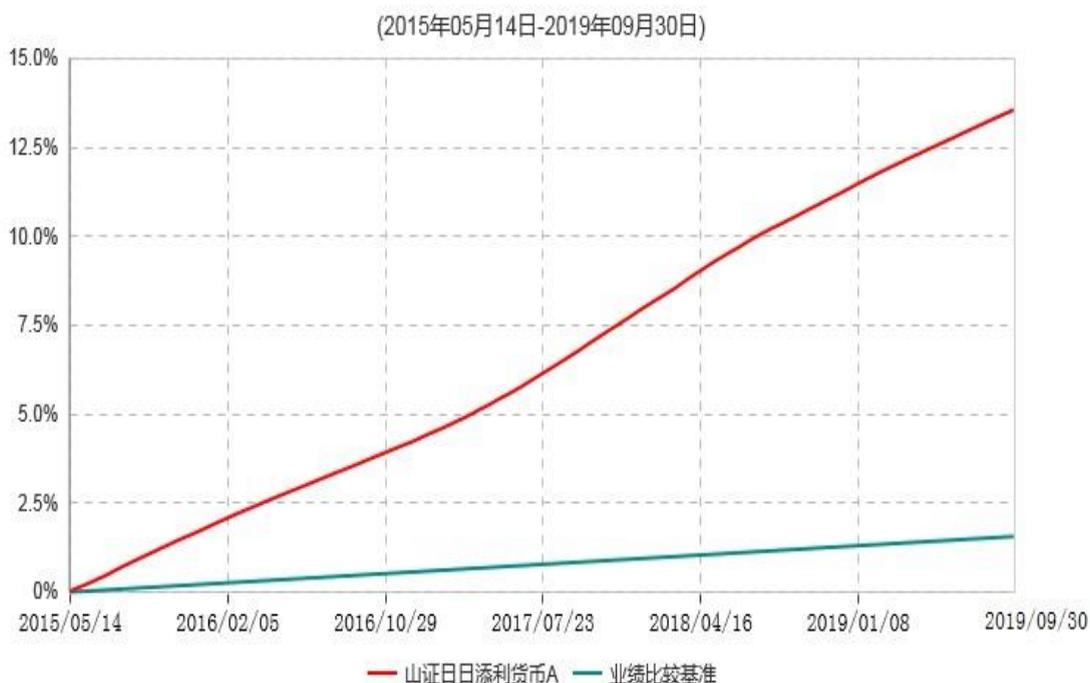
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.2449%	0.0002%	0.0895%	0.0000%	0.1554%	0.0002%

注：1、本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）；

2、本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

山证日日添利货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



山证日日添利货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



山证日日添利货币C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为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	证	说明
----	----	--------	---	----

		金经理期限		券 从 业 年 限	
		任职 日期	离任 日期		
华志 贵	本基金的基金经理	2015- 05-14	-	14 年	华志贵先生，复旦大学经济学硕士。2004年5月至2008年8月，在东方证券股份有限公司固定收益业务总部任高级投资经理；2008年9月至2009年8月，在中欧基金管理有限公司，从事研究、投资工作；2009年9月，加入华宝兴业基金管理有限公司，2010年6月至2011年9月担任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理；2010年6月至2013年4月担任华宝兴业增强收益债券型投资基金基金经理；2011年4月至2014年5月担任华宝兴业可转债基金基金经理。2014年10月加盟本公司公募基金部，2015年5月14日至今任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。2016年5月4日至2018年7月21日任山西证券保本混合型证券投资基金基金经理。2016年8月24日至今任山西证券裕利债券型证券投资基金（自2018年8月25日起，转型为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。2019年1月21日至今任山西证

					券超短债债券型证券投资基金基金经理。2019年5月30日至今任山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
刘相鹏	本基金的基金经理	2018-05-03	-	7年	刘相鹏先生，上海财经大学金融硕士。2012年1月至2013年9月任上海易序资产管理有限公司债券交易员；2013年10月至2015年2月任江苏大丰农商行债券交易员；2015年4月加入山西证券公募基金部，从事债券交易工作，2018年5月3日至今任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。2019年5月30日至今任山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

注：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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

本季度，基金对投资标的的信用级别提高到最严格的等级，包括质押券，严格保护投资者利益。在资产配置上，存单、存款、逆回购保持均衡比例，组合管理进一步优化流动性。在策略上，以平衡为上、守正，并在市场波动的两端动态调节。基金业绩稳定，流动性好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山证日日添利货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.6253%，同期业绩比较基准收益率为0.0895%；截至报告期末山证日日添利货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.6886%，同期业绩比较基准收益率为0.0895%；截至报告期末山证日日添利货币C基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.2449%，同期业绩比较基准收益率为0.0895%。

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	固定收益投资	2,656,443,620.69	87.84
	其中：债券	2,636,422,140.80	87.18
	资产支持证券	20,021,479.89	0.66
2	买入返售金融资产	143,458,855.19	4.74
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	204,889,962.65	6.78
4	其他资产	19,259,927.56	0.64
5	合计	3,024,052,366.09	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	1.36
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	83

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	17.83	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	16.53	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	22.78	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	3.30	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	39.11	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.55	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,200,087.53	2.66
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	700,126,884.21	23.20
6	中期票据	30,025,475.54	0.99
7	同业存单	1,826,069,693.52	60.50
8	其他	-	-
9	合计	2,636,422,140.80	87.35

10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
----	--------------------	---	---

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	111996858	19长沙银行CD074	1,000,000	99,679,193.87	3.30
2	111993280	19哈尔滨银行CD016	1,000,000	99,396,591.18	3.29
3	111993794	19重庆农村商行CD034	1,000,000	99,329,042.83	3.29
4	111994285	19厦门国际银行CD035	1,000,000	99,279,007.27	3.29
5	111915252	19民生银行CD252	1,000,000	98,568,387.79	3.27
6	111980837	19中原银行CD181	1,000,000	98,522,663.12	3.26
7	111914061	19江苏银行CD061	1,000,000	98,454,305.76	3.26
8	011900682	19融和融资SCP004	800,000	79,972,777.79	2.65
9	041800454	18大同煤矿CP007	600,000	60,127,944.37	1.99
10	1422011	14中电财务02	500,000	50,042,208.34	1.66

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0500%
报告期内偏离度的最低值	0.0042%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0221%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	139355	万科32A1	200,000	20,021,479.89	0.66

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	18,005,898.56
4	应收申购款	1,254,029.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	19,259,927.56

5.9.4 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

	山证日日添利货币A	山证日日添利货币B	山证日日添利货币C
报告期期初基金份额总额	10,113,171.79	456,346,743.38	2,971,481,464.92
报告期期间基金总申购份额	45,058,504.37	563,485,084.57	13,891,664,443.19

报告期期间基金总赎回份额	39,797,061.37	687,237,962.00	14,192,719,697.28
报告期期末基金份额总额	15,374,614.79	332,593,865.95	2,670,426,210.83

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利发放	2019-07-01	62,718.18	62,718.18	0
2	红利发放	2019-07-02	21,963.62	21,963.62	0
3	红利发放	2019-07-03	21,003.27	21,003.27	0
4	红利发放	2019-07-04	21,110.66	21,110.66	0
5	红利发放	2019-07-05	21,386.93	21,386.93	0
6	红利发放	2019-07-08	61,794.63	61,794.63	0
7	红利发放	2019-07-09	20,471.87	20,471.87	0
8	红利发放	2019-07-10	20,526.46	20,526.46	0
9	红利发放	2019-07-11	20,786.37	20,786.37	0
10	红利发放	2019-07-12	20,653.67	20,653.67	0
11	红利发放	2019-07-15	61,330.21	61,330.21	0
12	红利发放	2019-07-16	20,581.63	20,581.63	0
13	红利发放	2019-07-17	19,803.17	19,803.17	0
14	红利发放	2019-07-18	20,510.00	20,510.00	0
15	红利发放	2019-07-19	20,526.39	20,526.39	0
16	红利发放	2019-07-22	61,812.67	61,812.67	0
17	红利发放	2019-07-23	20,643.81	20,643.81	0
18	红利发放	2019-07-24	20,443.70	20,443.70	0
19	红利发放	2019-07-25	20,475.52	20,475.52	0
20	红利发放	2019-07-26	20,591.11	20,591.11	0
21	红利发放	2019-07-29	61,005.46	61,005.46	0
22	红利发放	2019-07-30	20,526.51	20,526.51	0
23	红利发放	2019-07-31	20,499.91	20,499.91	0
24	红利发放	2019-08-01	20,570.61	20,570.61	0
25	红利发放	2019-08-02	20,488.70	20,488.70	0
26	红利发放	2019-08-05	62,893.66	62,893.66	0
27	红利发放	2019-08-06	20,566.56	20,566.56	0

28	红利发放	2019-08-07	20,176.94	20,176.94	0
29	红利发放	2019-08-08	22,104.38	22,104.38	0
30	红利发放	2019-08-09	20,362.17	20,362.17	0
31	红利发放	2019-08-12	61,077.94	61,077.94	0
32	红利发放	2019-08-13	20,471.94	20,471.94	0
33	红利发放	2019-08-14	20,522.24	20,522.24	0
34	红利发放	2019-08-15	20,587.66	20,587.66	0
35	红利发放	2019-08-16	20,540.61	20,540.61	0
36	红利发放	2019-08-19	61,255.97	61,255.97	0
37	红利发放	2019-08-20	20,401.50	20,401.50	0
38	红利发放	2019-08-21	20,368.22	20,368.22	0
39	红利发放	2019-08-22	20,185.99	20,185.99	0
40	红利发放	2019-08-23	20,294.80	20,294.80	0
41	红利发放	2019-08-26	60,638.91	60,638.91	0
42	红利发放	2019-08-27	20,101.53	20,101.53	0
43	红利发放	2019-08-28	20,203.79	20,203.79	0
44	红利发放	2019-08-29	20,162.77	20,162.77	0
45	红利发放	2019-08-30	19,893.85	19,893.85	0
46	红利发放	2019-09-02	60,797.31	60,797.31	0
47	红利发放	2019-09-03	20,241.38	20,241.38	0
48	红利发放	2019-09-04	20,201.80	20,201.80	0
49	红利发放	2019-09-05	19,994.64	19,994.64	0
50	红利发放	2019-09-06	19,585.80	19,585.80	0
51	红利发放	2019-09-09	63,210.59	63,210.59	0
52	红利发放	2019-09-10	19,957.19	19,957.19	0
53	红利发放	2019-09-11	19,954.60	19,954.60	0
54	红利发放	2019-09-12	19,429.13	19,429.13	0
55	红利发放	2019-09-16	79,575.90	79,575.90	0
56	红利发放	2019-09-17	19,728.51	19,728.51	0
57	红利发放	2019-09-18	19,666.73	19,666.73	0
58	红利发放	2019-09-19	19,852.79	19,852.79	0
59	红利发放	2019-09-20	20,022.51	20,022.51	0
60	红利发放	2019-09-23	60,175.53	60,175.53	0

61	红利发放	2019-09-24	20,091.97	20,091.97	0
62	红利发放	2019-09-25	20,085.39	20,085.39	0
63	红利发放	2019-09-26	19,807.64	19,807.64	0
64	红利发放	2019-09-27	19,797.28	19,797.28	0
65	红利发放	2019-09-30	63,562.67	63,562.67	0
合计			1,920,775.85	1,920,775.85	

§ 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、山西证券日日添利货币市场基金基金合同；
- 3、山西证券日日添利货币市场基金托管协议；
- 4、山西证券日日添利货币市场基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内本基金披露的各项公告；
- 8、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

2019年10月25日