山西证券日日添利货币市场基金

2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 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

送出日期:2019 年 03 月 27 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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2019年3月22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已经审计，中喜会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2018年01月01日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 12
§4 管理人报告 13
4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 19
4.9 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 19
4.10 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 19
§5 托管人报告 19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 19
5.2 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 19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 20
§6 审计报告 20
6.1 审计报告基本信息 20
6.2 审计报告的基本内容 20
§7 年度财务报表 22
7.1 资产负债表 22
7.2 利润表 24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 26
7.4 报表附注 28
§8 投资组合报告 58
8.1 期末基金资产组合情况 58
8.2 债券回购融资情况 58
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明 59
8.3 基金投资组合平均剩余期限 59
8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况 59
8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例 59
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 60
8.6 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 60
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 61

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明 61
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明 61
8.8 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 61
8.9 投资组合报告附注 61
8.9.1 基金计价方法说明 62
8.9.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。 62
8.9.3 期末其他各项资产构成 62
8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分 62
§9 基金份额持有人信息 62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 62
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 63
9.4 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情况 64
§10 开放式基金份额变动 64
§11 重大事件揭示 65
11.1 基金份额持有人大会决议 65
11.2 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 65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 66
11.4 基金投资策略的改变 66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 67
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 68
11.9 其他重大事件 68
§12 影响投资者决策的其他重要信息 71
12.1 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 71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 72
§13 备查文件目录 72
13.1 备查文件目录 72
13.2 存放地点 72
13.3 查阅方式 72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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		
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		
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	2,307,196,674.93份		
基金合同存续期	不定期		
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	16,826,733.32份	282,154,853.15份	2,008,215,088.46份

2.2 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。

2.3 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
信息披	姓名	薛永红	陆志俊

露负责人	联系电话	95573	95559
	电子邮箱	xueyonghong@sxzq.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95573	95559
传真		0351-8686693	021-62701216
注册地址		山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		030002	200336
法定代表人		侯巍	彭纯

2.4 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	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中喜会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区崇文门外大街11号新成文化大厦A座11层
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东塔楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年			2017年			2016年		
	山证日日	山证日日	山证日日	山证日日	山证日日	山证日日	山证日日	山证日日	山证日日

	添利货币A	添利货币B	添利货币C	添利货币A	添利货币B	添利货币C	添利货币A	添利货币B	添利货币C
本期已实现收益	256,535.11	10,706,682.98	35,549,440.94	477,917.47	16,811,875.83	36,157,406.45	566,372.31	17,477,644.21	24,319,566.91
本期利润	256,535.11	10,706,682.98	35,549,440.94	477,917.47	16,811,875.83	36,157,406.45	566,372.31	17,477,644.21	24,319,566.91
本期净值收益率	3.2705%	3.5291%	1.7334%	3.3896%	3.6507%	1.8511%	2.5117%	2.7682%	0.9862%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末			2017年末			2016年末		
期末基金资产净值	16,826,733.32	282,154,853.15	2,008,215,088.46	9,372,426.10	322,142,985.29	1,732,837,650.56	17,284,525.76	877,540,214.57	2,097,047,531.36
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2018年末			2017年末			2016年末		
累计净值收益率	11.4411%	12.2642%	5.4938%	7.9119%	8.4373%	3.6964%	4.3740%	4.6180%	1.8117%

注：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、本基金无持有人申购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配为按日结转份额。

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

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.7254%	0.0003%	0.0895%	0.0000%	0.6359%	0.0003%
过去六个月	1.4716%	0.0005%	0.1790%	0.0000%	1.2926%	0.0005%
过去一年	3.2705%	0.0011%	0.3555%	0.0000%	2.9150%	0.0011%
过去三年	9.4527%	0.0014%	1.0712%	0.0000%	8.3815%	0.0014%
自基金合同生效起至今	11.4411%	0.0014%	1.2995%	0.0000%	10.1416%	0.0014%

山证日日添利货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.7884%	0.0003%	0.0895%	0.0000%	0.6989%	0.0003%
过去六个月	1.5992%	0.0005%	0.1790%	0.0000%	1.4202%	0.0005%
过去一年	3.5291%	0.0011%	0.3555%	0.0000%	3.1736%	0.0011%
过去三年	10.2792%	0.0014%	1.0712%	0.0000%	9.2080%	0.0014%
自基金	12.2642%	0.0017%	1.2995%	0.0000%	10.9647%	0.0017%

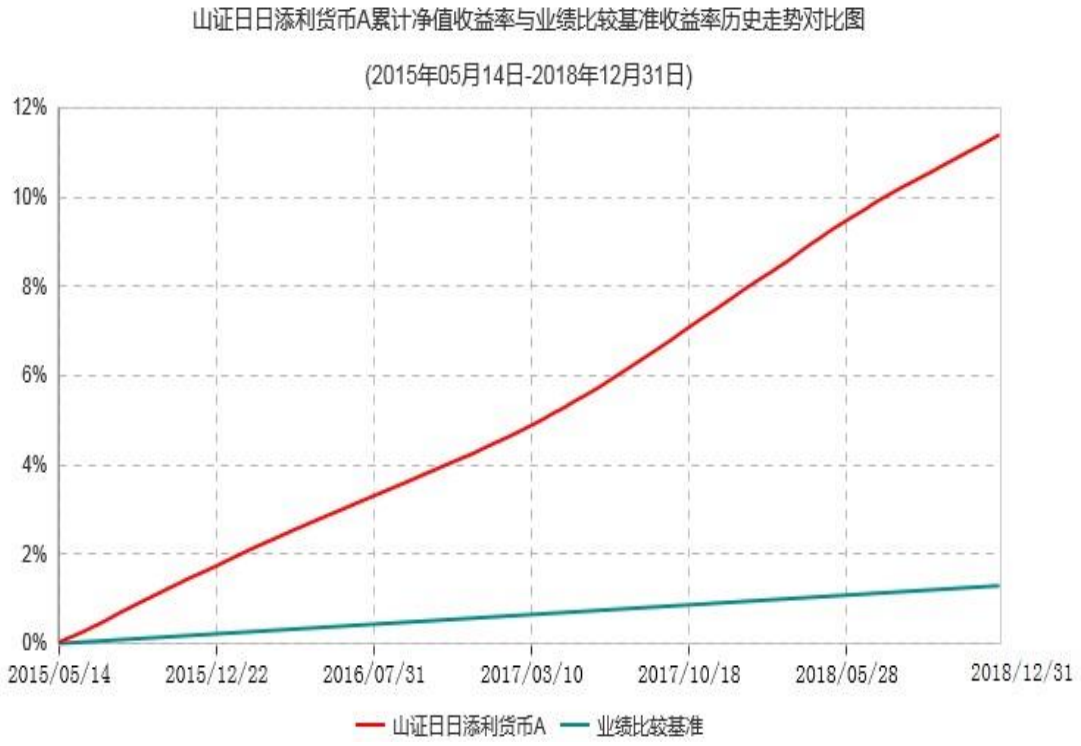
合同生效起至今						

山证日日添利货币C

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.3449%	0.0003%	0.0895%	0.0000%	0.2554%	0.0003%
过去六个月	0.7077%	0.0005%	0.1790%	0.0000%	0.5287%	0.0005%
过去一年	1.7334%	0.0011%	0.3555%	0.0000%	1.3779%	0.0011%
过去三年	4.6385%	0.0014%	1.0712%	0.0000%	3.5673%	0.0014%
自基金合同生效起至今	5.4938%	0.0014%	1.2946%	0.0000%	4.1992%	0.0014%

注：本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）。

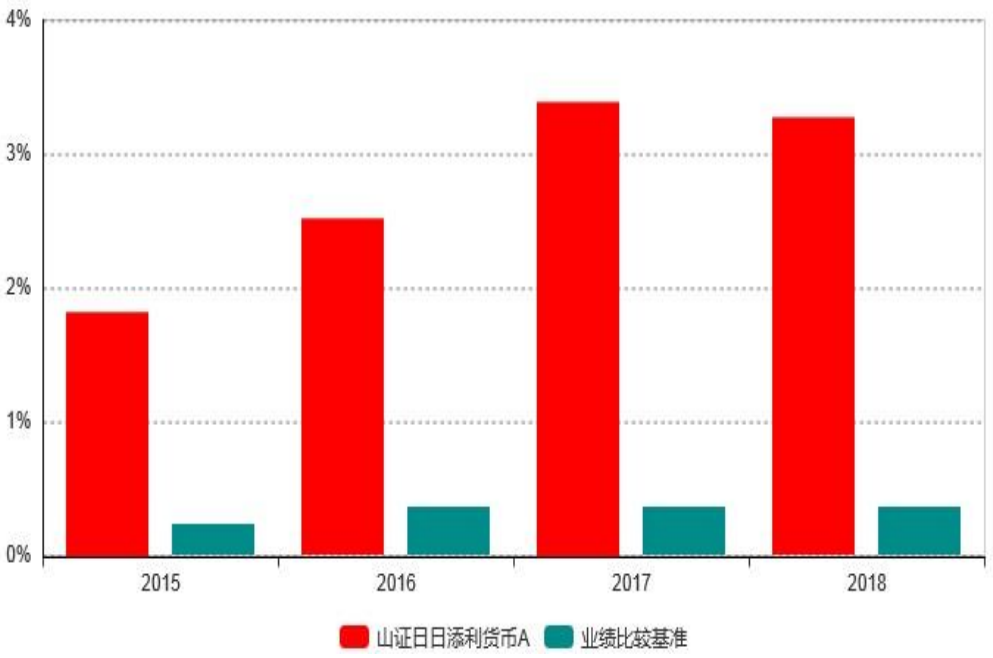
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

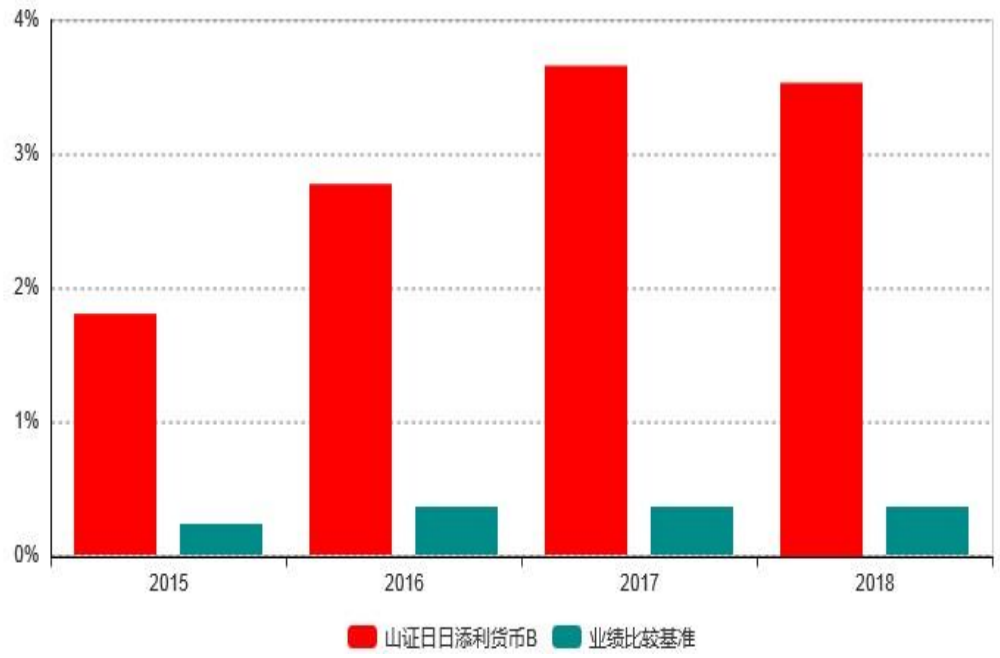

山证日日添利货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年05月14日-2018年12月31日)
12%
10%
8%
6%
4%
2%
0%
2015/05/14
2015/12/22
2016/07/31
2017/03/10
2017/10/18
2018/05/28
2018/12/31
山证日日添利货币A
业绩比较基准

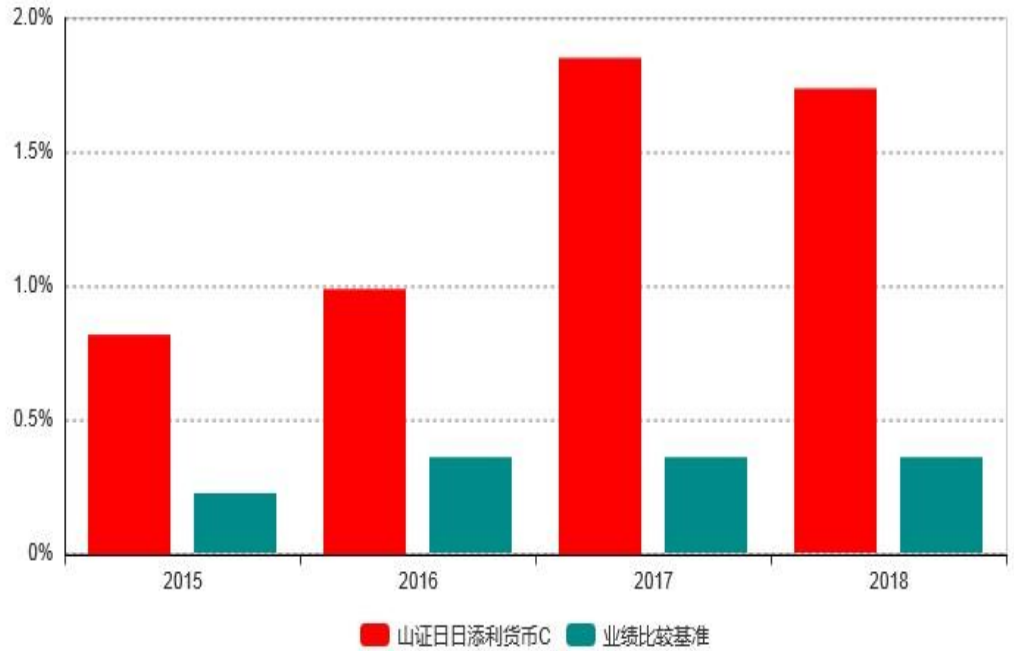
山证日日添利货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年05月14日-2018年12月31日)
12.5%
10.0%
7.5%
5.0%
2.5%
0%
2015/05/14
2015/12/22
2016/07/31
2017/03/10
2017/10/18
2018/05/28
2018/12/31
山证日日添利货币B
业绩比较基准

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日。本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较







注：本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日，2015 年度的相关数据根据当年实际存续期（2015 年 5 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

山证日日添利货币A

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2018年	256,079.71	-	455.40	256,535.11	-
2017年	478,198.20	-	-280.73	477,917.47	-
2016年	565,857.55	-	514.76	566,372.31	-
合计	1,300,135.46	-	689.43	1,300,824.89	-

山证日日添利货币B

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2018年	10,717,202.35	-	-10,519.37	10,706,682.98	-
2017年	16,846,574.79	-	-34,698.96	16,811,875.83	-
2016年	17,406,457.41	-	71,186.80	17,477,644.21	-
合计	44,970,234.55	-	25,968.47	44,996,203.02	-

山证日日添利货币C

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2018年	35,572,985.81	-	-23,544.87	35,549,440.94	-
2017年	36,112,163.95	-	45,242.50	36,157,406.45	-
2016年	24,342,693.93	-	-23,127.02	24,319,566.91	-
合计	96,027,843.69	-	-1,429.39	96,026,414.30	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。经过三十年的发展，已成为作风稳健、经营稳定、管理规范、业绩良好的创

新类证券公司。2010年9月，公司上市首发申请获中国证监会发审委审核通过，11月15日正式在深圳证券交易所挂牌上市，股票代码002500，注册资本28.2873亿元。

公司股东资金实力雄厚，经营风格稳健，资产质量优良，盈利能力良好，其构成集中体现多种优质资源、多家优势企业的强强联合。公司控股股东为山西金融投资控股集团有限公司。

山西证券的经营范围基本涵盖了所有的证券领域，分布于财富管理、资产管理、投资管理、投融资、研究、期货、国际业务等板块，具体包括：证券经纪；证券自营；证券资产管理；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务;融资融券；代销金融产品等。同时，公司具备公开募集证券投资基金管理业务资格，并获批开展债券质押式报价回购交易、股票质押式回购交易、约定购回式证券交易、转融通、上市公司股权激励行权融资、直接投资、柜台市场、场外期权等业务。

公司控股中德证券有限责任公司，致力于提供广泛的股票、债券的承销与保荐，以及并购重组等顾问服务；全资控股格林大华期货有限公司，致力于提供期货经纪、投资咨询业务及财富管理、资产管理、风险管理、中间业务等全方位、全产业链的金融服务；全资控股山证投资有限责任公司，致力于为具备风险承受能力的高净值个人和机构提供财富管理服务，同时向优质企业提供资金支持，协助被投资企业通过并购重组、IPO上市等途径做优做强；全资控股并在香港设立山证国际金融控股有限公司，致力于为客户提供专业、优质、多元化、一站式的环球证券、期货及期权产品投资，环球资产配置、企业海外融资及并购服务；全资控股山证创新投资有限公司，致力于把握市场趋势，挖掘资产价值，聚焦战略新兴产业，运用多元化投资手段，构建优质资产组合。

公司设有分公司14家，营业部119家，期货营业网点27家，以上网点分布于山西各地市、主要县区及北京、上海、天津、深圳、黑龙江、新疆、大连、河北、山东、陕西、河南、江苏、四川、重庆、两湖、浙江、福建、两广、海南等地，形成了以国内主要城市为前沿，重点城市为中心，覆盖山西、面向全国的业务发展框架，为160余万客户提供全面、优质、专业的综合金融服务。

近年来，公司先后获得山西省政府颁发的"优秀中介机构"、深交所颁发的"中小企业板优秀保荐机构"、中国证监会颁发的"账户规范先进集体"等荣誉，并连续多年荣获山西省人民政府授予的"支持山西地方经济发展贡献奖"。2014年，公司荣获山西省总工会颁发的"山西省金融系统优质服务先进单位"奖，在行业内评选中获得"中国上市公司风险管理金盾奖"、"2014年中国最具成长性证券经纪商"、"中国最佳区域证券经纪商"、"中国最佳融资融券商"；2015年，公司获得山西省金融办、山西证监局颁发的"2015年度新三板优秀主办券商"的称号，在中国最佳财富管理机构评选活动中获得"中国最佳区域证券经纪商"和"中国最佳投资顾问品牌"等荣誉；2016年，公司荣获"2016年度优秀证券公司"奖，"券商中国2016最具活力互联网券商"奖，"2016首届中国波特菲勒奖颁奖盛

典"最具发展潜力证券资管公司奖，"山西省金融系统五一劳动奖状"和"标兵单位"荣誉称号及中国扶贫基金会颁发的"杰出贡献奖";2017年，公司荣获中国证券投资者护基金有限责任公司颁发的"2016年度优秀证券公司"，山西省总工会金融工会工作委员会颁发的"山西省金融系统五一劳动奖章"，中国扶贫基金会颁发的"2016年度捐赠人大会杰出贡献奖"，公益时报颁发的"第十四届（2017）中国慈善榜慈善榜样"，证券时报颁发的"天马奖第八届中国上市公司投资者关系评选最佳董事会"，国际金融报颁发的"2017再融资先锋投行"、"2017并购重组先锋投行"、"2017IPO报审效率先锋投行"三项大奖，新三板智库SFC南方财经全媒体评选的"创新层十佳新锐督导券商"等奖项；2018年公司荣获中国证监会、中国上市公司协会颁发的"《中国上市公司年鉴》（2017）最佳研究实力奖"，中国证券投资者保护基金有限责任公司颁发的"营业部经理调查优秀证券公司"，新财富颁发的"中国最具潜力投行"、"最佳海外项目"、"最佳ABS项目"、"最佳再融资项目"、"最佳公司债项目"，券商中国颁发的"2018券商APP优秀案例奖"、"2018优秀证券公司海报王"、"2018优秀证券公司APP入围奖"，东方财富网、天天基金网颁发的"2018东方财富风云榜"之"最具潜力研究团队"，中国财经网颁发的"2017年度经营管理创新奖"、"2017年度金牌投研团队奖"、"2017年度成长性期货公司奖"、"期货行业杰出掌门人"，山西省总工会金融工会工作委员颁发的"山西省金融系统五一劳动奖状"，山西省直机关精神文明建设委员会颁发的"2017年度省直文明单位"，上海票据交易所颁发的"优秀非银行类交易商"，华夏时报颁发的"服务实体经济突出贡献奖"，中国证券业协会、中国期货业协会、证券时报券商中国颁发的"2018中国证券期货公司最佳服务贫困地区企业融资项目奖"、"2018中国证券期货最佳扶贫产业项目奖"、"2018中国证券期货公司扶贫爱心人物奖"，中国扶贫基金会颁发的"2017社会力量参与救灾先进单位"。

未来的山西证券将秉承"诚信、稳健、规范、创新、高效"的经营理念，"以义制利、协作包容、追求卓越"的核心价值观，以"专业服务创造价值"为使命，坚持"让投资更明白"的服务理念，培育务实高效、恪尽职守的工作作风，营造和谐宽松、风清气正的公司氛围，坚定公司发展过程中差异化、专业化、市场化、集约化的战略原则，打造公司与客户共同发展的平台，努力把公司建设成为有特色、有品牌、有竞争力的一流券商。

2014年3月19日，经中国证监会核准（证监许可【2014】319号），山西证券股份有限公司成为首批获得公开募集证券投资基金管理业务资格的证券公司。截至报告期末，山西证券股份有限公司旗下管理山西证券日日添利货币市场基金、山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金、山西证券改革精选灵活配置混合型证券投资基金共4只公募基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	14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14日至今任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。2016年5月4日至2018年7月21日任山西证券保本混合型证券投资基金基金经理。2016年8月24日至今任山西证券裕利债券型证券投资基金（自2018年8月25日起，转型为山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金）基金经理。2019年1月21日至今任山西证券超短债债券型证券投资基金基金经理。
刘相鹏	本基金的基金经理	2018-05-03	-	6年	刘相鹏先生，上海财经大学金融硕士。2012年1月至2013年9月任上海易序资产管理有限公司债券交易员；2013年10月至2

					015年2月任江苏大丰农商行债券交易员；2015年4月加入山西证券公募基金部，从事债券交易工作，2018年5月3日至今任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。

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”为本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 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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》，公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年，基金对投资标的的信用级别提高到最严格的等级，包括质押券，严格保护投资者利益。在资产配置上，存单、存款、逆回购保持均衡比例，组合管理进一步优化流动性。在季末月底的资金紧张环境下，抓住了市场机会。

4.4.2 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3.2705%，同期业绩比较基准收益率为0.3555%；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3.5291%，同期业绩比较基准收益率为0.3555%；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1.7334%，同期业绩比较基准收益率为0.3555%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年，央行的货币政策定调是稳健中性，流动性定调是合理充裕、松紧适度、管好货币供给总闸门。2019年，我们认为央行仍然会维持银行间市场流动性的宽松格局，有望再进行1-2次降准，高评级债券和同业存单的收益率有望进一步下行，我们继续看好债券市场。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司完善通信工具管理制度、员工投资行为管理制度、权限管理制度等多项制度，进一步完善合规制度建设；开展多种形式的合规培训，定期进行合规考试，不断提升员工的合规守法意识；积极参与各项业务的合规性管理，对信息披露文件、各类宣传推介材料进行合规性审查，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司加强风险控制制度建设，特别是投资风险控制，完善控制机制，提高员工的风险管理意识。在监察稽核

方面，公司定期和不定期开展内部稽核，对投资研究等关键业务和重点岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

无。

4.10 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

报告期内，本基金未发生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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2018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。

5.2 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

2018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、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：256,535.11元，向B级份额持有人分配利润：10,706,682.98元，向C级份额持有人分配利润：35,549,440.94元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018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年度报告中财务指标、收益表现、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。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	中喜审字【2019】第0375号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	山西证券日日添利货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了山西证券日日添利货币市场基金财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表，2018年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了山西证券日日添利货币市场基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于山西证券日日添利货币市场基

	金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	山西证券日日添利货币市场基金的管理人山西证券股份有限公司的管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估山西证券日日添利货币市场基金的持续经营能力，并运用持续经营假设，除非管理层计划清算山西证券日日添利货币市场基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督山西证券日日添利货币市场基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： 1. 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风

	险。 2. 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 3. 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 4. 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对山西证券日日添利货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报告使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致山西证券日日添利货币市场基金不能持续经营。 5. 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	中喜会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	白银泉 武丹
会计师事务所的地址	北京市东城区崇文门外大街11号新成文化大厦A座11层
审计报告日期	2019-03-20

§7 年度财务报表

7.1 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：2018年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日

资 产：			
银行存款	7.4.7.1	220,680,838.49	1,326,789,500.99
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,851,186,692.45	640,044,554.51
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,851,186,692.45	640,044,554.51
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	234,170,951.26	95,600,383.40
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	19,871,322.06	25,847,793.55
应收股利		-	-
应收申购款		442,022.49	18,529.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,326,351,826.75	2,088,300,761.61
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		14,499,738.25	19,799,850.30
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		676,882.86	630,131.83
应付托管费		180,502.12	168,035.15
应付销售服务费		485,144.68	436,236.93

应付交易费用	7.4.7.7	49,345.62	32,763.72
应交税费		123,204.25	-
应付利息		8,949.12	8,737.47
应付利润		121,135.74	154,744.58
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	3,010,249.18	2,717,199.68
负债合计		19,155,151.82	23,947,699.66
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,307,196,674.93	2,064,353,061.95
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,307,196,674.93	2,064,353,061.95
负债和所有者权益总计		2,326,351,826.75	2,088,300,761.61

注：1、报告截止日2018年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额2,307,196,674.93份，其中A级基金份额总额16,826,733.32份，B级基金份额总额282,154,853.15份，C级基金份额总额2,008,215,088.46份。

2、本财务报表的比较期间为2017年1月1日至2017年12月31日。

7.2 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：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入		93,263,105.91	98,464,932.68
1.利息收入		93,248,245.42	98,453,032.37
其中：存款利息收入	7.4.7.11	33,122,287.44	45,540,323.81
债券利息收入		43,014,590.11	38,414,889.63
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		17,111,367.87	14,497,818.93
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,860.49	6,996.56
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	14,860.49	6,996.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	4,903.75
减：二、费用		46,750,446.88	45,017,732.93
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	7,218,548.66	7,463,649.65
2．托管费	7.4.10.2.2	1,924,946.39	1,990,306.55
3．销售服务费	7.4.10.2.3	5,239,299.94	5,008,521.57
4．交易费用	7.4.7.1	-	-

	9		
5．利息支出		820,620.90	565,509.57
其中：卖出回购金融资产支出		820,620.90	565,509.57
6．税金及附加		76,742.17	-
7．其他费用	7.4.7.20	31,470,288.82	29,989,745.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,512,659.03	53,447,199.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,512,659.03	53,447,199.75

7.3 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：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	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）	2,064,353,061.95	-	2,064,353,061.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,512,659.03	46,512,659.03
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）	242,843,612.98	-	242,843,612.98
其中：1.基金申购款	44,140,985,298.70	-	44,140,985,298.70
2.基金赎回款	-43,898,141,685.72	-	-43,898,141,685.72
四、本期向基金份额	-	-46,512,659.03	-46,512,659.03

持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	2,307,196,674.93	-	2,307,196,674.93
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
	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)	2,991,872,271.69	-	2,991,872,271.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,447,199.75	53,447,199.75
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)	-927,519,209.74	-	-927,519,209.74
其中：1.基金申购款	46,875,046,667.37	-	46,875,046,667.37
2.基金赎回款	-47,802,565,877.11	-	-47,802,565,877.11
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）	-	-53,447,199.75	-53,447,199.75
五、期末所有者权益（基金净值）	2,064,353,061.95	-	2,064,353,061.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

侯巍 汤建雄 张立德

———————— ———————— ————————

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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》负责公开募集。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。经向中国证监会备案，《山西证券日日添利货币市场基金基金合同》于2015年5月14日正式生效。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。

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。根据基金管理人2018年3月30日发布的《山西证券股份有限公司关于旗下4只基金修订基金合同、托管协议的公告》及修改后的《山西证券日日添利货币市场基金基金合同》，本基金的投资范围修改为：法

律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体为现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、同业存单；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；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）。

7.4.2 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《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对

金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，终止确认：

（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。

本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用"摊余成本法"，即估值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，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

为了避免采用"摊余成本法"计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即"影子定价"。当"影子定价"确定的基金资产净值与"摊余成本法"计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资或资产支持证券投资的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债应当在资产负债表内分别列示，不得相互抵销。但是，同时满足下列条件的，应当以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

（1）企业具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；

（2）交易双方计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

不满足终止确认条件的金融资产转移，转出方不得将已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

债券投资或资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。

（1）本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

（2）本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

（3）"每日分配、按日支付"。本基金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，并每日进行支付；

（4）本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

（5）本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在当日收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

（6）当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

（7）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资或资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]70号《关于金融金构同业往来等增值税补充政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

（2）对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

（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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按0.10%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	120,680,838.49	116,789,500.99
定期存款	100,000,000.00	1,210,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	-	520,000,000.00
其他存款	-	-
合计	220,680,838.49	1,326,789,500.99

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2018年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,851,186,692.45	1,851,886,000.00	699,307.55	0.0303
	合计	1,851,186,692.45	1,851,886,000.00	699,307.55	0.0303
资产支持证券		-	-	-	-
合计		-	-	-	-
项目		上年度末2017年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	640,044,554.51	638,343,000.00	-1,701,554.51	-0.0824
	合计	640,044,554.51	638,343,000.00	-1,701,554.	-0.0824

				51	
资产支持证券		-	-	-	-
合计		-	-	-	-

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	234,170,951.26	-
合计	234,170,951.26	-
项目	上年度末2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	95,600,383.40	-
合计	95,600,383.40	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2018年12月31日	2017年12月31日
应收活期存款利息	96,703.23	92,427.55
应收定期存款利息	614,444.08	7,924,006.95
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	18,538,517.84	17,677,816.44
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	621,656.91	153,542.61
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	19,871,322.06	25,847,793.55

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	49,345.62	32,763.72
合计	49,345.62	32,763.72

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

预提费用	115,000.00	115,000.00
其他应付	2,895,249.18	2,602,199.68
合计	3,010,249.18	2,717,199.68

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 山证日日添利货币A

金额单位：人民币元

项目（山证日日添利货币A）	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,372,426.10	9,372,426.10
本期申购	45,350,306.67	45,350,306.67
本期赎回（以“-”号填列）	-37,895,999.45	-37,895,999.45
本期末	16,826,733.32	16,826,733.32

7.4.7.9.2 山证日日添利货币B

金额单位：人民币元

项目（山证日日添利货币B）	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	322,142,985.29	322,142,985.29
本期申购	213,820,795.90	213,820,795.90
本期赎回（以“-”号填列）	-253,808,928.04	-253,808,928.04
本期末	282,154,853.15	282,154,853.15

7.4.7.9.3 山证日日添利货币C

金额单位：人民币元

项目（山证日日添利货币C）	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,732,837,650.56	1,732,837,650.56

本期申购	43,881,814,196.13	43,881,814,196.13
本期赎回（以“-”号填列）	-43,606,436,758.23	-43,606,436,758.23
本期末	2,008,215,088.46	2,008,215,088.46

注：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。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 山证日日添利货币A

单位：人民币元

项目 (山证日日添利货币A)	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	256,535.11	-	256,535.11
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	-256,535.11	-	-256,535.11
本期末	-	-	-

7.4.7.10.2 山证日日添利货币B

单位：人民币元

项目 (山证日日添利货币B)	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	10,706,682.98	-	10,706,682.98
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	-10,706,682.98	-	-10,706,682.98
本期末	-	-	-

7.4.7.10.3 山证日日添利货币C

单位：人民币元

项目 (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
上年度末	-	-	-
本期利润	35,549,440.94	-	35,549,440.94
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	-35,549,440.94	-	-35,549,440.94
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
活期存款利息收入	3,501,253.10	4,002,955.93
定期存款利息收入	29,621,034.34	41,537,367.88
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	33,122,287.44	45,540,323.81

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	14,860.49	6,996.56
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	14,860.49	6,996.56

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,576,204,491.29	3,036,930,380.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,518,727,699.28	2,969,948,583.44
减：应收利息总额	57,461,931.52	66,974,800.42
买卖债券差价收入	14,860.49	6,996.56

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	4,903.75
合计	-	4,903.75

7.4.7.19 交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
审计费用	15,000.00	15,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
帐户维护费	36,600.00	37,400.00
增值服务费C	31,317,644.72	29,837,047.09
其他	1,044.10	298.50
合计	31,470,288.82	29,989,745.59

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 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
山西金融投资控股集团有限公司	基金管理人的股东
太原钢铁（集团）有限公司	基金管理人的股东
山西国际电力集团有限公司	基金管理人的股东
格林大华期货有限公司	基金管理人的全资子公司
山证投资有限责任公司	基金管理人的全资子公司
山证国际金融控股有限公司	基金管理人的全资子公司
山证创新投资有限公司	基金管理人的全资子公司

中德证券有限责任公司	基金管理人的控股子公司

注：所列股东为持股5%以上股东。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

所述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本年度与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本年度与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期与上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,218,548.66	7,463,649.65
其中：支付销售机构的客户维护费	2,358.52	8,403.86

注：1、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X0.3%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,924,946.39	1,990,306.55

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X0.08%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日			
	当期发生的基金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	合计
山西证券股份有限公司	15,753.55	-	5,219,607.52	5,235,361.07
交通银行	7.00	-	-	7.00
合计	15,760.55	-	5,219,607.52	5,235,368.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日			
	当期发生的基金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	合计
山西证券股份有限公司	24,074.95	-	4,972,841.15	4,996,916.10
交通银行	39.09	-	-	39.09
合计	24,114.04	-	4,972,841.15	4,996,955.19

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方通过银行间同业市场进行过债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

山证日日添利货币A

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
基金合同生效日（2015年05月14日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

山证日日添利货币B

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
基金合同生效日（2015年05月14日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	309,281,216.70	614,612,251.58
报告期间申购/买入总份额	9,597,026.01	14,668,965.12
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	50,000,000.00	320,000,000.00
报告期末持有的基金份额	268,878,242.71	309,281,216.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.65%	14.98%

山证日日添利货币C

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
基金合同生效日（2015年05月14日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

7.4.10.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	120,680,838.49	3,501,253.10	116,789,500.99	4,002,955.93
交通银行定期存款	-	-	-	165,277.78

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--货币市场基金

山证日日添利货币A

单位：人民币元

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
256,079.71	-	455.40	256,535.11	-

山证日日添利货币B

单位：人民币元

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
10,717,202.35	-	-10,519.37	10,706,682.98	-

山证日日添利货币C

单位：人民币元

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
35,572,985.81	-	-23,544.87	35,549,440.94	-

7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额14,499,738.25元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

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
111895304	18长沙银行CD067	2019-01-02	98.89	200,000	19,778,935.51
合计				200,000	19,778,935.51

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，本基金投资于各类固定收益类金融工具，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会

负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。

（2）风险管理执行委员会

根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和控制策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。

（3）投资决策委员会

负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

（4）公募基金管理业务专项合规负责人

按照规定履行公募基金管理业务合规负责人职责，对董事会负责。监督检查基金投资的合法合规性、基金运营的安全性对发现存在的问题，及时告知相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实。

（5）合规管理部：负责对公募基金管理业务相关制度、合同和流程进行合规性审核；按照监管机构的要求和公司的规定定期、不定期地进行合规检查，组织落实公募基金管理业务的业务隔离和反洗钱工作；负责处理公募基金管理业务相关法律诉讼事务。

（6）风险管理部：负责对整体业务进行全程监控，拟定和完善公募基金管理业务风险管理制度和风险控制流程；建立和完善公募基金管理业务风险监控指标体系；监控和检查公募基金管理业务运行情况；分析、评估公募基金管理业务的风险状况，并向公司总经理办公会及相关部门提交风险评估报告。

（7）稽核审计部：负责对公募基金管理业务进行全面的审计与监察、稽核，检查各部门对公募基金管理业务相关制度的执行情况，并出具监察稽核报告。

（8）业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

公募基金管理业务风险控制目标是通过建立科学的风险防范体系、风险控制机制及风险监测平台，及时发现、评估、规避、处理公募基金管理业务运作中的各类风险，确

保公募基金管理业务合规开展，风险可测、可控、可承受。在风险识别、风险评估、风险测量等的基础上，及时对各种风险进行监督、检查和评估，对风险进行管理控制，制定风险控制决策，采取适当有效的风险控制措施，将风险控制在预期可承受的范围内，实现风险管理目标。

7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，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，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。

本基金的基金管理人在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手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通过对交易对手的信用状况进行评估以控制相应的信用风险。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
A-1	30,048,222.18	59,981,676.92
A-1以下	-	-
未评级	830,315,487.76	540,056,764.64
合计	860,363,709.94	600,038,441.56

注：未评级为国债、政策性金融债和超短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	850,709,074.77	-
合计	850,709,074.77	-

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	140,113,907.74	40,006,112.95
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	140,113,907.74	40,006,112.95

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的证券，除在证券交易所的债券回购交易及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，均能够及时变现。

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。有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天；本基金投资于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。

基金管理人严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，因此存在相应的利率风险。本基金以摊余成本计价，每日通过"影子定价"对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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年12月31日	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	120,680,838.49	50,000,000.00	50,000,000.00	-	-	-	220,680,838.49
交易性金融资产	259,863,736.94	328,976,915.15	1,262,346,040.36	-	-	-	1,851,186,692.45
买入返售金融资产	234,170,951.26	-	-	-	-	-	234,170,951.26
应收利息	-	-	-	-	-	19,871,322.06	19,871,322.06
应收申购款	-	-	-	-	-	442,022.49	442,022.49
资产总计	614,715,526.69	378,976,915.15	1,312,346,040.36	-	-	20,313,344.55	2,326,351,826.75
负债							
卖出回购金融资产款	14,499,738.25	-	-	-	-	-	14,499,738.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	676,882.86	676,882.86
应付托管费	-	-	-	-	-	180,502.12	180,502.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	485,144.68	485,144.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	49,345.62	49,345.62
应交税费	-	-	-	-	-	123,204.25	123,204.25
应付利息	-	-	-	-	-	8,949.12	8,949.12
应付利润	-	-	-	-	-	121,135.74	121,135.74

其他负债	-	-	-	-	-	3,010,249.18	3,010,249.18
负债总计	14,499,738.25	-	-	-	-	4,655,413.57	19,155,151.82
利率敏感度缺口	600,215,788.44	378,976,915.15	1,312,346,040.36	-	-	15,657,930.98	2,307,196,674.93
上年度末2017年12月31日	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	641,789,500.99	405,000,000.00	280,000,000.00	-	-	-	1,326,789,500.99
交易性金融资产	150,011,729.14	190,086,271.42	299,946,553.95	-	-	-	640,044,554.51
买入返售金融资产	95,600,383.40	-	-	-	-	-	95,600,383.40
应收利息	-	-	-	-	-	25,847,793.55	25,847,793.55
应收申购款	-	-	-	-	-	18,529.16	18,529.16
资产总计	887,401,613.53	595,086,271.42	579,946,553.95	-	-	25,866,322.71	2,088,300,761.61
负债							
卖出回购金融资产款	19,799,850.30	-	-	-	-	-	19,799,850.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	630,131.83	630,131.83
应付托管费	-	-	-	-	-	168,035.15	168,035.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	436,236.93	436,236.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	32,763.72	32,763.72
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	8,737.47	8,737.47

应付利润	-	-	-	-	-	154,744.58	154,744.58
其他负债	-	-	-	-	-	2,717,199.68	2,717,199.68
负债总计	19,799,850.30	-	-	-	-	4,147,849.36	23,947,699.66
利率敏感度缺口	867,601,763.23	595,086,271.42	579,946,553.95	-	-	21,718,473.35	2,064,353,061.95

7.4.13.4.1.2 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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,500,807.15	330,627.54
	市场利率上升25个基点	-1,495,576.18	-329,630.72

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	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	1,851,186,692.45	80.24	640,044,554.51	31.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产一权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,851,186,692.45	80.24	640,044,554.51	31.00

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2018年12月31日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（b）持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年12月31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1,851,186,692.45元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

（2）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,851,186,692.45	79.57
	其中：债券	1,851,186,692.45	79.57
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	234,170,951.26	10.07
	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	220,680,838.49	9.49
4	其他各项资产	20,313,344.55	0.87
5	合计	2,326,351,826.75	100.00

8.2 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	0.85	
	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	14,499,738.25	0.63
	其中：买断式回购融资	-	-

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

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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

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。

8.3.2 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	25.35	0.63
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	9.95	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	7.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	14.70	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	42.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

合计	99.95	0.63

8.4 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。

8.5 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	860,363,709.94	37.29
6	中期票据	140,113,907.74	6.07
7	同业存单	850,709,074.77	36.87
8	其他	-	-
9	合计	1,851,186,692.45	80.24
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	占基金资产净值比例(%)
1	111882120	18郑州银行CD108	1,000,000	98,888,069.38	4.29
2	111882340	18东莞农村商业银行CD074	1,000,000	98,034,874.52	4.25
3	011801284	18大唐新能SCP0	800,000	80,190,934.	3.48

		03		10	
4	011801273	18滨建投SCP003	800,000	80,013,525.55	3.47
5	011802260	18恒信租赁SCP004	800,000	79,975,549.49	3.47
6	111882332	18成都银行CD203	800,000	79,145,032.38	3.43
7	101653010	16鞍钢集MTN001	500,000	50,046,389.22	2.17
8	011801238	18大同煤矿SCP007	500,000	50,032,478.02	2.17
9	011800712	18越秀租赁SCP002	500,000	50,015,682.22	2.17
10	011802246	18大同煤矿SCP016	500,000	50,000,368.90	2.17

8.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1556%
报告期内偏离度的最低值	-0.0543%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0199%

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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.3 期末其他各项资产构成

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	19,871,322.06
4	应收申购款	442,022.49
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,313,344.55

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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)	户均持有的基金份额	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

山证日日添利货币A	2,345	7,175.58	5,249,940.80	31.20%	11,576,792.52	68.80%
山证日日添利货币B	2	141,077,426.58	268,921,790.54	95.31%	13,233,062.61	4.69%
山证日日添利货币C	42,589	47,153.38	202,428,080.92	10.08%	1,805,787,007.54	89.92%
合计	44,936	51,344.06	476,599,812.26	20.66%	1,830,596,862.67	79.34%

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）。

9.2期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	持有份额占总份额的比例(%)
1	券商类机构	268,878,242.71	11.65
2	个人	70,860,533.22	3.07
3	私募产品	45,776,034.07	1.98
4	其他机构	32,809,334.96	1.42
5	其他机构	30,090,180.19	1.30
6	其他机构	23,992,097.60	1.04
7	个人	23,349,531.24	1.01
8	其他机构	21,519,814.72	0.93
9	个人	20,998,351.37	0.91
10	个人	20,967,233.79	0.91

9.3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	30,209.18	0.1795%
	山证日日添利货币B	-	-
	山证日日添利货币C	120,987.97	0.0060%
	合计	151,197.15	0.0066%

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）。

9.4 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	-
	山证日日添利货币B	-
	山证日日添利货币C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	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	-
	合计	0

§10 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
基金合同生效日(2015年05月14日)基金份额总额	190,332,531.91	273,834,220.88	873,407,149.43
本报告期期初基金份额总额	9,372,426.10	322,142,985.29	1,732,837,650.56
本报告期基金总申购份额	45,350,306.67	213,820,795.90	43,881,814,196.13
减：本报告期基金总赎回份额	37,895,999.45	253,808,928.04	43,606,436,758.23
本报告期期末基金份额总额	16,826,733.32	282,154,853.15	2,008,215,088.46

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

（1）基金管理人的重大人事变动

2018年1月15日，公司董事樊廷让先生因工作原因，向公司董事会申请辞去第三届董事会董事职务、第三届董事会审计委员会委员职务，同时申请辞去公司常务副总经理、财务负责人职务。公司董事赵树林先生因工作原因，向公司董事会申请辞去第三届董事会董事职务、第三届董事会风险管理委员会委员职务， 同时申请辞去公司副总经理职务(详见公告：临2018-006)。樊廷让先生、赵树林先生的辞职申请自2018年1月15日送达公司董事会时生效。辞职后，樊廷让先生、赵树林先生不再担任公司任何职务。

2018年3月8日，公司董事柴宏杰先生因工作原因，向公司董事会申请辞去第三届董事会董事职务、第三届董事会风险管理委员会委员职务(详见公告：临2018-015)。柴宏杰先生的辞职申请自2018年3月8日送达公司董事会时生效。

2018年8月10日，公司董事周宜洲先生因工作原因，向公司董事会申请辞去第三届董事会董事职务、第三届董事会风险管理委员会委员职务。公司董事傅志明先生因工作原因，向公司董事会申请辞去第三届董事会董事职务、第三届董事会战略发展委员会委员职务(详见公告：临2018-051)。周宜洲先生、傅志明先生的辞职申请自2018年8月10日送达公司董事会时生效。

2018年1月15日，公司第三届董事会第二十七次会议审议通过了《关于提名公司第三届董事会董事候选人的议案》（详见公告：临2018-004），提名杨增军先生为公司第三届董事会非独立董事候选人。2018年 2月1日，公司2018年第一次临时股东大会审议通过了《关于选举第三届董事会董事的议案》（详见公告： 临2018-008），选举杨增军先生为公司第三届董事会非独立董事。2018年2月13日，公司收到中国证券监督管理委员会山西监管局《关于核准杨增军证券公司董事任职资格的批复》（晋证监许可字[2018]3号），核准杨增军先生证券公司董事任职资格（详见公告：临2018-010）。杨增军先生自2018年2月13日起正式履行公司董事职责，任期与公司第三届董事会任期一致。

2018年3月7日，公司全体员工选举王怡里先生为公司第三届董事会职工董事（详见公告：临2018-014）， 任期与第三届董事会一致。

2018年7月24日，公司第三届董事会第三十二次会议审议通过了《关于提名公司第三届董事会非独立董事候选人的议案》（详见公告：临2018-043）提名李华先生、夏贵所为公司第三届董事会非独立董事候选人。2018年8月10日，公司2018年第二次临时股东大会审议通过了《关于选举第三届董事会非独立董事的议案》（详见公告：临2018-050），选举李华先生、夏贵所先生为公司第三届董事会非独立董事。根据上述会议决议及中国证券监督管理委员会山西监管局《关于核准李华证券公司董事任职资格的批复》（晋证监许可字[2018]9号）、《关于核准夏贵所证券公司董事任职资格的批复》（晋证监许可字[2018]11号），李华先生及夏贵所先生自2018年8月10日起正式履行公司董事职责，任期与公司第三届董事会任期一致。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

（1）本报告期内本基金管理人无重大诉讼、仲裁事项。

（2）本报告期内无涉及本基金财产的诉讼。

（3）本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。本报告期内，本基金应支付给中喜会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用15,000元。截至本报告期末，中喜会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务三年4个月。

11.6 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，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
山西证券	2	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

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租赁其他证券公司的交易单元，只能使用本基金管理人自有的交易单元。

4、本基金本报告期内未新增交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交	占当期权证成交总	成交	占当期基金成交总

		交总额的比例		购成交总额的比例	金额	额的比例	金额	额的比例
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

11.9 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	山西证券股份有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-12-28
2	山西证券日日添利货币市场基金更新招募说明书摘要（2018年第2号）	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-12-28
3	山西证券日日添利货币市场基金更新招募说明书（2018年第2号）	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-12-28
4	山西证券股份有限公司关于控股股东增持公司股份实施结果的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-12-06
5	山西证券日日添利货币市场基金2018年第三季度报告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-10-24
6	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金继续参与交通银行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	2018-09-29
7	山西证券日日添利货币市场基金2018年半年度报告摘要	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-08-27
8	山西证券日日添利货币市场基金2018年半年度报告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-08-27
9	山西证券股份有限公司关于公司董事变更的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-08-21
10	山西证券股份有限公司关于	证券日报和本基金基金管理	2018-08-09

	旗下部分公募基金增加通华财富为销售机构及开通相关业务并参与其费率优惠活动的公告	人公募基金业务网站	
11	山西证券日日添利货币市场基金2018年第二季度报告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-07-19
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	2018-07-03
13	山西证券股份有限公司旗下公募基金2018年半年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-07-02
14	山西证券日日添利货币市场基金更新招募说明书（2018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	2018-06-28
15	山西证券日日添利货币市场基金更新招募说明书摘要（2018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	2018-06-28
16	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金继续参加天天基金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	2018-06-16
17	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金继续参与上海利得基金销售有限公司基金定期定额投资业务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	2018-05-31
18	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金参加大泰金石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	2018-05-31
19	山西证券日日添利货币市场基金增聘基金经理的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-05-03

20	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金开通基金转换业务的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-04-28
21	山西证券日日添利货币市场基金2018年第1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	2018-04-23
22	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金继续参与交通银行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	2018-03-31
23	山西证券日日添利货币市场基金2017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	2018-03-31
24	山西证券日日添利货币市场基金2017年年度报告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-31
25	山西证券股份有限公司关于旗下4只基金修订基金合同、托管协议的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-30
26	山西证券日日添利货币市场基金托管协议	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-30
27	山西证券日日添利货币市场基金基金合同摘要	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-30
28	山西证券日日添利货币市场基金基金合同	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-30
29	山西证券日日添利货币市场基金托管协议	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-17
30	山西证券日日添利货币市场基金基金合同摘要	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-17
31	山西证券日日添利货币市场基金基金合同	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-17
32	关于山西证券日日添利货币市场基金修改基金合同的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-17
33	山西证券股份有限公司关于旗下部分公募基金参加长量	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-03-03

	基金费率优惠活动的公告		
34	山西证券股份有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司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	2018-02-09
35	山西证券股份有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-02-08
36	山西证券股份有限公司关于旗下部分基金开通上海利得基金销售有限公司基金定期定额投资业务并参与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	2018-02-07
37	山西证券股份有限公司关于旗下部分基金参加北京展恒基金销售股份有限公司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	2018-02-05
38	山西证券股份有限公司关于旗下部分基金参加大泰金石基金销售有限公司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	2018-02-05
39	山西证券日日添利货币市场基金2017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	2018-01-19
40	山西证券股份有限公司旗下公募基金2017年年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告	证券日报和本基金基金管理人公募基金业务网站	2018-01-01

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本基金在报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

13.3 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

二〇一九年三月二十七日