东吴中证同业存单 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：东吴基金管理有限公司

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 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 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 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	016758
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 8 日
报告期末基金份额总额	47,667,502.48 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	本基金为指数基金，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，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。
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	本基金预期的风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
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	115,978.91
2.本期利润	119,386.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0021
4.期末基金资产净值	50,434,998.37
5.期末基金份额净值	1.0581

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

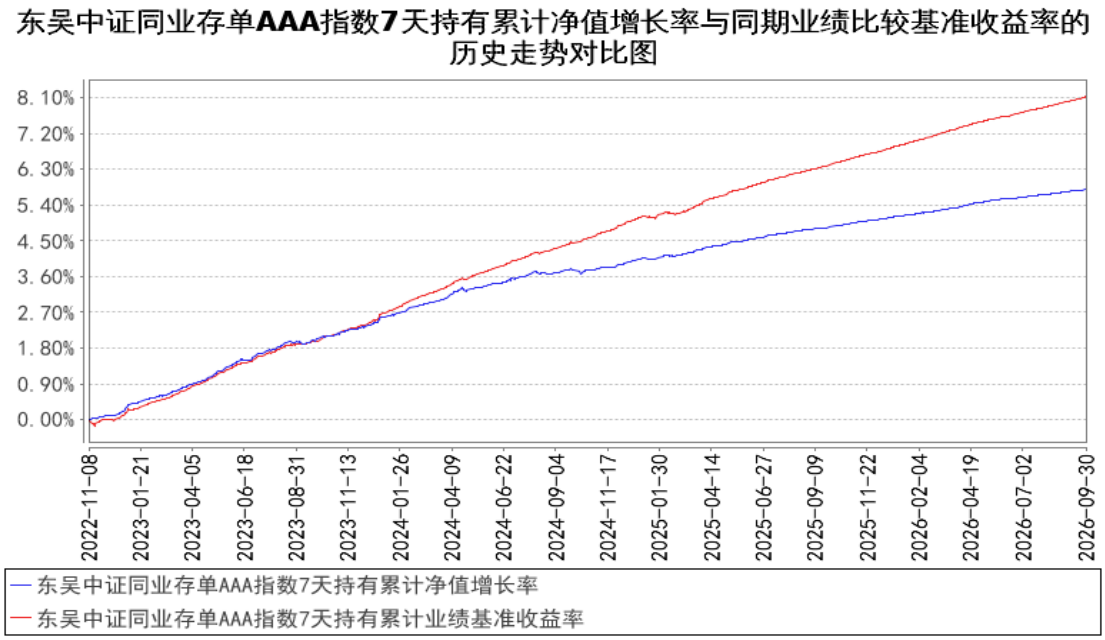
3.2 基金净值表现

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	0.21%	0.01%	0.37%	0.00%	-0.16%	0.01%
过去六个月	0.45%	0.01%	0.75%	0.00%	-0.30%	0.01%
过去一年	0.91%	0.01%	1.61%	0.01%	-0.70%	0.00%
过去三年	3.70%	0.01%	6.03%	0.01%	-2.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.81%	0.01%	8.13%	0.01%	-2.32%	0.00%

注：本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

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		
王明欣	基金经理	2022 年 11 月 8 日	-	9 年	王明欣女士，中国国籍，上海社会科学院经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。2017 年 7 月加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2021 年 7 月 12 日至 2023 年 11 月 6 日担任东吴货币市场证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至今担任东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月 8 日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，2022 年 11 月 9 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2026 年 3 月 27 日至今担任东吴恒益纯债债券型证券投资基金基金经理，2026 年 8 月 25 日至今担任东吴瑞欣债券型证券投资基金。
邵笛	基金经理	2024 年 9 月 25 日	-	20 年	邵笛先生，中国国籍，上海财经大学工商管理硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职上海广大律师事务所；上海文筑建筑咨询公司；上海永一房产咨询

					有限公司。2006 年 9 月起加入东吴基金管理有限公司，现任基金经理。2018 年 4 月 23 日至 2021 年 9 月 1 日及 2022 年 12 月 2 日至 2025 年 1 月 21 日担任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月 2 日至 2020 年 7 月 7 日担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月 2 日至 2021 年 7 月 28 日担任东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月 2 日至 2023 年 7 月 27 日担任东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至 2024 年 4 月 10 日担任东吴优益债券型证券投资基金基金经理，2018 年 4 月 11 日至 2023 年 9 月 28 日及 2024 年 9 月 25 日至今担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理，2014 年 10 月 30 日至今担任东吴货币市场证券投资基金基金经理，2022 年 5 月 9 日至今担任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 12 月 2 日至今担任东吴瑞盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 3 月 6 日至今担任东吴添利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 7 月 21 日至今担任东吴添瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2024 年 9 月 25 日至今担任东吴月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理，2024 年 9 月 25 日至今担任东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，2025 年 6 月 17 日至今担任东吴中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人

谋求最大利益。本报告期内，本基金不存在违反法律法规、基金合同和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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析，确保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和环节得到公平对待。

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，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现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%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度基本面仍处于供强需弱的状态，整体呈结构性改善。根据统计局公布数据，7 月、8 月的制造业 pmi 位于荣枯线以下，9 月制造业 pmi 回升至 50.1%。出口继续保持韧性，但其他经济数据仍有待改善。信贷数据仍较弱，具体来看仍是靠政府债发行支撑，实体贷款需求仍偏弱。基本面仍有利于债市。

市场参与者对货币宽松有一定的预期，7 月末政治局会议提出“综合运用并适时调整货币政策工具”，市场解读为进一步宽松的货币政策有望落地，点燃长债做多热情。三季度央行在公开市场持续的呵护流动性，虽然资金利率中枢相比其他资产收益率仍较高，但不存在收紧的风险，流动性整体保持低波平稳状态。在流动性及负债均相对平稳的背景下，票息资产继续受到追捧。另外，在新一批摊余债基获批的催化下，资产荒行情进一步演绎，5 年期票息资产受到进一步的追捧。在大部分利差都处于历史相对低位的情况下，市场进一波挖掘期限利差，短端则受制于资金利率中枢较高而空间有限，长债超长债表现明显好于短端，债市呈结构性分化。三季度整体收益率曲线进一步走平。

三季度，央行在公开市场上持续呵护流动性、精准调控，流动性的季节性波动进一步降低，资金利率中枢在政策利率附近波动，根据交易中心公布数据，三季度 DR001 和 DR007 的中位数分别为 1.3715%和 1.3952%。根据 wind 数据，1 年期国股存单三季度在 1.46%-1.49%间窄幅震荡。

本基金在报告期内，密切跟踪央行动态及市场参与者行为，根据市场波动适时调整持仓。在对 AAA 同业存单指数进行有效跟踪的同时，致力通过票息策略增厚组合收益，在保证组合各项指

标合规的前提下，努力实现产品净值的稳健增长，力求为基金持有人获取合理收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0581 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.21%，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

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或者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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,247,911.73	97.54
	其中：债券	49,247,911.73	97.54
	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	335,795.77	0.67
8	其他资产	908,794.88	1.80
9	合计	50,492,502.38	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	4,018,439.45	7.97
	其中：政策性金融债	4,018,439.45	7.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,009,795.78	2.00
6	中期票据	3,043,061.64	6.03
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	41,176,614.86	81.64
9	其他	-	-
10	合计	49,247,911.73	97.65

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	112695967	26 重庆农村商行 CD070	50,000	4,971,345.22	9.86
2	112614127	26 江苏银行 CD127	50,000	4,958,733.72	9.83
3	112618109	26 华夏银行 CD109	50,000	4,955,225.21	9.82
4	112608132	26 中信银行 CD132	45,000	4,474,421.80	8.87
5	09260401	26 农发清发 01	40,000	4,018,439.45	7.97

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

本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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是否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

本基金投资的前十名证券中“26 重庆农村商行 CD070（证券代码：112695967）、26 江苏银行 CD127（证券代码：112614127）、26 华夏银行 CD109（证券代码：112618109）、26 中信银行 CD132（证券代码：112608132）、26 农发清发 01（证券代码：09260401）、26 邮储银行 CD044（证券代码：112622044）、26 民生银行 CD059（证券代码：112615059）、26 建设银行 CD166（证券代码：112605166）、25 北京银行 CD168（证券代码：112512168）、25 农业银行 CD389（证券代码：112503389）”的发行主体在报告编制日前一年内受到监管部门的处罚。

经分析，上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响，本基金对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是否超出基金合同约定的备选股票库

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	908,794.88

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	908,794.88

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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	63,583,833.09
报告期期间基金总申购份额	85,476,371.33
减：报告期期间基金总赎回份额	101,392,701.94
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	47,667,502.48

§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

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无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（%）

机构	1	20260807-20260809	9,473,285.34	0.00	1,000,000.00	8,473,285.34	17.78
	2	20260724-20260726	9,473,285.34	0.00	1,000,000.00	8,473,285.34	17.78
	3	20260827-20260930	13,158,854.32	3,402,646.50	3,000,000.00	13,561,500.82	28.45
	4	20260701-20260823	13,158,854.32	3,402,646.50	3,000,000.00	13,561,500.82	28.45
个人	1	20260918-20260929	7,362,205.62	9,462,528.39	7,362,205.62	9,462,528.39	19.85
	2	20260904-20260906	7,362,205.62	9,462,528.39	7,362,205.62	9,462,528.39	19.85
产品特有风险							
1.巨额赎回风险 （1）本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响； （2）单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）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.转换运作方式或终止基金合同的风险 单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险； 3.流动性风险 单一投资者巨额赎回可能导致本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； 4.巨额赎回可能导致基金资产规模过小，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。							

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、中国证监会批准东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金设立的文件；

2、《东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》；

3、《东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

5、报告期内东吴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金在中国证监会指定媒介上披露的各项公告。

9.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：http：//www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666/400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日