山西证券日日添利货币市场基金 2018年年度报告摘要

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	山证日日添利货币		
基金主代码	001175		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年05月14日		
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
信息披露负责人	姓名	薛永红	陆志俊
	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的网址	http://publicfyfund.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

§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	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	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

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

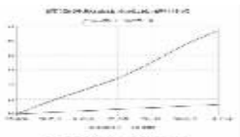
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7884%	0.0003%	0.0895%	0.0000%	0.6989%	0.0003%
过去六个月	1.5992%	0.0005%	0.1790%	0.0000%	1.4202%	0.0005%
过去一年	3.5291%	0.0011%	0.3555%	0.0000%	3.1736%	0.0011%
过去三年	10.2792%	0.0014%	1.0712%	0.0000%	9.2080%	0.0014%
自基金合同生效起至今	12.2642%	0.0017%	1.2995%	0.0000%	10.9647%	0.0017%

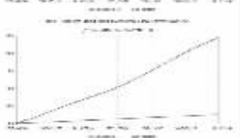
山证日日添利货币C

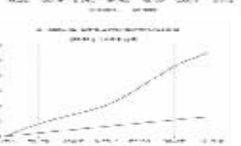
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3449%	0.0003%	0.0895%	0.0000%	0.2554%	0.0003%
过去六个月	0.7077%	0.0005%	0.1790%	0.0000%	0.5287%	0.0005%
过去一年	1.7334%	0.0011%	0.3555%	0.0000%	1.3779%	0.0011%
过去三年	4.6385%	0.0014%	1.0712%	0.0000%	3.5673%	0.0014%
自基金合同生效起至今	5.4938%	0.0014%	1.2946%	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







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SPC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扶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月任上海易玮资产管理有限公司债券交易员;2013年10月至2015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我们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,包括内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	7.4.7.19	-	-
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、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-46,512,659.03	-46,512,659.03
五、期末所有者权益(基金净值)	2,307,196,674.93	-	2,307,196,674.93
	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
项 目	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