

## 山西证券日日添利货币市场基金(C类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2024年05月29日

送出日期：2024年05月31日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

|         |   |             |            |
|---------|---|-------------|------------|
| 基金简称    | 山证日日添利货币  | 基金代码        | 001175     |
| 基金简称C   | 山证日日添利货币C   | 基金代码C       | 001177     |
| 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 |
| 基金合同生效日 | 2015年05月14日   | 上市交易所及上市日期  | 暂未上市       |
| 基金类型    | 货币市场基金  | 交易币种        | 人民币        |
| 运作方式    | 契约型开放式  | 开放频率        | 每个开放日      |
| 基金经理    | 开始担任本基金基金经理的日期  | 证券从业日期      |            |
| 蓝烨      | 2023年03月14日   | 2013年07月30日 |            |
| 其他（若有）  | 《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的，在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当及时报告中国证监会并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。 |             |            |

注：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，基金代码：001175）根据所收取费用的差异，将基金份额分为A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额，不同份额类别分别制作基金产品资料概要。

## 二、基金投资与净值表现

## (一) 投资目标与投资策略

|      |   |
|------|---|
| 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。  |
| 投资范围 | 本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体如下：<br>1、现金；<br>2、一年以内（含一年）的银行定期存款、同业存单；<br>3、剩余期限在397天以内（含397天）的债券及非金融企业债务融资工具；<br>4、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；<br>5、期限在一年以内（含一年）的债券回购；<br>6、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券； |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>7、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。</p> <p>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。</p>   |
| 主要投资策略 | <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，发掘出具备相对价值的个券。</p> <p>3、银行存款投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、久期策略</p> <p>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。</p> <p>5、回购策略</p> <p>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。</p> <p>6、套利策略</p> <p>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）。</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p><b>7、现金流管理策略</b></p> <p>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。</p> |
| 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。   |

注：请投资者详见《山西证券日日添利货币市场基金招募说明书》第十部分

## （二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年03月31日



## （三）自基金合同生效以来基金每年的净值收益率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日  
单位%



### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

**申购费C：**本基金不收取申购费

**赎回费C：**本基金不收取赎回费

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别   | 收费方式/年费率或金额  | 收取方        |
|--------|--|------------|
| 管理费    | 0.30%  | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费    | 0.08%  | 基金托管人      |
| 销售服务费C | 0.025%   | 销售机构       |
| 审计费用   | 15,000.00  | 会计师事务所     |
| 信息披露费  | 120,000.00   | 规定披露报刊     |
| 增值服务费C | 1.50%  | 基金管理人和销售机构 |
| 其他费用   | 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、仲裁费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用，以及按照国家有关 | 相关服务机构     |

|  |  |  |
|--|--|--|
|  | 规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。具体详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。 |  |
|--|--|--|

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费和指数许可使用费（若有）为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

### （三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

|     | 基金运作综合费率（年化） |
|-----|--------------|
| 持有期 | 1.25%        |

注：1、基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

2、增值服务费率为《基金合同》原费率，现行费率请参见基金管理人发布的最新费率活动公告。

## 四、 风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金主要风险包括：1、市场风险：证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、通货膨胀风险。2、流动性风险：因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险等。3、信用风险：债券、资产支持证券、短期融资券等信用证券发行主体信用状况恶化，到期不能履行合约进行兑付的风险等。4、操作风险：基金运作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。5、管理风险。6、合规性风险：基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反基金合同有关规定的风险。7、政策变更风险：因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的的风险。

### （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站

网址：<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/> 客服电话：95573

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

## 六、其他情况说明

无。