

山西证券日日添利货币市场基金2016年半年度报告

2016年6月30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：2016年8月29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。

## 1.2 目录

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| 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 主要财务指标和基金净值表现                        | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| §4 管理人报告                                | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明              | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 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     | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 15 |
| 6.1 资产负债表                               | 15 |
| 6.2 利润表                                 | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 18 |
| 6.4 报表附注                                | 19 |
| §7 投资组合报告                               | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40 |
| 7.2 债券回购融资情况                            | 41 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                        | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 42 |
| 7.6 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      | 43 |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离          | 43 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细   | 44 |
| 7.9 投资组合报告附注                            | 44 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 45 |
| 8.3 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        | 46 |
| §9 开放式基金份额变动                            | 46 |
| §10 重大事件揭示                              | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                        | 47 |
| 10.2 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        | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼             | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变                          | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况                   | 47 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况       | 47 |

|      |                   |    |
|------|-------------------|----|
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 47 |
| 10.8 | 偏离度绝对值超过 0.5%的情况  | 48 |
| 10.9 | 其他重大事件            | 48 |
| §11  | 影响投资者决策的其他重要信息    | 49 |
| §12  | 备查文件目录            | 49 |
| 12.1 | 备查文件目录            | 49 |
| 12.2 | 存放地点              | 50 |
| 12.3 | 查阅方式              | 50 |

## § 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5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          | 2,830,219,740.30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<br>A     | 山证日日添利货币<br>B  | 山证日日添利<br>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<br>份额总额 | 27,412,828.03     | 612,500,519.67 | 2,190,306,392.6<br>0 |

### 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<br>姓名 | 薛永红        | 汤嵩彦        |

|        |      |                      |                     |
|--------|------|----------------------|---------------------|
| 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                 |

## 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》  |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://publiclyfund.sxzq.com:8000">http://publiclyfund.sxzq.com:8000</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公地址  |

## 2.5 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 |

## § 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（2016年1月1日-2016年6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       | 239,980.08                | 7,327,863.97 | 13,011,781.80 |
| 本期利润          | 239,980.08                | 7,327,863.97 | 13,011,781.80 |

|               |                  |                |                  |
|---------------|------------------|----------------|------------------|
| 本期净值收益率       | 1.2692%          | 1.3946%        | 0.5146%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) |                |                  |
| 期末基金资产净值      | 27,412,828.03    | 612,500,519.67 | 2,190,306,392.60 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000           | 1.0000         | 1.0000           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2016年6月30日) |                |                  |
| 累计净值收益率       | 3.1089%          | 3.2197%        | 1.3363%          |

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。

## 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

(1) 山证日日添利货币A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

| 阶段(A级)                               | 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                                | 0.1965%  | 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-2016年06月30日) | 3.1089%  | 0.0010%     | 0.4033%    | 0.0000%       | 2.7056% | 0.0010% |

(2) 山证日日添利货币B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

| 阶段(B级)                               | 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                                | 0.2172<br>% | 0.0001<br>% | 0.0292<br>% | 0.0000<br>%   | 0.1880<br>% | 0.0001<br>% |
| 过去三个月                                | 0.6695<br>% | 0.0002<br>% | 0.0885<br>% | 0.0000<br>%   | 0.5810<br>% | 0.0002<br>% |
| 过去六个月                                | 1.3946<br>% | 0.0004<br>% | 0.1771<br>% | 0.0000<br>%   | 1.2175<br>% | 0.0004<br>% |
| 过去一年                                 | 2.8032<br>% | 0.0019<br>% | 0.3565<br>% | 0.0000<br>%   | 2.4467<br>% | 0.0019<br>% |
| 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<br>% | 0.0019<br>% | 0.4033<br>% | 0.0000<br>%   | 2.8164<br>% | 0.0019<br>% |

(3) 山证日日添利货币C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

| 阶段(C级)                               | 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                                | 0.0727<br>% | 0.0002<br>% | 0.0292<br>% | 0.0000<br>%   | 0.0435<br>% | 0.0002<br>% |
| 过去三个月                                | 0.2320<br>% | 0.0002<br>% | 0.0885<br>% | 0.0000<br>%   | 0.1435<br>% | 0.0002<br>% |
| 过去六个月                                | 0.5146<br>% | 0.0004<br>% | 0.1771<br>% | 0.0000<br>%   | 0.3375<br>% | 0.0004<br>% |
| 过去一年                                 | 1.1958<br>% | 0.0007<br>% | 0.3565<br>% | 0.0000<br>%   | 0.8393<br>% | 0.0007<br>% |
| 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<br>% | 0.0008<br>% | 0.3984<br>% | 0.0000<br>%   | 0.9379<br>% | 0.0008<br>% |

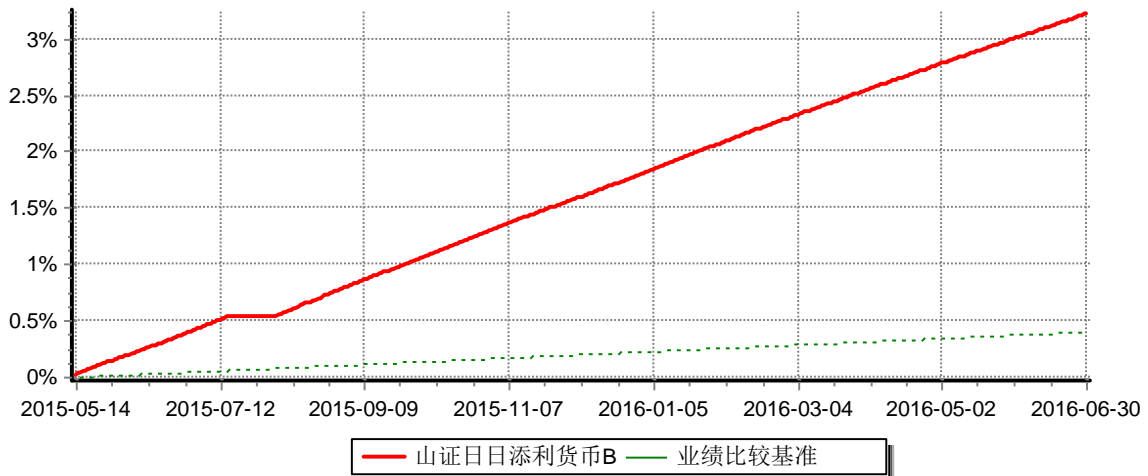
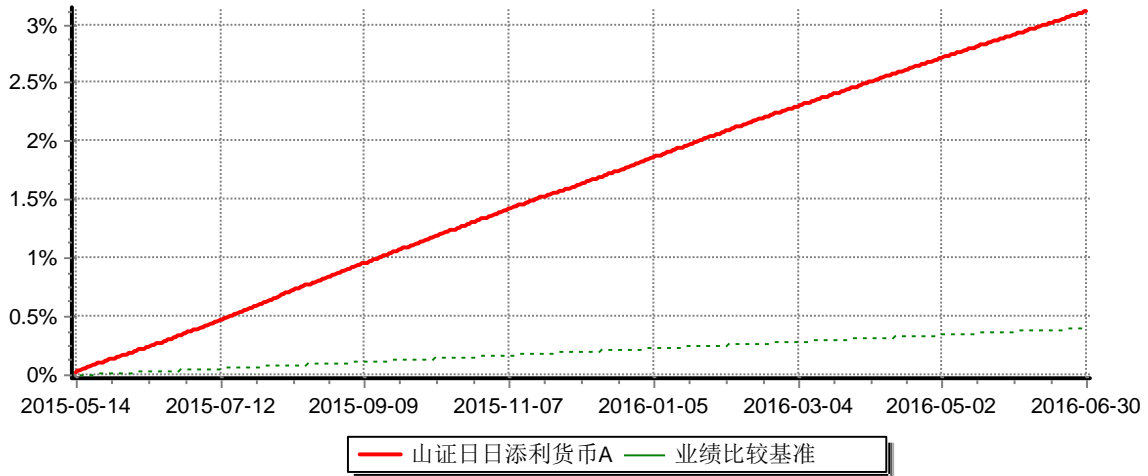


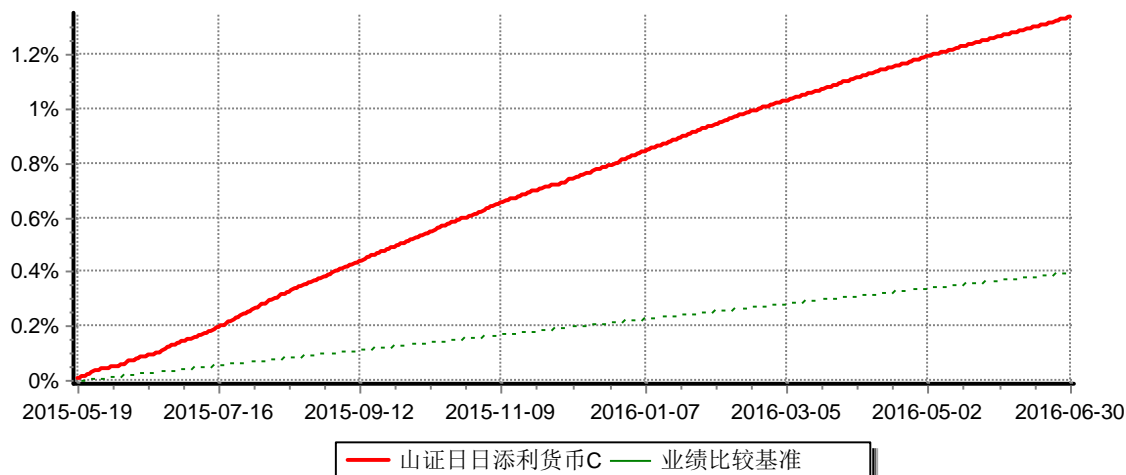
|                |  |  |  |  |  |  |
|----------------|--|--|--|--|--|--|
| 日-2016年06月30日) |  |  |  |  |  |  |
|----------------|--|--|--|--|--|--|

注：1、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

山西证券日日添利货币市场基金  
 份额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5月14日-2016年6月30日）





注：1、本基金基金合同生效日为2015年5月14日。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为基金合同生效之日起六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

## § 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。经过二十多年的发展，山西证券已发展成为作风稳健、经营稳定、管理规范、业绩良好的创新类证券公司。2010年9月20日，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。

发起人股东包括：山西省国信投资（集团）公司、太原钢铁（集团）有限公司、山西国际电力集团有限公司、山西海鑫实业股份有限公司、中信国安集团公司、山西焦化集团有限公司、山西杏花村汾酒集团有限责任公司、山西省科技基金发展总公司、山西信托股份有限公司、吕梁市投资管理公司、长治市行政事业单位国有资产管理中心、山西省经贸资产经营有限责任公司。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，其构成集中体现了多种优质资源、多家优势企业的强强联合。

公司经营范围为：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；公开募集证券投资基金管理业务。

公司与德意志银行合资设立中德证券有限责任公司；公司全资控股格林大华期货有限公司、山证国际金融控股有限公司；公司设立直投业务子公司-龙华启富投资有限责任公司。

公司设有分公司14家（管辖63家证券营业部）、总部直辖营业部15家、期货营业网点26家，分别分布在山西各地市、主要县区及北京、上海、天津、深圳、重庆、西安、宁波、大连、济南、福州等地，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，为近一百二十万客户提供全面、优质的专业服务。

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40多亿元，旗下管理山西证券日日添利货币市场基金和山西证券保本混合型证券投资基金共2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年5月14日  | —    | 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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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）公开竞价交易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成交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。

#### 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说明

#### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

PMI指标仍较弱，新订单指数和新出口订单指数表现仍偏弱，后续经济增长动能不强，虽有政策托底，但具体效应仍有待观察，预计2016年一季度经济弱回升，具体力度仍依赖基建投资增速。通胀方面，随着猪肉价格的震荡回升和石油价格反弹，预计后续通缩压力有所缓解，CPI企稳震荡，但工业品需求的弱势使得PPI仍会继续处于通缩状态。

由于基本面偏弱，央行预计继续维持宽松的货币政策，资金面整体偏宽松，但美联储加息预期及资金外流压力，货币市场资金价格可能维持在目前水平震荡，除非经济形势进一步恶化。股票市场大幅度下跌后也存在反弹需求，也会制约货币市场资金价格的继续下跌。继续看好中高评级信用债品种。

#### 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

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。

### §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

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。

#### 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

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。

### 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

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。

## § 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：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2016年6月30日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                   |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 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    | 6.4.7.2 | 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     | 6.4.7.3 | —                 | —                   |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | 79,200,518.80     | 337,501,306.25      |
| 应收证券清算款    |         | 30,007,495.84     | —                   |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 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            | 6.4.7.6    | —                         | —                           |
| 资产总计            |            | 2,934,899,768.71          | 2,834,290,886.54            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2015年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                           |                             |
| 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       |            | 99,999,750.00             | 19,599,850.60               |
| 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          | 6.4.7.7    | 50,287.70                 | 46,497.36                   |
| 应交税费            |            | —                         | —                           |
| 应付利息            |            | 5,674.66                  | 3,271.72                    |
| 应付利润            |            | 106,786.30                | 95,907.23                   |
| 递延所得税负债         |            | —                         | —                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 3,044,789.55              | 3,355,430.75                |
| 负债合计            |            | 104,680,028.41            | 24,590,742.42               |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 2,830,219,740.30          | 2,809,700,144.12            |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | —                         | —                           |
| 所有者权益合计         |            | 2,830,219,740.30          | 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。

## 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：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期2016年1月1日<br>-2016年6月30日 | 上年度可比期间2015<br>年5月14日合同生效日<br>-2015年06月30日 |
|------------------------|------------|----------------------------|--|
| 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              | 6.4.7.11   | 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             | 6.4.7.11.5 | —                          | —  |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.12   | —                          | —  |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.13   | —                          | —  |
| 股利收益                   | 6.4.7.14   | —                          | —  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15   | —                          | —  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号        |            | —                          | —  |

|                            |          |               |              |
|----------------------------|----------|---------------|--------------|
| 填列)                        |          |               |              |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列)        | 6.4.7.18 | —             | —            |
| <b>减: 二、费用</b>             |          | 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                     |          | 1,228,615.90  | 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    | 99,955.50    |
| 其中: 卖出回购金融资产支出             |          | 472,999.12    | 99,955.50    |
| 6. 其他费用                    |          | 18,980,052.52 | 2,151,301.44 |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |          | 20,579,625.85 | 2,373,748.10 |
| 减: 所得税费用                   |          | —             | —            |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |          | 20,579,625.85 | 2,373,748.10 |

### 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: 2016年1月1日-2016年6月30日

单位: 人民币元

| 项 目                               | 本期<br>2016年1月1日-2016年6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)                   | 2,809,700,144.12           | —             | 2,809,700,144.12  |
| 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.            | —             | 28,941,587,891.96 |

|  |  |                |                    |
|--|--|----------------|--------------------|
|  | 96                                     |                |                    |
| 2. 基金赎回款                                   | -28,921,068,29<br>5.78                 | —              | -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<br>(净值减少以“-”号填列) | —                                      | -20,579,625.85 | -20,579,625.85     |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                        | 2,830,219,740.3<br>0                   | —              | 2,830,219,740.30   |
| 项 目  | 上年度可比期间<br>2015年5月14日合同生效日-2015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)                            | 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)                   | —                                      | 2,373,748.10   | 2,373,748.10       |
| 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)          | 1,061,643,089.5<br>7                   | —              | 1,061,643,089.57   |
| 其中：1. 基金申购款                                | 11,390,232,455.<br>69                  | —              | 11,390,232,455.69  |
| 2. 基金赎回款                                   | -10,328,589,36<br>6.12                 | —              | -10,328,589,366.12 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动<br>(净值减少以“-”号填列) | —                                      | -2,373,748.10  | -2,373,748.10      |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                            | 1,525,809,842.3<br>6                   | —              | 1,525,809,842.36   |

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

樊廷让

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）。

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。

#### 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。

#### 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。

#### 6.4.4 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。

##### 6.4.4.1 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。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2016年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 264,451,410.76    |
| 定期存款         | 500,000,000.00    |
| 其中：存款期限1-3个月 | 150,000,000.00    |
| 其中：存款期限1个月以内 |                   |
| 其中：存款期限3个月以上 | 350,000,000.00    |
| 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。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |       | 本期末 2016年6月30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 | 2,019,422,790<br>.41 | 2,018,198,000<br>.00 | -1,224,790.41 | -0.0433% |
|    | 合计    | 2,019,422,790<br>.41 | 2,018,198,000<br>.00 | -1,224,790.41 | -0.0433% |

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。

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 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2016年6月30日 |           |
|-------|---------------|-----------|
|       | 账面余额          | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间市场 | 79,200,518.80 | —         |
| 合计    | 79,200,518.80 | —         |

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末 2016年6月30日 |
|------------|----------------|
| 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  |

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|----|----------------|
|----|----------------|

|             |           |
|-------------|-----------|
| 交易所市场应付交易费用 | —         |
| 银行间市场应付交易费用 | 50,287.70 |
| 合计          | 50,287.70 |

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —              |
| 应付赎回费       | —              |
| 预提费用        | 57,184.40      |
| 其他应付        | 2,987,605.15   |
| 合计          | 3,044,789.55   |

## 6.4.7.9 实收基金

## 6.4.7.9.1 山证日日添利货币A

金额单位：人民币元

| 项目(A级)        | 本期             |                |
|---------------|----------------|----------------|
|               | 基金份额(份)        | 账面金额           |
| 上年度末          | 10,123,855.09  | 10,123,855.09  |
| 本期申购          | 78,456,947.93  | 78,456,947.93  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -61,167,974.99 | -61,167,974.99 |
| 本期末           | 27,412,828.03  | 27,412,828.03  |

## 6.4.7.9.2 山证日日添利货币B

金额单位：人民币元

| 项目(B级)        | 本期               |                  |
|---------------|------------------|------------------|
|               | 基金份额(份)          | 账面金额             |
| 上年度末          | 7,542,784.47     | 7,542,784.47     |
| 本期申购          | 1,331,637,209.27 | 1,331,637,209.27 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -726,679,474.07  | -726,679,474.07  |
| 本期末           | 612,500,519.67   | 612,500,519.67   |



## 6.4.7.9.3 山证日日添利货币C

金额单位：人民币元

| 项目(C级)        | 本期                 |                    |
|---------------|--------------------|--------------------|
|               | 基金份额(份)            | 账面金额               |
| 上年度末          | 2,792,033,504.56   | 2,792,033,504.56   |
| 本期申购          | 27,531,493,734.76  | 27,531,493,734.76  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -28,133,220,846.72 | -28,133,220,846.72 |
| 本期末           | 2,190,306,392.60   | 2,190,306,392.60   |

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。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 山证日日添利货币A

单位：人民币元

| 项目             | 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  |
| 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        | -239,980.08 | —     | -239,980.08 |
| 本期末            | —           | —     | —           |

## 6.4.7.10.2 山证日日添利货币B

单位：人民币元

| 项目             | 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           | 7,327,863.97 | —     | 7,327,863.97 |
| 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 | -7,327,863.97 | — | -7,327,863.97 |
| 本期末     | —             | — | —             |

## 6.4.7.10.3 山证日日添利货币C

单位：人民币元

| 项目             | 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           | 13,011,781.80  | —     | 13,011,781.80  |
| 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        | -13,011,781.80 | —     | -13,011,781.80 |
| 本期末            | —              | —     | —              |

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 |
|-----------|------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,379,957.89           |
| 定期存款利息收入  | 6,422,140.70           |
| 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           |

## 6.4.7.11 债券投资收益

## 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2016年1月1日-2016年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券<br>(、债转股及债券到期兑付) | 24,393.86                  |

|                |           |
|----------------|-----------|
| 差价收入           |           |
| 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 |

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2016年1月1日-2016年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 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                  |

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.11.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

##### 6.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.16 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.17 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 |
|--------|------------------------|
| 审计费用   | 7,458.36               |
| 信息披露费  | 49,726.04              |
| 帐户维护费  | 18,200.00              |
| 汇划手续费  | 200.00                 |
| 增值服务费C | 18,904,468.12          |
| 合计     | 18,980,052.52          |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

2015年12月21日，公司收到中国证监会《关于对山西证券股份有限公司向香港子公司增资的无异议函》（机构部函【2015】3263号），公司完成该增资事项，并持有格林大华期货（香港）有限公司90%股份，公司全资子公司格林大华持有格林大华期货（香港）有限公司10%股份。同时，格林大华期货（香港）有限公司整体变更为山证国际金融控股有限公司（以下简称“山证国际金控”）。上述公司中英文名称变更均已收到香港公司注册处《公司更改名称证明书》，证明上述新名称已根据香港法例第622章公司条例于香港注册。

基金管理人变更前子公司为：

|              |             |
|--------------|-------------|
| 格林大华期货有限公司   | 基金管理人的全资子公司 |
| 龙华启富投资有限责任公司 | 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 |

基金管理人变更后子公司为：

|              |             |
|--------------|-------------|
| 格林大华期货有限公司   | 基金管理人的全资子公司 |
| 龙华启富投资有限责任公司 | 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 |
| 山证国际金融控股有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

#### 6.4.9.2 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         | 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           |

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

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。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期2016年1月1日-2016年6月30 | 上年度可比期间2015年5月14日 |
|-------|-----------------------|-------------------|
|-------|-----------------------|-------------------|

|                | 日             |                      | 合同生效日-2015年06月30日 |                      |
|----------------|---------------|----------------------|-------------------|----------------------|
|                | 成交金额          | 占当期债券<br>回购总量的<br>比例 | 成交金额              | 占当期债券<br>回购总量的<br>比例 |
| 山西证券股份<br>有限公司 | 30,000,000.00 | 100.00%              | 677,300,000.00    | 100.00%              |

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目                   | 本期2016年1月1日-2016年6<br>月30日 | 上年度可比期间2015年5月14<br>日合同生效日-2015年06月30<br>日 |
|----------------------|----------------------------|--|
| 当期发生的基金应支<br>付的管理费   | 4,607,309.41               | 484,999.03                                 |
| 其中：应支付销售机构<br>的客户维护费 | 6.02                       | —  |

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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目                 | 本期2016年1月1日-2016年6<br>月30日 | 上年度可比期间2015年5月14<br>日合同生效日-2015年06月30<br>日 |
|--------------------|----------------------------|--|
| 当期发生的基金应支<br>付的托管费 | 1,228,615.90               | 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。

## 6.4.10.2.3 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<br>2016年1月1日-2016年6月30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     | 23,942.66                          | —         | 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2015年5月14日合同生效日-2015年06月30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     | 12,664.87                          | —         | 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

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行过债券（含回购）交易。

## 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                | 本期2016年1月1日-2016年6月30日 |                 |           | 上年度可比期间2015年5月14日合同生效日-2015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 | 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 |
| 期初持有的基金份额         | —                      | —               | —         | —                                  | —               | —         |
| 期间申购/买入总份额        | —                      | 756,450,291.68  | —         | —                                  | 700,127,692.17  | —         |
| 期间因拆分变动份额         | —                      | —               | —         | —                                  | —               | —         |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | —                      | -150,000,000.00 | —         | —                                  | -700,127,692.17 | —         |
| 期末持有的基金份额         | —                      | 606,450,291.68  | —         | —                                  | —               | —         |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | —                      | 21.4277%        | —         | —                                  | —               | —         |

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。

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 |              | 本期末<br>2016年6月30日 |                  |
|-------|--------------|-------------------|------------------|
|       |              | 持有的基金份额           | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| C级    | 龙华启富投资有限责任公司 | 1204174.37        | 0.0004%          |

份额单位：份

| 关联方名称 |  | 上年度末<br>2015年12月31日 |  |
|-------|--|---------------------|--|
|-------|--|---------------------|--|



|        |                  | 持有的<br>基金份额 | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 |
|--------|------------------|-------------|----------------------|
| C<br>级 | 龙华启富投资有<br>限责任公司 | 18268.41    | 0.00%                |

关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

#### 6.4.10.5 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2016年1月1日-2016年6月30<br>日 |              | 上年度可比期间2015年5月14日<br>合同生效日-2015年06月30日 |              |
|--------------|----------------------------|--------------|--|--------------|
|              | 期末<br>余额                   | 当期<br>存款利息收入 | 期末<br>余额                               | 当期<br>存款利息收入 |
| 交通银行活期<br>存款 | 264,451,410.76             | 2,379,957.89 | 121,518,788.76                         | 906,297.97   |
| 交通银行定期<br>存款 | 50,000,000.00              | 1,841,902.79 | 60,000,000.00                          | 296,000.16   |

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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

单位：人民币元

|                      |                       |              |            |    |
|----------------------|-----------------------|--------------|------------|----|
| 已按再投资形式转<br>实收基金(A级) | 直接通过应付<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计   | 备注 |
| 238,880.60           | —                     | 1,099.48     | 239,980.08 |    |
| 已按再投资形式转<br>实收基金(B级) | 直接通过应付<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计   | 备注 |

|                      |                       |              |               |    |
|----------------------|-----------------------|--------------|---------------|----|
| 7,281,700.33         | —                     | 46,163.64    | 7,327,863.97  |    |
| 已按再投资形式转<br>实收基金(C级) | 直接通过应付<br>赎回款转出金<br>额 | 应付利润<br>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 |    |

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30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99999750.00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        |
|-----------|-------------|------------|--------|---------|---------------|
| 041553049 | 15中铝业CP001  | 2016-07-01 | 99.94  | 500000  | 49,970,000.00 |
| 011515009 | 15中铝业SCP009 | 2016-07-01 | 99.93  | 400000  | 39,972,000.00 |
| 011515011 | 15中铝业SCP011 | 2016-07-01 | 99.84  | 100000  | 9,984,000.00  |
| 合计        | —           | —          | —      | 1000000 | 99,926,000.00 |

###### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 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，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。

##### 6.4.13.2.1 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<br>2016年6月30日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 1,699,467,417.18  | 1,623,652,023.12    |
| A-1以下  | —                 | —                   |
| 未评级    | 319,955,373.23    | 310,016,105.63      |
| 合计     | 2,019,422,790.41  | 1,933,668,128.75    |

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级的债券投资。

### 6.4.13.3 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。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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，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。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

| 本期末2016年6月30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          | 564,451,410.76   | 200,000,000.00 | —                | —    | —    | —             | 764,451,410.76   |
| 交易性金融资产       | 420,052,725.67   | 450,151,611.99 | 1,149,218,452.75 | —    | —    | —             | 2,019,422,790.41 |
| 买入返售金融资产      | 79,200,518.80    | —              | —                | —    | —    | —             | 79,200,518.80    |
| 应收证券清算款       | —                | —              | —                | —    | —    | 30,007,495.84 | 30,007,495.84    |
| 应收利息          | —                | —              | —                | —    | —    | 40,796,468.75 | 40,796,468.75    |
| 应收申购款         | —                | —              | —                | —    | —    | 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 |
| 负债            |                  |                |                  |      |      |               |                  |
| 卖出回购金融资产款     | 99,999,750.00    | —              | —                | —    | —    | —             | 99,999,750.00    |
| 应付管理人报酬       | —                | —              | —                | —    | —    | 763,950.69    | 763,950.69       |
| 应付托管费         | —                | —              | —                | —    | —    | 203,720.18    | 203,720.18       |
| 应付销售服务费       | —                | —              | —                | —    | —    | 505,069.33    | 505,069.33       |
| 应付交易费用        | —                | —              | —                | —    | —    | 50,287.70     | 50,287.70        |

|                 |                |                |                  |      |      |               |                  |
|-----------------|----------------|----------------|------------------|------|------|---------------|------------------|
| 应付利息            | —              | —              | —                | —    | —    | 5,674.66      | 5,674.66         |
| 应付利润            | —              | —              | —                | —    | —    | 106,786.30    | 106,786.30       |
| 其他负债            | —              | —              | —                | —    | —    | 3,044,789.55  | 3,044,789.55     |
| 负债总计            | 99,999,750.00  | —              | —                | —    | —    | 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 | 2,830,219,740.30 |
| 上年度末2015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            | 157,613,467.19 | 200,000,000.00 | 150,000,000.00   | —    | —    | —             | 507,613,467.19   |
| 交易性金融资产         | 30,024,044.22  | 641,398,805.81 | 1,262,245,278.72 | —    | —    | —             | 1,933,668,128.75 |
| 买入返售金融资产        | 337,501,306.25 | —              | —                | —    | —    | —             | 337,501,306.25   |
| 应收利息            | —              | —              | —                | —    | —    | 55,497,080.74 | 55,497,080.74    |
| 应收申购款           | —              | —              | —                | —    | —    | 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 |
| 负债              |                |                |                  |      |      |               |                  |
| 卖出回购金融资产款       | 19,599,850.60  | —              | —                | —    | —    | —             | 19,599,850.60    |
| 应付管理人           | —              | —              | —                | —    | —    | 734,692       | 734,692          |

|         |                |                |                  |   |   |               |                  |
|---------|----------------|----------------|------------------|---|---|---------------|------------------|
| 报酬      |                |                |                  |   |   | .34           | .34              |
| 应付托管费   | —              | —              | —                | — | — | 195,917.93    | 195,917.93       |
| 应付销售服务费 | —              | —              | —                | — | — | 559,174.49    | 559,174.49       |
| 应付交易费用  | —              | —              | —                | — | — | 46,497.36     | 46,497.36        |
| 应付利息    | —              | —              | —                | — | — | 3,271.72      | 3,271.72         |
| 应付利润    | —              | —              | —                | — | — | 95,907.23     | 95,907.23        |
| 其他负债    | —              | —              | —                | — | — | 3,355,430.75  | 3,355,430.75     |
| 负债总计    | 19,599,850.60  | —              | —                | — | — | 4,990,891.82  | 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 |

#### 6.4.13.4.1.2 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（2015年6月30日）             |
|    | 市场利率下降25个基点        | 1,941,530.74                |
|    | 市场利率上升25个基点        | -1,938,700.52               |

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.14 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。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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 | 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          | 79,200,518.80    | 2.70   |
|   | 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  |
|   | 其他各项资产            | 71,825,048.74    | 2.45   |
|   | 合计                | 2,934,899,768.71 | 100.00 |

## 7.2 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   | —              |                |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 99,999,750.00  | 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

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%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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    | 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120天情况说明

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。

### 7.3.2 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                | 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)—120天          | 7.78                | —                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | —                   | —                   |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 32.83               | —                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | —                   | —                   |
|    | 合计                   | 102.22              | 3.53                |

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期没有超过240天的情况。

#### 7.5 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      | 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 | 其他                 | —                | —     |
| 8 | 合计                 | 2,019,422,790.41 | 71.35 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | —                | —     |

## 7.6 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<br>(张) | 摊余成本          | 占基金资产净<br>值<br>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                 |

## 7.7 “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                  | 0.0861%  |
| 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

注：无。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：无。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

#### 7.9 投资组合报告附注

##### 7.9.1 基金计价方法说明。

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。

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

##### 7.9.3 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 | 30,007,495.84 |
| 3  | 应收利息    | 40,796,468.75 |
| 4  | 应收申购款   | 1,021,084.15  |
| 5  | 其他应收款   | —             |
| 6  | 待摊费用    | —             |
| 7  | 其他      | —             |
| 8  | 合计      | 71,825,048.74 |

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别          | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额      | 持有人结构              |                |                      |                |
|-------------------|--------------|--------------------|--------------------|----------------|----------------------|----------------|
|                   |              |                    | 机构投资者              |                | 个人投资者                |                |
|                   |              |                    | 持有<br>份额           | 占总份<br>额<br>比例 | 持有<br>份额             | 占总份<br>额<br>比例 |
| 山证日<br>日添利<br>货币A | 1,183        | 23,172.30          | 5,573,513.<br>99   | 20.33%         | 21,839,314<br>.04    | 79.67%         |
| 山证日<br>日添利<br>货币B | 2            | 306,250.25<br>9.84 | 606,450.29<br>1.68 | 99.01%         | 6,050,227.<br>99     | 0.99%          |
| 山证日<br>日添利<br>货币C | 32,116       | 68,199.85          | 114,798.55<br>9.69 | 5.24%          | 2,075,507,<br>832.91 | 94.76%         |
| 合计                | 33,301       | 84,989.03          | 726,822.36<br>5.36 | 25.68%         | 2,103,397,<br>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）。

## 8.2 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 |
|-----------------------|---------------|------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人<br>员持有本基金 | 山证日日添<br>利货币A | 700,844.86 | 2.56%    |
|                       | 山证日日添<br>利货币B | —          | —        |
|                       | 山证日日添<br>利货币C | 132,649.70 | 0.01%    |
|                       | 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）。

### 8.3 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 | 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              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 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                 |

### §9 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5月14日)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  |
| 本报告期基金总申购份额               | 78,456,947.93  | 1,331,637,209.27 | 27,531,493,734.76 |
| 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 |

|              |               |                |                  |
|--------------|---------------|----------------|------------------|
| 本报告期期末基金份额总额 | 27,412,828.03 | 612,500,519.67 | 2,190,306,392.60 |
|--------------|---------------|----------------|------------------|

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

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。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 债券成交金额 | 债券交易占当期成交总额的比例 | 债券回购成交金额      | 债券回购交易占当期成交总额的比例 | 权证交易成交金额 | 权证交易占当期成交总额的比例 | 应付券商的佣金 | 应付券商的佣金占当期佣金总量的比例 | 备注 |
|------|--------|--------|----------------|---------------|------------------|----------|----------------|---------|-------------------|----|
| 山西证券 | 2      | —      | —              | 30,000,000.00 | 100.00%          | —        | —              | —       | —                 | —  |

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况况稳定。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。

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。

## 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

无。

## 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                               | 信息披露方式                | 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。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

## 12.2 存放地点

太原市府西街69号山西国际贸易中心。

## 12.3 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

二〇一六年八月二十九日