

# 山西证券日日添利货币市场基金

2022年第2季度报告

2022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

报告送出日期:2022年07月20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 .....	9
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 .....	9
4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明 .....	12
4.3 公平交易专项说明 .....	12
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 .....	13
4.5 报告期内基金的业绩表现 .....	14
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 .....	15
§5 投资组合报告 .....	15
5.1 报告期末基金资产组合情况 .....	15
5.2 报告期债券回购融资情况 .....	15
5.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	15
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 .....	16
5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	16
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 .....	17
5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	18
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 .....	18
5.9 投资组合报告附注 .....	18
§6 开放式基金份额变动 .....	19
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 .....	19
§8 影响投资者决策的其他重要信息 .....	21
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 .....	21
8.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	21
§9 备查文件目录 .....	21
9.1 备查文件目录 .....	21
9.2 存放地点 .....	21
9.3 查阅方式 .....	22

## § 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2022年7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2022年04月01日起至2022年06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	5,353,633,352.83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、</p>

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。		
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	15,044,495.30份	1,794,919,173.05份	3,543,669,684.48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(2022年04月01日 - 2022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
1. 本期已实现收益	68,227.90	11,053,927.23	4,499,131.66
2. 本期利润	68,227.90	11,053,927.23	4,499,131.66
3. 期末基金资产净值	15,044,495.30	1,794,919,173.05	3,543,669,684.48

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	0.4689%	0.0004%	0.0885%	0.0000%	0.3804%	0.0004%
过去六个月	1.0044%	0.0005%	0.1761%	0.0000%	0.8283%	0.0005%
过去一年	2.1467%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	1.7912%	0.0005%
过去三年	6.9016%	0.0007%	1.0712%	0.0000%	5.8304%	0.0007%
过去五年	13.9315%	0.0016%	1.7911%	0.0000%	12.1404%	0.0016%
自基金合同生效起至今	20.6883%	0.0015%	2.5650%	0.0000%	18.1233%	0.0015%

## 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	0.5316%	0.0004%	0.0885%	0.0000%	0.4431%	0.0004%
过去六个月	1.1298%	0.0005%	0.1761%	0.0000%	0.9537%	0.0005%
过去一年	2.4028%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	2.0473%	0.0005%
过去三年	7.7072%	0.0007%	1.0712%	0.0000%	6.6360%	0.0007%

过去五年	15.3684%	0.0016%	1.7911%	0.0000%	13.5773%	0.0016%
自基金合同生效起至今	22.6486%	0.0016%	2.5650%	0.0000%	20.0836%	0.0016%

## 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	0.1378%	0.0003%	0.0885%	0.0000%	0.0493%	0.0003%
过去六个月	0.2993%	0.0003%	0.1761%	0.0000%	0.1232%	0.0003%
过去一年	0.6701%	0.0003%	0.3555%	0.0000%	0.3146%	0.0003%
过去三年	2.4303%	0.0006%	1.0712%	0.0000%	1.3591%	0.0006%
过去五年	5.9442%	0.0015%	1.7911%	0.0000%	4.1531%	0.0015%
自基金合同生效起至今	8.6601%	0.0014%	2.5600%	0.0000%	6.1001%	0.0014%

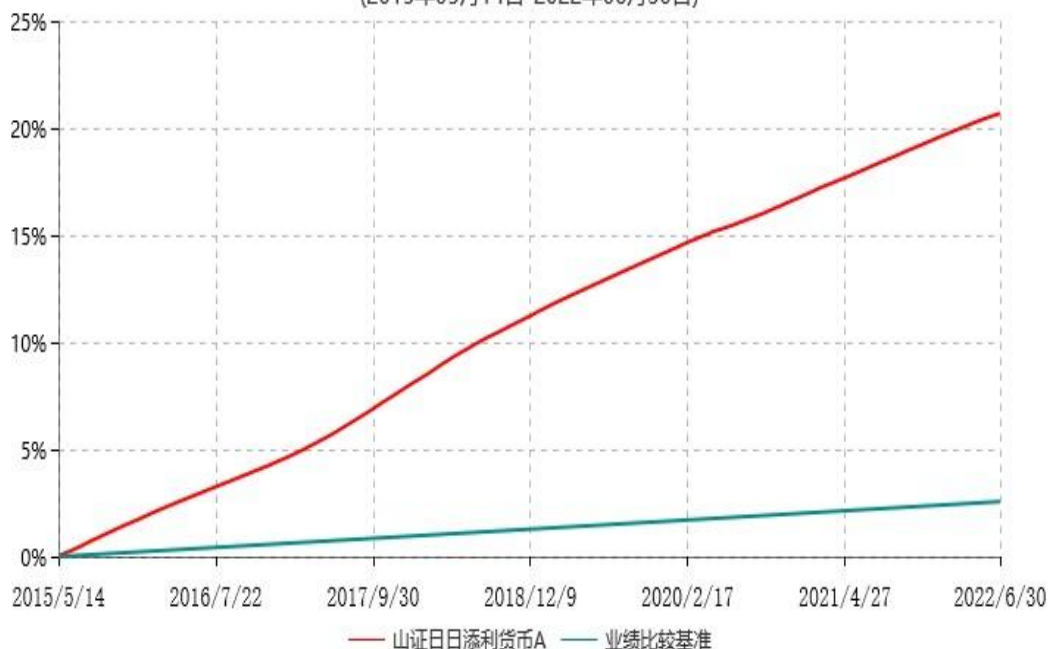
1、本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）；

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

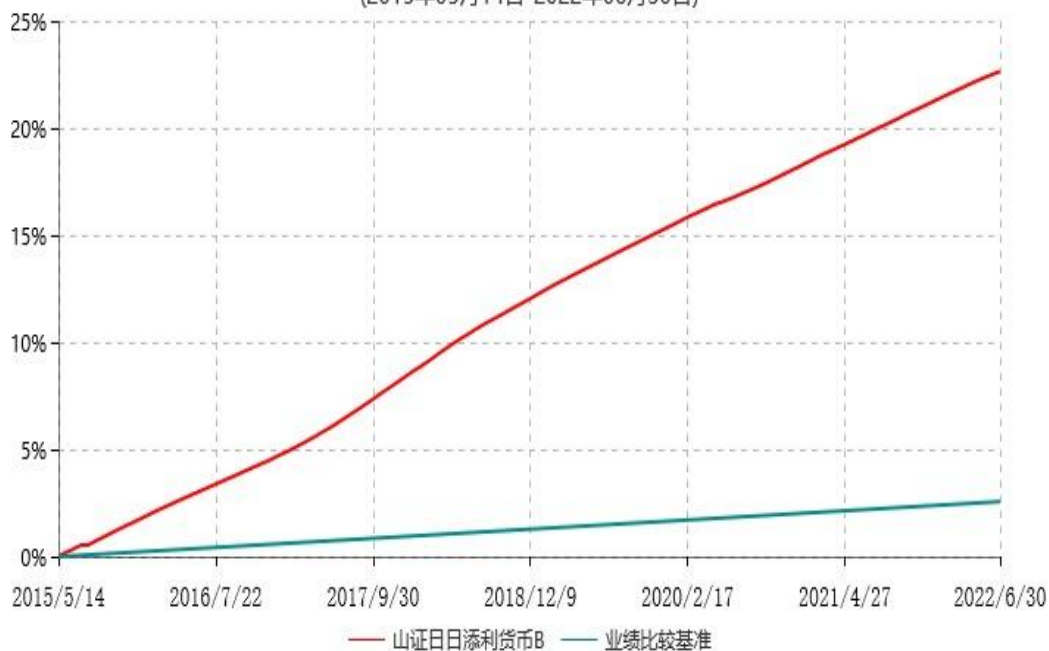
山证日日添利货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年05月14日-2022年06月30日)



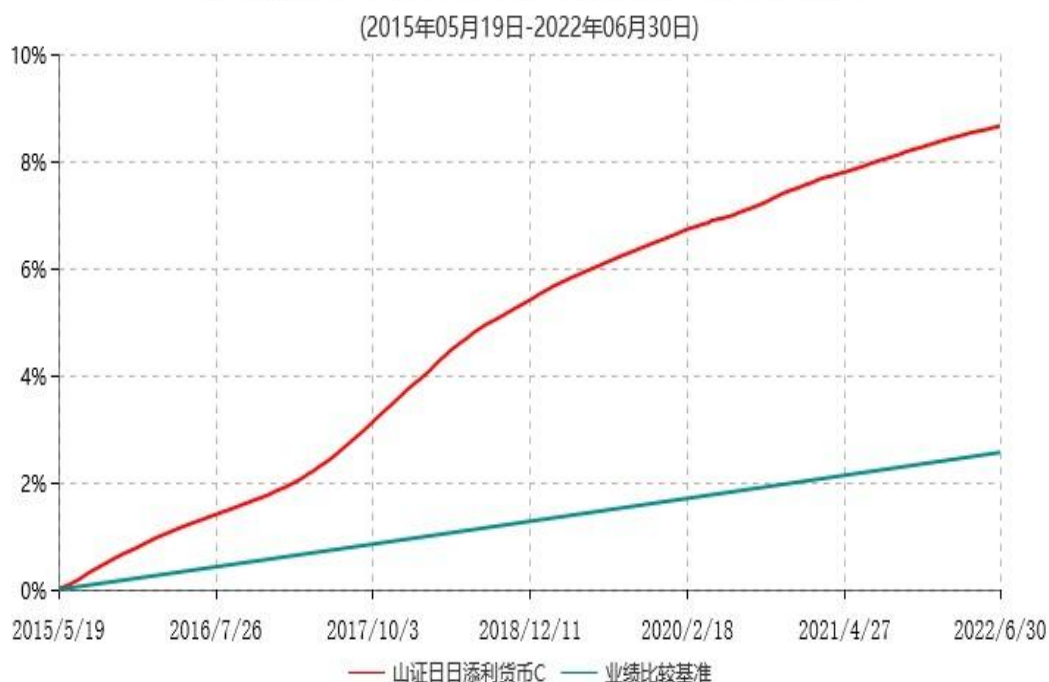
山证日日添利货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年05月14日-2022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



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		
刘凌云	本基金的基金经理	2020-07-01	-	15年	刘凌云女士，上海交通大学管理科学与工程专业硕士。2007年6月29日至2013年6月28日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5日至2015年4月27日任富国富钱包

				<p>货币市场基金基金经理；2014年8月5日至2015年4月27日任富国天时货币市场基金基金经理。2016年8月3日至2017年3月起担任中欧货币市场基金基金经理；2016年8月3日至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月起担任山西证券超短债债券型证券投资基金基金经理；2019年6月起担任山西证券裕睿6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2020年7月起担任山西证券日日添利货币市场基金基金经理；2021年7月起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1月起任山西证券90天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理。2022年4月起担任山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金、山西证券</p>
--	--	--	--	---

					裕亨增强债券型发起式证券投资基金基金经理。刘凌云女士具备基金从业资格。
缪佳	本基金的基金经理	2021-12-10	-	8 年	缪佳女士，新西兰梅西大学金融学硕士。2012年2月至2014年8月任上海国际货币经纪有限公司利率互换经纪。2014年8月至2016年7月任海通证券股份有限公司债券融资部债券销售交易经理。2016年7月至2017年11月，在长城证券股份有限公司任投资主办，管理定向专户。2017年11月加入山西证券股份有限公司资管固收部任投资主办，管理恒利系列集合资产管理计划和启睿系列集合资产管理计划，管理规模约50亿。2021年8月调入山西证券股份有限公司公募基金部。2021年12月10日担任山西证券日日添利货币市场基金、山西证券超短债债券型证券投资基金、山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券裕睿6个月定期开放债券型证券投资基金、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、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。2022年1月起担任山西证券90天滚

					动持有短债债券型证券投资基金基金经理。2022年5月起担任山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金、山西证券裕亨增强债券型发起式证券投资基金基金经理。缪佳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

二季度，上海疫情封城对经济影响较大，但整体冲击不如2020年武汉疫情，对于企业和居民预期的影响更大，因此疫情逐步消退后经济的修复程度不及2020年。由于经济下行压力比年初预想得更大，留抵退税、央行上缴利润、专项债发行等财政手段进度提前；货币政策总体保持稳健偏宽松，流动性较为充裕。

工业生产：弹性较大。1-5月工业增加值累计同比3.3%，为去年以来最小值，季度内经历了探底回升的过程，工业增加值环比（季调）从4月的-5.8%跃升至5月的5.61%。疫情对生产的影响除了直接的停工停产外，物流阻滞也会间接拖累非封控区的作业；但是一旦封控放开，生产也能较快恢复，这是2020年和今年共同表现出的特征。

消费：修复较慢。1-5月社零累计同比-1.5%，2-4月份环比（季调）连续3个月为负，历史上首次，5月虽然转正但依然较低，而在2020年武汉疫情与2021年南京疫情时期，消费环比均在降至0以下后的下个月迅速转正，体现了居民收入趋势下行的影响以及对于经济的悲观预期。结构上，疫情期间粮油食品等囤货需求相关商品大幅强于整体，而金银珠宝等可选消费以及餐饮等服务类消费明显弱于整体。由于居民消费信心的修复滞后于基本面，并且疫情仍可能在短期内不断反复，三季度消费难以大幅改善；结构上，政策倾斜较大的汽车消费可能是亮点。

固定资产投资：结构分化。1-5月份，固定资产投资增速为6.2%，地产、制造业和基建（不含电力）投资累计同比分别为 -4.0%、10.6%和6.7%。

基建投资：“稳增长”的主要抓手。2021年下半年开始，经济开启下行周期，基建也从去年四季度开始发力，疫情对基建的影响相对较小。支撑二季度乃至上半年基建的因素主要有以下三方面：第一，从今年各大会议和各种通知文件传达出的内容看，政府的投资意愿强；第二，专项债发行前置，财政支出向基建倾斜，上半年可用资金充足；第三，从建筑公司的订单变化看，上半年项目储备充足。考虑到短期内消费和地产可能对经济的支撑仍较弱，以及资金依然充足，我们预计三季度基建发力仍较为确定。

房地产投资：深坑后的缓坡。去年下半年以来地产本身就处于下行周期，疫情加剧了地产各项指标的下滑；虽然5月销售和投资当月增速较4月低点双双回升，但与2020年3月（疫情基本得到控制后的首月）相比，回升幅度较小。为了尽快遏制地产快速回落的趋势，今年以来特别是二季度以来多地放宽地产政策，其中不乏南京、苏州、青岛、东莞等强二线城市，且多有涉及“限购、限贷”；全国层面，5月15日，央行宣布在全国范围内下调首套房贷利率下限至5年期LPR-20bp，突破了“因城施策”的政策框架，信号意义明显；5月20日，5年期LPR又创纪录地调降15bp。得益于政策支撑、疫情后的补偿性修复以及低基数，地产投资可能在短期内筑底回升，然而，地产企业的资金问题依旧突出，企业和居民对于经济的预期依然偏弱，预计本轮地产的修复力度不强。

制造业投资：韧性背后的隐忧。在疫情最严重的4月，制造业投资表现得最为突出，环比甚至不弱于2017-2019年的同期水平，大规模的留抵退税提升了上半年企业的投资能力。后续制造业投资回落压力较大，一方面减税退税力度大概率减弱，另一方面企业可能已经进入主动去库周期，而主动去库常常对应着投资下降。

出口：外需回落但份额仍有支撑。1-5月出口累计同比13.5%，在各项经济指标中名列前茅。4月份出口大幅回落主要原因是停工停产和物流阻滞导致的份额回落，外需虽呈现下滑趋势，但依然偏强，5月出口增速快速反弹至高于疫情前的水平也主要源于份额的回归。后续外需或因加息持续推进而加速下滑，但欧洲份额中枢不断回落或支撑我国份额，预计我国出口的下行速度偏慢。

货币政策：4月中旬降准25bp，此外通过各种结构性工具（科技创新再贷款、普惠养老专项再贷款、普惠小微贷款等），以及下调银行负债端成本（鼓励下调存款利率、鼓励降低拨备覆盖率），希望激发实体的信贷需求。央行对资金面也较为呵护，除了降准和日常的逆回购操作外，上缴利润也为银行带来大量资金。在经济弱复苏的态势下，后续货币政策稳健偏宽松的基调预计难以发生改变。

财政政策：保主体、扩基建。4月1日至6月9日，已有14250亿元退税款退到纳税人账上；523国常会决定在更多行业实施留抵退税，目标额度增加1400亿，因此全年额度1.64万亿。专项债发行方面，二季度共发行2.10万亿，其中6月单月发行1.36万亿。预计三季度将主要聚焦于上半年各项政策落地效果，例如专项债形成实物工作量的情况、退税规模增加后有关行业的复苏情况、缓缴税费和补贴政策对行业修复和消费的拉动情况等。

疫情影响逐步消退，三季度中国经济或温和修复，但复苏动能较弱，不及2020年疫情后经济的修复速度。第一，疫情的长尾特征明显，不排除下半年小规模、小范围爆发的可能，除了对生产活动直接的限制外，对实体信心的压抑也将减缓消费和地产回升的速度。第二，20年疫情之前，经济本身已处于上升周期，因此短期冲击过后，经济能够迅速向趋势回归；而当前处于衰退末期或复苏前期，经济向上动能自然不足。第三，出口虽保持韧性，但方向回落比较确定。

本基金二季度合理把握配置节奏，在注重安全性和流动性的基础上，合理安排同业存款、存单、逆回购、高等级债券等资产的配置比例，控制账户久期及各项风控指标，组合整体运作平稳。

#### 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0.4689%，同期业绩比较基准收益率为0.0885%；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0.5316%，同期业绩比较基准收益率为0.0885%；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0.1378%，同期业绩比较基准收益率为0.0885%。

#### 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	3,878,447,921.45	72.36
	其中：债券	3,878,447,921.45	72.36
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	768,184,237.29	14.33
	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	613,046,838.87	11.44
4	其他资产	100,184,389.53	1.87
5	合计	5,359,863,387.14	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	-	0.68
	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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

### 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	26.55	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	13.02	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	15.68	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	36.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.24	-

### 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	223,127,743.72	4.17
	其中：政策性金融债	223,127,743.72	4.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	938,696,024.66	17.53
6	中期票据	342,509,742.33	6.40
7	同业存单	2,374,114,410.74	44.35
8	其他	-	-
9	合计	3,878,447,921.45	72.45
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	112216033	22上海银行CD033	2,000,000	199,512,591.34	3.73
2	112281578	22晋商银行CD027	1,000,000	99,897,848.48	1.87
3	112186201	21长沙银行CD154	1,000,000	99,820,461.19	1.86
4	112188612	21青岛农商行CD176	1,000,000	99,534,555.75	1.86
5	112189104	21郑州银行CD247	1,000,000	99,485,621.85	1.86
6	112295575	22徽商银行CD025	1,000,000	99,438,958.64	1.86
7	112280209	22华融湘江银行CD115	1,000,000	99,092,923.53	1.85
8	112108173	21中信银行CD173	1,000,000	99,066,129.28	1.85
9	112281314	22四川银行CD092	1,000,000	99,065,857.04	1.85
10	112213087	22浙商银行CD087	1,000,000	99,060,098.75	1.85

### 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	0.0841%
报告期内偏离度的最低值	0.0380%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0595%

#### 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 报告期内基金投资的前十名证券除青农商行（002958.SZ）外的其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。青岛银保监局于2022年1月26日对青岛农村商业银行股份有限公司出具行政处罚决定书。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 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	-
4	应收申购款	100,184,389.53

5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	100,184,389.53

#### 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	15,793,569.00	1,403,516,613.27	2,864,810,230.26
报告期期间基金总申购份额	16,917,996.62	2,021,330,386.04	16,853,965,006.70
报告期期间基金总赎回份额	17,667,070.32	1,629,927,826.26	16,175,105,552.48
报告期期末基金份额总额	15,044,495.30	1,794,919,173.05	3,543,669,684.48

### § 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	2022-04-01	38,834.21	38,834.21	0
2	红利发放	2022-04-06	189,012.82	189,012.82	0
3	红利发放	2022-04-07	37,193.27	37,193.27	0
4	红利发放	2022-04-08	36,547.69	36,547.69	0
5	红利发放	2022-04-11	107,086.89	107,086.89	0
6	红利发放	2022-04-12	35,472.64	35,472.64	0
7	红利发放	2022-04-13	33,807.89	33,807.89	0
8	红利发放	2022-04-14	34,644.24	34,644.24	0
9	红利发放	2022-04-15	34,288.10	34,288.10	0
10	红利发放	2022-04-18	102,856.37	102,856.37	0
11	红利发放	2022-04-19	33,462.60	33,462.60	0
12	红利发放	2022-04-20	34,232.53	34,232.53	0
13	红利发放	2022-04-21	34,113.74	34,113.74	0
14	红利发放	2022-04-22	34,146.33	34,146.33	0

15	红利发放	2022-04-25	102,871.47	102,871.47	0
16	红利发放	2022-04-26	34,635.84	34,635.84	0
17	红利发放	2022-04-27	34,661.50	34,661.50	0
18	红利发放	2022-04-28	34,475.12	34,475.12	0
19	红利发放	2022-04-29	34,654.93	34,654.93	0
20	红利发放	2022-05-05	210,725.84	210,725.84	0
21	红利发放	2022-05-06	34,503.71	34,503.71	0
22	红利发放	2022-05-09	98,583.43	98,583.43	0
23	红利发放	2022-05-10	33,217.22	33,217.22	0
24	红利发放	2022-05-11	33,053.17	33,053.17	0
25	红利发放	2022-05-12	32,608.81	32,608.81	0
26	红利发放	2022-05-13	32,364.41	32,364.41	0
27	红利发放	2022-05-16	96,499.27	96,499.27	0
28	红利发放	2022-05-17	31,870.53	31,870.53	0
29	红利发放	2022-05-18	31,744.70	31,744.70	0
30	红利发放	2022-05-19	31,978.35	31,978.35	0
31	红利发放	2022-05-20	31,980.96	31,980.96	0
32	红利发放	2022-05-23	95,357.88	95,357.88	0
33	红利发放	2022-05-24	31,730.31	31,730.31	0
34	红利发放	2022-05-25	31,659.34	31,659.34	0
35	红利发放	2022-05-26	32,219.86	32,219.86	0
36	红利发放	2022-05-27	32,193.67	32,193.67	0
37	红利发放	2022-05-30	96,191.95	96,191.95	0
38	红利发放	2022-05-31	32,475.13	32,475.13	0
39	红利发放	2022-06-01	32,747.11	32,747.11	0
40	红利发放	2022-06-02	32,491.70	32,491.70	0
41	红利发放	2022-06-06	128,012.85	128,012.85	0
42	红利发放	2022-06-07	31,553.60	31,553.60	0
43	红利发放	2022-06-08	30,978.47	30,978.47	0
44	红利发放	2022-06-09	30,671.78	30,671.78	0
45	红利发放	2022-06-10	30,034.17	30,034.17	0
46	红利发放	2022-06-13	89,006.32	89,006.32	0
47	红利发放	2022-06-14	29,409.40	29,409.40	0

48	红利发放	2022-06-15	29,135.98	29,135.98	0
49	红利发放	2022-06-16	29,339.66	29,339.66	0
50	红利发放	2022-06-17	29,306.04	29,306.04	0
51	红利发放	2022-06-20	86,824.87	86,824.87	0
52	红利发放	2022-06-21	28,986.93	28,986.93	0
53	红利发放	2022-06-22	28,966.20	28,966.20	0
54	红利发放	2022-06-23	28,725.70	28,725.70	0
55	红利发放	2022-06-24	29,417.18	29,417.18	0
56	红利发放	2022-06-27	89,499.00	89,499.00	0
57	红利发放	2022-06-28	30,553.44	30,553.44	0
58	红利发放	2022-06-29	30,463.86	30,463.86	0
59	红利发放	2022-06-30	30,848.76	30,848.76	0
合计			2,984,929.74	2,984,929.74	

## § 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：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

2022年07月20日