关于摩根士丹利中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《摩根士丹利中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，摩根士丹利中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（以下简称“本基金”）出现了基金合同约定的终止事由，摩根士丹利基金管理（中国）有限公司（以下简称“基金管理人”)应当在上述事由出现后依法履行基金财产清算程序并终止基金合同，此事项不需召开基金份额持有人大会。现将相关事宜公告如下：

一、本基金基本信息

基金名称：摩根士丹利中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

基金简称：大摩中证同业存单 AAA 指数 7 天持有

基金代码：022023

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2024 年 11 月 5 日

基金管理人名称：摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

基金托管人名称：中国民生银行股份有限公司

公告依据：《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《摩根士丹利中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》、《摩根士丹利中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》及其更新等

二、基金合同终止事由

根据《基金合同》第五部分“基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：

“基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而不需召开基金份额持有人大会。”

截至 2026 年 11 月 12 日日终，本基金已连续 50 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人，触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，基金管理人将根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算，无需召开基金份额持有人大会。

三、相关业务办理情况

本基金最后运作日为 2026 年 11 月 12 日，自 2026 年 11 月 13 日起，本基金进入基金财产清算程序。本基金进入清算程序后，不再办理申购、赎回及转换（转入和转出）等业务，并停止收取基金管理费、基金托管费和基金销售服务费。

四、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：

（1）自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人或临时基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。基金财产清算小组成员由基金管理人或临时基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

3、 基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制或其他原因，导致基金财产不能及时变现的，清算期限可以相应顺延。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的律师费将由本基金管理人承担。

5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，不低于法律法规规定的最低期限。

四、其他

1、本基金进入清算程序后停止办理申购、赎回及转换（转入和转出）等业务，并且不再恢复。敬请投资者予以关注。本公司承诺在清算过程中以诚实信用、勤勉尽责的原则履行相关职责。

2. 基金进入清算程序后，如因持有流通受限证券暂时无法变现的，基金将可能无法及时完成全部资产清算，且基金资产在流通受限证券变现处置过程中亦可能进一步产生收益或损失。

3、投资者可以登陆摩根士丹利基金管理（中国）有限公司网站（www.morganstanleyfunds.com.cn）或拨打摩根士丹利基金管理（中国）有限公司客户服务热线400-8888-668（免长途通话费用）咨询相关情况。

特此公告。

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

2026年11月13日