

# 摩根悦享回报 6 个月持有期混合型证券投资 基金 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 摩根悦享回报 6 个月持有期混合                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 019718                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金合同生效日    | 2024 年 6 月 12 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 70,072,027.16 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资目标       | 本基金在严格的风险控制的基础上，力争实现基金资产的稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 投资策略       | 1、资产配置策略<br>本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场技术指标、市场资金构成及流动性情况，对证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，并结合本基金的投资目标、投资策略，综合制定基金在各类资产中的配置比例、配置中枢和调整范围。未来随着宏观经济、市场环境以及投资者结构的变化等因素，可能会对基金的资产配置中枢进行调整，以实现基金的长期稳定收益目标。<br>2、股票投资策略<br>采用“自下而上”的个股精选策略，基于公司内部研究团队对于个股的基本面的深入研究和细致的实地调研，有效挖掘价值低估及具有增长潜力的个股，为投资者获得超过业绩比较基准的收益。<br>3、债券投资策略<br>本基金将采取久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提 |

|                 |                                                                                                                 |                    |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
|                 | 下，发掘市场投资机会，实现债券组合增值，提高组合综合收益。<br>4、其他投资策略<br>包括：存托凭证投资策略、港股投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略                               |                    |
| 业绩比较基准          | 中证 800 指数收益率×15%+中证港股通综合指数收益率×5%+中债综合全价（总值）指数收益率×80%                                                            |                    |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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。 |                    |
| 基金管理人           | 摩根基金管理（中国）有限公司                                                                                                  |                    |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                    |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 摩根悦享回报 6 个月持有期混合 A                                                                                              | 摩根悦享回报 6 个月持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 019718                                                                                                          | 019719             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 19,160,480.09 份                                                                                                 | 50,911,547.07 份    |

### §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 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |                    |
|-----------------|---------------------------------------|--------------------|
|                 | 摩根悦享回报 6 个月持有期混合 A                    | 摩根悦享回报 6 个月持有期混合 C |
| 1. 本期已实现收益      | 217,753.67                            | 544,703.08         |
| 2. 本期利润         | -923,005.39                           | -2,507,104.10      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0460                               | -0.0452            |
| 4. 期末基金资产净值     | 18,651,197.30                         | 49,151,032.83      |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9734                                | 0.9654             |

注：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。

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（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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

摩根悦享回报 6 个月持有期混合 A

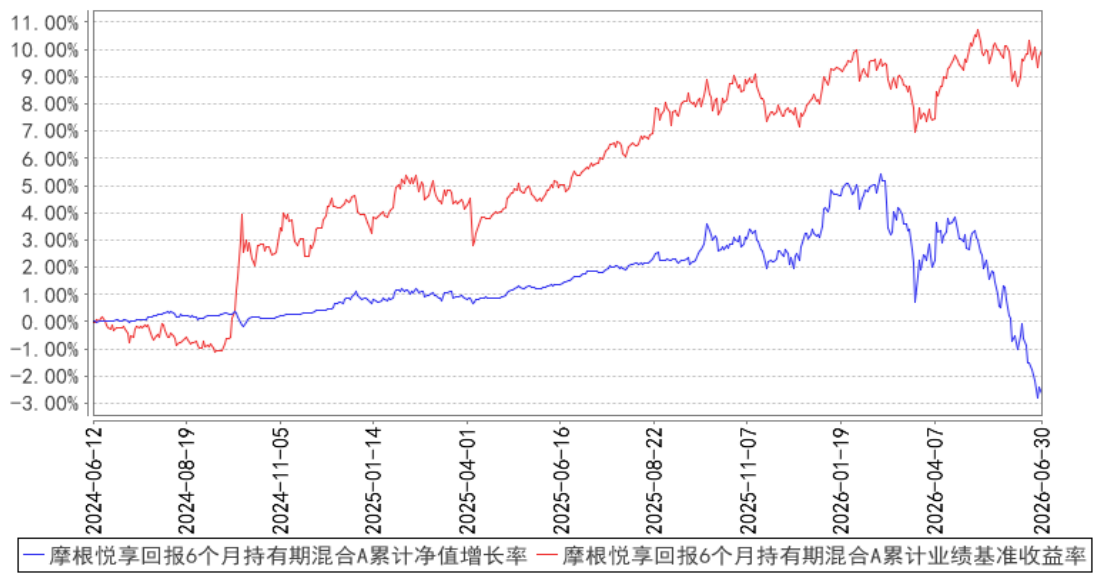
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④    |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | -4.78% | 0.40%         | 2.11%          | 0.24%                 | -6.89%  | 0.16%  |
| 过去六个月          | -5.60% | 0.40%         | 1.67%          | 0.23%                 | -7.27%  | 0.17%  |
| 过去一年           | -4.26% | 0.30%         | 4.14%          | 0.21%                 | -8.40%  | 0.09%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -2.66% | 0.22%         | 9.98%          | 0.23%                 | -12.64% | -0.01% |

摩根悦享回报 6 个月持有期混合 C

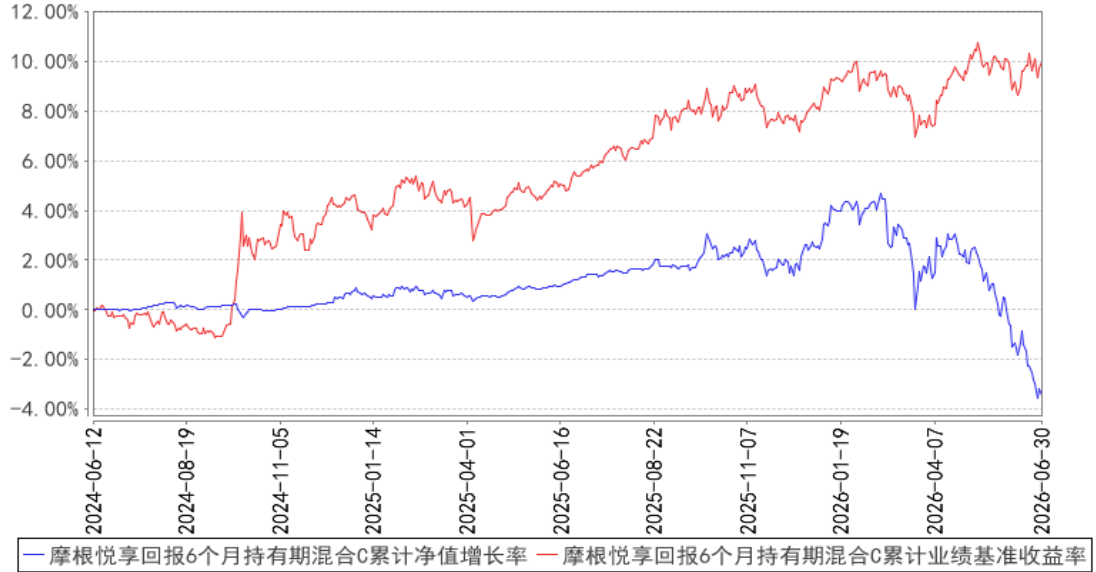
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④    |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | -4.88% | 0.40%         | 2.11%          | 0.24%                 | -6.99%  | 0.16%  |
| 过去六个月          | -5.79% | 0.40%         | 1.67%          | 0.23%                 | -7.46%  | 0.17%  |
| 过去一年           | -4.64% | 0.30%         | 4.14%          | 0.21%                 | -8.78%  | 0.09%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -3.46% | 0.22%         | 9.98%          | 0.23%                 | -13.44% | -0.01% |

### 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

摩根悦享回报6个月持有期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史  
走势对比图



摩根悦享回报6个月持有期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史  
走势对比图



注：本基金合同生效日为 2024 年 6 月 12 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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 |        |                                    |
| 杨鹏 | 本基金基金经理 | 2025 年 1 月 16 日 | —    | 15 年   | 杨鹏先生曾就职于华泰柏瑞基金管理有限公司和华金证券，曾任建信人寿保险 |

|     |                   |                 |                |      |                                                                                                                                               |
|-----|-------------------|-----------------|----------------|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                   |                 |                |      | 股份有限公司 FOF 投资经理，鹏华基金管理有限公司绝对收益投资部投资经理，太平养老保险股份有限公司年金和养老金投资经理。自 2023 年 5 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），现任混合资产投资部高级基金经理。                     |
| 刘心一 | 本基金的基金经理          | 2026 年 1 月 15 日 | -              | 5 年  | 刘心一女士曾任融通基金管理有限公司固定收益部固定收益研究员；自 2024 年 10 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），历任基金经理助理，现任债券投资部基金经理。                                              |
| 侯杰  | 本基金基金经理、混合资产投资部总监 | 2026 年 3 月 17 日 | -              | 24 年 | 侯杰先生 2002 年 7 月加入北京首创融资担保有限公司，任职于资本运营部（部门副经理）；2017 年 9 月加入招商基金管理有限公司，任职于混合投资部（部门负责人）；2025 年 9 月加入摩根基金管理（中国）有限公司，任混合资产投资部总监。                   |
| 周梦婕 | 本基金基金经理           | 2025 年 1 月 16 日 | 2026 年 4 月 3 日 | 14 年 | 周梦婕女士曾任东方证券资产管理有限公司产品经理，长江证券股份有限公司投资经理助理，长江证券（上海）资产管理公司固定收益研究员、交易员，中海基金管理有限公司担任基金经理助理、基金经理。2021 年 10 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），现任基金经理。 |

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，在控制风险的前提下，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本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相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

所有投资组合参与的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成交量的 5% 的情形：无。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

上半年国内经济转型态势延续，产业结构持续优化升级。出口动力表现亮眼，前 5 个月进出口总额同比增长 15.3%，其中附加值较高的机电产品出口占比超六成，是拉动出口增长的主力。投资端，尽管上半年固定资产投资同比增速有所下降，但新兴产业投资实现了快速增长。消费端，社会消费品零售总额增速整体有所放缓，但新需求不断释放，新能源汽车、高能效等级家电、智能产品零售额同比增长较快。市场关注企业盈利增速能否持续兑现，通胀预期升温与新兴产业涨价链条成为博弈焦点。宏观政策在继续发挥出口和制造业投资拉动作用的同时，着力把扩大内需摆到更加重视的位置，意图通过供需动态平衡，保证经济运行持续向好。

海外方面，地缘冲突反复之下油价中枢预期有所上升，市场对美联储从降息预期迅速切换至边际收紧。主要发达经济体通胀预期脱锚，日欧央行加息落地，美联储 6 月议息会议释放鹰派信号，市场年内加息概率升温，全球流动性边际由松转紧。随着中东局势最终缓和，美国通胀压力可能已经见顶，而美国就业市场未来仍有可能延续走弱，失业率存在上行风险，联储新主席沃什

上任后首次议息会议可能是紧缩预期的阶段性顶点。

权益市场方面，二季度 A 股结构分化明显，一边是 AI 科技板块继续突进，一边是传统消费基建板块持续低迷，或反映市场对行业短期景气度的追逐和对长期基本面的过度悲观。在持续提升的日均成交量之下，居民资金入市加速为市场提供持续增量流动性。当前市场分化已经持续了足够长的时间，估值的剪刀差扩大至历史相对较高水平。本基金投资组合以均衡配置为切入点，聚焦估值与业绩匹配方向，结合上市公司中报预期，力争挖掘业绩确定性强、景气赛道的优质标的。

债券市场方面，二季度随着基本面修复节奏放缓以及内生通胀预期下降后，在流动性充裕的支持下，债券收益率震荡下行，信用利差压缩。

总体来看，国内经济平稳运行基础稳固，生产端新动能持续提升，出口韧性仍较强。内需相关的消费增速、地产与投资仍在磨底，消费端进一步从短期刺激转向居民稳收入、稳预期。

展望后市，权益方面，当前 AI 板块的快速上行对其他板块的资金抽吸效应较为显著。我们并不否认 AI 技术的发展前景，但当前实业端与二级市场均呈现出一定程度的过热现象。这种过热状态使得即便是微小的预期差，也可能引发较大的市场波动。在资金过度向 AI 板块集中、其他板块被明显抽吸的背景下，其余板块至少在阶段性层面或具备一定的回暖潜力。

“六张网”规划建设对 2026 年经济增长的拉动作用具有重要意义，但目前市场对其关注度仍显不足。当前消费市场呈现 K 型复苏态势，这一趋势符合经济逐步恢复的节奏。高端消费的渗透过程有望逐步向下延伸，从长期来看，中国经济的持续发展或仍需依赖消费的持续增长。

在此过程中，我们坚持自下而上的选股策略，本基金投资组合在持续优化与动态调整中，发现经过近期市场结构分化的行情，很多具备较高估值吸引力的优质公司数量明显增加。

债券方面，信贷需求疲软或是当前流动性超预期宽松的关键原因，传统债务部门信贷周期回落可能还未触及底部，新动能对债务融资扩张的替代效应尚未充分显现，需要从中长期的维度进行观察。三季度银行间流动性可能面临较大的扰动因素：一是央行监管力度的边际调整，二是政策加码对应基本面修复预期，可能放大资金利率短期波动。在降息窗口兑现之前，短端利率进一步向下的空间相对有限。关注央行降息预期、信贷投放节奏变化及内需复苏进展等，在出现新的影响因素前，10 年国债收益率可能仍将在低位震荡运行。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根悦享回报 6 个月持有期混合 A 份额净值增长率为：-4.78%，同期业绩比较基准收益率为：2.11%；

摩根悦享回报 6 个月持有期混合 C 份额净值增长率为：-4.88%，同期业绩比较基准收益率为：

2.11%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §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              | 19,509,638.35 | 28.55        |
|    | 其中：股票             | 19,509,638.35 | 28.55        |
| 2  | 基金投资              | —             | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 37,557,991.87 | 54.97        |
|    | 其中：债券             | 37,557,991.87 | 54.97        |
|    | 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          | 10,000,000.00 | 14.64        |
|    | 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      | 1,248,614.59  | 1.83         |
| 8  | 其他资产              | 11,305.48     | 0.02         |
| 9  | 合计                | 68,327,550.29 | 100.00       |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 6,843,633.75 元，占期末净值比例为 10.09%。

### 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

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —            | —            |
| B  | 采矿业              | —            | —            |
| C  | 制造业              | 7,773,331.29 | 11.46        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —            | —            |
| E  | 建筑业              | —            | —            |
| F  | 批发和零售业           | —            | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,537,272.00 | 2.27         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —            | —            |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | —             | —     |
| J | 金融业             | —             | —     |
| K | 房地产业            | —             | —     |
| L | 租赁和商务服务业        | 286,512.00    | 0.42  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 1,014,324.00  | 1.50  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 712,796.31    | 1.05  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | —             | —     |
| P | 教育              | 779,904.00    | 1.15  |
| Q | 卫生和社会工作         | —             | —     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 561,865.00    | 0.83  |
| S | 综合              | —             | —     |
|   | 合计              | 12,666,004.60 | 18.68 |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|--------------|--------------|
| 基础材料    | —            | —            |
| 消费者非必需品 | 2,104,388.07 | 3.10         |
| 消费者常用品  | 2,132,260.72 | 3.14         |
| 能源      | —            | —            |
| 金融      | —            | —            |
| 医疗保健    | —            | —            |
| 工业      | 1,980,760.40 | 2.92         |
| 信息技术    | 141,834.22   | 0.21         |
| 电信服务    | —            | —            |
| 公用事业    | —            | —            |
| 房地产     | 484,390.34   | 0.71         |
| 合计      | 6,843,633.75 | 10.09        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 603713 | 密尔克卫 | 21,600 | 1,537,272.00 | 2.27         |
| 2  | 03690  | 美团-W | 21,900 | 1,302,955.28 | 1.92         |
| 3  | 688036 | 传音控股 | 17,247 | 1,016,710.65 | 1.50         |
| 4  | 601058 | 赛轮轮胎 | 87,400 | 1,007,722.00 | 1.49         |
| 5  | 02367  | 巨子生物 | 38,800 | 893,043.11   | 1.32         |
| 6  | 301035 | 润丰股份 | 19,110 | 886,704.00   | 1.31         |
| 7  | 300791 | 仙乐健康 | 53,800 | 861,876.00   | 1.27         |
| 8  | 605098 | 行动教育 | 14,400 | 779,904.00   | 1.15         |
| 9  | 688466 | 金科环境 | 55,557 | 712,796.31   | 1.05         |

|    |       |      |        |            |      |
|----|-------|------|--------|------------|------|
| 10 | 01797 | 东方甄选 | 36,000 | 706,026.92 | 1.04 |
|----|-------|------|--------|------------|------|

#### 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      | 5,048,451.24  | 7.45         |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | 18,313,826.22 | 27.01        |
|    | 其中：政策性金融债 | 5,092,772.60  | 7.51         |
| 4  | 企业债券      | 11,116,289.75 | 16.40        |
| 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      | —             | —            |
| 9  | 其他        | 3,079,424.66  | 4.54         |
| 10 | 合计        | 37,557,991.87 | 55.39        |

#### 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  | 2228042   | 22 农业银行二级 02  | 50,000 | 5,487,500.00 | 8.09         |
| 2  | 260205    | 26 国开 05      | 50,000 | 5,092,772.60 | 7.51         |
| 3  | 243128    | 25 平证 19      | 50,000 | 5,025,331.23 | 7.41         |
| 4  | 242580026 | 25 浦发银行永续债 02 | 45,000 | 4,610,476.85 | 6.80         |
| 5  | 019792    | 25 国债 19      | 40,000 | 4,041,969.32 | 5.96         |

#### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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中，中国农业银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，上海浦东发展银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到央行、国家金融监督管理总局的处罚，国家开发银行报告编制日前一年内曾受到央行、国家外汇管理局北京市分局的处罚，广发银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局广东省分局、国家金融监督管理总局的处罚，兴业银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

### 5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定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   | 10,858.90 |
| 2  | 应收证券清算款 | 446.58    |
| 3  | 应收股利    | —         |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | —         |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 其他      | —         |
| 8  | 合计      | 11,305.48 |

### 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

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 摩根悦享回报 6 个月持有期混合 A | 摩根悦享回报 6 个月持有期混合 C |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 21,189,158.16      | 59,801,177.05      |
| 报告期期间基金总申购份额              | 63,369.91          | 303,957.60         |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 2,092,047.98       | 9,193,587.58       |
| 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               | 19,160,480.09      | 50,911,547.07      |

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

## §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

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §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

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予摩根悦享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金募集注册的文件
- （二）摩根悦享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同
- （三）摩根悦享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）摩根基金管理（中国）有限公司开放式基金业务规则
- （八）中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

### 9.3 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。

摩根基金管理（中国）有限公司

2026 年 7 月 21 日