山西证券日日添利货币市场基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:山西证券股份有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2019年08月24日

§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8月20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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30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	3,437,941,380.09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	10,113,171.79份	456,346,743.38份	2,971,481,464.92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

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://publicidyfund.sxzq.com:8000
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)		
	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	151,946.04	7,058,327.39	15,480,928.49
本期利润	151,946.04	7,058,327.39	15,480,928.49
本期净值收益率	1.3061%	1.4323%	0.5576%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)		
期末基金资产净值	10,113,171.79	456,346,743.38	2,971,481,464.92
期末基金份额净值	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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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
过去一个月	0.2068%	0.0001%	0.0292%	0.0000%	0.1776%	0.0001%
过去三个月	0.6282%	0.0003%	0.0885%	0.0000%	0.5397%	0.0003%
过去六个月	1.3061%	0.0005%	0.1761%	0.0000%	1.1300%	0.0005%
过去一年	2.7969%	0.0006%	0.3555%	0.0000%	2.4414%	0.0006%
过去三年	9.4926%	0.0014%	1.0703%	0.0000%	8.4223%	0.0014%
自基金合同生效起至今	12.8966%	0.0013%	1.4779%	0.0000%	11.4187%	0.0013%

山证日日添利货币B

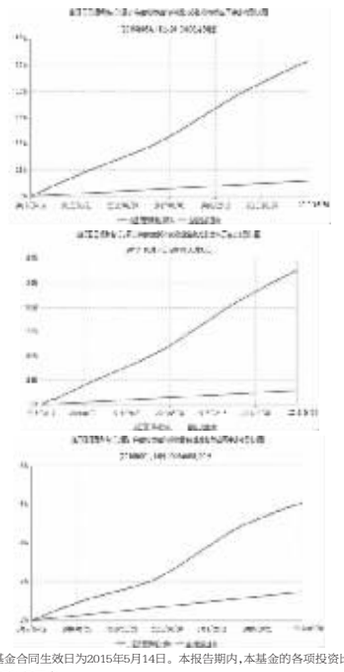
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2276%	0.0001%	0.0292%	0.0000%	0.1984%	0.0001%
过去三个月	0.6911%	0.0003%	0.0885%	0.0000%	0.6026%	0.0003%
过去六个月	1.4323%	0.0005%	0.1761%	0.0000%	1.2562%	0.0005%
过去一年	3.0544%	0.0006%	0.3555%	0.0000%	2.6989%	0.0006%
过去三年	10.3202%	0.0014%	1.0703%	0.0000%	9.2499%	0.0014%
自基金合同生效起至今	13.8722%	0.0016%	1.4779%	0.0000%	12.3943%	0.0016%

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
过去一个月	0.0833%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.0541%	0.0002%
过去三个月	0.2527%	0.0003%	0.0885%	0.0000%	0.1642%	0.0003%
过去六个月	0.5576%	0.0005%	0.1761%	0.0000%	0.3815%	0.0005%
过去一年	1.2692%	0.0006%	0.3555%	0.0000%	0.9137%	0.0006%
过去三年	4.6832%	0.0014%	1.0703%	0.0000%	3.6129%	0.0014%
自基金合同生效起至今	6.0821%	0.0013%	1.4730%	0.0000%	4.6091%	0.0013%

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。

§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24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"和山西省总金融工委授予的"山西省金融系统五一劳动奖章"。2013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"和山西省人民政府授予的"支持山西转型跨越发展-突出贡献奖"等荣誉;2014年,公司荣获中国上市公司协会授予的"《中国上市公司年鉴》最佳研究实力奖",证券时报评选的"中国最佳区域证券经纪商奖"和"中国最佳融资融券商奖";2015年,公司获得山西省金融办、山西证监局授予的"2015年度新三板优秀主办券商"称号,证券时报评选的"中国最佳区域证券经纪商"和"中国最佳投资顾问品牌"等奖项;2016年,公司获得山西省妇女联合会授予的"三八红旗集体奖"、"券商中国--最具活力互联网券商"、"波特非勒奖--最具发展潜力证券公司",中国证券投资者保护基金授予的"2016年优秀证券公司",中国扶贫基金会授予的"杰出贡献奖"等荣誉;2017年,公司荣获中国证券投资者护基金的"2017年优秀证券公司",中国扶贫基金会的"捐赠人大会杰出贡献奖"及公益时报的"第十四届中国慈善榜慈善榜样"等荣誉;2018年,公司荣获中国上市公司协会授予的"《中国上市公司年鉴》最佳研究实力奖",上海票据交易所授予的"优秀非银行类交易商",山西省直机关精神文明建设委员授予的"山西省直机关精神文明单位","中国证券业协会、中国期货业协会共同授予的"中国证券期货公司最佳服务贫困地区企业融资项目奖"、"中国证券期货最佳扶贫产业项目奖"、"中国证券期货公司扶贫爱心人物奖"及中国扶贫基金会颁发的"社会力量参与救灾先进单位"等荣誉。

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,经中国证监会批准,山西证券股份有限公司成为首批获得公募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(不含子公司)管理公募基金资产规模58.005亿元,旗下管理7只开放式基金。

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4月,在中银基金管理有限公司,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4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(目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券型证券投资基金基金经理。2019年5月30日至今任山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
刘相鹏	本基金的基金经理	2018-05-03	-	7年	刘相鹏先生,上海财经大学金融硕士。2012年1月至2013年9月任上海易非资产管理有限公司债券交易员;2013年10月至2015年2月任江苏天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。2019年5月30日至今任山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式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。

4.3.2 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

2019年上半年,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。实践上,成功渡过包商事件对市场的冲击。

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1.3061%,同期业绩比较基准收益率为0.1761%;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1.4323%,同期业绩比较基准收益率为0.1761%;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0.5576%,同期业绩比较基准收益率为0.1761%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济在去杠杆与稳增长之间取平衡,去杠杆转向结构性去杠杆、稳增长成为主要选项。下半年,PMI、房地产新开工等先行指标预示经济还会进一步下行,但是在追求高质量增长的基础上防风险、结构性去杠杆仍会继续,因此,国债利率将震荡,资金价格在区间调控内波动,信用违约风险将进一步释放。货币市场、国债市场、信用债市场、股票市场都可能出现区间波动、缺乏方向性的趋势。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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

本报告期内,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

本报告期内,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:151,946.04元,向B级份额持有人分配利润:7,058,327.39元,向C级份额持有人分配利润:15,480,928.49元。

5.3 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

本报告期内,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、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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2019年06月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	326,456,358.21	220,680,838.49
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,954,175,847.44	1,851,186,692.45
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,770,727,556.66	1,851,186,692.45
资产支持证券投资		183,448,290.78	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	255,994,144.00	234,170,951.26
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	34,062,183.08	19,871,322.06
应收股利		-	-
应收申购款		51,422.00	442,022.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,570,739,954.73	2,326,351,826.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		126,999,736.50	14,499,738.25
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		891,414.56	676,882.86
应付托管费		237,710.57	180,502.12
应付销售服务费		615,617.32	485,144.68
应付交易费用	6.4.7.7	41,835.07	49,345.62
应交税费		117,496.77	123,204.25
应付利息		29,490.90	8,949.12
应付利润		121,902.78	121,135.74
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,743,370.17	3,010,249.18
负债合计		132,798,574.64	19,155,151.82
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,437,941,380.09	2,307,196,674.93
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,437,941,380.09	2,307,196,674.93
负债和所有者权益总计		3,570,739,954.73	2,326,351,826.75

注:1、报告截止日2019年06月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额3,437,941,380.09份,其中A级基金份额总额10,113,171.79份,B级基金份额总额456,346,743.38份,C级基金份额总额2,971,481,464.92份。

6.2 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:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		54,218,987.95	48,406,648.84
1.利息收入		54,300,816.95	48,403,766.68
其中:存款利息收入	6.4.7.11	5,053,245.86	27,589,207.35
债券利息收入		40,221,746.44	11,064,045.50
资产支持证券利息收入		2,339,566.29	-
买入返售金融资产收入		6,686,258.36	9,750,513.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-81,829.00	2,882.16
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	29,335.91	2,882.16
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-111,164.91	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	-	-
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		31,527,786.03	22,336,294.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,969,343.50	3,444,714.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,322,491.60	918,590.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,516,446.03	2,504,666.54
4. 交易费用	6.4.7.19	100.00	-
5. 利息支出		548,922.63	400,884.16
其中:卖出回购金融资产支出		548,922.63	400,884.16
6. 税金及附加		87,161.60	24,142.93
7. 其他费用	6.4.7.20	21,093,320.67	15,043,295.60
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		22,691,201.92	26,070,354.48
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		22,691,201.92	26,070,354.48

6.3 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:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06月30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)	2,307,196,674.93	-	2,307,196,674.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,691,201.92	22,691,201.92
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)	1,130,744,705.16	-	1,130,744,705.16
其中:1.基金申购款	35,004,413,941.31	-	35,004,413,941.31
2.基金赎回款	-33,873,669,236.15	-	-33,873,669,236.15
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)	-	-22,691,201.92	-22,691,201.92
五、期末所有者权益(基金净值)	3,437,941,380.09	-	3,437,941,380.09

项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30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)	-	26,070,354.48	26,070,354.48
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)	-163,871,314.24	-	-163,871,314.24
其中:1.基金申购款	23,324,641,730.53	-	23,324,641,730.53
2.基金赎回款	-23,488,513,044.77	-	-23,488,513,044.77
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)	-	-26,070,354.48	-26,070,354.48
五、期末所有者权益(基金净值)	1,900,481,747.71	-	1,900,481,747.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 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》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)。

6.4.2 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。

6.4.3 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2019年06月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2019年1月1日至2019年6月30日止。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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《关于金融企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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
山西证券股份有限公司(“山西证券”)	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
山证基金管理有限公司	基金管理人的子公司
山西股权交易中心有限公司	受基金管理人控股股东控制

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
山西证券股份有限公司	341,964,787.13	100.00%	-	-

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,969,343.50	3,444,714.54
其中:支付销售机构的客户维护费	15,668.80	1,554.79

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。

管理费的计算方法如下:

H=E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年01月01日至2019年06月30日 | 上年度可比期间 2018年01月