

---

# 山西证券日日添利货币市场基金

## 2020 年中期报告

2020 年 06 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

送出日期:2020 年 08 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2020年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2020年01月01日起至2020年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6 中期财务会计报告(未经审计)	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	21
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	23
6.4 报表附注	24
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 债券回购融资情况	51
7.3 基金投资组合平均剩余期限	52
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 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	53
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	54
7.8 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	55
7.9 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§9 开放式基金份额变动	58

§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	60
10.9 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
11.1 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.....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	山西证券日日添利货币市场基金		
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		
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		
报告期末基金份额总额	3,657,926,067.33份		
基金合同存续期	不定期		
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	21,651,241.54份	632,291,943.38份	3,003,982,882.41份

### 2.2 基金产品说明

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>

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	山西证券股份有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	薛永红
	联系电话	95573
	电子邮箱	xueyonghong@sxzq.com
客户服务电话	95573	95559
传真	0351-8686693	021-62701216
注册地址	山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	030002	200120
法定代表人	侯巍	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://publiclyfund.sxzq.com">http://publiclyfund.sxzq.com</a> :8000
基金中期报告备置地	山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

点	
---	--

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	山西证券股份有限公司	太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日-2020年06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
本期已实现收益	250,486.19	13,591,584.71	11,902,421.74
本期利润	250,486.19	13,591,584.71	11,902,421.74
本期净值收益率	1.0795%	1.2055%	0.3945%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)		
期末基金资产净值	21,651,241.54	632,291,943.38	3,003,982,882.41
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)		
累计净值收益率	15.5332%	16.8236%	7.0105%

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。

2、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

## 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



阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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
过去一个月	0.1562%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.127 0%	0.000 4%
过去三个月	0.4868%	0.0015%	0.0885%	0.0000%	0.398 3%	0.001 5%
过去六个月	1.0795%	0.0013%	0.1771%	0.0000%	0.902 4%	0.001 3%
过去一年	2.3354%	0.0010%	0.3565%	0.0000%	1.978 9%	0.001 0%
过去三年	9.0651%	0.0017%	1.0712%	0.0000%	7.993 9%	0.001 7%
自基金合同 生效起至今	15.5332%	0.0014%	1.8396%	0.0000%	13.693 6%	0.001 4%

## 山证日日添利货币B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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
过去一个月	0.1767%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.147 5%	0.000 4%
过去三个月	0.5496%	0.0015%	0.0885%	0.0000%	0.461 1%	0.001 5%
过去六个月	1.2055%	0.0013%	0.1771%	0.0000%	1.028 4%	0.001 3%
过去一年	2.5918%	0.0010%	0.3565%	0.0000%	2.235 3%	0.001 0%
过去三年	9.8891%	0.0017%	1.0712%	0.0000%	8.817 9%	0.001 7%
自基金合同 生效起至今	16.8236%	0.0017%	1.8396%	0.0000%	14.984 0%	0.001 7%

## 山证日日添利货币C

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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
过去一个月	0.0606%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.0314%	0.0004%
过去三个月	0.1784%	0.0015%	0.0885%	0.0000%	0.0899%	0.0015%
过去六个月	0.3945%	0.0011%	0.1771%	0.0000%	0.2174%	0.0011%
过去一年	0.8752%	0.0008%	0.3565%	0.0000%	0.5187%	0.0008%
过去三年	4.3358%	0.0016%	1.0712%	0.0000%	3.2646%	0.0016%
自基金合同 生效起至今	7.0105%	0.0014%	1.8347%	0.0000%	5.1758%	0.0014%

本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

(2015年05月14日-2020年06月30日)

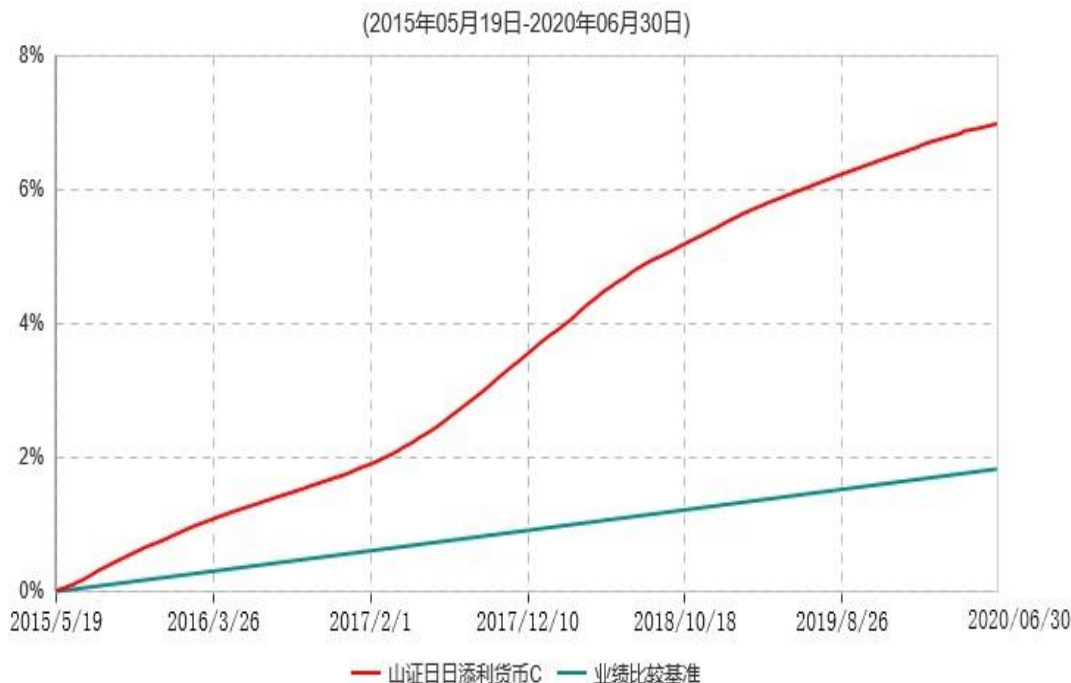


山证日日添利货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年05月14日-2020年06月30日)



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



本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日。本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

山西证券股份有限公司最早成立于1988年7月，是全国首批证券公司之一，属国有控股性质。经过三十多年的发展，已成为作风稳健、经营稳定、管理规范、业绩良好的创新类证券公司。2010年9月，公司上市首发申请获中国证监会发审委审核通过，11月15日正式在深圳证券交易所挂牌上市，股票代码002500，注册资本28.2873亿元。

公司股东资金实力雄厚，经营风格稳健，资产质量优良，盈利能力良好，其构成集中体现多种优质资源、多家优势企业的强强联合。公司控股股东为山西金融投资控股集团有限公司。

山西证券的经营范围基本涵盖了所有的证券领域，分布于财富管理、资产管理、投资管理、投融资、研究、期货、国际业务等板块，具体包括：证券经纪；证券自营；证券资产管理；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券；代销金融产品等。同时，公司具备公开募集证券投资基金管理业务资格，并获批开展债券质押式报价回购交易、股票质押

式回购交易、约定购回式证券交易、转融通、上市公司股权激励行权融资、直接投资、柜台市场、场外期权、银行间债券市场尝试做市、债券通做市等业务。

公司控股中德证券有限责任公司，致力于提供广泛的股票、债券的承销与保荐，以及并购重组等顾问服务；全资控股格林大华期货有限公司，致力于提供期货经纪、投资咨询业务及财富管理、资产管理、风险管理、中间业务等全方位、全产业链的金融服务；全资控股山证投资有限责任公司，致力于为具备风险承受能力的高净值个人和机构提供财富管理服务，同时向优质企业提供资金支持，协助被投资企业通过并购重组、IPO上市等途径做优做强；全资控股并在香港设立山证国际金融控股有限公司，致力于为客户提供专业、优质、多元化、一站式的环球证券、期货及期权产品投资，环球资产配置、企业海外融资及并购服务；全资控股山证创新投资有限公司，致力于把握市场趋势，挖掘资产价值，聚焦战略新兴产业，运用多元化投资手段，构建优质资产组合；全资控股山证科技（深圳）有限责任公司，致力于计算机软件开发、信息系统软件开发、信息技术咨询、数据管理等信息技术服务，将大数据、云计算和人工智能技术与证券金融业务深度融合，探索证券行业金融科技发展的新模式，提升公司的行业核心竞争力。

公司设有分公司15家，营业部128家，期货营业网点24家，以上网点分布于山西各地市、主要县区及北京、上海、天津、深圳、黑龙江、新疆、大连、河北、山东、陕西、河南、江苏、四川、重庆、两湖、浙江、福建、两广、海南等地，形成了以国内主要城市为前沿，重点城市为中心，覆盖山西、面向全国的业务发展框架，为200余万客户提供全面、优质、专业的综合金融服务。

近年来，公司先后获得山西省政府颁发的“优秀中介机构”、深交所颁发的“中小企业板优秀保荐机构”、中国证监会颁发的“账户规范先进集体”等荣誉，并连续多年荣获山西省人民政府授予的“支持山西地方经济发展贡献奖”、“支持山西转型跨越发展-突出贡献奖”和山西省总工会授予的“山西省金融系统五一劳动奖章”、“山西省金融系统优质服务先进单位”。2015年，公司获得山西省金融办、山西证监局授予的“2015年度新三板优秀主办券商”称号，证券时报评选的“中国最佳区域证券经纪商”和“中国最佳投资顾问品牌”等奖项；2016年，公司获得山西省妇女联合会授予的“三八红旗集体奖”，“券商中国—最具活力互联网券商”，“波特菲勒奖—最具发展潜力证券公司”，中国证券投资者保护基金授予的“2016年优秀证券公司”，中国扶贫基金会授予的“杰出贡献奖”等荣誉；2017年，公司荣获中国证券投资者保护基金授予的“2017年优秀证券公司”，中国扶贫基金会授予的“捐赠人大会杰出贡献奖”及公益时报评选的“第十四届中国慈善榜慈善榜样”等荣誉；2018年，公司荣获中国上市公司协会授予的“《中国上市公司年鉴》最佳研究实力奖”，上海票据交易所授予的“优秀非银行类交易商”，山西省直机关精神文明建设委员会授予的“山西省直机关精神文明单位”，中国证券业协会、中国期货业协会共同授予的“中国证券期货公司最佳服务贫困地区企业融资项目奖”、“中国证券期货最佳扶贫产业项目奖”、“中国证券期货公司扶贫爱心人物奖”及中国扶贫基金会颁发的“社会

力量参与救灾先进单位”等荣誉；2019年，公司荣获山西省总工会授予的“标兵单位”，深交所授予的“优秀债券投资交易机构”、“优秀固定收益业务创新机构”，上海票据交易所授予的“优秀非银行类交易商”，中国上市公司协会授予的“《中国上市公司年鉴（2018）》最佳研究实力奖”，中国扶贫基金会授予的“2018年度突出贡献奖”，中国证券报评选的“金牛成长证券公司”，证券时报评选的“中国区证券投资顾问团队君鼎奖”和“中国区证券经纪业务服务品牌君鼎奖”，证券日报评选的“2019服务实体经济卓越者”等荣誉，“公司推动完成山西路桥借壳上市项目”入选山西日报评选的“2018年山西金融业十大事件”。

未来的山西证券将秉承“诚信、稳健、规范、创新、高效”的经营理念，“以义制利、协作包容、追求卓越”的核心价值观，以“专业服务创造价值”为使命，坚持“让投资更明白”的服务理念，培育务实高效、恪尽职守的工作作风，营造和谐宽松、风清气正的公司氛围，坚定公司发展过程中差异化、专业化、市场化、集约化的战略原则，打造公司与客户共同发展的平台，努力把公司建设成为有特色、有品牌、有竞争力的一流券商。

2014年3月19日，经中国证监会批准，山西证券股份有限公司成为首批获得公募业务资格的证券公司。截至报告期末，山西证券股份有限公司（不含子公司）管理公募基金资产规模79.6亿元，旗下管理10只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
华志贵	本基金的基金经理	2015-05-14	2020-07-01	16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

					<p>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2020年6月30日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。2020年6月11日至今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基金经理。</p>
刘相鹏	本基金的基金经理	2018-05-03	-	8年	<p>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</p>

					<p>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。2020年6月11日至今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基金经理。</p>
刘凌云	本基金的基金经理	2020-07-01	-	4年	<p>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</p>



					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。
--	--	--	--	--	--

- 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020年上半年，基金延续一贯的配置风格，资产比例比较均衡，在货币市场利率不正常极地时期，分批卖掉一些年前配置的资产，组合管理进一步优化。实践上，成功渡过5月以来资金价格的大幅度回升。

##### 4.4.2 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1.0795%，同期业绩比较基准收益率为0.1771%；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1.2055%，同期业绩比较基准收益率为0.1771%；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0.3945%，同期业绩比较基准收益率为0.1771%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

货币政策在六保和防风险之间平衡，央行的疫情危机应对极端宽松政策暂告一段落，接下来更加强调稳健，总量适度。宏观经济也在逐步复工复产，股票市场的活跃度仍维持高位，冷局难凑、热局难散，会对债券市场的情绪与资金形成一定压力。债券市场维持窄幅波动，根据后续通胀及政策变化而动态调整。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

同时，由具备丰富专业知识、两年以上相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金会计负责估值工作。基金经理可参

与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定，本基金的收益分配采取“每日分配、按日支付”的方式，即根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，并每日以红利再投资（即红利转基金份额）方式支付收益。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未发生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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，托管人在山西证券日日添利货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，山西证券股份有限公司在山西证券日日添利货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：250,486.19元，向B级份额持有人分配利润：13,591,584.71元，向C级份额持有人分配利润：11,902,421.74元。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由山西证券股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关山西证券日日添利货币市场基金的中期报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：山西证券日日添利货币市场基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	193,815,569.51	544,635,965.86
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,272,131,155.64	2,096,960,046.28
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,130,826,134.18	1,893,934,748.47
资产支持证券投资		141,305,021.46	203,025,297.81
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,174,638,422.56	1,209,503,314.10
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	21,880,875.57	12,261,115.14
应收股利		-	-
应收申购款		627,175.70	233,160,094.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,663,093,198.98	4,096,520,535.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		957,789.88	962,340.88
应付托管费		255,410.66	256,624.23
应付销售服务费		67,741.88	554,528.66
应付交易费用	6.4.7.7	77,641.71	50,848.39
应交税费		50,460.69	26,103.56
应付利息		-	-
应付利润		152,693.88	182,722.52
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,605,392.95	3,434,474.14
负债合计		5,167,131.65	5,467,642.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,657,926,067.33	4,091,052,893.00
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,657,926,067.33	4,091,052,893.00
负债和所有者权益总计		3,663,093,198.98	4,096,520,535.38

1、报告截止日2020年06月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额3,657,926,067.33份，其中A级基金份额总额21,651,241.54份，B级基金份额总额632,291,943.38份，C级基金份额总额3,003,982,882.41份。

## 6.2 利润表

会计主体：山西证券日日添利货币市场基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		60,016,659.45	54,218,987.95
1. 利息收入		58,933,941.76	54,300,816.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,358,923.01	5,053,245.86
债券利息收入		32,621,987.75	40,221,746.44

资产支持证券利息收入		3,265,450.17	2,339,566.29
买入返售金融资产收入		13,687,580.83	6,686,258.36
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,082,717.69	-81,829.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	69,934.50	29,335.91
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14. 5	1,012,783.19	-111,164.91
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
<b>减：二、费用</b>		34,272,166.81	31,527,786.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	6,224,016.99	4,959,343.50
2. 托管费	6.4.10.2. 2	1,659,737.90	1,322,491.60
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	2,437,226.82	3,516,446.03
4. 交易费用	6.4.7.19	230.70	100.00
5. 利息支出		1,918,979.75	548,922.63
其中：卖出回购金融资产 支出		1,918,979.75	548,922.63

6. 税金及附加		30,619.01	87,161.60
7. 其他费用	6.4.7.20	22,001,355.64	21,093,320.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,744,492.64	22,691,201.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,744,492.64	22,691,201.92

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：山西证券日日添利货币市场基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,091,052,893.00	-	4,091,052,893.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,744,492.64	25,744,492.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-433,126,825.67	-	-433,126,825.67
其中：1. 基金申购款	35,596,477,764.04	-	35,596,477,764.04
2. 基金赎回款	-36,029,604,589.71	-	-36,029,604,589.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-25,744,492.64	-25,744,492.64
五、期末所有者权益	3,657,926,067.33	-	3,657,926,067.33

(基金净值)			
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,307,196,674.93	-	2,307,196,674.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,691,201.92	22,691,201.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,130,744,705.16	-	1,130,744,705.16
其中: 1. 基金申购款	35,004,413,941.31	-	35,004,413,941.31
2. 基金赎回款	-33,873,669,236.15	-	-33,873,669,236.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-22,691,201.92	-22,691,201.92
五、期末所有者权益 (基金净值)	3,437,941,380.09	-	3,437,941,380.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

侯巍

汤建雄

张立德

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

山西证券日日添利货币市场基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]414号《关于准予山西证券日日添利货



币市场基金注册的批复》核准募集，由山西证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《山西证券日日添利货币市场基金基金合同》、《山西证券日日添利货币市场基金招募说明书》和《山西证券日日添利货币市场基金基金份额发售公告》发起，并于2015年5月14日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次发售募集的有效认购资金人民币464,126,947.45元，折合464,126,947.45份基金份额；孳生利息人民币39,805.37元，折合39,805.37份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币464,166,752.82元，折合464,166,752.82份基金份额。业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第1500747号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为山西证券股份有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金根据销售渠道、基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量以及开立证券资金账户等的不同，对基金份额按照不同的费率计提管理费、销售服务费和增值服务费，因此形成不同的基金份额类别。本基金分设三类基金份额：A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额。三类基金份额分设不同的基金代码，收取不同的管理费、销售服务费和增值服务费，并分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。A类基金份额指投资人认、申购本基金，按照0.3%年费率计提管理费，0.25%年费率计提销售服务费的基金份额类别；B类基金份额指投资人认、申购本基金，按照0.3%年费率计提管理费，按照0年费率计提销售服务费的基金份额类别；C类基金份额指投资人认、申购本基金，须开立证券资金账户，按照0.3%年费率计提管理费，0.25%年费率计提销售服务费，1.5%年费率计提增值服务费。本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体为现金；通知存款；短期融资券；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购；剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据；剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表以持续经营为基础编制。

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）进行编制。同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第

3号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定，并按照《山西证券日日添利货币市场基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2020年06月30日的财务状况以及2020年1月1日至2020年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2020年1月1日至2020年6月30日止。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]70号《关于金融同业往来等增值税补充政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税; 2018年1月1日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股票的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.10%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	93,815,569.51
定期存款	100,000,000.00
其中: 存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	100,000,000.00
其他存款	-
合计	193,815,569.51

1、定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末2020年06月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,130,826,134.18	2,131,951,000.00	1,124,865.82	0.0308
	合计	2,130,826,134.18	2,131,951,000.00	1,124,865.82	0.0308
资产支持证券		141,305,021.46	141,305,021.46	-	-
合计		2,272,131,155.64	2,273,256,021.46	1,124,865.82	0.0308

1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,174,638,422.56	-
合计	1,174,638,422.56	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末

	2020年06月30日
应收活期存款利息	104,098.71
应收定期存款利息	878,332.92
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	16,712,765.83
应收资产支持证券利息	3,840,402.19
应收买入返售证券利息	345,275.92
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	21,880,875.57

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	77,641.71
合计	77,641.71

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	82,130.70
其他应付	3,523,262.25

合计	3,605,392.95
----	--------------

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 山证日日添利货币A

金额单位：人民币元

项目 (山证日日添利货币A)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	25,318,701.22	25,318,701.22
本期申购	92,935,558.92	92,935,558.92
本期赎回(以“-”号填列)	-96,603,018.60	-96,603,018.60
本期末	21,651,241.54	21,651,241.54

##### 6.4.7.9.2 山证日日添利货币B

金额单位：人民币元

项目 (山证日日添利货币B)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,408,381,900.03	1,408,381,900.03
本期申购	2,698,919,555.14	2,698,919,555.14
本期赎回(以“-”号填列)	-3,475,009,511.79	-3,475,009,511.79
本期末	632,291,943.38	632,291,943.38

##### 6.4.7.9.3 山证日日添利货币C

金额单位：人民币元

项目 (山证日日添利货币C)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,657,352,291.75	2,657,352,291.75
本期申购	32,804,622,649.98	32,804,622,649.98
本期赎回(以“-”号填列)	-32,457,992,059.32	-32,457,992,059.32
本期末	3,003,982,882.41	3,003,982,882.41

1、申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 山证日日添利货币A

单位：人民币元

项目 (山证日日添利货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	250,486.19	-	250,486.19
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-250,486.19	-	-250,486.19
本期末	-	-	-

## 6.4.7.10.2 山证日日添利货币B

单位：人民币元

项目 (山证日日添利货币B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	13,591,584.71	-	13,591,584.71
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-13,591,584.71	-	-13,591,584.71
本期末	-	-	-

## 6.4.7.10.3 山证日日添利货币C

单位：人民币元

项目 (山证日日添利货币C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	11,902,421.74	-	11,902,421.74

本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-11,902,421.74	-	-11,902,421.74
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	6,474,430.66
定期存款利息收入	2,881,460.76
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,031.59
其他	-
合计	9,358,923.01

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	69,934.50
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-



合计	69,934.50
----	-----------

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,208,932,949.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,189,856,461.16
减：应收利息总额	19,006,554.07
买卖债券差价收入	69,934.50

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	434,392,017.50
减：卖出资产支持证券成本总额	421,141,587.74
减：应收利息总额	12,237,646.57
资产支持证券投资收益	1,012,783.19

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	230.70
合计	230.70

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	7,458.36
信息披露费	59,672.34
帐户维护费	18,000.00
增值服务费C	21,915,624.94
其他	600.00

合计	22,001,355.64
----	---------------

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
山西证券股份有限公司（“山西证券”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
山证投资有限责任公司	基金管理人的全资子公司
山证基金管理有限公司	基金管理人的全资子公司
山西股权交易中心有限公司	受基金管理人控股股东控制

注：所列股东为持股5%以上股东。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

所述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
山西证券 股份有限 公司	596,745,503.01	100.00%	341,964,787.13	100.00%

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
山西证券 股份有限 公司	400,000,000.00	100.00%	-	-

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期与上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至202 0年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至201 9年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	6,224,016.99	4,959,343.50
其中：支付销售机构的客户维护费	263,885.65	15,668.80

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,659,737.90	1,322,491.60

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	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	合计
山西证券	27,414.43	0.00	2,408,291.69	2,435,706. 12

交通银行	153.60	0.00	0.00	153.60
合计	27,568.03	0.00	2,408,291.69	2,435,859.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	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	合计
山西证券	13,621.56	0.00	3,501,932.08	3,515,553.64
交通银行	3.43	0.00	0.00	3.43
合计	13,624.99	0.00	3,501,932.08	3,515,557.07

本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，对于B类降级为A类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0，对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的费率。C类基金份额的年销售服务费率为0.25%。基金销售服务费每日计提，按月支付。

三类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，日销售服务费=前一日基金资产净值×年销售服务费率÷当年天数

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行过债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

山证日日添利货币A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00

报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

山证日日添利货币B

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至2020年06 月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06 月30日
报告期初持有的基金份额	276,505,592.14	268,836,779.01
报告期间申购/买入总份额	1,856,223.33	3,890,462.75
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	278,361,815.47	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	272,727,241.76
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	7.93%

山证日日添利货币C

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至2020年06 月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06 月30日

报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

基金管理人投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

山证日日添利货币A

关联方名称	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山证基金管理有限公司	194,011.94	0.0053%	191,939.77	0.0000%
太钢集团财务有限公司	0.00	0.0000%	0.29	0.0000%

山证日日添利货币B

关联方名称	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的



		比例		比例
山证投资 有限责任 公司	8,016,595.67	0.2192%	0.00	0.0000%
山证汇通 恒利101 号集合资 产管理计 划	0.00	0.0000%	7,900,579.54	0.19%

## 山证日日添利货币C

关联方名 称	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
山西股权 交易中心 有限公司	906,723.00	0.0248%	9,542,785.53	0.23%

## 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名 称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行 股份有限 公司	93,815,569.51	6,474,430.66	176,456,358.21	2,926,926.23

本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金

山证日日添利货币A

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
250,747.69	-	-261.50	250,486.19	-

山证日日添利货币B

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
13,650,850.30	-	-59,265.59	13,591,584.71	-

山证日日添利货币C

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
11,872,923.29	-	29,498.45	11,902,421.74	-

## 6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单位： 张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
1687 33	申程 01优	2020 -06- 29	2020 -07- 14	-	100. 00	100. 00	100,00 0	10,0 00,0 00.0 0	10,0 00,0 00.0 0	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，本基金投资于各类固定收益类金融工具，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，具体而言，包括如下组成部分：

##### (1) 董事会

负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。

##### (2) 风险管理执行委员会

根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和控制策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。

##### (3) 投资决策委员会

负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

##### (4) 公募基金管理业务专项合规负责人

按照规定履行公募基金管理业务合规负责人职责，对董事会负责。监督检查基金投资的合法合规性、基金运营的安全性对发现的问题，及时告知相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实。

(5) 合规管理部：负责对公募基金管理业务相关制度、合同和流程进行合规性审核；按照监管机构的要求和公司的规定定期、不定期地进行合规检查，组织落实公募基金管理业务的业务隔离和反洗钱工作；负责处理公募基金管理业务相关法律诉讼事务。

(6) 风险管理部：负责对整体业务进行全程监控，拟定和完善公募基金管理业务风险管理制度和风险控制流程；建立和完善公募基金管理业务风险监控指标体系；监控和检查公募基金管理业务运行情况；分析、评估公募基金管理业务的风险状况，并向公司总经理办公会及相关部门提交风险评估报告。

(7) 稽核审计部：负责对公募基金管理业务进行全面的审计与监察、稽核，检查各部门对公募基金管理业务相关制度的执行情况，并出具监察稽核报告。

#### (8) 业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

公募基金管理业务风险控制目标是通过建立科学的风险防范体系、风险控制机制及风险监测平台，及时发现、评估、规避、处理公募基金管理业务运作中的各类风险，确保公募基金管理业务合规开展，风险可测、可控、可承受。在风险识别、风险评估、风险测量等的基础上，及时对各种风险进行监督、检查和评估，对风险进行管理控制，制定风险控制决策，采取适当有效的风险控制措施，将风险控制在预期可承受的范围内，实现风险管理目标。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不超过该证券的10%。

本基金的基金管理人在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均通过对交易对手的信用状况进行评估以控制相应的信用风险。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2020年06月30日	2019年12月31日
A-1	100,089,130.20	230,000,402.65
A-1以下	-	-
未评级	620,151,578.56	140,035,415.02
合计	720,240,708.76	370,035,817.67

未评级为国债、政策性金融债和超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	141,305,021.46	173,028,485.53
合计	141,305,021.46	173,028,485.53

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,250,055,084.74	1,493,832,652.05
合计	1,250,055,084.74	1,493,832,652.05

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	160,530,340.68	30,066,278.75
AAA以下	-	-
未评级	-	-

合计	160,530,340.68	30,066,278.75
----	----------------	---------------

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	29,996,812.28
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	29,996,812.28

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的证券，除在证券交易所的债券回购交易及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，均能够及时变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况

下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，引起基金收益水平的变化。特别是短期利率变化以及货币市场投资工具市场价格的相关波动，会影响基金组合投资业绩。

本基金主要投资于银行存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金以摊余成本计价，每日通过“影子定价”对面临的市场风险进行监控，使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值。本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	93,815,569.51	100,000,000.00	-	-	-	-	193,815,569.51
交易性金融资产	359,753,905.95	648,759,258.57	1,263,617,991.12	-	-	-	2,272,131,155.64
买入返售金融资产	1,174,638,422.56	-	-	-	-	-	1,174,638,422.56
应收利息	-	-	-	-	-	21,880,875.57	21,880,875.57
应收申购款	-	-	-	-	-	627,175.70	627,175.70
资产总计	1,628,207,898.02	748,759,258.57	1,263,617,991.12	-	-	22,508,051.27	3,663,093,198.98
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	957,789.88	957,789.88
应付托管费	-	-	-	-	-	255,410.66	255,410.66
应付销	-	-	-	-	-	67,741.88	67,741.88

售服务费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	77,641.71	77,641.71
应交税费	-	-	-	-	-	50,460.69	50,460.69
应付利润	-	-	-	-	-	152,693.88	152,693.88
其他负债	-	-	-	-	-	3,605,392.95	3,605,392.95
负债总计	-	-	-	-	-	5,167,131.65	5,167,131.65
利率敏感度缺口	1,628,207,898.02	748,759,258.57	1,263,617,991.12	-	-	17,340,919.62	3,657,926,067.33
上年度末2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	244,635,965.86	300,000,000.00	-	-	-	-	544,635,965.86
交易性金融资产	377,964,494.26	676,676,126.03	1,042,319,425.99	-	-	-	2,096,960,046.28
买入返售金融资产	1,209,503,314.10	-	-	-	-	-	1,209,503,314.10
应收利息	-	-	-	-	-	12,261,115.14	12,261,115.14
应收申购款	-	-	-	-	-	233,160,094.00	233,160,094.00
资产总计	1,832,103,774.22	976,676,126.03	1,042,319,425.99	-	-	245,421,209.14	4,096,520,535.38
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	962,340.88	962,340.88
应付托管费	-	-	-	-	-	256,624.23	256,624.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	554,528.66	554,528.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	50,848.39	50,848.39
应交税费	-	-	-	-	-	26,103.56	26,103.56
应付利润	-	-	-	-	-	182,722.52	182,722.52
其他负债	-	-	-	-	-	3,434,474.14	3,434,474.14



负债总计	-	-	-	-	-	5,467,642.38	5,467,642.38
利率敏感度缺口	1,832,103,774.22	976,676,126.03	1,042,319,425.99	-	-	239,953,566.76	4,091,052,893.00

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,598,750.47	1,595,359.20
	市场利率上升25个基点	-1,593,260.85	-1,589,619.01

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资	-	-	-	-

产—基金投资				
交易性金融资产—债券投资	2,272,131,155.64	62.12	2,096,960,046.28	51.26
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,272,131,155.64	62.12	2,096,960,046.28	51.26

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2020年06月30日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2020年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币2,272,131,155.64元，无属于第一层次和第三层次的余额

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	2,272,131,155.64	62.03
	其中：债券	2,130,826,134.18	58.17
	资产支持证券	141,305,021.46	3.86
2	买入返售金融资产	1,174,638,422.56	32.07
	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	193,815,569.51	5.29
4	其他各项资产	22,508,051.27	0.61
5	合计	3,663,093,198.98	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.66	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	0.00

其中：买断式回购融资	-	0.00
------------	---	------

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

在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%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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	70
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

### 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。

### 7.3.2 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	44.24	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)—60天	12.01	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)—90天	8.73	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)—120天	10.85	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-

5	120天(含)—397天(含)	23.69	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
	合计	99.53	0.00

#### 7.4 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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,649,488.98	6.31
	其中：政策性金融债	100,376,765.18	2.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	589,918,093.02	16.13
6	中期票据	60,203,467.44	1.65
7	同业存单	1,250,055,084.74	34.17
8	其他	-	-
9	合计	2,130,826,134.18	58.25
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------	------	---------------

1	190307	19进出07	1,000,000	100,376,765.18	2.74
2	1720065	17郑州银行绿色金融01	1,000,000	100,326,873.24	2.74
3	111912100	19北京银行CD100	1,000,000	99,184,838.43	2.71
4	111970650	19西安银行CD081	1,000,000	99,052,487.88	2.71
5	012001157	20复星高科SCP002	700,000	69,994,834.26	1.91
6	012000648	20大同煤矿SCP006	600,000	60,053,759.35	1.64
7	012000332	20苏农垦SCP001	500,000	50,042,332.17	1.37
8	012000714	20山东电力SCP001	500,000	50,000,085.33	1.37
9	041900278	19大同煤矿CP003	500,000	50,000,033.38	1.37
10	011902944	19大同煤矿SCP023	500,000	50,000,010.63	1.37

### 7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2325%
报告期内偏离度的最低值	0.0187%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1065%

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。

## 7.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	159499	时代04优	300,000	30,017,458.57	0.82
2	165721	时代06优	210,000	21,097,926.76	0.58
3	138391	海诺1A1	200,000	20,098,902.34	0.55
4	165865	龙联06A	200,000	20,010,153.30	0.55
5	138633	海诺2A1	200,000	19,995,051.52	0.55
6	165015	企发01A	100,000	10,025,646.91	0.27
7	168733	申程01优	100,000	10,000,000.00	0.27
8	138387	元熹1优1	70,000	7,043,191.88	0.19
9	138365	招慧06A	30,000	3,016,690.18	0.08

## 7.9 投资组合报告附注

## 7.9.1 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。

7.9.2 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。

## 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收利息	21,880,875.57
4	应收申购款	627,175.70
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,508,051.27

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
山证 日日 添利 货币A	3,017	7,176.41	2,247,140.48	10.38%	19,404,101.06	89.62%
山证 日日 添利 货币B	9	70,254,660.38	618,511,594.98	97.82%	13,780,348.40	2.18%
山证 日日 添利 货币C	53,248	56,414.94	59,954,575.21	2.00%	2,944,028,307.20	98.00%
合计	56,274	65,002.06	680,713,310.67	18.61%	2,977,212,756.66	81.39%

机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。



## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	保险类机构	202,588,392.06	5.54%
2	银行类机构	151,252,786.46	4.13%
3	银行类机构	151,037,697.36	4.13%
4	个人	78,625,796.53	2.15%
5	证券类机构	70,291,649.62	1.92%
6	个人	21,409,115.94	0.59%
7	个人	21,105,870.99	0.58%
8	证券类机构	20,241,118.42	0.55%
9	个人	20,077,496.78	0.55%
10	其他机构	16,573,824.49	0.45%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	山证日日添利货币A	2.97	0.00%
	山证日日添利货币B	-	0.00%
	山证日日添利货币C	96,315.82	0.0032%
	合计	96,318.79	0.0026%

分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资	山证日日添利货币	0

和研究部门负责人持有本开放式基金	A	
	山证日日添利货币 B	0
	山证日日添利货币 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	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	-
	合计	-

### § 9 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
基金合同生效日(2015年05月14日)基金份额总额	190,332,531.91	273,834,220.88	873,407,149.43
本报告期期初基金份额总额	25,318,701.22	1,408,381,900.03	2,657,352,291.75
本报告期基金总申购份额	92,935,558.92	2,698,919,555.14	32,804,622,649.98
减：本报告期基金总赎回份额	96,603,018.60	3,475,009,511.79	32,457,992,059.32
本报告期期末基金份额总额	21,651,241.54	632,291,943.38	3,003,982,882.41

报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

### § 10 重大事件揭示

**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动****(1) 基金管理人的重大人事变动**

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

**(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

(1) 本报告期内本基金管理人无重大诉讼、仲裁事项。

(2) 本报告期内无涉及本基金财产的诉讼。

(3) 本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

为本基金提供审计服务的会计师事务所为中喜会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变更。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

山西 证券	2	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计, 不单指股票交易佣金。

## 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能租赁其他证券公司的交易单元，只能使用本基金管理人自有的交易单元。

4、本基金本报告期内未新增交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
山西证券	596,745,503.01	100.00%	400,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	山西证券日日添利货币市场基金更新招募说明书（2020年第1号）	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-17
2	山西证券日日添利货币市场	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-17

	基金更新招募说明书摘要(2020年第1号)		
3	山西证券日日添利货币市场基金更新招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-17
4	山西证券日日添利货币市场基金继续暂停(大额)申购(转换转入、定期定额投资)业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-29
5	山西证券股份有限公司关于新增大连网金基金销售公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-15
6	山西证券日日添利货币市场基金暂停(大额)申购(转换转入、定期定额投资)公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-08
7	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金参加北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-08
8	山西证券股份有限公司旗下全部基金2020年第一季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
9	山西证券日日添利货币市场基金2020年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
10	山西证券股份有限公司旗下基金2019年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
11	山西证券日日添利货币市场基金2019年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
12	关于山西证券股份有限公司旗下公募基金相关业务开放	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-31

	日及开放时间的提示性公告		
13	山西证券日日添利货币市场基金2019年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-20
14	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金继续参与交通银行费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-03

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 12.3 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  
二〇二〇年八月二十五日