博道中证同业存单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:博道基金管理有限公司

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

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 4
3.1 主要财务指标 4
3.2 基金净值表现 4
§4 管理人报告 5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 6
4.3 公平交易专项说明 6
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 7
4.5 报告期内基金的业绩表现 7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 7
§5 投资组合报告 7
5.1 报告期末基金资产组合情况 7
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 8
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 8
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 8
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 9
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 9
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 9
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 9
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 9
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 9
5.11 投资组合报告附注 10
§6 开放式基金份额变动 10
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 11
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 11
§8 影响投资者决策的其他重要信息 11
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 11
§9 备查文件目录 12
9.1 备查文件目录 12
9.2 存放地点 12
9.3 查阅方式 12

§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07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博道中证同业存单AAA指数7天持有期
基金主代码	019037
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年10月24日
报告期末基金份额总额	20,007,706.04份
投资目标	本基金通过指数化投资，在尽量控制偏离度及跟踪误差的前提下，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数基金，在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。本基金将采用抽样复制和动态优化的方法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑投资标的久期、流动性、基金日常申购赎回以及银行间和交易所成份券交易特性及交易惯例等情况进行优化，以保证对标的指数的有效跟踪。当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券和备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券和备

	选成份券外寻找其他同业存单构建替代组合，对指数进行跟踪复制。本基金的债券投资策略和资产支持证券投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证同业存单AAA指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和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。同时，本基金为同业存单指数基金，主要投资于标的指数成份券及其备选成份券，具有与标的指数以及标的指数所代表的同业存单市场相似的风险收益特征。
基金管理人	博道基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

注：本基金对认/申购、转换转入的每份基金份额设定7天的最短持有期限，基金份额在最短持有期限内不办理赎回及转换转出业务，最短持有期限为持有期起始日（含）至持有期到期日（不含），自持有期到期日（含该日）起可以提出赎回或转换转出申请。

§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	48,431.77
2.本期利润	45,385.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0022
4.期末基金资产净值	20,766,712.79
5.期末基金份额净值	1.0379

注：1、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，计入费用后的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。

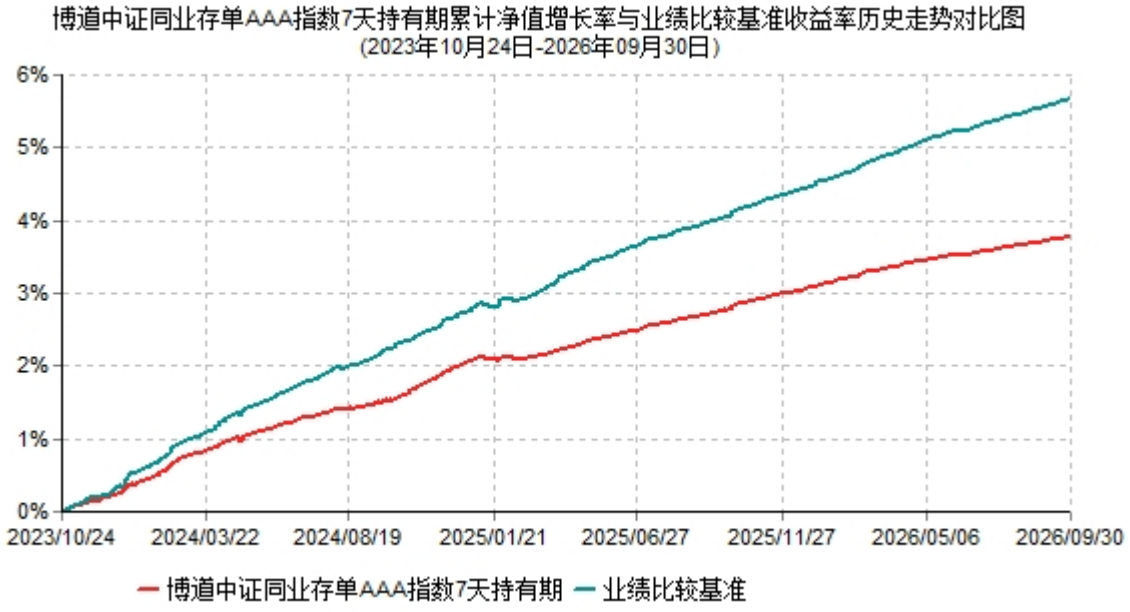
3.2 基金净值表现

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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		②	率③	率标准差④		
过去三个月	0.21%	0.00%	0.36%	0.00%	-0.15%	0.00%
过去六个月	0.41%	0.00%	0.72%	0.00%	-0.31%	0.00%
过去一年	0.96%	0.01%	1.55%	0.01%	-0.59%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.79%	0.01%	5.69%	0.01%	-1.90%	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：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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		
袁争光	博道卓远混合、博道志远混合、博道安远6个月持有期混合、	2026-05-29	-	20年	袁争光先生，中国籍，经济学硕士。2006年1月至2007年4月担任上海金信证券研

	博道中证同业存单AAA指数7天持有期、博道和盈利率债的基金经理				究所有限责任公司研究员，2007年4月至2008年4月担任中原证券股份有限公司证券研究所研究员，2008年4月至2009年9月担任光大保德信基金管理有限公司研究员，2009年10月至2017年6月担任中欧基金管理有限公司高级研究员、基金经理。2017年9月加入博道基金管理有限公司。具有基金从业资格。

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》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，并本着诚实信用、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，不存在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

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，实现投资组合间公平交易分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生2次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资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年第三季度，美国经济再度走强，美联储正式进入加息周期，扭转了部分市场参与者此前对于美联储维持利率不变的预期。同时，美以伊冲突再次恶化，带动油价重新回升。在此背景下，全球发达国家的长端利率进入了加速上行周期，以美债为例，10年期美债单季由4.48%升至5.29%，上升81bps。从宏观基本面来看，全球AI产业叙事也在发生微妙的变化，AI需求爆发后进入新的观察期。同时，随着AI基建的投资规模不断扩大，市场主要参与者面临一定的融资约束。国内宏观经济指标相对乏力，但全市场非金融企业的2026年第二季度单季净利润增速创2021年以来新高。此外，出口维持较高增长，有力托底经济增长，8月规模以上工业增加值重新回到5%以上，预计全年增长目标能够顺利完成。资本市场表现来看，中债综合全价（总值）指数上涨0.52%。本基金报告期间内加强流动性管理，同业存单仓位有所上升，期末因部分存单到期兑付，仓位总体保持在平稳水平。

展望未来一段时间，预计宏观基本面仍然偏弱，债券市场利率总体处于低位平衡阶段。

本基金以高等级存单为主要投资对象，着眼于流动性管理，在严格控制信用风险的基础上，为投资者做好流动性管理，力争取得更具竞争力的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见"3.1 主要财务指标" 及"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"部分披露。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内本基金已连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元。基金管理人已按照法律法规及《基金合同》的有关规定，向中国证监会报告并提出解决方案，自2025年4月10日起至本报告期末相关信息披露费、审计费、持有人会议费、银行间账户维护费用由基金管理人承担。

§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	18,462,797.25	88.86
	其中：债券	18,462,797.25	88.86
	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	1,999,555.06	9.62
	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	314,227.97	1.51
8	其他资产	10.00	0.00
9	合计	20,776,590.28	100.00

注：银行存款和结算备付金合计余额包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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通过港股通投资的股票。

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	1,006,060.22	4.84
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	17,456,737.03	84.06
9	其他	-	-
10	合计	18,462,797.25	88.91

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	112509279	25浦发银行CD279	20,000	1,997,999.65	9.62
2	112620014	26广发银行CD014	20,000	1,991,610.66	9.59
3	112518312	25华夏银行CD312	19,000	1,894,046.76	9.12
4	112502283	25工商银行CD283	17,000	1,694,566.61	8.16
5	112505409	25建设银行CD409	15,000	1,498,583.89	7.22

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

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

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，或者在本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的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期无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 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的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	10.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10.00

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	21,979,697.56
报告期期间基金总申购份额	2,023,744.71
减：报告期期间基金总赎回份额	3,995,736.23
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	20,007,706.04

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,652,815.39
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,652,815.39
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	53.24

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则买入/申购总份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则卖出/赎回总份额中包含该业务；
3、分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”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。非分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，比例的分母采用期末基金份额总额。

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未进行本基金的认购、申购、赎回、转换、红利再投、现金分红等。

§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	20260701 - 20260930	10,652,815.39	-	-	10,652,815.39	53.24%

产品特有风险
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金募集注册的文件；

2、《博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》；

3、《博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》；

4、《博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》；

5、关于申请募集注册博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的法律意见书；

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、报告期内博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.bdfund.cn）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博道基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-085-2888（免长途话费）。

博道基金管理有限公司

2026年10月27日