

山西证券日日添利货币市场基金

2016年第3季度报告

2016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：2016年10月26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2016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2016年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	山证日日添利货币
场内简称	-
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	2,738,552,506.84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	26,848,160.10	632,871,140.63	2,078,833,206.1 1

§ 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（2016年07月01日-2016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	158,762.23	5,194,410.36	5,576,014.79
2. 本期利润	158,762.23	5,194,410.36	5,576,014.79
3. 期末基金资产净值	26,848,160.10	632,871,140.63	2,078,833,206.1 1

注：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，由于本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。

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

1、山证日日添利货币A

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	0.6060 %	0.0002 %	0.0895 %	0.0000%	0.5165 %	0.0002 %

2、山证日日添利货币B

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标	业绩比 较基准	业绩比较基 准收益率标	①-③	②-④
----	------------	------------	------------	----------------	-----	-----

		准差②	收益率 ③	准差④		
过去三个月	0.6693 %	0.0001 %	0.0895 %	0.0000%	0.5798 %	0.0001 %

3、山证日日添利货币C

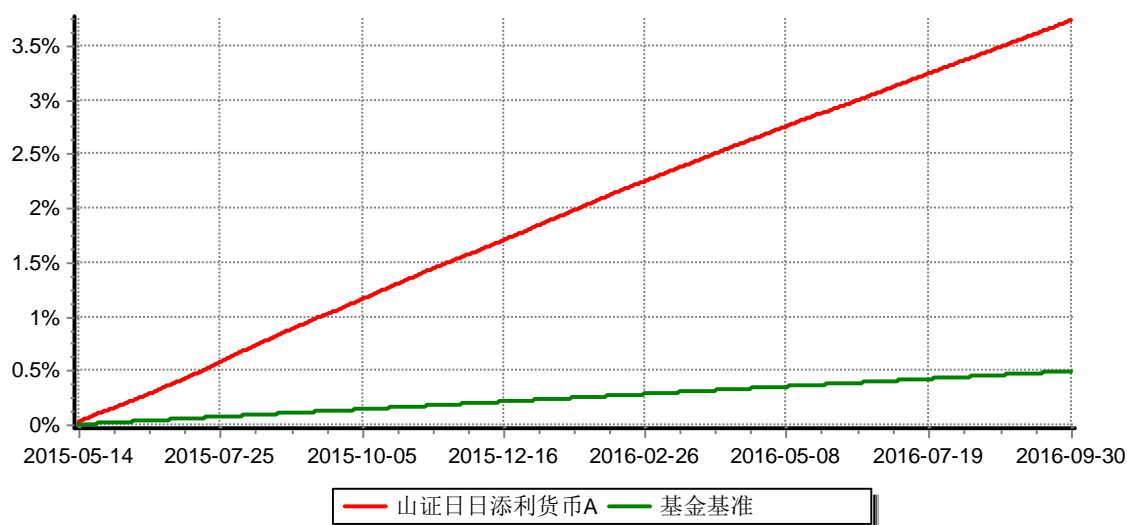
阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 准差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.2271 %	0.0002 %	0.0895 %	0.0000%	0.1376 %	0.0002 %

- 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

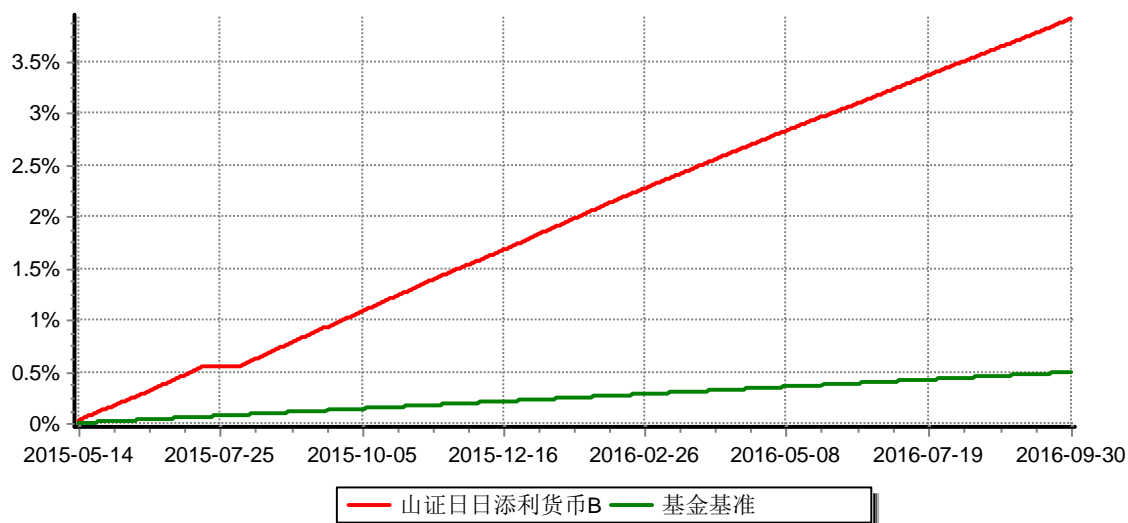
山证日日添利货币A

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年05月14日-2016年09月30日)

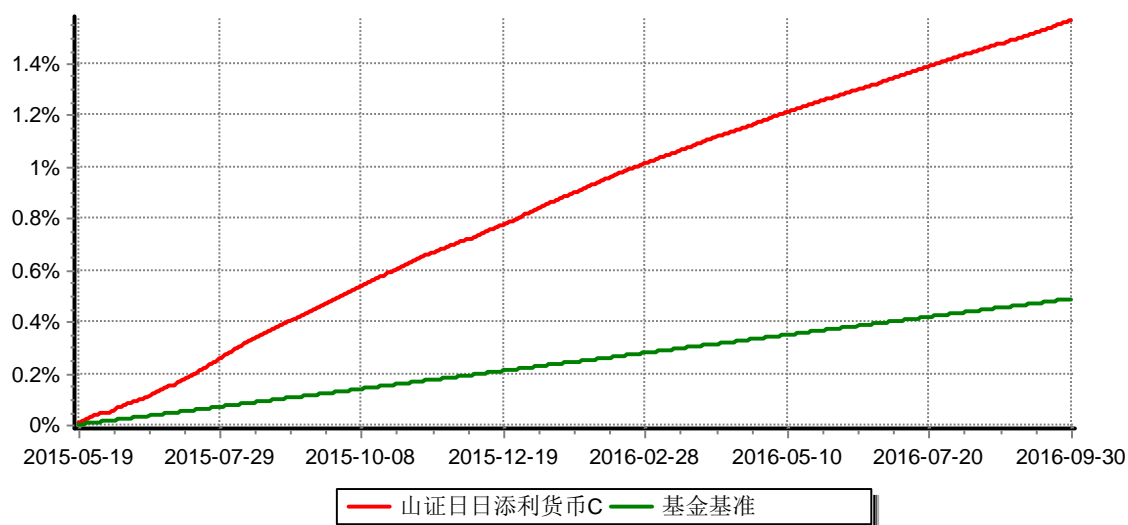


山证日日添利货币B

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-2016年09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
(2015年05月19日-2016年09月30日)



注：1、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（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）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		

华志贵	本基金的基金经理	2015年05月14日	—	12年	<p>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月任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。2016年5月任山西证券保本混合型证券投资基金基金经理。</p>
-----	----------	-------------	---	-----	--

注：1、此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期；
2、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，在流动性与收益率的动态平衡中，采取配置适度比例的高资质短融以提高收益率，辅以存款、逆回购和现金资产以保障基金的流动性。在短融选择策略中，兼顾短期与中期收益，维持中等以上的久期。在9月份资金价格较高时，通过稍长期限的回购提高基金收益。信用控制上，坚决不碰资质差的短融。整体来看，该策略取得了比较好的效果。

接下来，基金仍然会延续上述风格。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金份额A净值收益率为0.6060%，同期业绩比较基准收益率为0.0895%。

本报告期内本基金份额B净值收益率为0.6693%，同期业绩比较基准收益率为0.0895%。

本报告期内本基金份额C净值收益率为0.2271%，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

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	2,310,108,637.62	83.30
	其中：债券	2,310,108,637.62	83.30
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	174,200,501.30	6.28
	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	243,820,437.24	8.79
4	其他资产	45,011,044.01	1.62
5	合计	2,773,140,620.17	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	0.64	
	其中：买断式回购融资	—	
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	29,999,835.00	1.10
	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	113
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	89

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内，本基金投资组合的平均剩余期限未发生超过120天的情况。

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	22.57	1.10
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	17.16	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	6.58	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	7.66	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	45.65	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	99.62	1.10

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：报告期内投资组合平均剩余存续期没有超过240天的情况。

5.5 报告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	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	2,289,989,199.64	83.62
6	中期票据	20,119,437.98	0.73
7	同业存单	—	—
8	其他	—	—
9	合计	2,310,108,637.62	84.36
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

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(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	041663004	16首钢CP002	1,500,000	150,014,374.18	5.48
2	041653025	16新兴铸管CP002	1,100,000	109,934,670.37	4.01
3	041557005	15中色CP002	1,000,000	99,980,363.37	3.65
4	041664009	16甘公投CP001	900,000	89,907,970.92	3.28
5	041572017	15日照港CP002	700,000	70,012,810.04	2.56
6	011698268	16云能投SCP005	600,000	59,976,702.33	2.19
7	011698023	16首钢SCP001	500,000	50,195,655.52	1.83

8	041682001	16忠旺CP001	500,000	50,166,718.64	1.83
9	041558111	15鲁宏桥CP004	500,000	50,098,290.27	1.83
10	011620001	16中铝SCP001	500,000	50,096,947.83	1.83

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	0.0678%
报告期内偏离度的最低值	-0.0327%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0380%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：无。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：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

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计价，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未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

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	44,998,001.01

4	应收申购款	13,043.00
5	其他应收款	—
6	其他	—
7	合计	45,011,044.01

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

无

§ 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	27,412,828.03	612,500,519.67	2,190,306,392.6 0
报告期期间基金总申购份额	37,384,095.78	747,205,434.26	12,978,408,056. 86
减：报告期期间基金总赎回份额	37,948,763.71	726,834,813.30	13,089,881,243. 35
报告期期末基金份额总额	26,848,160.10	632,871,140.63	2,078,833,206.1 1

§ 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	2016年07月01 日	46,335.48	46,335.48	0.00%
2	红利发放	2016年07月04 日	136,684.17	136,684.17	0.00%
3	红利发放	2016年07月05 日	44,543.44	44,543.44	0.00%
4	红利发放	2016年07月06 日	43,826.87	43,826.87	0.00%
5	红利发放	2016年07月07 日	43,688.12	43,688.12	0.00%
6	红利发放	2016年07月08	43,974.51	43,974.51	0.00%

		日			
7	红利发放	2016年07月11日	131,530.56	131,530.56	0.00%
8	红利发放	2016年07月12日	42,600.74	42,600.74	0.00%
9	红利发放	2016年07月13日	42,910.53	42,910.53	0.00%
10	红利发放	2016年07月14日	43,585.05	43,585.05	0.00%
11	红利发放	2016年07月15日	44,079.88	44,079.88	0.00%
12	红利发放	2016年07月18日	131,830.48	131,830.48	0.00%
13	红利发放	2016年07月19日	44,313.62	44,313.62	0.00%
14	红利发放	2016年07月20日	44,395.12	44,395.12	0.00%
15	红利发放	2016年07月21日	44,303.47	44,303.47	0.00%
16	红利发放	2016年07月22日	43,874.56	43,874.56	0.00%
17	红利发放	2016年07月25日	129,742.70	129,742.70	0.00%
18	红利发放	2016年07月26日	44,542.51	44,542.51	0.00%
19	红利发放	2016年07月27日	44,914.43	44,914.43	0.00%
20	红利发放	2016年07月28日	45,137.26	45,137.26	0.00%
21	红利发放	2016年07月29日	45,132.62	45,132.62	0.00%
22	红利发放	2016年08月01日	134,520.50	134,520.50	0.00%

23	红利发放	2016年08月02日	43,633.51	43,633.51	0.00%
24	红利发放	2016年08月03日	43,618.39	43,618.39	0.00%
25	红利发放	2016年08月04日	43,619.09	43,619.09	0.00%
26	红利发放	2016年08月05日	43,377.19	43,377.19	0.00%
27	红利发放	2016年08月08日	128,125.90	128,125.90	0.00%
28	红利发放	2016年08月09日	42,898.20	42,898.20	0.00%
29	红利发放	2016年08月10日	42,284.62	42,284.62	0.00%
30	红利发放	2016年08月11日	43,025.07	43,025.07	0.00%
31	红利发放	2016年08月12日	43,579.63	43,579.63	0.00%
32	红利发放	2016年08月15日	130,449.02	130,449.02	0.00%
33	红利发放	2016年08月16日	42,453.68	42,453.68	0.00%
34	红利发放	2016年08月17日	43,474.13	43,474.13	0.00%
35	红利发放	2016年08月18日	43,821.08	43,821.08	0.00%
36	红利发放	2016年08月19日	43,433.83	43,433.83	0.00%
37	红利发放	2016年08月22日	128,648.40	128,648.40	0.00%
38	红利发放	2016年08月23日	43,597.14	43,597.14	0.00%

39	红利发放	2016年08月24日	43,592.58	43,592.58	0.00%
40	红利发放	2016年08月25日	44,169.50	44,169.50	0.00%
41	红利发放	2016年08月26日	43,765.49	43,765.49	0.00%
42	红利发放	2016年08月29日	132,077.31	132,077.31	0.00%
43	红利发放	2016年08月30日	44,110.44	44,110.44	0.00%
44	红利发放	2016年08月31日	43,980.19	43,980.19	0.00%
45	红利发放	2016年09月01日	44,429.94	44,429.94	0.00%
46	红利发放	2016年09月02日	43,938.92	43,938.92	0.00%
47	红利发放	2016年09月05日	132,973.24	132,973.24	0.00%
48	红利发放	2016年09月06日	43,186.86	43,186.86	0.00%
49	红利发放	2016年09月07日	43,808.37	43,808.37	0.00%
50	红利发放	2016年09月08日	43,998.32	43,998.32	0.00%
51	红利发放	2016年09月09日	44,136.33	44,136.33	0.00%
52	红利发放	2016年09月12日	131,753.96	131,753.96	0.00%
53	红利发放	2016年09月13日	43,569.27	43,569.27	0.00%
54	红利发放	2016年09月14日	43,970.52	43,970.52	0.00%

55	红利发放	2016年09月19日	223,847.10	223,847.10	0.00%
56	红利发放	2016年09月20日	45,410.68	45,410.68	0.00%
57	红利发放	2016年09月21日	45,300.11	45,300.11	0.00%
58	红利发放	2016年09月22日	45,484.83	45,484.83	0.00%
59	红利发放	2016年09月23日	45,569.26	45,569.26	0.00%
60	红利发放	2016年09月26日	137,916.30	137,916.30	0.00%
61	红利发放	2016年09月27日	45,842.09	45,842.09	0.00%
62	红利发放	2016年09月28日	45,730.70	45,730.70	0.00%
63	红利发放	2016年09月29日	45,678.57	45,678.57	0.00%
64	红利发放	2016年09月30日	45,740.48	45,740.48	0.00%
合计			4,060,486.86	4,060,486.86	

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 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。

8.2 存放地点

太原市府西街69号山西国际贸易中心。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场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
二〇一六年十月二十六日