山证资管日日添利货币市场基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:山证（上海）资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月26日

目录

§1 重要提示 3
§2 基金产品概况 3
§3 主要财务指标和基金净值表现 5
3.1 主要财务指标 5
3.2 基金净值表现 5
§4 管理人报告 9
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 9
4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明 11
4.3 公平交易专项说明 11
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 11
4.5 报告期内基金的业绩表现 12
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 13
§5 投资组合报告 13
5.1 报告期末基金资产组合情况 13
5.2 报告期债券回购融资情况 13
5.3 基金投资组合平均剩余期限 14
5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 14
5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 15
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 15
5.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 16
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 16
5.9 投资组合报告附注 16
§6 开放式基金份额变动 17
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 17
§8 影响投资者决策的其他重要信息 19
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 19
8.2 影响投资者决策的其他重要信息 19
§9 备查文件目录 19
9.1 备查文件目录 19
9.2 存放地点 20
9.3 查阅方式 20

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	山证资管日日添利货币
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
报告期末基金份额总额	7,498,151,512.03份
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。 1、资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政与货币政策形势、信用状况、市场结构变化和短期资金供给等因素的综合判断，结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征，决定各类资产的配置比例和期限匹配量，并适时进行动态调整。 2、个券选择策略 本基金将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值，发掘

	出具备相对价值的个券。 3、银行存款投资策略 本基金根据不同银行的银行存款收益率情况，结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析，以及对整个利率市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。 4、久期策略 本基金根据对未来短期利率走势的研判，结合货币市场基金资产的高流动性要求及其相关的投资比例规定，动态调整组合的久期。当预期市场短期利率上升时，本基金将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期，以降低组合跌价风险；当预期市场短期利率下降时，则通过增持剩余期限较长的债券等方式提高组合久期，以分享债券价格上升的收益。 5、回购策略 根据回购市场利率走势变化情况，在回购利率较低时，本基金在严格遵守相关法律法规的前提下，利用正回购操作循环融入资金进行债券投资，提高基金收益水平。另一方面，本基金将把握资金供求的瞬时效应，积极捕捉收益率峰值的短线机会。如新股发行期间、年末资金回笼时期的季节效应等短期资金供求失衡，导致回购利率突增等。此时，本基金可通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。 6、套利策略 不同交易市场或不同交易品种受参与群体、交易模式、环境冲击、流动性等因素影响而出现定价差异，从而产生套利机会。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上，适度进行跨市场或跨品种套利操作，提高资产收益率。如跨银行间和交易所的跨市场套利，期限收益结构偏移中的不同期限品种的互换操作（跨期限套利）。 7、现金流管理策略 本基金作为现金管理工具，具有较高的流动性要求，本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎

	回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。			
业绩比较基准	人民币活期存款利率（税后）			
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。			
基金管理人	山证（上海）资产管理有限公司			
基金托管人	交通银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	山证资管日日添利货币A	山证资管日日添利货币B	山证资管日日添利货币C	山证资管日日添利货币E
下属分级基金的交易代码	001175	001176	001177	024724
报告期末下属分级基金的份额总额	109,707,715.08份	2,179,025,985.92份	5,189,213,989.92份	20,203,821.11份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026年07月01日 - 2026年09月30日)			
	山证资管日日添利货币A	山证资管日日添利货币B	山证资管日日添利货币C	山证资管日日添利货币E
1.本期已实现收益	226,256.32	4,616,742.81	2,078,517.83	55,846.25
2.本期利润	226,256.32	4,616,742.81	2,078,517.83	55,846.25
3.期末基金资产净值	109,707,715.08	2,179,025,985.92	5,189,213,989.92	20,203,821.11

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、本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配为"每日分配、按日支付"。

4、本基金于2025年7月28日起新增E类份额。

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

山证资管日日添利货币A净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.2138%	0.0000%	0.0895%	0.0000%	0.1243%	0.0000%
过去六个月	0.4471%	0.0001%	0.1781%	0.0000%	0.2690%	0.0001%
过去一年	0.9429%	0.0002%	0.3555%	0.0000%	0.5874%	0.0002%
过去三年	3.9175%	0.0009%	1.0712%	0.0000%	2.8463%	0.0009%
过去五年	7.8401%	0.0011%	1.7911%	0.0000%	6.0490%	0.0011%
过去七年	12.7936%	0.0014%	2.5171%	0.0000%	10.2765%	0.0014%
过去十年	23.5243%	0.0021%	3.6143%	0.0000%	19.9100%	0.0021%
自基金合同生效起至今	28.1364%	0.0021%	4.1253%	0.0000%	24.0111%	0.0021%

山证资管日日添利货币B净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.2769%	0.0000%	0.0895%	0.0000%	0.1874%	0.0000%
过去六个月	0.5730%	0.0001%	0.1781%	0.0000%	0.3949%	0.0001%
过去一年	1.1952%	0.0002%	0.3555%	0.0000%	0.8397%	0.0002%
过去三年	4.6987%	0.0009%	1.0712%	0.0000%	3.6275%	0.0009%
过去五年	9.1953%	0.0011%	1.7911%	0.0000%	7.4042%	0.0011%
过去七年	14.7846%	0.0014%	2.5171%	0.0000%	12.2675%	0.0014%
过去十年	26.6548%	0.0021%	3.6143%	0.0000%	23.0405%	0.0021%
自基金合同生效起至今	31.6078%	0.0021%	4.1253%	0.0000%	27.4825%	0.0021%

山证资管日日添利货币C净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

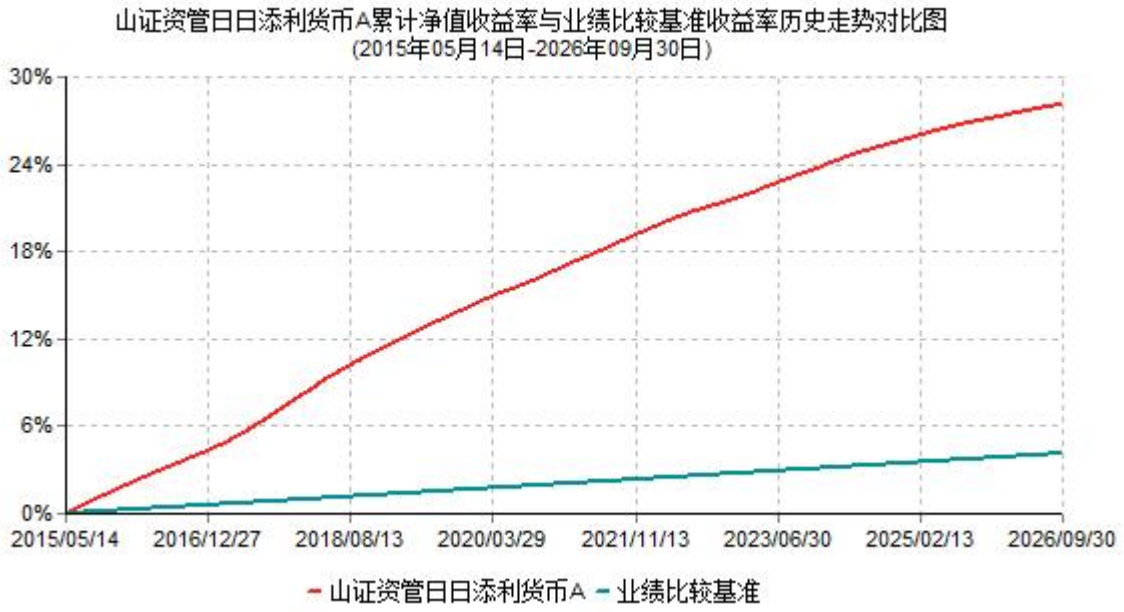
过去三个月	0.0359%	0.0001%	0.0895%	0.0000%	-0.0536%	0.0001%
过去六个月	0.0877%	0.0002%	0.1781%	0.0000%	-0.0904%	0.0002%
过去一年	0.2183%	0.0002%	0.3555%	0.0000%	-0.1372%	0.0002%
过去三年	1.0246%	0.0005%	1.0712%	0.0000%	-0.0466%	0.0005%
过去五年	2.4268%	0.0007%	1.7911%	0.0000%	0.6357%	0.0007%
过去七年	4.1575%	0.0008%	2.5171%	0.0000%	1.6404%	0.0008%
过去十年	9.0547%	0.0016%	3.6143%	0.0000%	5.4404%	0.0016%
自基金合同生效起至今	10.7630%	0.0015%	4.1202%	0.0000%	6.6428%	0.0015%

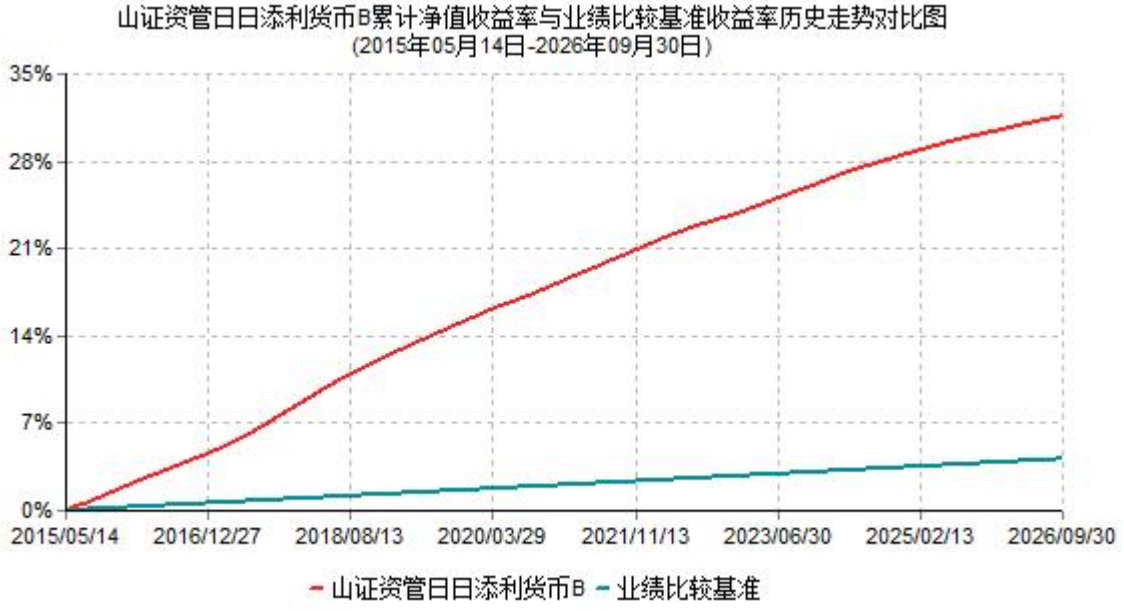
山证资管日日添利货币E净值表现

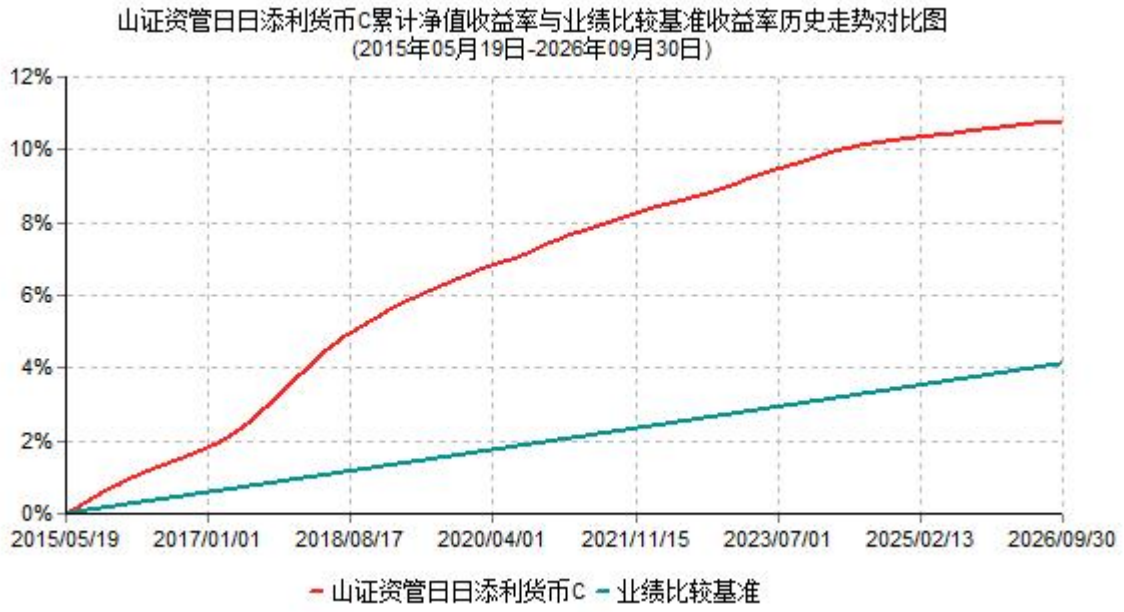
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.2769%	0.0000%	0.0895%	0.0000%	0.1874%	0.0000%
过去六个月	0.5730%	0.0001%	0.1781%	0.0000%	0.3949%	0.0001%
过去一年	1.1952%	0.0002%	0.3555%	0.0000%	0.8397%	0.0002%
自基金合同生效起至今	1.4128%	0.0003%	0.4189%	0.0000%	0.9939%	0.0003%

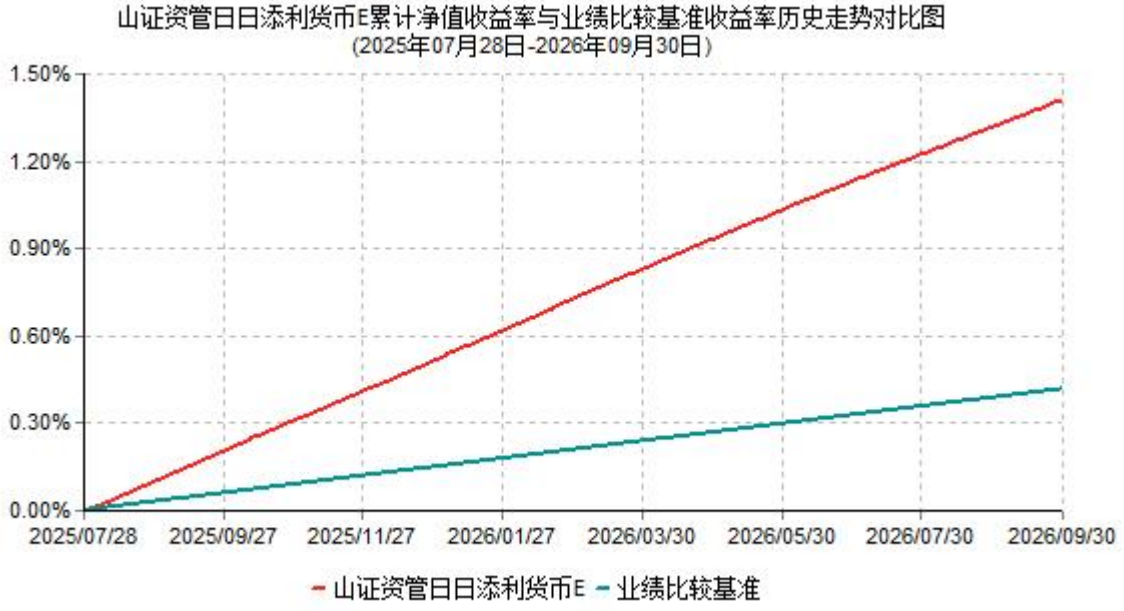
1、本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）；
2、本基金收益分配是按日结转份额。

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


山证资管日日添利货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年05月14日-2026年09月30日)
30%
24%
18%
12%
6%
0%
2015/05/14
2016/12/27
2018/08/13
2020/03/29
2021/11/13
2023/06/30
2025/02/13
2026/09/30
山证资管日日添利货币A
业绩比较基准


山证资管日日添利货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年05月14日-2026年09月30日)
35%
28%
21%
14%
7%
0%
2015/05/14
2016/12/27
2018/08/13
2020/03/29
2021/11/13
2023/06/30
2025/02/13
2026/09/30
山证资管日日添利货币B
业绩比较基准





1、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的有关约定。
2、本基金于 2025 年 7 月 28 日起新增 E 类份额。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		

蓝烨	本基金的基金经理	2023-03-14	-	13年	蓝烨女士，厦门大学金融学硕士。2013年7月至2017年2月在光大证券股份有限公司担任债券交易员。2017年3月至2020年3月在太平基金管理有限公司担任债券投资经理助理。2020年3月至2020年9月在太平基金管理有限公司担任产品经理。2020年9月加入山西证券股份有限公司公募基金部担任基金经理助理。2022年8月起担任山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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；2022年9月起任山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金基金经理；2023年2月起任山西证券裕景30天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理；2023年3月起任山西证券日日添利货币市场基金基金经理。2024年4月起担任山西证券中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。自2025年2月28日起，上述山西证券股份有限公司旗下基金的基金管理人变更为山证（上海）资产管理有限公司。2025年9月起担任山证资管裕泽债券型发起式证券投资基金基金经理。蓝烨

					女士具备基金从业资格。

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责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 公平交易专项说明

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，拟定了《山证（上海）资产管理有限公司公平交易管理细则》、《山证（上海）资产管理有限公司集中交易管理办法》、《山证（上海）资产管理有限公司异常交易管理细则》，对公司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，并规定对买卖股票、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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度美伊前期趋于缓和的关系破裂，布伦特原油突破100美元/桶，地缘风险溢价显著抬升。油价飙升推升美国通胀压力，9月美联储如期加息，美元指数走强，全球风险资产承压。

国内经济增长方面，宏观总量波动降低，经济结构分化延续，出口与政策拉动是经济的主要增量来源，内需拉动特征尚不明显。8月制造业PMI回升0.6至49.8、略低于预期49.9，产需重回扩张区间但绝对水平偏低，装备制造业和高技术制造业PMI分别为51.4、52.9持续位于扩张区间，新动能较为强劲。8月出口同比25.0%、连续七个月维持双位数，进口同比28.2%，贸易顺差1190.9亿美元、较7月扩大，结构上出口边际贡献几乎都来自AI链，1—8月集成电路出口金额累计增长103.9%、数量仅增长4.1%，以提价为主。通胀方面，能源与AI链推升价格、PPI-CPI剪刀差维持高位，价格传到不畅，M1-M2负剪刀差反映企业资金活性不足。社零连续两月回落，内需依然疲弱。

展望四季度，当前基本面产业的K型分化很难在短期内逆转，出口、政策拉动仍是经济主要增量来源。此前出口高增更多源于涨价，但在全球加息预期增强以及AI相关产品涨价放缓的背景下，出口增速可能已处于震荡或高位收敛态势，经济增长更需内需发力。通胀层面，短期油价反复、有色修复及AI产业链价格传导影响下，PPI环比存在阶段性反复可能，且涨价行业集中于上游、算力等少数行业，并未向中下游广泛传导，通胀走势不确定性增加。

国内政策方面，货币政策保持“流动性合理充裕+结构性政策优化”的主线，对短端利率的调控更加精细，资金波动率明显降低，9月央行三季度货币政策例会单独强调"加大逆周期调节力度"，政策重心向短期稳增长倾斜。三季度末财政发力信号增强，8月新增专项债发行放量，9月新型政策性金融工具开始投放，财政部明确“下半年存量政策将加快落地，同时将根据经济运行情况及时谋划增量政策”释放较为积极的稳增长信号。

展望四季度，基本面有望在政策加码下边际改善。财政端，8000亿元新型政策性金融工具加速落地，"六张网"基建项目开工叠加专项债结存限额盘活，基建投资有望集中释放；3000亿元注资特别国债预计四季度初发行。货币政策维持"适度宽松"基调，降准概率高于降息。债市“钱多”逻辑不变，大幅回调动能不足，债牛方向并未改变。政策发力更多重视新兴产业与发展质量，对依赖信贷的传统行业拉动较低，信贷需求延续偏弱，债券成为机构资产配置的主要方向。

本基金报告期内合理把握配置节奏，在注重安全性和流动性的基础上，合理安排同业存款、同业存单、逆回购、高等级债券等资产的配置比例，积极优化配置结构，控制账户久期及各项风控指标，努力实现低风险基础上的较好回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山证资管日日添利货币A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.2138%，同期业绩比较基准收益率为0.0895%；截至报告期末山证资管日日添利货币B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收

益率为0.2769%，同期业绩比较基准收益率为0.0895%；截至报告期末山证资管日日添利货币C基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.0359%，同期业绩比较基准收益率为0.0895%；截至报告期末山证资管日日添利货币E基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.2769%，同期业绩比较基准收益率为0.0895%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人，未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	5,901,181,007.08	78.63
	其中：债券	5,901,181,007.08	78.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	550,567,997.78	7.34
	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	1,053,362,958.81	14.04
4	其他资产	-	-
5	合计	7,505,111,963.67	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	0.26
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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

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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	17.34	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	10.23	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	32.70	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	3.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	36.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.99	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	571,920,719.46	7.63
6	中期票据	154,478,438.23	2.06
7	同业存单	5,174,781,849.39	69.01
8	其他	-	-
9	合计	5,901,181,007.08	78.70
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112603137	26农业银行CD137	2,000,000	199,468,229.93	2.66
2	112606106	26交通银行CD106	1,500,000	149,085,650.74	1.99
3	112613012	26浙商银行CD012	1,000,000	99,925,529.81	1.33
4	112603087	26农业银行CD087	1,000,000	99,888,089.07	1.33
5	112695628	26广州银行CD076	1,000,000	99,816,707.18	1.33
6	112695683	26南京银行CD127	1,000,000	99,812,892.15	1.33
7	112695702	26长沙银行CD087	1,000,000	99,812,222.94	1.33
8	112517246	25光大银行CD246	1,000,000	99,759,618.02	1.33
9	112696389	26江西银行CD031	1,000,000	99,757,769.48	1.33

10	112696639	26湖南银行CD056	1,000,000	99,740,436.11	1.33
11	112696637	26东莞农村商业银行CD040	1,000,000	99,740,436.11	1.33
12	112696626	26广州银行CD091	1,000,000	99,740,436.11	1.33

5.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0069%
报告期内偏离度的最低值	-0.0033%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0018%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。

5.9.2 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	山证资管日日添利货币A	山证资管日日添利货币B	山证资管日日添利货币C	山证资管日日添利货币E
报告期期初基金份额总额	96,332,606.76	2,946,318,611.65	5,716,228,857.60	20,145,174.58
报告期期间基金总申购份额	218,865,419.83	1,950,993,311.22	39,423,400,841.72	122,863.49
报告期期间基金总赎回份额	205,490,311.51	2,718,285,936.95	39,950,415,709.40	64,216.96
报告期期末基金份额总额	109,707,715.08	2,179,025,985.92	5,189,213,989.92	20,203,821.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利发放	2026-07-01	9,924.03	-	0
2	红利发放	2026-07-02	9,630.76	-	0
3	红利发放	2026-07-03	9,264.97	-	0
4	红利发放	2026-07-06	28,514.92	-	0
5	红利发放	2026-07-07	9,560.89	-	0
6	红利发放	2026-07-08	9,348.91	-	0
7	红利发放	2026-07-09	9,418.39	-	0
8	红利发放	2026-07-10	9,464.77	-	0
9	申购	2026-07-10	100,000,000.00	100,000,000.00	0
10	红利发放	2026-07-13	37,145.07	-	0
11	红利发放	2026-07-14	12,480.18	-	0
12	红利发放	2026-07-15	12,123.24	-	0
13	红利发放	2026-07-16	12,448.71	-	0
14	红利发放	2026-07-17	12,377.97	-	0
15	红利发放	2026-07-20	37,219.65	-	0
16	红利发放	2026-07-21	12,564.88	-	0
17	红利发放	2026-07-22	12,246.29	-	0
18	红利发放	2026-07-23	12,415.88	-	0

19	红利发放	2026-07-24	12,272.07	-	0
21	红利发放	2026-07-27	37,192.32	-	0
20	红利发放	2026-07-28	12,572.96	-	0
22	红利发放	2026-07-29	12,197.14	-	0
23	红利发放	2026-07-30	12,360.12	-	0
24	红利发放	2026-07-31	12,534.26	-	0
25	红利发放	2026-08-03	37,104.65	-	0
26	红利发放	2026-08-04	12,639.94	-	0
27	红利发放	2026-08-05	12,024.10	-	0
28	红利发放	2026-08-06	12,386.30	-	0
29	红利发放	2026-08-07	12,355.57	-	0
30	红利发放	2026-08-10	36,819.32	-	0
31	红利发放	2026-08-11	12,544.79	-	0
32	红利发放	2026-08-12	11,848.23	-	0
33	红利发放	2026-08-13	12,258.78	-	0
34	红利发放	2026-08-14	12,220.99	-	0
35	红利发放	2026-08-17	36,950.19	-	0
36	红利发放	2026-08-18	12,527.82	-	0
37	红利发放	2026-08-19	12,030.00	-	0
38	红利发放	2026-08-20	12,215.36	-	0
39	红利发放	2026-08-21	12,161.37	-	0
40	红利发放	2026-08-24	36,795.39	-	0
41	红利发放	2026-08-25	12,550.28	-	0
42	红利发放	2026-08-26	11,996.68	-	0
43	红利发放	2026-08-27	12,309.18	-	0
44	红利发放	2026-08-28	12,442.07	-	0
45	红利发放	2026-08-31	37,168.16	-	0
46	红利发放	2026-09-01	12,523.15	-	0
47	红利发放	2026-09-02	12,205.13	-	0
48	红利发放	2026-09-03	12,321.52	-	0
49	红利发放	2026-09-04	12,391.04	-	0
50	红利发放	2026-09-07	37,133.27	-	0
51	红利发放	2026-09-08	12,618.55	-	0

52	红利发放	2026-09-09	12,096.62	-	0
53	红利发放	2026-09-10	12,322.40	-	0
54	红利发放	2026-09-11	12,343.19	-	0
55	红利发放	2026-09-14	37,024.91	-	0
56	红利发放	2026-09-15	12,449.65	-	0
57	红利发放	2026-09-16	12,068.48	-	0
58	红利发放	2026-09-17	12,382.28	-	0
59	红利发放	2026-09-18	12,463.34	-	0
60	红利发放	2026-09-21	37,261.33	-	0
61	红利发放	2026-09-22	13,033.83	-	0
62	红利发放	2026-09-23	12,073.22	-	-
63	红利发放	2026-09-24	12,322.62	-	-
64	红利发放	2026-09-28	49,361.31	-	-
65	红利发放	2026-09-29	12,359.21	-	-
66	赎回	2026-09-29	-50,000,000.00	-50,000,000.00	-
67	赎回	2026-09-29	-100,000,000.00	-100,000,000.00	-
68	红利发放	2026-09-30	8,046.04	-	-
合计			-48,896,571.36	-50,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册及变更的文件；

2、山证资管日日添利货币市场基金基金合同；

3、山证资管日日添利货币市场基金托管协议；

4、山证资管日日添利货币市场基金招募说明书；

5、山证资管日日添利货币市场基金产品资料概要；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内本基金披露的各项公告；

9、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者可以通过以下途径咨询相关事宜：

1、客服热线：0351-95573、95573

2、公司公募基金业务网站：https://szzg.sxzq.com/

山证（上海）资产管理有限公司

2026年10月26日