

摩根盈元稳健三个月持有期混合型基金中
基金(FOF)
2026年第1季度报告

2026年3月31日

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：2026年4月22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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 4 月 21 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 摩根盈元稳健三个月持有期混合 (FOF) |
| 基金主代码 | 024695 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2025 年 8 月 6 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 799,528,836.26 份 |
| 投资目标 | 本基金通过资产配置及优选基金，并结合严格的风险控制，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略：</p> <p>在大类资产配置上，本基金将结合产品定位、风险收益特征以及管理人的长期资本市场观点确定基金的资产配置方案。</p> <p>首先，管理人将根据基金业绩基准确定产品的风险收益特征。其次，管理人将根据投研团队的长期资本市场观点对各类型资产的风险收益特征进行判断。最后，结合本基金以及各资产类别的风险收益特征，依据现代投资组合理论，模拟得出各大类资产的长期战略配置比例。</p> <p>本基金将定期结合策略观点，修正资产配置，实现细分资产类别的动态调整。</p> <p>2、基金投资策略：</p> <p>(1) 主动管理型基金投资策略</p> <p>本基金通过自下而上的方式优选基金，研究过程中综合运用定量分析和定性分析的方式，通过层层筛选，优选符合要求且能在中长期创造超额收益的基金构建</p> |

| | |
|-----------------|--|
| | <p>投资组合。</p> <p>(2) 指数基金投资策略 本基金优选中长期景气向好的指数基金进行配置，以增厚组合收益，并把握市场阶段性投资机会，获取更高的超额收益。</p> <p>(3) 公募 REITs 投资策略</p> <p>3、其他投资策略： 包括股票投资策略、港股投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证纯债债券型基金指数收益率*80%+中证偏股型基金指数收益率*5%+MSCI 世界指数 (MSCI World Index) 收益率 (使用估值汇率折算) *5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率*5%+活期存款利率 (税后) *5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金中基金，预期风险和收益水平低于股票型基金中基金，高于债券型基金中基金和货币型基金中基金。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 | 招商银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 摩根盈元稳健三个月持有期混合 (FOF) A 摩根盈元稳健三个月持有期混合 (FOF) C |
| 下属分级基金的交易代码 | 024695 024696 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 396,977,354.64 份 402,551,481.62 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 1 月 1 日 - 2026 年 3 月 31 日) | |
|-----------------|--|------------------------|
| | 摩根盈元稳健三个月持有期混合 (FOF) A | 摩根盈元稳健三个月持有期混合 (FOF) C |
| 1. 本期已实现收益 | 9,133,090.28 | 9,191,354.92 |
| 2. 本期利润 | 2,469,980.99 | 2,896,421.06 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0047 | 0.0051 |
| 4. 期末基金资产净值 | 400,257,787.25 | 404,820,877.37 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0083 | 1.0056 |

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

摩根盈元稳健三个月持有期混合 (FOF) A

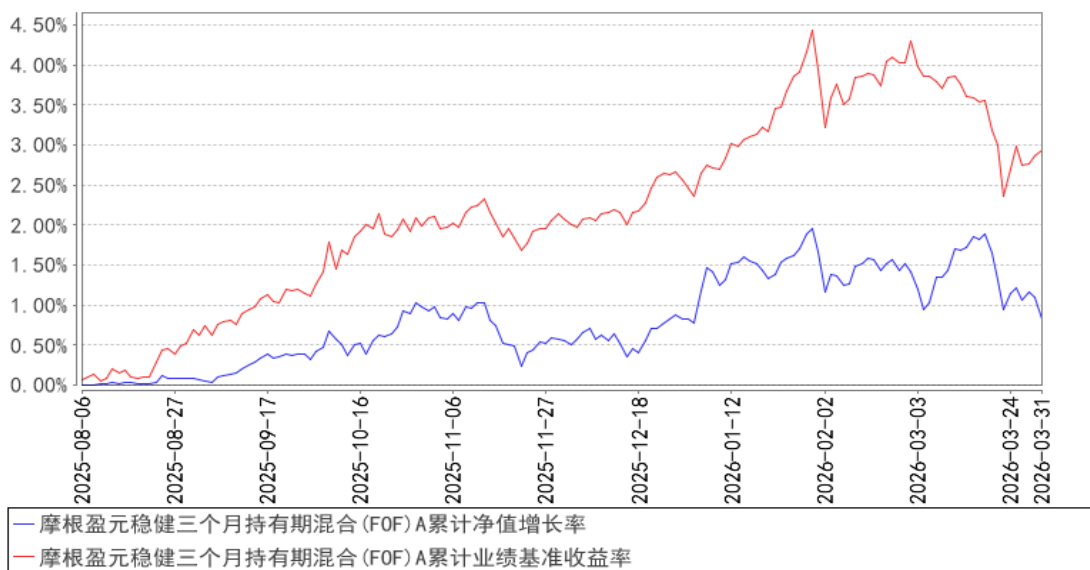
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.06% | 0.18% | 0.56% | 0.21% | -0.50% | -0.03% |
| 过去六个月 | 0.36% | 0.14% | 1.50% | 0.17% | -1.14% | -0.03% |
| 自基金合同 生效起至今 | 0.83% | 0.12% | 2.94% | 0.16% | -2.11% | -0.04% |

摩根盈元稳健三个月持有期混合 (FOF) C

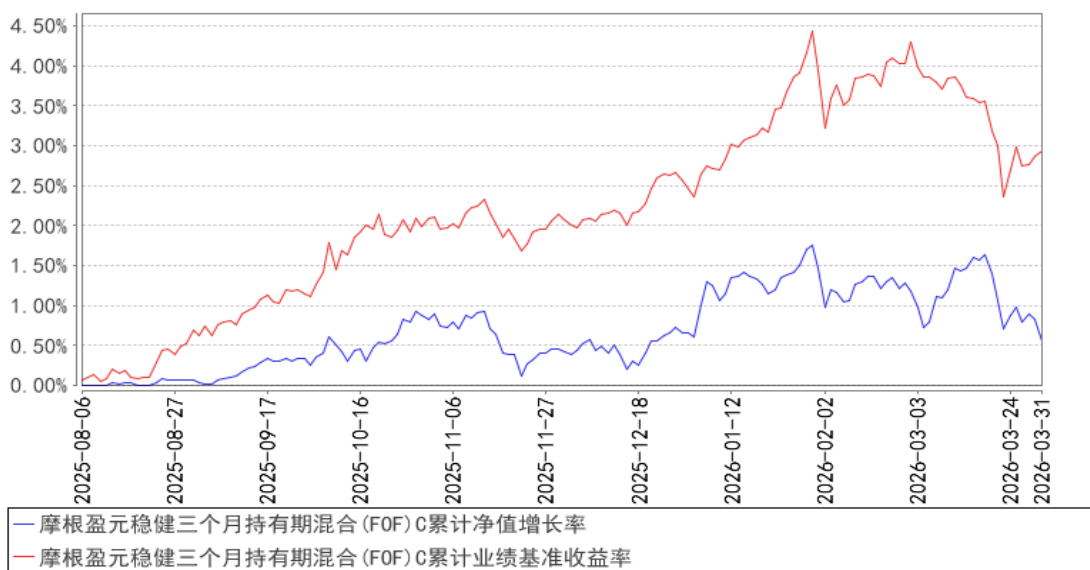
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -0.05% | 0.18% | 0.56% | 0.21% | -0.61% | -0.03% |
| 过去六个月 | 0.15% | 0.14% | 1.50% | 0.17% | -1.35% | -0.03% |
| 自基金合同 生效起至今 | 0.56% | 0.12% | 2.94% | 0.16% | -2.38% | -0.04% |

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

摩根盈元稳健三个月持有期混合(FOF)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



摩根盈元稳健三个月持有期混合(FOF)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2025年8月6日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

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 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|---------------------|-----------|---|-----|---|
| 吴春杰 | 本基金基金经理 | 2025年8月6日 | - | 15年 | 吴春杰女士曾任长江证券股份有限公司宏观策略分析师，中国太平洋人寿保险有限公司资产配置中心配置策略经理，上海景熙资产管理有限公司投资经理/宏观策略研究。2018年7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），历任宏观研究员，现任高级基金经理。 |
| 恩学海 | 本基金基金经理、资产管理解决方案主席。 | 2025年8月6日 | - | 31年 | 恩学海先生曾就职于通用数据公司。自1994年至2017年就职于美国富达投资集团，先后于资本市场部任高级程序设计和系统分析员、项目经理；于资产管理服务部任高级量化分析师；于战略顾问部、全球资产配置任基金经理、基金策略师；自2018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），历任资产配置及退休金管理首席投资官，现任资产管理解决方案主席。 |

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遵规守信情况的说明

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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共有 2 次，均为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年一季度，国内宏观经济平稳运行。经济增长方面，1-2 月出口数据好于预期，春节长假期间的国内消费也不乏亮点；通胀方面，CPI、PPI 延续回升态势。A 股在经历了 2025 年的震荡上行后，投资者对基本面、政策面的信心逐步增强，对 2026 年企业盈利改善抱有乐观的期待。开年之初，各类增量资金入市积极。但 1 月中旬开始，随着宽基 ETF 份额出现逆势大幅减少，A 股进入震荡、结构分化的状态，科技成长、周期板块表现更优。进入 3 月，中东地缘冲突爆发且持续时间不断超预期，国际油价大幅上涨约 50%，滞胀风险上升，引发全球股、债、黄金等资产共振下跌，A 股亦受风险偏好压制出现回调。回顾 2026 年一季度，中证 800 指数先扬后抑，累计下跌 2.28%。

对于国内债券市场而言，尽管年初政府债券发行节奏前置，但机构配置需求承接较好。国内债市受地缘冲突的影响相对较小，一方面，国内通胀低位，具备一定抵御能源推升型通胀的空间；另一方面，央行最新货币政策执行报告延续宽松基调。2026 年一季度，国内债券收益率曲线下行趋陡、信用利差普遍收窄。在 2026 年一季度期间，10 年期国债收益率下行 4bp 至 1.81%，1 年期国债到期收益率下行 12bp 至 1.22%。

海外方面，1-2 月非美区域股市表现强于美国，美股受软件板块拖累。但中东地缘冲突爆发后，能源进口依赖度更高的日本、韩国受冲击更大，美国股市体现韧性。2026 年一季度，标普 500 指数下跌 4.6%，德国 DAX 指数下跌 7.4%，日经 225 指数上涨 1.4%。美债方面，10 年期美国国债收益率上行 12bp 至 4.30%。

回顾基金在 2026 年一季度的操作，大类资产配置上降低海外权益配置幅度，主要是亚太与欧洲区域。增加 A 股配置比例，风格相对均衡。小幅增加商品基金的配置，中东地缘冲突爆发后，组合配置的商品基金，与成本推升型通胀呈正相关关系，能够在一定程度上起到丰富收益来源与对冲组合波动的作用。债券基金方面，组合久期低于债券资产部分基准指数的久期，阶段性以长债 ETF 做组合久期调节，参与利率下行的机会。产品在运作期间，围绕投资目标，动态调整、优化组合配置结构。

展望二季度，中东地缘冲突形势对经济与市场的影响或仍存在较大变数。传导链条上，油价上涨推升通胀的幅度、通胀对增长的抑制以及各国央行货币政策如何在多个目标间做出平衡，均存在不确定性。冲突拖延越久、中东原油供给损失越多，对全球经济增长的拖累幅度可能越大。届时，各国权益市场也或将需要更长的时间来修复。A 股配置上，前期已降低超配幅度，同时降低高贝塔板块的配置，超配消费为主。密切关注霍尔木兹海峡的通航进展，或有调整后增配 A 股的机会。

海外权益方面，在中东地缘政治风险缓和前，或延续低配。结构上，相对看好港股，因前期对资金面、盈利方面的负面担忧已有所反映，估值更具优势，且有望受益于中国经济的相对韧性。

另类资产方面，或维持能与农产品基金的配置。短期有望受益于油价上涨，长期有望受益于国内价格水平温和回升。后续考虑更分散地配置到更广泛的、受益于价格上涨的标的上。

国内债券方面，短期或将进入震荡期。来自油价上行的冲击将加速价格指标寻得底部的过程。组合在债券基金的部分预期仍以关注中短债策略为主，后续结合增长预期与风险偏好变化，阶段性考虑以长久期债券 ETF 参与波段性机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根盈元稳健三个月持有期混合 (FOF) A 份额净值增长率为：0.06%，同期业绩比较基准收益率为：0.56%；

摩根盈元稳健三个月持有期混合 (FOF) C 份额净值增长率为：-0.05%，同期业绩比较基准收益率为：0.56%。

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 | 2,252,432.00 | 0.28 |
| | 其中：股票 | 2,252,432.00 | 0.28 |
| 2 | 基金投资 | 739,530,025.07 | 90.49 |
| 3 | 固定收益投资 | 55,523,027.40 | 6.79 |
| | 其中：债券 | 55,523,027.40 | 6.79 |
| | 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 | 14,818,891.37 | 1.81 |
| 8 | 其他资产 | 5,112,794.43 | 0.63 |
| 9 | 合计 | 817,237,170.27 | 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

| 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 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,252,432.00 | 0.28 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| 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 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|--------------|------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,252,432.00 | 0.28 |

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港股通股票。

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

| 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 | 600900 | 长江电力 | 83,300 | 2,252,432.00 | 0.28 |

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 | 55,523,027.40 | 6.90 |
| 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 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 55,523,027.40 | 6.90 |

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 | 019785 | 25国债13 | 550,000 | 55,523,027.40 | 6.90 |

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

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,012,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 100,650.41 |
| 6 | 其他应收款 | 144.02 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,112,794.43 |

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额 (份) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-------------------|--------------|---------------|---------------|---------------|------------------------|
| 1 | 010168 | 天弘安利短债 A | 契约型开放式 | 59,418,024.35 | 68,354,495.21 | 8.49 | 否 |
| 2 | 270048 | 广发纯债债券 A | 契约型开放式 | 53,738,139.73 | 66,839,498.20 | 8.30 | 否 |
| 3 | 003949 | 兴全稳泰债券 A | 契约型开放式 | 54,290,849.34 | 66,365,134.23 | 8.24 | 否 |
| 4 | 511360 | 海富通中证短融 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 583,100.00 | 66,040,156.70 | 8.20 | 否 |
| 5 | 040040 | 华安纯债债券 A | 契约型开放式 | 60,418,720.73 | 65,010,543.51 | 8.08 | 否 |
| 6 | 016947 | 国泰利安中短债债券 A | 契约型开放式 | 58,613,247.41 | 63,601,234.76 | 7.90 | 否 |
| 7 | 004672 | 华夏短债债券 A | 契约型开放式 | 49,629,128.32 | 55,559,809.15 | 6.90 | 否 |
| 8 | 012246 | 博时月月享 30 天持有期短债 A | 契约型开放式 | 49,224,917.21 | 55,535,551.60 | 6.90 | 否 |
| 9 | 012395 | 兴业 60 天滚动持有短债 A | 契约型开放式 | 26,404,360.74 | 30,291,082.64 | 3.76 | 否 |
| 10 | 159981 | 能源化工 | 交易型开放式 (ETF) | 11,753,500.00 | 20,216,020.00 | 2.51 | 否 |

6.1.1 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公开募集基础设施证券投资基金投资明细

无。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

无。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 31 日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费 (元) | - | - |

| | | |
|--------------------------|------------|------------|
| 当期交易基金产生的赎回费 (元) | 154,998.59 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销 售服务费(元) | 30,175.11 | 143.67 |
| 当期持有基金产生的应支付管 理费(元) | 888,231.93 | 156,285.59 |
| 当期持有基金产生的应支付托 管费(元) | 207,869.04 | 6,709.48 |
| 当期交易基金产生的交易费 (元) | 31,924.91 | 812.85 |

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 摩根盈元稳健三个月持有 期混合 (FOF) A | 摩根盈元稳健三个月持有 期混合 (FOF) C |
|-------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 740,269,294.01 | 874,150,330.18 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 7,711,673.03 | 7,075,861.23 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 351,003,612.40 | 478,674,709.79 |
| 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 | 396,977,354.64 | 402,551,481.62 |

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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 摩根盈元稳健三个月持有 期混合 (FOF) A | 摩根盈元稳健三个月持有 期混合 (FOF) C |
|-------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 464,345.43 | - |
| 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 | 464,345.43 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总 份额比例 (%) | 0.06 | - |

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|----|------|------|---------|---------|------|
|----|------|------|---------|---------|------|

| | | | | | |
|----|----|------------|------------|------------|---|
| 1 | 申购 | 2026-02-04 | 464,345.43 | 472,100.00 | - |
| 合计 | | | 464,345.43 | 472,100.00 | |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予摩根盈元稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 募集注册的文件
- (二) 摩根盈元稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同
- (三) 摩根盈元稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

10.3 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 4 月 22 日