国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月23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	国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	018360
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 09 月 12 日
报告期末基金份额总额	94,454,709.19 份
投资目标	本基金通过指数化投资，在控制与标的指数偏离风险的基础上，争取获得与标的指数相似的总回报。
投资策略	本基金为被动式指数基金，主要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，以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差控制在 2%以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。

业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为同业存单指数基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

注：2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金由国泰君安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金变更而来。国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同生效日为 2025 年 9 月 29 日。

§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）
1.本期已实现收益	187,641.06
2.本期利润	175,462.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0027
4.期末基金资产净值	99,145,320.29
5.期末基金份额净值	1.0497

注：1.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。

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

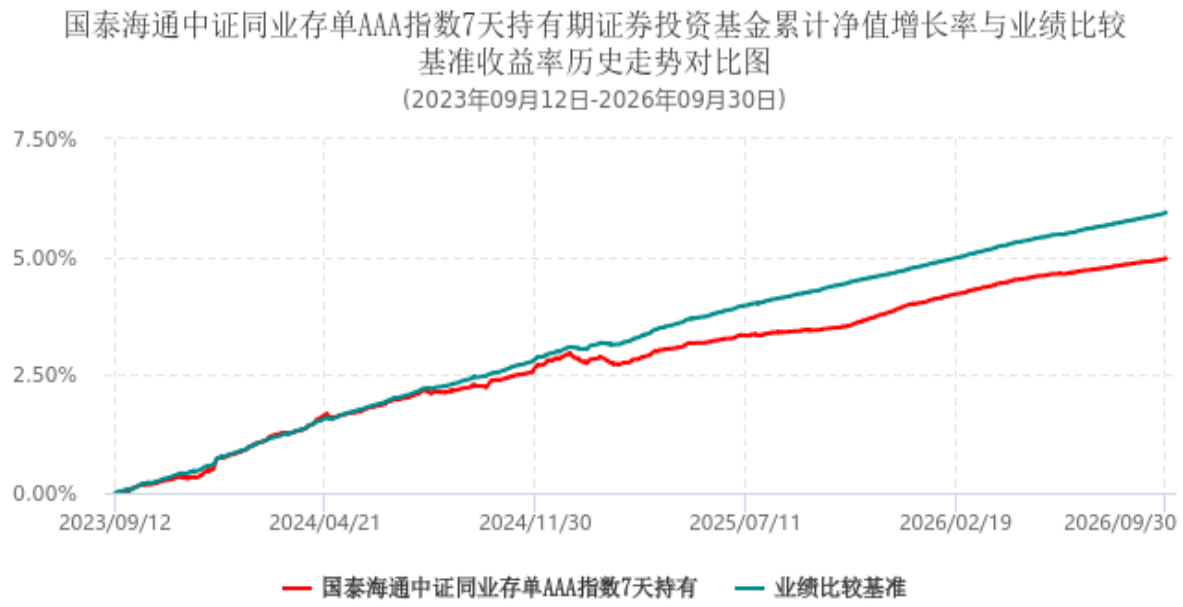
3.2 基金净值表现

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	0.26%	0.01%	0.36%	0.00%	-0.10%	0.01%
过去六个月	0.55%	0.01%	0.72%	0.00%	-0.17%	0.01%
过去一年	1.45%	0.01%	1.55%	0.01%	-0.10%	0.00%

过去三年	4.87%	0.01%	5.85%	0.01%	-0.98%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.97%	0.01%	5.94%	0.01%	-0.97%	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



§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		
杜浩然	国泰海通 30 天滚动持有中短债基金经理，国泰海通现金管家货币基金经理，国泰海通 60 天滚动持有中短债基金经理，国泰海通君得利短债基金经理，国泰海通 90 天滚动持有中短债发起	2023-09-12	-	12 年	杜浩然，复旦大学金融硕士，2014 年 7 月入职上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任固定收益投资部助理研究员、投资经理；基金投资部基金经理；固定收益投资部（公募）副总经

	基金经理，国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金经理，国泰海通君享利 30 天滚动持有债券发起基金经理，国泰海通 120 天持有债券发起基金经理。现任固定收益投资部（上海）副总经理兼任固定收益投资部（公募）总经理。				理；现任固定收益投资部（上海）副总经理兼任固定收益投资部（公募）总经理，主要负责固定收益类产品的投资研究工作。
李佳闻	国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金经理，国泰海通鑫诚六个月持有期债券基金经理，国泰海通安悦债券基金经理，国泰海通鑫选三个月持有期债券基金经理，国泰海通鑫悦债券基金经理，国泰海通鑫逸债券基金经理，国泰海通安裕中短债债券基金经理，国泰海通海升六个月持有期债券基金经理，国泰海通安润 90 天持有期中短债债券基金经	2025-06-18	-	10 年	李佳闻，香港科技大学经济学硕士，历任上海海通证券资产管理有限公司固定收益研究部研究员助理、固定收益三部投资经理助理、公募固收部基金经理助理、基金经理。2025 年 5 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现任固定收益投资部（公募）基金经理。

	理，国泰海通安泰三个月持有债券基金经理。现任固定收益投资部（公募）基金经理。				

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵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

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的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%的次数为 0 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度债券收益率整体下行，曲线走平，10 年期国债收益率下行 5bp，30 年期国债收益率下行 14bp。7 月初市场对政府债供给与资金面保持谨慎，长端缺乏方向；月底政治局会议提及“综合运用并适时调整货币政策工具”，宽货币预期带动 10 年期国债收益率下行至 1.71%。8 月在内需修复偏弱、政策宽松预期支撑等因素驱动下，10 年期国债收益率回落至 1.70%以下。9 月下旬央行呵护跨季资金面，月末政策组合拳落地，10 年期国债收益率收于 1.68%。资金方面，7-9 月 DR007 月度均值分别为 1.42%、1.40%、1.40%，1 年期 AAA 存单在 1.46%-1.48%区间震荡。报告期内本基金以 AAA 级同业存单为主要配置资产，保持适度久期和杠杆，在关注收益的同时兼顾回撤控制。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金份额净值为 1.0497 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准收益率为 0.36%。

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的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	82,512,845.61	79.21
	其中：债券	82,512,845.61	79.21
	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	608,908.16	0.58
8	其他资产	21,046,530.00	20.20
9	合计	104,168,283.77	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股票。

5.2.2 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 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	6,523,761.79	6.58
	其中：政策性金融债	6,523,761.79	6.58
4	企业债券	1,534,603.86	1.55
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	74,454,479.96	75.10
9	其他	-	-
10	合计	82,512,845.61	83.22

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	112611019	26 平安银行 CD019	80,000	7,944,826.96	8.01
2	112615047	26 民生银行 CD047	70,000	6,957,929.50	7.02
3	112604031	26 中国银行 CD031	70,000	6,951,721.67	7.01
4	260308	26 进出 08	60,000	6,009,366.58	6.06
5	112606122	26 交通银行 CD122	59,000	5,861,373.15	5.91

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体华夏基金管理有限公司，2026 年 3 月因未依法履行职责被证监会分局警示。

本基金持有的前十名证券发行主体交通银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体平安银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体兴业银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、地方财政局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国建设银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局、证监会分局、地方财政局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国进出口银行，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国民生银行股份有限公司，其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、证监会分局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局、证监会分局、中国银行间市场交易商协会罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中信银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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	21,046,530.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	21,046,530.00

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	40,252,371.55
报告期期间基金总申购份额	140,441,451.52
减：报告期期间基金总赎回份额	86,239,113.88
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	94,454,709.19

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§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

本报告期内基金管理人持有本基金份额未发生变化。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20260701-20260709,20260724-20260726,20260807-20260809	-	11,461,318.05	1,000,000.00	10,461,318.05	11.08%
产品特有风险							
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%,则面临大额赎回的情况,可能导致: (1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响; (2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平; (3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动; (4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策						

略;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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、关于准予国泰君安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复;

2、《国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》;

3、《国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》;

4、《国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、管理人业务资格批件、营业执照;

7、托管人业务资格批件、营业执照;

8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 https://www.gthtzg.com。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰海通证券资产管理有限公司

二〇二六年十月二十七日