摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）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 27 日

§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 26 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
基金主代码	019683
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 18 日
报告期末基金份额总额	472,416,715.90 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	(一)资产配置策略 本基金将在降低跟踪误差和控制流动性风险的前提下构建指数化的投资组合。本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%。 (二)抽样复制策略 本基金按待偿期将可投资同业存单进行分层，综合考虑同业存单发行人的信用资质、存单流动性及可获得性，在每个分层中选取一定数量个券，分配权重，使得组合每个分层的权重占比与指数保持一致。本基金将定期对投资组合进行调整，以确保组合总体特征与标的指数相似，并缩小跟踪误差。当发生较大的申购赎回、组合中同业存单派息、存单到期以及市场波动剧烈等情况，导致投资组合与标的指数出现偏离，本基金将综合考虑市场流动性、交易成本、偏离程度等因素，对投资组合进行不定期的动态调整以缩小跟踪误差。 (三)替代性策略 基金管理人可以在成份券和备选成份券外寻找其他存单和债券构

	建替代组合，本基金将选取与成份券久期相近、剩余期限基本匹配的存单和债券进行替代。在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，如久期管理、期限结构配置、类别配置、骑乘、息差等优化策略对基金资产进行调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 (四)资产支持证券投资策略 本基金将在严格控制组合投资风险的前提下投资于资产支持证券。本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金预期风险与预期收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	258,669.98
2.本期利润	251,054.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0023
4.期末基金资产净值	490,463,830.71
5.期末基金份额净值	1.0382

注：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。

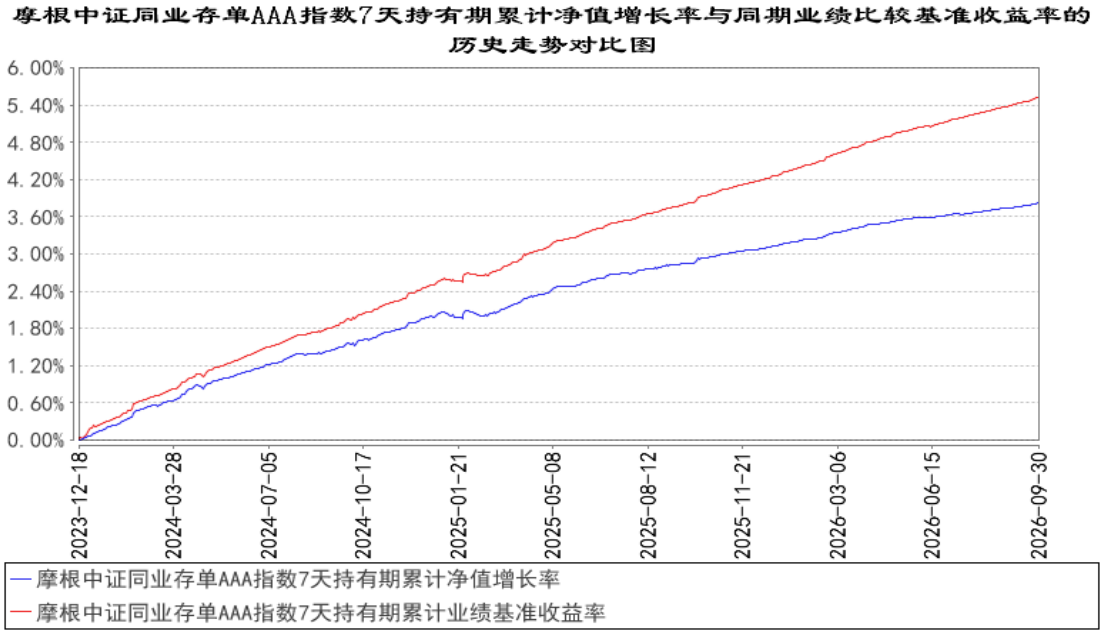
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.18%	0.00%	0.37%	0.00%	-0.19%	0.00%
过去六个月	0.38%	0.01%	0.75%	0.00%	-0.37%	0.01%
过去一年	0.90%	0.01%	1.61%	0.01%	-0.71%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.82%	0.01%	5.53%	0.01%	-1.71%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金合同生效日为 2023 年 12 月 18 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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		
鞠婷	本基金基金经理	2023 年 12 月 18 日	-	21 年	鞠婷女士曾任中国建设银行第一支行助理经济师，瑞穗银行总行总经理助理。

					2014 年 10 月起加入摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司)，历任基金经理助理、基金经理，高级基金经理，现任货币市场投资部副总监兼资深基金经理。
邱林晶	本基金基金经理	2023 年 12 月 22 日	-	13 年	邱林晶女士曾任国泰基金管理有限公司风险管理部分析师，平安资产管理有限责任公司固收交易员，中银理财有限责任公司集中交易室高级经理、活期理财产品部投资经理；自 2022 年 5 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），历任货币市场投资部基金经理助理，现任基金经理。

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；对非首任基金经理，"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中国证监会及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，在控制风险的前提下，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、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环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 19 次，均为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，尽管国际地缘政治冲突仍在持续，我国经济延续总体平稳、向新向优的发展态势。8 月货物贸易出口（美元计价）同比增长 25%，保持稳定增长态势；8 月份全国规模以上工业增加值同比增长 5.2%，比上月加快 0.7%，装备制造业和高技术制造业快速增长；1—8 月份固定资产投资同比下降 7.2%，投资由过去侧重规模扩张转向更加注重科技创新、产业升级和基础支撑；8 月份社会消费品零售总额同比增长 0.4%，消费品以旧换新政策持续发力，限额以上单位通讯器材类零售额增长 27.3%；9 月份制造业采购经理人指数（PMI）为 50.1%，比上月上升 0.3%，升至扩张区间；8 月消费者价格指数（CPI）当月同比上涨 0.8%，生产者价格指数（PPI）当月同比上涨 3.8%，主要受能源价格涨幅扩大影响。

三季度，货币政策保持适度宽松，综合运用多种货币政策工具，为经济持续向好创造适宜的货币金融环境。本季度，央行在税期、月末开展隔夜逆回购操作以更好地匹配银行体系短期流动性需求，结合 7 天期逆回购、买断式回购、中期借贷便利（MLF）等工具共同维护资金市场的平稳运行。此外，央行下调抵押补充贷款（PSL）利率 0.25 个百分点，一年期 PSL 利率从 1.75%降至 1.5%，同时扩大 PSL 支持范围至水网、新型电网、算力网、新一代通信网、城市地下管网、物流网等“六张网”建设，更好激励政策性银行支持实体经济。本季度货币市场运行平稳，流动性整体较为充裕，银行间隔夜质押式回购利率围绕 1.40%波动。同业存单收益率窄幅震荡，曲线期限利差处于低位，1 年期国股行同业存单季末成交在 1.47%附近。

报告期内，本基金采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，以实现对标的指数的有效跟踪，本季度组合整体运行状况良好。

展望下季度，我国经济或仍面临供强需弱、结构分化、外部冲击等问题和挑战，预计央行将继续实施适度宽松的货币政策，加大逆周期调节力度，保持流动性充裕，促进经济稳定增长和物

价合理回升。预计银行负债成本将维持在较低水平，同业存单收益率可能在当前位置窄幅震荡。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期份额净值增长率为:0.18%，同期业绩比较基准收益率为:0.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	446,291,277.87	90.92
	其中：债券	446,291,277.87	90.92
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	36,904,430.95	7.52
8	其他资产	7,651,200.00	1.56
9	合计	490,846,908.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有指数投资股票。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票 。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 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	30,160,468.50	6.15
	其中：政策性金融债	30,160,468.50	6.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	416,130,809.37	84.84
9	其他	-	-
10	合计	446,291,277.87	90.99

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112618063	26 华夏银行 CD063	400,000	39,733,778.85	8.10
2	112604067	26 中国银行 CD067	300,000	29,695,249.23	6.05
3	112606166	26 交通银行 CD166	300,000	29,693,986.81	6.05
4	260308	26 进出 08	200,000	20,031,221.92	4.08
5	112509295	25 浦发银行 CD295	200,000	19,967,836.38	4.07

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国邮政储蓄银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到央行的处罚，中国进出口银行报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局的处罚，广发银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到央行、国家外汇管理局广东省分局的处罚，渤海银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到央行、国家金融监督管理总局、国家外汇管理局天津市分局的处罚，交通银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、央行的处罚，中国银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，兴业银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国农业银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，华夏银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到央行的处罚，中国建设银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局、央行的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他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。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同约定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	7,651,200.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,651,200.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	164,968,218.63
报告期期间基金总申购份额	428,540,592.67
减：报告期期间基金总赎回份额	121,092,095.40
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	472,416,715.90

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会准予摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金募集注册的文件

(二)摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同

(三)摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议

(四)法律意见书

(五)基金管理人业务资格批件、营业执照

(六)基金托管人业务资格批件、营业执照

(七)摩根基金管理(中国)有限公司开放式基金业务规则

(八)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住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根基金管理（中国）有限公司

2026 年 10 月 27 日