

山西证券日日添利货币市场基金

2024年第3季度报告

2024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:2024年10月24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	5
3.1 主要财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	8
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	8
4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明	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	10
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	12
§5 投资组合报告	12
5.1 报告期末基金资产组合情况	12
5.2 报告期债券回购融资情况	12
5.3 基金投资组合平均剩余期限	13
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	14
5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	14
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	14
5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	15
5.8 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资产支持证券投资明细	15
5.9 投资组合报告附注	15
§6 开放式基金份额变动	15
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	16
§8 影响投资者决策的其他重要信息	18
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	18
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	18
§9 备查文件目录	18
9.1 备查文件目录	18
9.2 存放地点	18
9.3 查阅方式	19

§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2024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2024年07月01日起至2024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	3,903,800,943.38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	<p>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。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金根据宏观经济运行状况、财政与货币政策形势、信用状况、市场结构变化和短期资金供给等因素的综合判断，结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征，决定各类资产的配置比例和期限匹配量，并适时进行动态调整。</p> <p>2、个券选择策略</p> <p>本基金将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值，发掘</p>

出具备相对价值的个券。

3、银行存款投资策略

本基金根据不同银行的银行存款收益率情况，结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析，以及对整个利率市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。

4、久期策略

本基金根据对未来短期利率走势的研判，结合货币市场基金资产的高流动性要求及其相关的投资比例规定，动态调整组合的久期。当预期市场短期利率上升时，本基金将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期，以降低组合跌价风险；当预期市场短期利率下降时，则通过增持剩余期限较长的债券等方式提高组合久期，以分享债券价格上升的收益。

5、回购策略

根据回购市场利率走势变化情况，在回购利率较低时，本基金在严格遵守相关法律法规的前提下，利用正回购操作循环融入资金进行债券投资，提高基金收益水平。另一方面，本基金将把握资金供求的瞬时效应，积极捕捉收益率峰值的短线机会。如新股发行期间、年末资金回笼时期的季节效应等短期资金供求失衡，导致回购利率突增等。此时，本基金可通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。

6、套利策略

不同交易市场或不同交易品种受参与群体、交易模式、环境冲击、流动性等因素影响而出现定价差异，从而产生套利机会。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上，适度进行跨市场或跨品种套利操作，提高资产收益率。如跨银行间和交易所的跨市场套利，期限收益结构偏移中的不同期限品种的互换操作（跨期限套利）。

7、现金流管理策略

本基金作为现金管理工具，具有较高的流动性要求，本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎

	回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。		
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	17,615,022.58份	526,143,343.04份	3,360,042,577.76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(2024年07月01日 - 2024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	65,528.55	3,408,589.02	2,495,213.23
2.本期利润	65,528.55	3,408,589.02	2,495,213.23
3.期末基金资产净值	17,615,022.58	526,143,343.04	3,360,042,577.76

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 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	净值收益	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	0.3492%	0.0001%	0.0895%	0.0000%	0.2597%	0.0001%
过去六个月	0.7433%	0.0003%	0.1781%	0.0000%	0.5652%	0.0003%
过去一年	1.6729%	0.0006%	0.3565%	0.0000%	1.3164%	0.0006%
过去三年	5.5108%	0.0007%	1.0712%	0.0000%	4.4396%	0.0007%
过去五年	10.3572%	0.0010%	1.7921%	0.0000%	8.5651%	0.0010%
自基金合同 生效起至今	25.3687%	0.0017%	3.3889%	0.0000%	21.9798%	0.0017%

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	0.4124%	0.0001%	0.0895%	0.0000%	0.3229%	0.0001%
过去六个月	0.8694%	0.0003%	0.1781%	0.0000%	0.6913%	0.0003%
过去一年	1.9277%	0.0006%	0.3565%	0.0000%	1.5712%	0.0006%
过去三年	6.3053%	0.0007%	1.0712%	0.0000%	5.2341%	0.0007%
过去五年	11.7467%	0.0010%	1.7921%	0.0000%	9.9546%	0.0010%
自基金合同 生效起至今	28.1246%	0.0018%	3.3889%	0.0000%	24.7357%	0.0018%

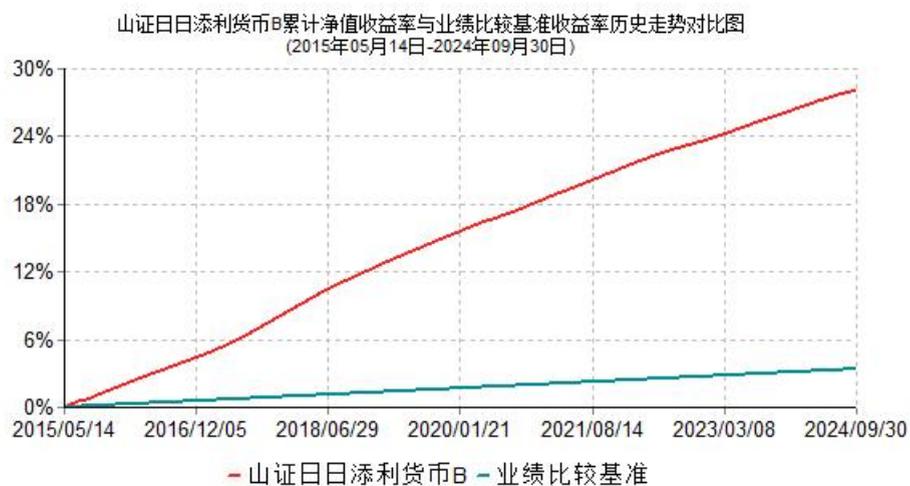
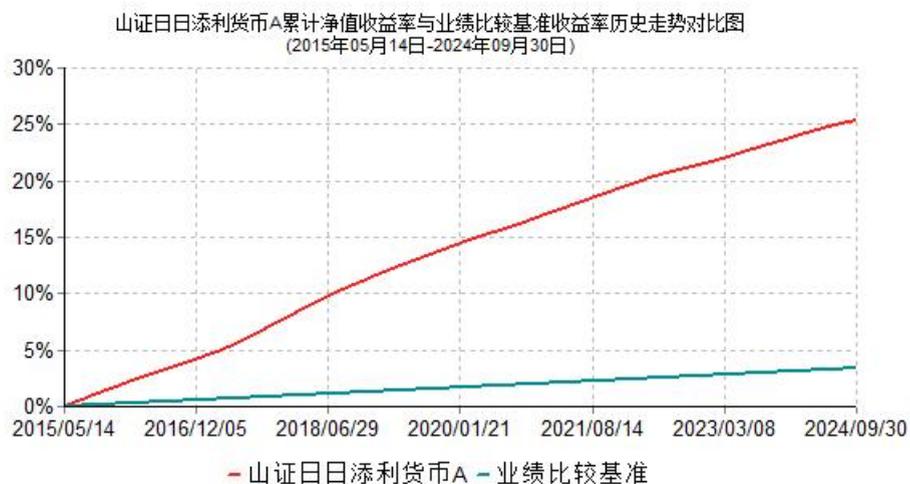
山证日日添利货币C净值表现

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	0.0787%	0.0002%	0.0895%	0.0000%	-0.0108%	0.0002%
过去六个月	0.1939%	0.0003%	0.1781%	0.0000%	0.0158%	0.0003%
过去一年	0.5306%	0.0005%	0.3565%	0.0000%	0.1741%	0.0005%
过去三年	1.9260%	0.0005%	1.0712%	0.0000%	0.8548%	0.0005%
过去五年	3.6482%	0.0006%	1.7921%	0.0000%	1.8561%	0.0006%
自基金合同	10.2214%	0.0014%	3.3839%	0.0000%	6.8375%	0.0014%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

- 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





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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蓝焯	本基金的基金经理	2023-03-14	-	11年	蓝焯女士，厦门大学金融学硕士。2013年7月至2017年2月在光大证券股份有限公司担任债券交易员。2017年3月至2020年3月在太平基金管理有限公司担任债券投资经理助理。2020年3月至2020年9月在太平基金管理有限公司担任产品经理。2020年9月加入山西证券股份有限公司公募基金部担任基金经理助理。2022年8月起担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基金基金经理。2022年9月起任山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金基金经理。2023年2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基金经理。2023年3月起担任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。蓝焯女士具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

- 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

三季度，随着海外主要经济体通胀数据的持续回落，叠加美国经济韧性仍存和部分新兴经济体展现出良好增长势头，全球经济“硬着陆”风险降低，但是长期来看仍面临挑战。

美联储政策在三季度出现明显变化，虽然在7月保持按兵不动，但是会议纪要显示部分官员在7月会议上支持降息，并且后续披露的劳动力数据未纳入考量。9月，美联储虽然超市场预期降息50BP，但是对于降息幅度仍存在一定分歧，主要原因为仍有部分官员坚持认为通胀风险依然较高，需要保持政策利率处于限制性水平，而其余大部分官员均表达了对劳动力市场转弱的担忧。需要注意的是，在当前美国大选进程不断推进之际，政治压力对美联储决策的影响开始凸显。美联储9月降息之后，包括拜登、耶伦和特朗普在内的主要政治角色均在各自立场上表达了观点，在11月大选前，美联储货币政策决策面临的压力或将进一步提升。

国内方面，7月下旬在海外主要经济体货币政策变化及预期影响下，人民币对美元汇率迅速升值，期间结汇盘增多短期内加快了升值速度。9月，央行、国家金融监管总局和证监会举办联合新闻发布会，提出一揽子金融增量措施；26日，政治局会议超预期对经济工作做出指示，国内外对于政策刺激下经济升温的预期大幅回升，中国资产的吸引力也促使部分海外资金回流国内，综合促使人民币汇率出现一波明显上涨。四季度，美联储年内预计至少仍有一次25bp的降息操作，国内各大会议陆续召开，叠加设备依旧更新和消费刺激政策效果逐步显现，可能阶段性提振人民币汇率。

三季度，基本面总体上延续了第二季度的疲软状态。出口方面，全球制造业景气度连续下行，外需回落，但是我国出口份额仍有较强韧性，可能是获益于国内产业链齐全、“朋友圈”扩大以及转口贸易等可持续的积极因素。消费方面，社零同比仍在低位震荡，财产缩水与工资下降仍是近期消费持续疲软的主要原因，70城新建和二手住宅销售价格同比降幅扩大，城镇失业率也持续走高，也验证了居民财产性收入的缩水和工资收入的下降。地产方面，5月地产新政以来销售逐步回升，8月商品房销售面积当月同比升至年内新高，但是房价环比依然没有显著的回升，仍处于以价换量的阶段。当前商品房广义库存去化时间仍在拉长，销售端的短暂回升未能明显缩短库存量的去化时间，因此房价可能仍有下跌的空间。基建方面，二季度以来基建不含电力口径当月同比持续下行至8月的1.2%，创22年以来新低，而全口径增速冲高回落、相对韧性（8月录得6.2%），7

月二者增速差录得15年5月以来新高，8月虽有所回落但依然处于高位。二者严重分化说明电力投资是基建的重要支撑，而电力投资更多由中央主导，即二者分化源于中央与地方财力的分化。地方财力的低景气源于土地财政的大幅收缩，化债背景下城投融资受限以及今年1-4月专项债发行速度较慢的影响。制造业方面，今年以来制造业投资与出口同步，虽然3季度制造业投资增速有所回落，但在设备更新政策的支撑下，设备更新改造对制造业投资的提振将持续显现。

通胀方面，3月以来CPI震荡回升，8月录得0.6%为年内次高，食品分项触底快速回升是主要贡献。23年以来能繁母猪持续去化，本轮猪价上升周期从今年4月开始；另外，高温、强降雨、台风等天气因素使得鲜菜和鲜果价格波动较大，8月二者都大幅涨价。5月以来，能源和核心CPI以回落为主。由于外需走弱，国际油价带动交通工具燃料持续下滑；收入信心不足的情况下，核心CPI连续下降至21年二季度以来新低，无论是房租还是此前韧性的旅游分项都连续下降，表明内需不足的范围正在扩大。今年前8个月，PPI环比仅在5月录得正增长，8-9月环比跌幅明显扩大，5月的环比正增长是国内政策预期发酵导致黑色系价格上行，国外经济韧性、全球制造业景气度扩张导致原油、铜价上升。但进入三季度上述逻辑出现转变：“517”新政投入的资金规模有限，外加地产供需两端无明显好转，黑色系绝对价格从5月下旬开始由涨转跌；

三季度，7月份的二十届三中全会主要是为未来五年改革锚定了方向，7月降息后也未有大规模刺激政策的出台。9月下旬中央政治局会议的定调以及一系列金融增量政策，彻底扭转了市场对于基本面的预期，9月24日货币政策大幅发力，年内再次发力的概率不高，甚至一定程度上透支了明年年初的政策空间。随着存款准备金率的下调，我国货币政策操作框架转型预计将加快，央行买卖国债或将逐步放量并替换MLF基础货币投放的作用。在地方财政压力加大、国债发行进度偏慢的情况下，财政政策仍可期待，但是需要结合相关政策出台需要的必备流程以及实际所需资金量与国际观瞻进行综合权衡。

三季度央行的监管手段不再局限于口头“喊话”，而是通过直接或间接（指导大行）参与二级市场买卖以及行政措施控制长端利率下行速度。上述行为确实导致债市阶段性调整，其中8月的调整引发一定程度上的赎回负反馈，对信用债的影响更大，然而在经济下行压力增大、货币宽松预期增强、稳增长政策迟迟不兑现的情况下，利率下行幅度明显大于二季度。9月中旬利率下破2.1%并于中秋前逼近2.0%，924政策力度较大，利率明显上行。当前信用债性价比有所提高，在资产荒的大背景下，信用利差再度明显走阔的概率不大。并且9月R-DR经历了冲高回落的过程，后续资金分层现象预计有所缓和。

总体来看，四季度债券市场预计以低位较大幅度震荡为主，财政政策具体的实施力度，美国大选和降息进程的扰动，以及年末的中央经济工作会议均可能对债券市场产生较大波动。

本基金报告期内合理把握配置节奏，在注重安全性和流动性的基础上，合理安排同业存款、同业存单、逆回购、高等级债券等资产的配置比例，积极优化配置结构，控制账户久期及各项风控指标，努力实现低风险基础上的较好回报。

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1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.3492%，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1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.4124%，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1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.0787%，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	2,324,420,004.91	59.47
	其中：债券	2,324,420,004.91	59.47
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	908,328,058.04	23.24
	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	675,913,785.74	17.29
4	其他资产	-	-
5	合计	3,908,661,848.69	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	-	0.57
	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	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	96
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

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	26.94	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	6.67	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	24.80	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	9.50	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	31.70	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.60	-

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

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	184,359,844.06	4.72
	其中：政策性金融债	184,359,844.06	4.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	584,959,543.36	14.98
6	中期票据	432,179,578.65	11.07
7	同业存单	1,122,921,038.84	28.76
8	其他	-	-
9	合计	2,324,420,004.91	59.54
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	112480814	24宁波银行CD068	1,000,000	99,588,272.65	2.55
2	112413089	24浙商银行CD089	1,000,000	99,583,005.12	2.55
3	112499569	24郑州银行CD132	1,000,000	99,185,471.97	2.54
4	112419326	24恒丰银行CD326	1,000,000	99,125,145.35	2.54
5	112486216	24江西银行CD124	1,000,000	99,119,772.35	2.54
6	112481204	24珠海华润银行CD057	1,000,000	99,072,533.91	2.54
7	112481638	24四川银行CD101	1,000,000	99,040,158.23	2.54

8	180401	18农发01	600,000	62,691,139.16	1.61
9	200305	20进出05	600,000	61,339,545.39	1.57
10	220217	22国开17	600,000	60,329,159.51	1.55

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	0.0351%
报告期内偏离度的最低值	-0.0158%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0163%

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 报告期末按摊余成本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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

5.9.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	20,613,235.71	608,848,738.22	3,115,026,721.60
报告期期间基金总申购份额	31,112,876.26	2,862,338,709.72	15,040,765,798.21
报告期期间基金总赎回份额	34,111,089.39	2,945,044,104.90	14,795,749,942.05
报告期期末基金份额总额	17,615,022.58	526,143,343.04	3,360,042,577.76

§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	2024-07-01	63,710.60	63,710.60	0
2	红利发放	2024-07-02	21,809.55	21,809.55	0
3	红利发放	2024-07-03	21,126.52	21,126.52	0
4	红利发放	2024-07-04	21,580.02	21,580.02	0
5	红利发放	2024-07-05	21,162.14	21,162.14	0
6	红利发放	2024-07-08	62,308.41	62,308.41	0
7	红利发放	2024-07-09	21,300.04	21,300.04	0
8	红利发放	2024-07-10	21,046.26	21,046.26	0
9	红利发放	2024-07-11	20,895.74	20,895.74	0
10	红利发放	2024-07-12	20,766.75	20,766.75	0
11	红利发放	2024-07-15	59,513.46	59,513.46	0
12	红利发放	2024-07-16	20,727.63	20,727.63	0
13	红利发放	2024-07-17	20,732.89	20,732.89	0
14	红利发放	2024-07-18	20,743.96	20,743.96	0
15	红利发放	2024-07-19	20,749.54	20,749.54	0
16	红利发放	2024-07-22	60,498.53	60,498.53	0
17	红利发放	2024-07-23	20,593.96	20,593.96	0
18	红利发放	2024-07-24	20,543.92	20,543.92	0
19	红利发放	2024-07-25	20,397.90	20,397.90	0
20	红利发放	2024-07-26	20,254.39	20,254.39	0
21	红利发放	2024-07-29	60,324.35	60,324.35	0

22	红利发放	2024-07-30	20,707.95	20,707.95	0
23	红利发放	2024-07-31	20,747.00	20,747.00	0
24	红利发放	2024-08-01	20,581.52	20,581.52	0
25	红利发放	2024-08-02	20,951.46	20,951.46	0
26	红利发放	2024-08-05	59,297.22	59,297.22	0
27	红利发放	2024-08-06	20,685.07	20,685.07	0
28	红利发放	2024-08-07	20,546.38	20,546.38	0
29	红利发放	2024-08-08	20,524.55	20,524.55	0
30	红利发放	2024-08-09	20,424.83	20,424.83	0
31	红利发放	2024-08-12	57,004.87	57,004.87	0
32	红利发放	2024-08-13	20,713.62	20,713.62	0
33	红利发放	2024-08-14	17,750.54	17,750.54	0
34	红利发放	2024-08-15	19,906.98	19,906.98	0
35	红利发放	2024-08-16	20,072.42	20,072.42	0
36	红利发放	2024-08-19	61,695.65	61,695.65	0
37	红利发放	2024-08-20	20,706.89	20,706.89	0
38	红利发放	2024-08-21	20,614.69	20,614.69	0
39	红利发放	2024-08-22	20,457.13	20,457.13	0
40	红利发放	2024-08-23	20,135.25	20,135.25	0
41	红利发放	2024-08-26	61,165.33	61,165.33	0
42	红利发放	2024-08-27	20,764.90	20,764.90	0
43	红利发放	2024-08-28	20,868.85	20,868.85	0
44	红利发放	2024-08-29	20,549.38	20,549.38	0
45	红利发放	2024-08-30	20,836.21	20,836.21	0
46	红利发放	2024-09-02	61,914.25	61,914.25	0
47	红利发放	2024-09-03	20,528.23	20,528.23	0
48	红利发放	2024-09-04	20,441.73	20,441.73	0
49	红利发放	2024-09-05	20,594.27	20,594.27	0
50	红利发放	2024-09-06	20,372.93	20,372.93	0
51	红利发放	2024-09-09	60,069.01	60,069.01	0
52	红利发放	2024-09-10	20,410.60	20,410.60	0
53	红利发放	2024-09-11	20,431.14	20,431.14	0
54	红利发放	2024-09-12	20,563.86	20,563.86	0

55	红利发放	2024-09-13	20,184.49	20,184.49	0
56	红利发放	2024-09-18	101,071.15	101,071.15	0
57	红利发放	2024-09-19	21,184.78	21,184.78	0
58	红利发放	2024-09-20	20,140.48	20,140.48	0
59	红利发放	2024-09-23	59,032.83	59,032.83	0
60	红利发放	2024-09-24	20,347.61	20,347.61	0
61	红利发放	2024-09-25	21,223.66	21,223.66	0
62	红利发放	2024-09-26	20,383.53	20,383.53	0
63	红利发放	2024-09-27	20,003.88	20,003.88	0
64	红利发放	2024-09-30	62,115.85	62,115.85	0
合计			1,919,509.53	1,919,509.53	

§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、山西证券日日添利货币市场基金产品资料概要；
- 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、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

2024年10月24日