摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金

清算报告

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月十二日

报告公告日期：二〇二六年十月二十日

目录

1、重要提示 3
2、基金概况 3
2.1 基金基本情况 3
2.2 基金产品说明 4
3、基金运作情况概述 5
4、财务会计报告 6
5、清盘事项说明 7
5.1 基金基本情况 7
5.2 清算原因 8
5.3 清算报表编制基础 8
6、清算情况 9
6.1 清算费用 9
6.2 资产处置情况 9
6.3 负债清偿情况 9
6.4 清算期的清算损益情况 10
6.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况 11
6.6 基金财产清算报告的告知安排 11
7、备查文件目录 11
7.1 备查文件目录 11
7.2 存放地点 11
7.3 查阅方式 12

1、重要提示

摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]303 号文准予募集注册，于 2023 年 8 月 22 日成立并正式运作，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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》和《摩根世代趋势混合型发起式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：《基金合同》生效日起三年后的对应日，若基金资产净值低于二亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。本基金的基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 日，基金合同生效之日起 3 年后的对应日为 2026 年 8 月 22 日。截至 2026 年 8 月 22 日日终，本基金资产净值低于 2 亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的终止情形，基金合同自动终止，基金管理人根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金的最后运作日为 2026 年 8 月 22 日，并于 2026 年 8 月 23 日进入基金财产清算程序。

本基金从 2026 年 8 月 23 日起进入清算期，由基金管理人摩根基金管理（中国）有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金
基金简称	摩根世代趋势混合发起式
基金主代码	018430
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2023年8月22日	
基金管理人名称	摩根基金管理（中国）有限公司	
基金托管人名称	招商银行股份有限公司	
基金最后运作日（2026年8月22日）基金份额总额	12,025,017.23	
下属分级基金的基金简称	摩根世代趋势混合发起式A	摩根世代趋势混合发起式C
下属分级基金的交易代码	018430	018431
2026年8月22日下属分级基金份额总额	10,923,359.25	1,101,657.98

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过长期追踪中国人口结构变化的大趋势，识别受益其中的多个明确产业子趋势，自下而上精选产业链中最有竞争力优势的个股，基于严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	人口作为经济社会发展的基本要素和动力，其结构的变化将影响长期经济走势和增长方式。本基金将持续关注中国人口结构中年轻代，中年代，年长代的世代趋势变化，以其年龄结构，财富增长，知识结构，行为和消费理念的深度研究为线索，力争前瞻性地识别多个明确的长期产业发展趋势，并聚焦产业链分析，投资到具有长期竞争壁垒的优质企业。 1、资产配置策略 本基金将综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的

	重要因素进行深入分析，重点关注包括GDP增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，结合股票、债券等各类资产风险收益特征，确定合适的资产配置比例。本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例，动态优化投资组合。 2、股票投资策略 基金管理人依托本公司研究平台，基于对上市公司系统、全面、细致的基本面研究，重点投资于受益于上述世代趋势发展的优势产业链中最具有竞争力的个股构建股票投资组合。深度研究并长期追踪上述符合世代趋势的行业中其用户年龄结构、财富积累水平、不同年龄段人群的消费行为及消费理念的变化趋势，识别受益产业及具备稀缺投资价值的产业链环节，捕捉推动世代趋势变化的长期投资机会。在具体操作上，综合运用定量分析与定性分析的手段，获取个股的超额收益。 3、港股投资策略 本基金可通过港股通机制投资于香港股票市场。对于港股投资，本基金将主要关注港股中受益于中国人口结构变化大趋势及子趋势的产业链，自下而上精选产业链中最有竞争力优势的个股，在具体操作上，综合运用定量分析与定性分析的手段，获取个股的超额收益；于此同时结合宏观基本面，包含资金流向等对香港上市公司的投资价值进行综合判断。 4、其他投资策略包括债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、股票期权投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、存托凭证投资策略。

业绩比较基准	中证800指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*15%+银行活期存款利率(税后)*15%
风险收益特性	本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金若投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

3、基金运作情况概述

根据中国证监会关于准予本基金注册的文件（证监许可[2023]303号文），自2023年8月7日起向全社会公开募集，并于2023年8月18日募集工作顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙)验资，本次募集的有效净认购金额为14,129,041.05元人民币（其中A类基金份额12,595,149.38元人民币，C类基金份额1,533,891.67元人民币），折合基金份额14,129,041.05份（其中A类基金份额12,595,149.38份，C类基金份额1,533,891.67份）；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计1,100.10元人民币（其中A类基金份额792.19元人民币，C类基金份额307.91元人民币），折合基金份额1,100.10份（其中A类基金份额792.19份，C类基金份额307.91份）。

经中国证监会书面确认，本基金的基金合同于2023年8月22日生效。本基金为契约型开放式混合型证券投资基金，存续期限为不定期。

自2023年8月22日至2026年8月22日期间，本基金按基金合同正常运作。

自2026年8月23日起，本基金进入清算程序。

4、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 8 月 22 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2026 年 8 月 22 日 (基金最后运作日)
资 产：	
货币资金	14,702,494.70
应收股利	2,934.40
资产总计	14,705,429.10
负债和净资产	
负 债：	
应付赎回款	353,505.41
应付管理人报酬	10,679.21
应付托管费	1,779.88
应付销售服务费	514.29
其他负债	10,184.19
负债合计	376,662.98
净资产：	
实收基金	12,025,017.23
未分配利润	2,303,748.89
净资产合计	14,328,766.12
负债和净资产总计	14,705,429.10

注：

1. 报告截止日 2026 年 8 月 22 日（最后运作日），基金份额总额 12,025,017.23 份。其摩根世代趋势混合发起式 A 基金份额总额 10,923,359.25 份，基金份额净值 1.1935 元；摩根世代趋势混合发起式 C 基金份额总额 1,101,657.98 份，基金份额净值 1.1723 元。

2. 财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 8 月 22 日(基金最后运作

日)止期间。

5、清盘事项说明

5.1 基金基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、公开发行的次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的 60%-95%；其中，港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*15%+银行活期存款利率（税后）*15%

5.2 清算原因

根据《基金合同》以及摩根基金管理（中国）有限公司于 2026 年 8 月 24 日发布的《关于摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金触发了《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，本基金的最后运作日为 2026 年 8 月 22 日，并于 2026 年 8 月 23 日进入基金财产清算程序。

5.3 清算报表编制基础

本基金的清算报表是参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》

的有关规定编制。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

6、清算情况

自 2026 年 8 月 23 日至 2026 年 10 月 12 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

6.1 清算费用

按照《基金合同》中“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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。

6.2 资产处置情况

（1） 自最后运作日(2026 年 8 月 22 日)后至基金财产返还投资人前一日止期间本基金由货币资金产生的利息收入将由基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司先行垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。托管账户销户后将由基金托管人退还基金管理人，与之前预估数所产生的差异也由基金管理人享有/承担。

（2） 本基金最后运作日(2026 年 8 月 22 日)持有的应收股利 2,934.40 元，已于 2026 年 9 月 4 日前收到相应股利款项。

6.3 负债清偿情况

（1）本基金最后运作日(2026 年 8 月 22 日)应付管理人报酬为人民币 10,679.21 元，该款项已于 2026 年 9 月 10 日支付。

（2）本基金最后运作日(2026年8月22日)应付托管费为人民币1,779.88元，该款项已于2026年9月10日支付。

（3）本基金最后运作日(2026年8月22日)应付销售服务费为人民币514.29元，该款

项已于2026年9月10日支付。

（4）本基金最后运作日(2026年8月22日)应付赎回款为人民币353,505.41元，该款项已分别于2026年8月24日、2026年8月25日支付。

（5）本基金最后运作日(2026 年 8 月 22 日)确认的其他负债为人民币 10,184.19 元，包括应付审计费人民币 9,617.40 元，该款项于 2026 年 9 月 10 日支付；应付赎回费人民币 566.79 元，该款项已分别于 2026 年 8 月 24 日、2026 年 8 月 25 日支付。

6.4 清算期的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2026年8月23日至2026年10月12日止清算期间
一、资产处置收入	
1、利息收入-存款利息收入（注1）	4,679.46
2、投资收益	-
3、公允价值变动损益	-
4、赎回费收入	12.23
二、清算费用	
1、清算费用	20,102.60
2、其他费用	205.00
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-15,615.91

注1：利息收入以当前适用的利率预估计提的自2026年8月23日至2026年10月12日止清算期间的货币资金利息。

6.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

截至本次清算期结束日2026年10月12日，本基金剩余财产为人民币14,310,718.10元，自本次清算结束日次日2026年10月13日至本次清算款划出前一日的货币资金产生的利息亦归基金份额持有人所有。根据本基金的基金合同约定，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。

为便于及时向基金份额持有人分配剩余资产，基金管理人摩根基金管理（中国）有限公司以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

本基金的货币资金应收利息为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中基金管理人垫付资金与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

6.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

7、备查文件目录

7.1 备查文件目录

（1）摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金清算财务报表及审计报告

（2）关于摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见

7.2 存放地点

基金管理人处

7.3 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。

摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金财产清算组

2026年10月20日