

山西证券超短债债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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:2019年08月24日
§ 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人的董事、董监高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。
基金托管人以诚实信用、勤勉尽责的原则履行托管人职责，公平地对待其所托管的不同基金财产，保护基金份额持有人的合法权益。
基金管理人和基金托管人承诺根据《基金法》及其他法律法规的规定，诚实守信、勤勉尽责地履行基金合同和本托管协议规定的各项义务，严格控制基金的投资风险，以维护基金份额持有人的合法权益。
基金管理人和基金托管人就各自代表本基金管理人和本基金托管人履行本报告书所列明的职责，承诺根据《基金法》、基金合同和本托管协议的约定，对基金的运作实施监督，对违反法律法规、基金合同和本托管协议的事项，及时报告并提出纠正意见，防止损害基金份额持有人的利益。
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致基金财产或基金份额持有人受到损害的，应当承担相应的法律责任；因共同行为给基金份额持有人造成损害的，应先支付各自所欠的费用、赔偿责任。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况
基金名称 山证超短债基金
基金代码 000626
基金运作方式 约定期开放式
基金合同生效日 2019年01月21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
报告期末基金资产总额 336,791,12236.06
基金合同存续期间 不定期
下属分级基金的基金简称 山证超短债基金A 山证超短债基金C
下属分级基金的基金代码 000626 000627
报告期末下属分级基金的份额总额 250,399,567.18份 77,381,566.38份

2.2 基金产品说明

投资目标
本基金在保持资产较高流动性的前提下，力争取得超越业绩基准的收益。
本基金将充分运用管理经验，保持组合高流动性的基础上，实现超过业绩基准的回报。本基金的资产配置包括资产配置策略、久期策略及凸性策略，改善收益曲线形状，信用投资策略，中小企业私募债投资策略，资产支持证券投资策略，以及新股申购策略和国债期货投资策略。
业绩比较基准 中行货币基金(1年以下)指数收益率
风险收益特征 本基金为货币市场基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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》、《证券日报》

登载基金半年度报告正文的互联网网址: http://publicityfund.zxjtc.com:8000

基金年度报告年度报告披露地点:基金管理人及基金托管人住所

客户服务电话: 96673 966900

传真: 0351-5969693 021-67012126

注:2019年1月20日,本基金的信息披露报刊由《证券日报》变更为《中国证券报》

§ 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 本期利润构成	报告期2019年01月21日(基金合同生效日)-2019年06月30日			
本期初累计收益	4,303,375.06			
本期利润	4,624,826.26			
加权平均基金份额本期利润	0.0171			
本期基金份额净值	1.0700			
本期基金份额净值增长率为	1.07%			

注:1.本基金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)扣除交易费用后的余额,本期利润为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将降低。

3. 期间供款指用于申购基金的款项,从未分配利润中未分配利润中已实现部分的孰低(为零,不包括当期产生的)。

4. 本基金合同自2019年1月21日起生效,至2019年06月30日止满一年。

5. 基金合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期间计算,不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

山证超短债基金A

阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	差额(%)	①-③	②-④
过去一个月	0.32%	0.01%	0.31%	0.01%	0.00%
过去三个月	0.91%	0.02%	0.76%	0.01%	0.15%
自基金合同期生效起至今	1.70%	0.02%	1.41%	0.01%	0.20%

注:1.本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(1年以下)指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的对比图

注:1.本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(1年以下)指数收益率。

3.2.3 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位:人民币元

3.3.1 本期利润构成

报告期2019年01月21日(基金合同生效日)-2019年06月30日

山证超短债基金A

山证超短债基金C

本期初累计收益

4,993,476.16

本期利润

4,624,826.26

加权平均基金份额本期利润

0.0171

本期基金份额净值

924,070.77

本期基金份额净值增长率为

1.07%

注:1.本基金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)扣除交易费用后的余额,本期利润为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将降低。

3. 期间供款指用于申购基金的款项,从未分配利润中未分配利润中已实现部分的孰低(为零,不包括当期产生的)。

4. 本基金合同自2019年1月21日起生效,至2019年06月30日止满一年。

5. 基金合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期间计算,不按整个自然年度进行折算。

3.2.4 基金净值表现

3.2.5 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

山证超短债基金A

山证超短债基金C

份额净值增长率为

1.07%

注:1.本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(1年以下)指数收益率。

3.2.6 本期基金份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的对比图

注:1.本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(1年以下)指数收益率。

3.2.7 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位:人民币元

3.3.2 本期利润构成

报告期2019年01月21日(基金合同生效日)-2019年06月30日

山证超短债基金A

山证超短债基金C

本期初累计收益

4,303,375.06

本期利润

4,624,826.26

加权平均基金份额本期利润

0.0171

本期基金份额净值

924,070.77

本期基金份额净值增长率为

1.07%

注:1.本基金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)扣除交易费用后的余额,本期利润为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将降低。

3. 期间供款指用于申购基金的款项,从未分配利润中未分配利润中已实现部分的孰低(为零,不包括当期产生的)。

4. 本基金合同自2019年1月21日起生效,至2019年06月30日止满一年。

5. 基金合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期间计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 基金净值表现

3.3.1 本期利润构成

报告期2019年01月21日(基金合同生效日)-2019年06月30日

山证超短债基金A

山证超短债基金C

本期初累计收益

4,303,375.06

本期利润

4,624,826.26

加权平均基金份额本期利润

0.0171

本期基金份额净值

924,070.77

本期基金份额净值增长率为

1.07%

注:1.本基金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)扣除交易费用后的余额,本期利润为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将降低。

3. 期间供款指用于申购基金的款项,从未分配利润中未分配利润中已实现部分的孰低(为零,不包括当期产生的)。

4. 本基金合同自2019年1月21日起生效,至2019年06月30日止满一年。

5. 基金合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期间计算,不按整个自然年度进行折算。

3.4 基金管理费

3.4.1 基金管理人和基金经理的经营情况

山西证券股份有限公司,致力于提供广泛的股票、债券的