

2016 年度山西证券日日添利货币基金半年度报告

公告日期：2016-08-29

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。本半年度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 2016 年 8 月 17 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

基金基本情况

项目	数值		
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		
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	2015-05-14		
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	2,830,219,740.3		
基金合同存续期	不定期		
下属 3 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 3 级基金的场内简称	-	-	-
下属 3 级基金的交易代码	001175	001176	001177
报告期末下属 3 级基金的份 额总额	27412828.03	612500519.67	2190306392.6

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	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
姓名	薛永红	汤嵩彦
信息披露负责人	联系电话 0351-8686699	95559
	电子邮箱 xueyonghong@sxzq.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话	95573	95559
传真	0351-8686693	021-62701216
注册地址	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心西塔楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	030002	200120
法定代表人	侯巍	牛锡明

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://publiclyfund.sxzq.com:8000
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

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西塔楼

主要会计数据和财务指标

金额单位：

期间数据和指标	报告期（2016-01-01 至 2016-06-30）			
	山证日日添利货币	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	-	239,980.08	7,327,863.97	13,011,781.8
本期利润	-	239,980.08	7,327,863.97	13,011,781.8
加权平均基金份	-	-	-	-
额本期利润	-	-	-	-
本期加权平均净	-%	-%	-%	-%
值利润率	-%	-%	-%	-%

本期基金份额净值增长率	-%	-%	-%	-%
本期净值收益率	-%	1.2692%	1.3946%	0.5146%
报告期末 (2016-06-30)				
期末数据和指标	山证日日添利货币	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
期末可供分配利润	-	-	-	-
期末可供分配基金份额利润	-	-	-	-
期末基金资产净值	-	27,412,828.03	612,500,519.67	2,190,306,392.6
期末基金份额净值	-	1	1	1
报告期末 (2016-06-30)				
累计期末指标	山证日日添利货币	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
基金份额累计净值增长率	-%	-%	-%	-%
累计净值收益率	-%	3.1089%	3.2197%	1.3363%
期末还原后基金份额累计净值	-	-	-	-

注：1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、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。

3、本基金收益分配为按日结转份额。

本报告期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 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
过去一个月	0.1965%	0.0001%	0.0292%	0.0000%	0.1673%	0.0001%
过去三个月	0.6075%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.5190%	0.0002%
过去六个月	1.2692%	0.0004%	0.1771%	0.0000%	1.0921%	0.0004%
过去一年	2.7288%	0.0007%	0.3565%	0.0000%	2.3723%	0.0007%
自基金合同生效日起至 今(2015年 05月14日-	3.1089%	0.0010%	0.4033%	0.0000%	2.7056%	0.0010%

2016 年
06 月 30 日)

本报告期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 B

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
过去一个月	0.2172%	0.0001%	0.0292%	0.0000%	0.1880%	0.0001%
过去三个月	0.6695%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.5810%	0.0002%
过去六个月	1.3946%	0.0004%	0.1771%	0.0000%	1.2175%	0.0004%
过去一年	2.8032%	0.0019%	0.3565%	0.0000%	2.4467%	0.0019%
自基金合同 生效日起至 今(2015 年 05 月 14 日- 2016 年 06 月 30 日)	3.2197%	0.0019%	0.4033%	0.0000%	2.8164%	0.0019%

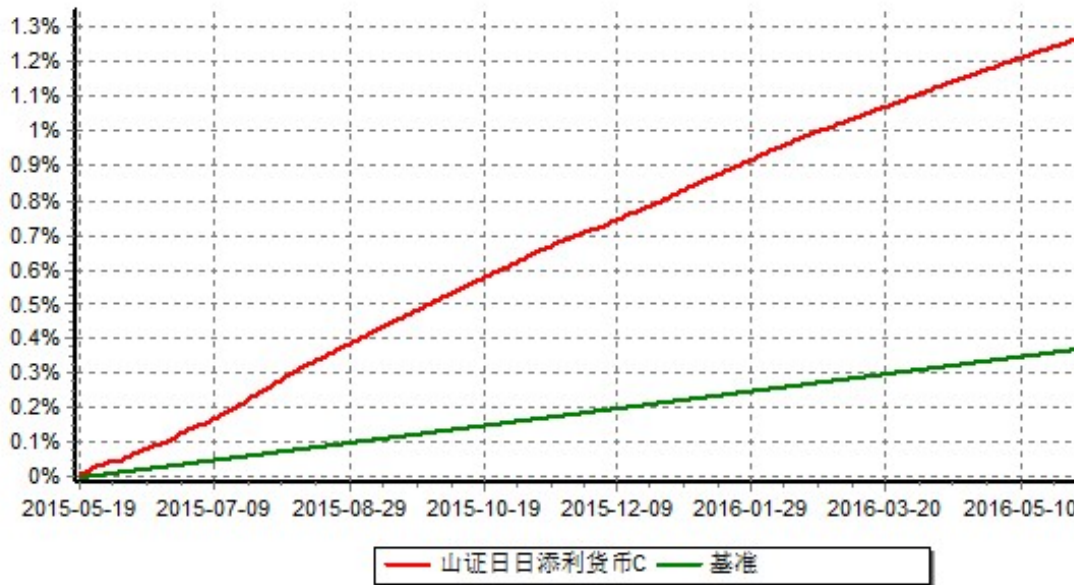
本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 C

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
过去一个月	0.0727%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.0435%	0.0002%
过去三个月	0.2320%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.1435%	0.0002%
过去六个月	0.5146%	0.0004%	0.1771%	0.0000%	0.3375%	0.0004%
过去一年	1.1958%	0.0007%	0.3565%	0.0000%	0.8393%	0.0007%
自基金合同 生效日起至 今(2015 年 05 月 19 日- 2016 年 06 月 30 日)	1.3363%	0.0008%	0.3984%	0.0000%	0.9379%	0.0008%

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 A



自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 B



基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

基金经理（或基金经理小组）简介
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。经过二

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	2015-05-14	-	12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。

注：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”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
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。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，公司在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个

环节对投资行为进行规范。通过《山西证券股份有限公司公募基金管理业务公平交易管理细则》、《山西证券股份有限公司公募基金管理业务集中交易管理细则》和《山西证券股份有限公司公募基金管理业务异常交易管理细则》对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。

本基金不参与股票投资业务，针对本基金参与的公开竞价债券投资部分，对公司管理的所有投资组合（完全复制的指数基金除外），连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公开竞价的证券进行了价差分析，并对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。针对银行间投资部分，对不同投资组合临近日的反向交易的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。本报告期内，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

-

报告期内基金投资策略和运作分析

中国经济仍然处于调整周期，主要的担忧是去杠杆。虽然工业增加值、消费、投资、进出口等月度数据会出现波动，但经济内生的动力还是不足的，这是主要矛盾。

政策上继续积极的财政政策和宽松的货币政策，资金面也持续宽裕，资金成本处于历史低位。无风险利率维持低位，权益市场缺乏系统机会，债券市场窄幅波动。本基金在充分考虑安全性和流动性的基础上，保持稳健的操作风格，适时调整组合资产的配置，维持中等偏上的债券仓位占比，防范市场和

流动性风险，同时自下而上精选短期信用债以防范个券的信用风险，为投资者提供稳健的投资收益。

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 1.2692%，同期业绩比较基准收益率为 0.1771%。

本报告期内本基金份额 B 净值收益率为 1.3946%，同期业绩比较基准收益率为 0.1771%。

本报告期内本基金份额 C 净值收益率为 0.5146%，同期业绩比较基准收益率为 0.1771%。

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。

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。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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

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。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016 年上半年度，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。

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

2016 年上半年度，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、基金资产净值的计算、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：239,980.08 元，向 B 级份额持有人分配利润：

7,327,863.97 元，向 c 级份额持有人分配利润：13,011,781.80 元。

托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016 年上半年度，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半年度报告中财务指标、净值表现、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。

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：2016-06-30

单位：

资产	本期末 2016-06-30	上年度末 2015-12-31
资产：		
银行存款	764,451,410.76	507,613,467.19
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,019,422,790.41	1,933,668,128.75
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,019,422,790.41	1,933,668,128.75
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	79,200,518.8	337,501,306.25
应收证券清算款	30,007,495.84	-
应收利息	40,796,468.75	55,497,080.74
应收股利	-	-
应收申购款	1,021,084.15	10,903.61
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,934,899,768.71	2,834,290,886.54
负债和所有者权益	本期末 2016-06-30	上年度末 2015-12-31
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	99,999,750	19,599,850.6
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	763,950.69	734,692.34
应付托管费	203,720.18	195,917.93
应付销售服务费	505,069.33	559,174.49
应付交易费用	50,287.7	46,497.36
应交税费	-	-
应付利息	5,674.66	3,271.72
应付利润	106,786.3	95,907.23
递延所得税负债	-	-

其他负债	3,044,789.55	3,355,430.75
负债合计	104,680,028.41	24,590,742.42
所有者权益：		
实收基金	2,830,219,740.3	2,809,700,144.12
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,830,219,740.3	2,809,700,144.12
负债和所有者权益总计	2,934,899,768.71	2,834,290,886.54

注：1、报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,830,219,740.30 份，其中 A 级基金份额总额 27,412,828.03 份，B 级基金份额总额 612,500,519.67 份，C 级基金份额总额 2,190,306,392.60 份。

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：2016-01-01 至 2016-06-30

单位：

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-06-30	2015-05-14 至 2015-06-30
一、收入	49,043,298.42	5,606,870.68
1. 利息收入	49,018,904.56	5,617,468.81
其中：存款利息收入	8,802,098.59	4,559,382.41
债券利息收入	32,703,166.41	545,499.88
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,513,639.56	512,586.52
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	24,393.86	-10,598.13
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	24,393.86	-10,598.13
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	28,463,672.57	3,233,122.58
1. 管理人报酬	4,607,309.41	484,999.03
2. 托管费	1,228,615.9	129,333.06

3. 销售服务费	3,174,695.62	367,533.55
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	472,999.12	99,955.5
其中：卖出回购金融资产支出	472,999.12	99,955.5
6. 其他费用	18,980,052.52	2,151,301.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	20,579,625.85	2,373,748.1
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	20,579,625.85	2,373,748.1

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：2016-01-01 至 2016-06-30

单位：

项目	本期		
	2016-01-01 至 2016-06-30		
	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）	2,809,700,144.1	-	2,809,700,144.1
	2		2
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,579,625.85	20,579,625.85
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）	20,519,596.18	-	20,519,596.18
其中：1. 基金申购款	28,941,587,891.96	-	28,941,587,891.96
2. 基金赎回款	-28,921,068,295.78	-	-28,921,068,295.78
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）	-	-20,579,625.85	-20,579,625.85
五、期末所有者权益（基金净值）	2,830,219,740.3	-	2,830,219,740.3
项目	上年度可比期间		
	2015-05-14 至 2015-06-30		
	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）	464,166,752.79	-	464,166,752.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,373,748.1	2,373,748.1
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）	1,061,643,089.57	-	1,061,643,089.57
其中：1. 基金申购款	11,390,232,455.69	-	11,390,232,455.69

2. 基金赎回款	-10,328,589,366	-	-10,328,589,366
	.12		.12
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）	-2,373,748.	-	-2,373,748.1
		1	
五、期末所有者权益（基金净值）	1,525,809,842.3	-	1,525,809,842.3
	6		6

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署；

基金管理人负责人：侯巍 主管会计工作负责人：樊廷让 会计机构负责人：张立德

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

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）。

2015年12月18日颁布了《货币市场基金监督管理办法》，于2016年2月1日起正式施行。其中规定货币市场基金的投资范围为现金；期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券，非金融企业债务融资工具、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。本公司已根据《货币市场基金监督管理办法》做出了相应调整。

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《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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〈年度报告和半年度报告〉》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《山西证券日日添利货币市场基金招募说明书》约定的资产估值和会计核算方法编制。

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2016年06月30日的财务状况以及2016年01月01日至2016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。

重要会计政策和会计估计

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。

会计年度

—

记账本位币

—

金融资产和金融负债的分类

—

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

—

金融资产和金融负债的估值原则

—

金融资产和金融负债的抵销

—

实收基金

—

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：

项目	本期末 2016-06-30
----	-------------------

活期存款	264,451,410.76
定期存款	500,000,000
其中：存款期限 1-3 个月	150,000,000
其中：存款期限 1 个月以内	-
其中：存款期限 3 个月以上	350,000,000
其他存款	-
合计	764,451,410.76

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

交易性金融资产

单位：

项目	本期末 2016-06-30			
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
交易所市场	-	-	-	-%
债券	2,019,422,790.4	2,018,198,00	-1,224,790.4	-0.0433%
银行间市场	1	0	1	
合计	2,019,422,790.4	2,018,198,00	-1,224,790.4	-0.0433%
	1	0	1	

注：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。

衍生金融资产/负债

单位：

项目	本期末 2016-06-30			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：

项目	本期末 2016-06-30	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	79,200,518.8	0
合计	79,200,518.8	0

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：元

项目	本期末						其中：已出售或再质押 总额
	债券代 码	债券名 称	约定返售 日	估值单 价	数量（张 ）	估值总 额	
	2016-06-30						

注：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。

应收利息

单位：

项目	本期末 2016-06-30
应收活期存款利息	115,361.93
应收定期存款利息	3,370,765.03
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	37,293,869.27
应收买入返售证券利息	16,472.52
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	40,796,468.75

其他资产

单位：

项目	本期末 2016-06-30
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	-

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

应付交易费用

单位：

项目	本期末 2016-06-30
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	50,287.7
合计	50,287.7

其他负债

单位：

项目	本期末 2016-06-30
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	57,184.4
其他应付	2,987,605.15
合计	3,044,789.55

实收基金

单位：

项目	本期末 2016-06-30					
	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	
	基金份额 (份)	账面金额	基金份额 (份)	账面金额	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	10,123,855.09	10,123,855.09	7,542,784.47	7,542,784.47	2,792,033,504.56	2,792,033,504.56
本期申购	78,456,947.93	78,456,947.93	1,331,637,209.27	1,331,637,209.27	27,531,493,734.76	27,531,493,734.76
本期赎回 (以“-”号填列)	-61,167,974.99	-61,167,974.99	-726,679,474.07	-726,679,474.07	-28,133,220,846.72	-28,133,220,846.72
基金拆分/份额折算前	-	-	-	-	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-	-	-	-	-
本期申购	-	-	-	-	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-	-	-	-	-
本期末	27,412,828.03	27,412,828.03	612,500,519.67	612,500,519.67	2,190,306,392.6	2,190,306,392.6

注：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。

未分配利润

单位：

项目	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		
	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计	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	239,980.08	-	239,980.08	7,327,863.97	-	7,327,863.97	13,011,781.8	-	13,011,781.8
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	-239,9	-	-239,98	-7,327,	-	-7,327,	-13,011	-	-13,011,

	80.08	0.08	863.97	863.97	,781.8	781.8
本期末	-	-	-	-	-	-

存款利息收入

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
活期存款利息收入		2,379,957.89
定期存款利息收入		6,422,140.7
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		-
其他		-
合计		8,802,098.59

股票投资收益

股票投资收益项目构成

单位:

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
合计		-

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
卖出股票成交总额		-
减: 卖出股票成本总额		-
买卖股票差价收入		-

股票投资收益——赎回差价收入

单位:

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
赎回基金份额对价总额		-
减: 现金支付赎回款总额		-
减: 赎回股票成本总额		-
赎回差价收入		-

股票投资收益——申购差价收入

单位：

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
申购基金份额总额		-
减：现金支付申购款总额		-
减：申购股票成本总额		-
申购差价收入		-

基金投资收益

单位：

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
卖出/赎回基金成交总额		-
减：卖出/赎回基金成本总额		-
基金投资收益		-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：

项目	本期		上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-06-30		2015-05-14 至 2015-06-30
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入		24,393.86	-
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		24,393.86	-10,598.13

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：

项目	本期		上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-06-30		2015-05-14 至 2015-06-30
卖出债券(、债转股及债券 到期兑付)成交总额		1,796,550,876.47	-
减：卖出债券(、债转股及 债券到期兑付)成本总额		1,725,712,916.46	-
减：应收利息总额		70,813,566.15	-
买卖债券差价收入		24,393.86	-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-06-30	2015-05-14 至 2015-06-30
赎回基金份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回债券成本总额	-	-
减：赎回债券应收利息总额	-	-
赎回差价收入	-	-

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

债券投资收益——申购差价收入

单位：

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-06-30	2015-05-14 至 2015-06-30
申购基金份额对价总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购债券成本总额	-	-
减：申购债券应收利息总额	-	-
申购差价收入	-	-

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

资产支持证券投资收益

单位：

项目	本期
	2016-01-01 至 2016-06-30
卖出资产支持证券成交总额	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应收利息总额	-
资产支持证券投资收益	-

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

贵金属投资收益

贵金属投资收益项目构成

单位：

项目	本期
	2016-01-01 至 2016-06-30
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-
合计	-

贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位:

项目	本期 2016-01-01 至 2016-06-30
卖出贵金属成交总额	-
减: 卖出贵金属成本总额	-
买卖贵金属差价收入	-

贵金属投资收益——赎回差价收入

单位:

项目	本期 2016-01-01 至 2016-06-30
赎回贵金属份额对价总额	-
减: 现金支付赎回款总额	-
减: 赎回贵金属成本总额	-
赎回差价收入	-

贵金属投资收益——申购差价收入

单位:

项目	本期 2016-01-01 至 2016-06-30
申购贵金属份额总额	-
减: 现金支付申购款总额	-
减: 申购贵金属成本总额	-
申购差价收入	-

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位:

项目	本期 2016-01-01 至 2016-06-30
卖出权证成交总额	-
减: 卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	-

注: 本基金本报告期无衍生工具收益。

衍生工具收益——其他投资收益

项目	本期收益金额 2016-01-01 至 2016-06-30
----	-----------------------------------

股利收益

单位:

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
股票投资产生的股利收益		-
基金投资产生的股利收益		-
合计		-

注：本基金本报告期无股利收益。

公允价值变动收益

单位：

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
1. 交易性金融资产		-
——股票投资		-
——债券投资		-
——资产支持证券投资		-
——基金投资		-
——贵金属投资		-
——其他		-
2. 衍生工具		-
——权证投资		-
3. 其他		-
合计		-

注：本基金本报告期无公允价值变动收益。

其他收入

单位：

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
基金赎回费收入		-
合计		-

注：本基金本报告期无其他收入。

交易费用

单位：

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
交易所市场交易费用		-
银行间市场交易费用		-
合计		-

注：本基金本报告期无交易费用。

其他费用

单位：

项目	本期	
	2016-01-01 至 2016-06-30	
审计费用		7,458.36

信息披露费	49,726.04
帐户维护费	18,200
汇划手续费	200
增值服务费 C	18,904,468.12
合计	18,980,052.52

分部报告

-

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

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。

关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
山西证券股份有限公司	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
龙华启富投资有限责任公司	基金管理人的全资子公司

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016-01-01 至 2016-06-30		2015-05-14 至 2015-06-30	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

单位：元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016-01-01 至 2016-06-30		2015-05-14 至 2015-06-30	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

金额单位：

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016-01-01 至 2016-06-30		2015-05-14 至 2015-06-30	
	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
-	-	-%	677,300,000	100%
山西证券股份有限公司	30,000,000	100%	-	-%

基金交易

单位：元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016-01-01 至 2016-06-30		2015-05-14 至 2015-06-30	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

权证交易

单位：元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016-01-01 至 2016-06-30		2015-05-14 至 2015-06-30	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

应支付关联方的佣金

单位：元

关联方名称	本期			
	2016-01-01 至 2016-06-30			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
关联方名称	上年度可比期间			
	2015-05-14 至 2015-06-30			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

关联方报酬

基金管理费

单位：

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-06-30	2015-05-14 至 2015-06-30
当期发生的基金应支付的管理费	4,607,309.41	484,999.03
其中：支付销售机构的客户维护费	6.02	0

注：支付基金管理人山西证券股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.3% / 当年天数。

基金托管费

单位：

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-06-30	2015-05-14 至 2015-06-30
当期发生的基金应支付的管 理费	1,228,615.9	129,333.06

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

销售服务费

单位：

获得销售服务费的各关联方名称	本期				合计
	2016-01-01 至 2016-06-30				
	当期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		
山西证券股份有限公司	23,942.66	3,150,744.65	3,150,744.65		3,174,687.31
交通银行	8.22	-	-		8.22
好买基金	0.09	-	-		0.09
合计	23,950.97	3,150,744.65			3,174,695.62

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间				合计
	2015-05-14 至 2015-06-30				
	当期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	山证日日添利 货币	
山西证券股份有限公司	12,664.87	354,868.68	354,868.68	367,533.55	
合计	12,664.87	354,868.68		367,533.55	

注：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

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：元

本期
2016-01-01 至 2016-06-30

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间						
2015-05-14 至 2015-06-30						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注：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。

各关联方投资本基金的情况

报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期			上年度可比期间		
	2016-01-01 至 2016-06-30			2015-05-14 至 2015-06-30		
	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	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（2015-05-14）持有的基金份额	-	-	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	0	-	-	0	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-	-	-

注：关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

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

项目	山证日日添利货币 A		
	本期末	上年度末	
	2016-06-30	2015-12-31	
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
项目	山证日日添利货币 B		
	本期末	上年度末	
	2016-06-30	2015-12-31	

项目	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
	山证日日添利货币 C			
	本期末 2016-06-30	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2015-12-31	持有的基金份额占基金总份额的比例
-	-	-	18,268.41	0.0000065
龙华启富投资有限责任公司	1,204,174.37	0.0004255	-	-

注：关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

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：

关联方名称	本期 2016-01-01 至 2016-06-30		上年度可比期间 2015-05-14 至 2015-06-30	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	-	-	-	121,518,788.76
-	-	-	60,000,000	296,000.16
交通银行活期存款	264,451,410.76	2,379,957.89	-	-
交通银行定期存款	50,000,000	1,841,902.79	-	-

注：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。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2016-01-01 至 2016-06-30	
				基金在承销期内买入数量（单位：股/张）	总金额
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间 2015-05-14 至 2015-06-30	
				基金在承销期内买入数量（单位：股/张）	总金额

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

其他关联交易事项的说明

无。

利润分配情况

利润分配情况——货币市场基金

单位：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
13,048,165.85	-	-36,384.05	13,011,781.80	-

期末（2016-06-30）本基金持有的流通受限证券

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：元

受限证券类别：股票										
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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
受限证券类别：债券										
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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
041553049	15 中铝业 CP001	2016-07-01	99.94	500,000	49,970,000
011515009	15 中铝业 SCP009	2016-07-01	99.93	400,000	39,972,000
011515011	15 中铝业 SCP011	2016-07-01	99.84	100,000	9,984,000
合计				1,000,000	99,926,000

交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 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。

金融工具风险及管理

风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、公募基金管理业务合规负责人、合规总监、合规管理部、稽核考核部、风险控制部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制预期可承受的范围之内。

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，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，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家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，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司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对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：元

短期信用评级	本期末	上年度末
	2016-06-30	2015-12-31
A-1	1,699,467,417.18	1,623,652,023.12
A-1 以下	0	0
未评级	319,955,373.23	310,016,105.63
合计	2,019,422,790.41	1,933,668,128.75

按长期信用评级列示的债券投资

单位：元

长期信用评级	本期末	上年度末
	2016-06-30	2015-12-31
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级的债券投资。

流动性风险

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，且能够通过提前支取定期存款和出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

证监会2015年12月17日颁布了《货币市场基金监督管理办法》，规定了货币市场基金遇到其持有的金融工具出现兑付风险；货币市场基金发生巨额赎回，且持有资产的流动性难以满足赎回要求等情形时，基金管理人及其股东在履行内部程序后，可以使用固有资金从货币市场基金购买金融工具。有效保障基金持有人利益。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：元

本期末	
2016-06-30	合计
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-
流动性净额	-
上年度末	
2015-12-31	合计
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-
流动性净额	-

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。

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，以摊余成本计价，每日通过“影子定价”对本基金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。

利率风险敞口

单位：元

本期末 2016-06-30	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	564,451,410.76	200,000,000.00	0	0	0	0	764,451,410.76
交易性金融资产	420,052,725.67	450,151,611.99	1,149,218,452.75	0	0	0	2,019,422,790.41
买入返售金融资产	79,200,518.8	0	0	0	0	0	79,200,518.8
应收证券清算款	0	0	0	0	0	30,007,495.84	30,007,495.84
应收利息	0	0	0	0	0	40,796,468.75	40,796,468.75
应收申购款	0	0	0	0	0	1,021,084.15	1,021,084.15
资产总计	1,063,704,655.23	650,151,611.99	1,149,218,452.75	-	-	71,825,048.74	2,934,899,768.71
卖出回购金融资产款							
卖出回购金融资产款	99,999,750	0	0	0	0	0	99,999,750
应付管理人报酬	0	0	0	0	0	763,950.69	763,950.69
应付托管费	0	0	0	0	0	203,720.18	203,720.18
应付销售服务费	0	0	0	0	0	505,069.33	505,069.33

应付交易费用	0	0	0	0	0	50,287.7	50,287.7
应付利息	0	0	0	0	0	5,674.66	5,674.66
应付利润	0	0	0	0	0	106,786.3	106,786.3
其他负债	0	0	0	0	0	3,044,789.55	3,044,789.55
负债总计	99,999,750	-	-	-	-	4,680,278.41	104,680,028.41
利率敏感度缺口	963,704,905.23	650,151,611.99	1,149,218,452.75	-	-	67,144,770.33	2,830,219,740.3
上年度末	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
2015-12-31							
资产							
银行存款	157,613,467.19	200,000,000.00	150,000,000.00	0	0	0	507,613,467.19
交易性金融资产	30,024,044.22	641,398,805.81	1,262,245,278.72	0	0	0	1,933,668,128.75
买入返售金融资产	337,501,306.25	0	0	0	0	0	337,501,306.25
应收利息	0	0	0	0	0	55,497,080.74	55,497,080.74
应收申购款	0	0	0	0	0	10,903.61	10,903.61
资产总计	525,138,817.66	841,398,805.81	1,412,245,278.72	-	-	55,507,984.35	2,834,290,886.54
卖出回购金融资产款	19,599,850.6	0	0	0	0	0	19,599,850.6
应付管理人报酬	0	0	0	0	0	734,692.34	734,692.34
应付托管费	0	0	0	0	0	195,917.93	195,917.93
应付销售服务费	0	0	0	0	0	559,174.49	559,174.49
应付交易费用	0	0	0	0	0	46,497.36	46,497.36

应付利息	0	0	0	0	0	3,271.72	3,271.72
应付利润	0	0	0	0	0	95,907.23	95,907.23
其他负债	0	0	0	0	0	3,355.43	3,355.43
负债总计	19,599,850.6	-	-	-	-	4,990.89	24,590,742.42
利率敏感度缺口	505,538,967.06	841,398,805.81	1,412,245,278.72	-	-	50,517,092.53	2,809,700,144.12

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

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）

相关风险变量的变动 分析	本期末	上年度末
	2016-06-30	2015-12-31
市场利率下降 25 个基点	1,941,530.74	-
市场利率上升 25 个基点	-1,938,700.522	-

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。

外汇风险敞口

单位：元

项目	本期末			合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末			合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风				
险敞口净额	-	-	-	-

外汇风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末	上年度末
		2016-06-30	2015-12-31

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。

其他价格风险敞口

金额单位：元

项目	本期末		上年度末	
	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	-	-	-	-
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	-	-	-	-

其他价格风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末	上年度末
		2016-06-30	2015-12-31

采用风险价值法管理风险

假设	-		
	-		
分析	风险价值（金额单位：元）	本期末 2016-06-30	上年度末 2015-12-31

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

1、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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相同。

2、以公允价值计量的金融工具

(1) 各层次金融工具公允价值

于2016年6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2,019,422,790.41元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

2016年度，对于以公允价值计量的金融工具，无由第一层次转入第二层次及由第二层次转入第一层次的投资。

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

(3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	2,019,422,790.41	68.81
	其中：债券	2,019,422,790.41	68.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	79,200,518.8	2.7
	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	764,451,410.76	26.05
4	其他各项资产	71,825,048.74	2.45
5	合计	2,934,899,768.71	100

债券回购融资情况

金额单位：元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额		1.12
	其中：买断式回购融资		-
2	报告期末债券回购融资余额	99,999,750	3.53
	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

金额单位：元

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
----	------	-------------------	----	-----

注：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%。

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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
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 180 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
----	------	--------	----	-----

注：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。

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	37.94	3.53
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	9.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	17.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	22.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天	-	-

的浮动利率债		
合计	102.22	3.53

期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

序号	债券品种	公允价值（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	59,992,093.07	2.12
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,959,430,697.34	69.23
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,019,422,790.41	71.35
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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：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	041664009	16 甘公投 CP001	900,000	89,848,524.14	3.17
2	041572017	15 日照港 CP002	700,000	70,036,706.29	2.47
3	041562041	15 昆山创业 CP001	600,000	60,016,166.43	2.12
4	041551028	15 象屿 CP001	600,000	60,000,514.17	2.12
5	041569028	15 昆交产 CP001	500,000	50,027,207.25	1.77
6	041553049	15 中铝业 CP001	500,000	50,018,015.31	1.77
7	041558095	15 鲁国投 CP001	500,000	50,017,013.08	1.77
8	041552029	15 渝南 CP001	500,000	50,010,738.92	1.77
9	041562047	15 渝轨交 CP001	500,000	50,008,840.78	1.77
10	011699369	16 徐工 SCP001	500,000	49,999,188.24	1.77

“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	0.0861%
报告期内偏离度的最低值	-0.0685%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0409%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
----	------	-----	----	-----

注：无。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
----	------	-----	----	-----

注：无。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

基金计价方法说明

投资组合报告附注

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。

期末资产组合情况

单位：元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	30,007,495.84
3	应收股利	-
4	应收利息	40,796,468.75
5	应收申购款	1,021,084.15
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	71,825,048.74

投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

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。

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

一、2015年12月17日，汤建雄先生辞去公司财务总监职务。公司第三届董事会第九次会议审议通过《关于聘任公司合规总监的议案》，聘任汤建雄先生担任公司合规总监，为公司的合规负责人，任期

与公司第三届董事会任期一致。汤建雄先生自 2016 年 1 月 5 日起正式履行公司合规总监职责。公司董事会于 2016 年 5 月 4 日收到董事王拴红先生的辞职申请。王拴红先生因工作原因，向公司董事会申请辞去第三届董事会董事职务，同时申请辞去第三届董事会战略发展委员会委员职务。根据相关法律法规和《公司章程》的规定，王拴红先生的辞职申请自 2016 年 5 月 4 日送达公司董事会时生效。

二、本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内不存在涉及基金管理人或基金财产的法律诉讼案件；
本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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。

改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高管未受到稽查或处罚；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。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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：元

券商名称	交易单元数量	股票交易		基金交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期比例	成交金额	占当期比例	成交金额	占当期比例	成交金额	占当期比例	成交金额	占当期比例	成交金额	占当期比例	
山西证券	2	0	0%	-	-%	0	0%	00,0	100%	0	0%	0	0%	-
								30,000						

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定。经营行为规范，内控制度健全；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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在租赁其他证券公司的交易单元。

偏离度绝对值超过 0.5%的情况

项目	发生日期	偏离度	法定披露报刊	法定披露日期
报告期内偏离度绝	-	-	-	-

对值在 0.5% (含)

以上

注：无。

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 2015 年度资产净值公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-01-04
2	山西证券日日添利货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-01-22
3	山西证券日日添利货币市场基金 2015 年年度报告	本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-03-29
4	山西证券日日添利货币市场基金 2015 年年度报告摘要	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-03-29
5	山西证券日日添利货币市场基金增加销售机构的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-04-01
6	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金增加诺亚正行为销售机构的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-04-08
7	关于山西证券旗下部分公募基金增加天天基金为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-04-14
8	山西证券日日添利货币市场基金 2016 年第一季度度报告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-04-21
9	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金增加众禄金融为销售机构的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-06-07
10	山西证券日日添利货币市场基金更新招募说明书(2016 年第 1 号)	本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-06-28
11	山西证券日日添利货币市场基金更新招募说明书摘要(2016 年第 1 号)	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-06-28
12	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金参与交通银行申购费率优惠活动的公告	本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-06-28
13	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金参加好买基金网费率优惠活动的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2016-06-28

注：本报告期内，公司按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定，每个开放日公布基金每万份收益和 7 日年化收益率。

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)	持有人均持有的基金份额	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	1,183	23,172.3	5,573,513.99	20.33%	21,839,314.04	79.67%

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	2 306,250,259.84	606,450,291.68	99.01%	6,050,227.99	0.99%
32,116	68,199.85	114,798,559.69	5.24%	2,075,507,832.91	94.76%
33,301	84,989.03	726,822,365.36	25.68%	2,103,397,374.94	74.32%

注：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）。

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	700,844.86	2.56%
	山证日日添利货币 B	0	0%
	山证日日添利货币 C	132,649.7	0.006056%
	合计	833,494.56	0.03%

注：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）。

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的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	山证日日添利货币 A	0
	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
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	山证日日添利货币 A	0
	山证日日添利货币 B	0
	山证日日添利货币 C	0
	合计	0

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目	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
基金合同生效日的基金 份额总额	190,332,531.91	273,834,220.88	-
本报告期期初基金 份额总额	10,123,855.09	7,542,784.47	2,792,033,504.56
本报告期基金总申	78,456,947.93	1,331,637,209.27	27,531,493,734.76

购份额			
减：本报告期基金总赎回份额	61,167,974.99	726,679,474.07	28,133,220,846.72
本报告期末基金份额总额	27,412,828.03	612,500,519.67	2,190,306,392.6

发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-%	-	-%	-
基金管理人高级管理人员	-	-%	-	-%	-
基金经理等人员	-	-%	-	-%	-
基金管理人股东	-	-%	-	-%	-
其他	-	-%	-	-%	-
合计	-	-%	-	-%	-

影响投资者决策的其他重要信息

无。

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。

存放地点

太原市府西街 69 号山西国际贸易中心。

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印件或复印件。

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>