

摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中 基金 (FOF) 2026 年中期报告

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：北京银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 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	48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 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贵金属投资明细	48
7.9 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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 本报告期投资基金情况	48
7.13 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	54
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	54
10.9 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1 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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	
基金简称	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF)	
基金主代码	026576	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 2 月 11 日	
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	822, 383, 367. 83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) A	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) C
下属分级基金的交 易代码	026576	026577
报告期末下属分级 基金的份额总额	264, 324, 611. 55 份	558, 058, 756. 28 份

2.2 基金产品说明

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	1、资产配置策略： 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。 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。 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。 2、基金投资策略： （1）主动管理型基金投资策略 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投资组合。 （2）指数基金投资策略 本基金将通过对国内外宏观经济、经济结构转型的方向、国家经济政策、产业政策导向的深入研究，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。 （3）公募 REITs 投资策略 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。
业绩比较基准	中证红利指数收益率*8.5%+中证港股通高股息投资指数(人民币)收益率*4%+上海黄金交易所AU99.99现货实盘合约收益率*4%+MSCI世界指数(MSCI World Index)收益率(使用估值汇率折算)*8.5%+中证纯债债券型基金指数收益率*70%+活期存款基准利率(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。本基金若投资港股通标的股票,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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根基金管理(中国)有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭海明	闫朝
	联系电话	021-38794888	010-66223587
	电子邮箱	services@jpmamc.com	yanzhao@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95526
传真		021-20628400	010-89661115
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层	北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层	北京市西城区金融大街丙17号
邮政编码		200120	100033
法定代表人		王琼慧	关文杰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	am.jpmorgan.com/cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根基金管理(中国)有限公司	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2026年2月11日(基金合同生效日) - 2026年6月30日	
	摩根聚利稳健三个月持有期混合(FOF)A	摩根聚利稳健三个月持有期混合(FOF)C
本期已实现收益	1,558,947.34	2,244,265.25

本期利润	8,826,600.27	17,319,335.89
加权平均基金份额本期利润	0.0251	0.0236
本期加权平均净值利润率	2.50%	2.35%
本期基金份额净值增长率	2.76%	2.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年6月30日)	
期末可供分配利润	1,858,915.23	3,059,290.62
期末可供分配基金份额利润	0.0070	0.0055
期末基金资产净值	271,621,754.82	572,587,280.51
期末基金份额净值	1.0276	1.0260
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.76%	2.60%

注：1. 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。

2. 基金合同在当期生效。

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

摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	3.71%	0.33%	-0.73%	0.16%	4.44%	0.17%
自基金合同生效起至今	2.76%	0.29%	-1.52%	0.18%	4.28%	0.11%

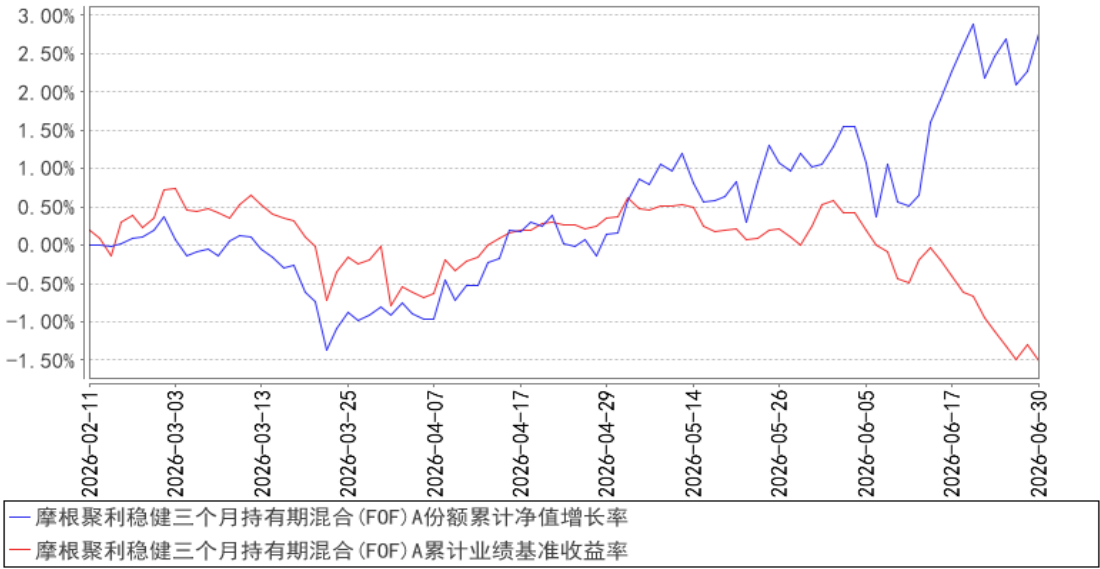
摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	3.60%	0.33%	-0.73%	0.16%	4.33%	0.17%
自基金合同生效起至今	2.60%	0.29%	-1.52%	0.18%	4.12%	0.11%

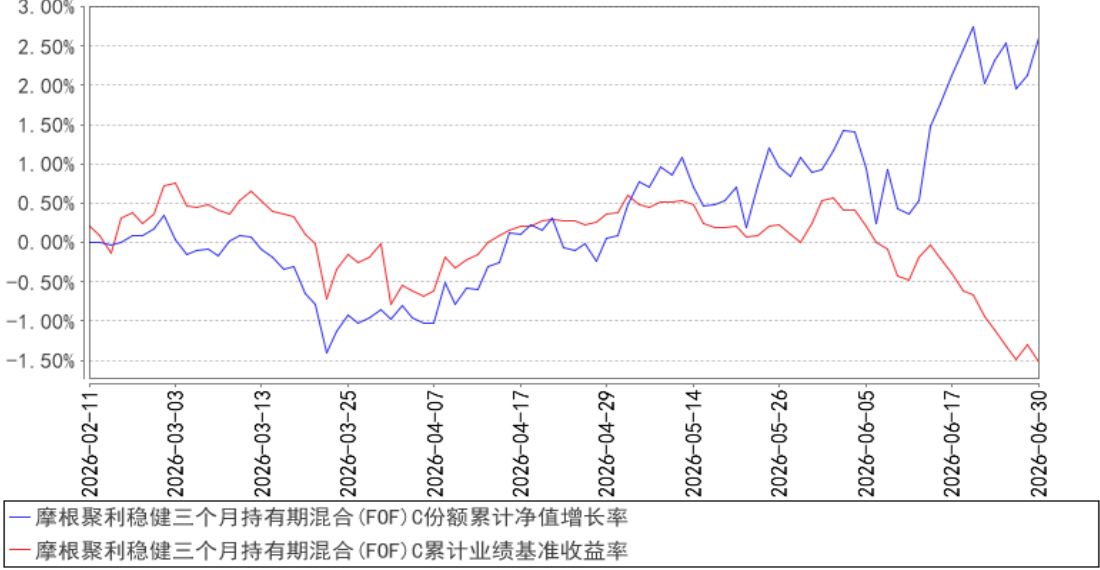
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

摩根聚利稳健三个月持有期混合 (F0F) A 份额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



摩根聚利稳健三个月持有期混合 (F0F) C 份额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 2026 年 2 月 11 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，截至本报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根基金管理（中国）有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。2023 年 1 月 19 日，经中国证监会批准，本公司原股东之一上海国际信托有限公司将其持有的本公司 51% 股权，与原另一股东 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 将其持有的本公司 49% 股权转让给摩根资产管理控股公司 (JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)，从而摩根资产管理控股公司取得本公司全部股权。2023 年 4 月 10 日，基金管理人的名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理（中国）有限公司”。截至 2026 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有一百二十二只，均为开放式基金，分别是：摩根中国优势证券投资基金、摩根货币市场基金、摩根阿尔法混合型证券投资基金、摩根双息平衡混合型证券投资基金、摩根成长先锋混合型证券投资基金、摩根内需动力混合型证券投资基金、摩根亚太优势混合型证券投资基金 (QDII)、摩根双核平衡混合型证券投资基金、摩根中小盘混合型证券投资基金、摩根纯债债券型证券投资基金、摩根行业轮动混合型证券投资基金、摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、摩根全球新兴市场混合型证券投资基金 (QDII)、摩根新兴动力混合型证券投资基金、摩根强化回报债券型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根全球天然资源混合型证券投资基金 (QDII)、摩根核心优选混合型证券投资基金、摩根智选 30 混合型证券投资基金、摩根成长动力混合型证券投资基金、摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、摩根双债增利债券型证券投资基金、摩根核心成长股票型证券投资基金、摩根民生需求股票型证券投资基金、摩根纯债丰利债券型证券投资基金、摩根天添盈货币市场基金、摩根天添宝货币市场基金、摩根安全战略股票型证券投资基金、摩根卓越制造股票型证券投资基金、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、摩根智慧互联股票型证券投资基金、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、摩根新兴服务股票型证券投资基金、摩根医疗健康股票型证券投资基金、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金 (QDII)、摩根全球多元配置证券投资基金 (QDII-FOF)、摩根安通回报混合型证券投资基金、摩根丰瑞债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、摩根安隆回报混合型证券投资基金、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金 (QDII)、摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、摩根尚睿混合型基金中基金 (FOF)、摩根安裕回报混合型证券投资基金、摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金 (QDII)、摩根核心精选股票型证券投资基金、摩根动力精

选混合型证券投资基金、摩根中国生物医药混合型证券投资基金 (QDII)、摩根领先优选混合型证券投资基金、摩根日本精选股票型证券投资基金 (QDII)、摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、摩根慧选成长股票型证券投资基金、摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、摩根研究驱动股票型证券投资基金、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根慧见两年持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根远见两年持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根行业睿选股票型证券投资基金、摩根优势成长混合型基金中基金 (FOF)、摩根安荣回报混合型基金中基金 (FOF)、摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、摩根景气甄选混合型基金中基金 (FOF)、摩根均衡优选混合型基金中基金 (FOF)、摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、摩根全景优势股票型证券投资基金、摩根沃享远见一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根鑫睿优选一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧享成长混合型基金中基金 (FOF)、摩根时代睿选股票型证券投资基金、摩根瑞享纯债债券型证券投资基金、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金 (QDII)、摩根海外稳健配置混合型基金中基金 (FOF)、摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金 (FOF)、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)、摩根世代趋势混合型基金中基金 (FOF)、摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)、摩根瑞锦纯债债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、摩根悦享回报 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、摩根瑞欣利率债债券型证券投资基金、摩根红利优选股票型证券投资基金、摩根均衡精选混合型基金中基金 (FOF)、摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根共同分类目录绿色债券债券型证券投资基金、摩根上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金、摩根恒鑫债券型证券投资基金、摩根 90 天持有期债券型证券投资基金、摩根 60 天持有期债券型证券投资基金、摩根沪深 300 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、摩根 30 天持有期债券型证券投资基金、摩根盈元稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根沪深 300 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根汇智优选混合型基金中基金 (FOF)、摩根中证 A500 指数增强型证券投资基金、摩根上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资

基金联接基金、 摩根标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、摩根上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金、摩根恒生港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧启成长混合型证券投资基金、摩根中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金、摩根恒睿债券型证券投资基金、摩根聚利稳健三个月持有期 FOF 基金、摩根恒悦纯债债券型证券投资基金、摩根恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金、摩根港股通宁远成长混合型证券投资基金、摩根均衡成长混合型证券投资基金、摩根恒利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (ETF-FOF)。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋华安	本基金基金经理、资产配置部总监	2026 年 2 月 11 日	-	18 年	蒋华安先生曾任安永会计师事务所担任高级审计员，社保基金理事会资产配置处副处长，工银瑞信基金 FOF 投资部总经理、基金经理；自 2025 年 4 月起加入摩根基金管理（中国）有限公司，现任资产配置部总监。
吴春杰	本基金基金经理	2026 年 2 月 11 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。
郑玥	本基金的基金助理	2026 年 3 月 23 日	-	9 年	毕业于中国人民大学。郑玥女士自 2015 年 7 月至 2017 年 1 月在美国 Epic Systems 担任软件工程师；自 2017 年 8 月-2018 年 11 月在上海耀之资产管理担任量化研究员；自 2018 年 11 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”），历任投资组合经理、量化研究员、绝对收益投资部基金经理助理，现任资产配置部基金经理和基金经理助理。
周诺	本基金的基金助理	2026 年 6 月 16 日	-	6 年	周诺女士曾任平安科技集团科技创新部高级分析师、平安基金资产配置事业部 MOM 研究员。2022 年 8 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），历任投资组合经理，现任资产配置部基金经理、基金经理助理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，全球经济延续温和复苏态势，但不同经济体、行业及资产之间分化进一步加剧。上半年，全球制造业投资周期延续改善，美国财政扩张仍对经济形成支撑，但全球通胀粘性较强，美联储维持偏鹰派立场，降息节奏有所放缓，全球流动性环境阶段性趋紧。国内经济整体呈现“K 型复苏”特征，出口及新质生产力保持较强韧性，内需恢复仍相对偏弱。财政政策继续保持积极取向但节奏相对克制，货币政策维持适度宽松，流动性总体充裕。上半年国内通胀仍处于较低水平，PPI 受输入性因素影响逐步改善。与此同时，地缘政治风险经历由升温到边际缓和的变化，对市场风险偏好形成阶段性扰动。

资产表现方面，上半年各类资产呈现明显的结构性行情。权益市场内部表现极度分化，AI 产业趋势持续强化，科技成长成为全球市场最重要的主线，中小盘成长板块显著跑赢传统蓝筹及价值板块；海外市场中，美日韩股市整体表现较强，而港股波动相对较大。债券市场整体维持震荡格局，利率债与信用债表现有所分化，收益率整体仍处于低位区间。商品市场上半年先强后弱，能源价格冲高回落，黄金受地缘政治及美元走势影响呈现较大波动。汇率方面，美元指数整体偏强，人民币兑美元总体保持升值态势。

报告期内，本基金坚持全球多资产配置框架，根据宏观环境、产业趋势及市场风险偏好的变化动态调整组合结构。一季度，在全球地缘风险上升背景下，本基金整体维持中性风险水平，更加注重组合防御能力，逐步增配红利、黄金及能源等防御类资产，同时保持境内外权益、债券及商品资产的充分分散配置。二季度，随着地缘风险边际缓和、市场风险偏好明显修复，本基金主动提升风险资产配置比例，把握科技成长主线带来的结构性机会，逐步降低防御类资产配置，重点增配境内外科技成长、中小盘及人工智能相关基金，并根据市场节奏适时进行仓位调整和结构优化。稳健资产方面，考虑到债券收益率整体仍处于低位区间，本基金始终保持中性偏低久期，以中短久期债券基金作为组合稳定器。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) A 份额净值增长率为：2.76%，同期业绩比较基准收益率为：-1.52%；

摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) C 份额净值增长率为：2.60%，同期业绩比较基准收益率为：-1.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，AI 产业革命与全球秩序重构仍将是影响全球资本市场的两条核心主线。全球经

济预计仍将维持“K 型分化”格局，美国财政扩张、高债务约束及贸易政策调整共同决定中长期弱美元方向，但短期货币政策仍取决于通胀及就业数据演变。国内经济有望在政策托底作用下继续企稳回升，新质生产力相关产业景气度预计仍将保持较高水平，结构性机会仍将显著优于整体市场。

资产配置方面，本基金将继续坚持全球分散配置理念，在产业趋势与宏观周期之间保持动态平衡。权益资产方面，将继续重点关注科技创新、自主可控、人工智能、机器人及先进制造等长期产业趋势，同时积极把握人民币升值背景下中国资产价值重估及低位板块估值修复机会；固定收益方面，继续保持适度久期，以票息收益及组合稳定性为主要目标，并灵活把握交易性机会；黄金仍将作为长期资产配置的重要组成部分，在全球央行购金、美元信用体系演变及地缘政治风险背景下继续发挥风险对冲作用。

本基金将继续坚持长期投资理念，密切跟踪全球宏观政策、产业趋势及市场风险偏好的变化，坚持自上而下的大类资产配置与自下而上的基金优选相结合，持续优化组合结构，努力在控制组合回撤的基础上，为投资者创造长期稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括投资研究、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理可参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在直接的重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在托管摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的有关规 定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议约定，对本基金的投资运作进行了监督，为本基金独立建账、独立核算、独立估值，按照托管协议约定的频率与管理人进行账务核对，本报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本基金托管人在能够知悉和掌握的信息范围内，按照国家法律法规规定、基金合同和托管协议约定，复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明”、“关联方报酬-应支付销售机构的客户维护费”、“关联方报酬-销售服务费”、“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告相关内容，复核内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (F0F)

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	41,560,192.90
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	834,951,175.13
其中：股票投资		-
基金投资		787,272,837.27
债券投资		47,678,337.86
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-

其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		677,786.56
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	15,772.51
资产总计		877,204,927.10
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		31,989,574.66
应付管理人报酬		437,167.01
应付托管费		112,330.01
应付销售服务费		202,469.88
应付投资顾问费		-
应交税费		193,856.21
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	60,494.00
负债合计		32,995,891.77
净资产:		
实收基金	6.4.7.10	822,383,367.83
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	21,825,667.50
净资产合计		844,209,035.33
负债和净资产总计		877,204,927.10

注：1. 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额：822,383,367.83 份，其中：A 类，基金份额净值：1.0276 元，基金份额：264,324,611.55 份。C 类，基金份额净值：1.0260 元，基金份额：558,058,756.28 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (F0F)

本报告期：2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2026 年 2 月 11 日 (基金合同生效日) 至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		30,426,433.88
1. 利息收入		231,289.71
其中：存款利息收入	6.4.7.13	52,915.97
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		178,373.74
其他利息收入		-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		6,058,981.74
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-233,386.06
基金投资收益	6.4.7.15	5,339,489.51
债券投资收益	6.4.7.16	333,863.72
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	619,014.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.21	22,342,723.57
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.22	1,793,438.86
减：二、营业总支出		4,280,497.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,447,845.93
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	624,824.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,125,371.88
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-
7. 税金及附加		21,561.89
8. 其他费用	6.4.7.25	60,894.00
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		26,145,936.16
减：所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		26,145,936.16
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		26,145,936.16

6.3 净资产变动表

会计主体：摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 170, 762, 819. 24	-	-	1, 170, 762, 819. 24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-348, 379, 451. 41	-	21, 825, 667. 50	-326, 553, 783. 91
（一）、综合收益总额	-	-	26, 145, 936. 16	26, 145, 936. 16
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-348, 379, 451. 41	-	-4, 320, 268. 66	-352, 699, 720. 07
其中：1. 基金申购款	2, 789, 683. 65	-	43, 817. 09	2, 833, 500. 74
2. 基金赎回款	-351, 169, 135. 06	-	-4, 364, 085. 75	-355, 533, 220. 81
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	822, 383, 367. 83	-	21, 825, 667. 50	844, 209, 035. 33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王琼慧

基金管理人负责人

徐振晨

主管会计工作负责人

俞文涵

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金(FOF)(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[2025]2932号《关于准予摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》注册,由摩根基金管理(中国)有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,170,250,567.59元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2026)验字第70042058_B02号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2026年2月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,170,762,819.24份基金份额,其中认购资金利息折合512,251.65份基金份额。本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司,基金托管人为北京银行股份有限公司。

本基金设置基金份额持有人最短持有期限。基金份额持有人持有的每份基金份额最短持有期限为三个月。对于认购的基金份额而言,指自基金合同生效之日起(含基金合同生效之日)至三个月后的月度对日的前一日(含该日)的期间;对于申购的基金份额而言,指自该笔申购份额确认日(含该日)至三个月后的月度对日的前一日(含该日)的期间。最短持有期限内基金份额持有人不可办理赎回及转换转出业务。每份基金份额的最短持有期限届满后的下一工作日(含该日)起,基金份额持有人可办理赎回及转换转出业务。

根据《摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额,其中,通过基金管理人认购、申购A类基金份额的不收取认购/申购费用;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额,其中,通过基金管理人认购/申购C类基金份额的不收取销售服务费;投资人持续持有期限超过一年的C类基金份额,不再继续收取销售服务费。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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, 包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金 (含 QDII 基金、香港互认基金、商品基金 (含商品期货基金和黄金 ETF)、公开募集基础设施证券投资基金 (公募 REITs) 及其他经中国证监会核准或注册的基金)、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 (含分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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)。

本基金的投资组合比例为: 投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于基金资产的 80%; 投资于权益类资产 (包括股票型基金、计入权益类资产的混合型基金、国内依法发行或上市的股票、存托凭证、港股通标的股票) 合计占基金资产的比例为 10%-40% (其中港股通标的股票投资占股票资产的比例不超过 50%), 计入权益类资产的混合型基金是指基金合同中明确约定股票投资占基金资产的比例为 60% 以上或者根据定期报告最近 4 个季度披露的股票投资占基金资产的比例均在 60% 以上的混合型基金; 投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%, 投资于商品基金 (含商品期货基金和黄金 ETF) 的比例不超过基金资产的 10%, 投资于 QDII 基金和香港互认基金比例合计不超过基金资产的 20%。本基金应保持现金或到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: 中证红利指数收益率 $\times 8.5\%$ + 中证港股通高股息投资指数 (人民币) 收益率 $\times 4\%$ + 上海黄金交易所 AU99.99 现货实盘合约收益率 $\times 4\%$ + MSCI 世界指数 (MSCI World Index) 收益率 (使用估值汇率折算) $\times 8.5\%$ + 中证纯债债券型基金指数收益率 $\times 70\%$ + 活期存款基准利率 (税后) $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标, 且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致, 即在特定日期产生的现金流量, 仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具, 以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资, 在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的,处于第一阶段,本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加,认定为处于第一阶段的金融工具,按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具,按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具,按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余

成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应

取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(3) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的, 若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值, 按其最近公布的基金份额净值为基础估值;

(b) 以所投资基金的收盘价估值的, 若估值日无交易, 且最近交易日后市场环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值; 如最近交易日后市场环境发生了重大变化的, 可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价, 确定公允价值;

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分, 基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部 税务总局公告2026年第10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前, 资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为, 可以选择适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前, 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值

税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	31,444,396.16

等于：本金	31,441,580.94
加：应计利息	2,815.22
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	10,115,796.74
等于：本金	10,114,890.09
加：应计利息	906.65
减：坏账准备	-
合计	41,560,192.90

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	47,575,724.00	92,617.86	47,678,337.86	9,996.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	47,575,724.00	92,617.86	47,678,337.86	9,996.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		764,940,109.70	-	787,272,837.27	22,332,727.57
其他		-	-	-	-
合计		812,515,833.70	92,617.86	834,951,175.13	22,342,723.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无余额。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无余额。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无余额。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无余额。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无余额。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无余额。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	15,772.51
待摊费用	-
合计	15,772.51

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	60,494.00
合计	60,494.00

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) A

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	380,622,531.56	380,622,531.56
本期申购	728,038.80	728,038.80
本期赎回（以“-”号填列）	-117,025,958.81	-117,025,958.81
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	264,324,611.55	264,324,611.55

摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) C

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	790,140,287.68	790,140,287.68
本期申购	2,061,644.85	2,061,644.85
本期赎回（以“-”号填列）	-234,143,176.25	-234,143,176.25
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	558,058,756.28	558,058,756.28

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,558,947.34	7,267,652.93	8,826,600.27
本期基金份额交易产生的变动数	299,967.89	-1,829,424.89	-1,529,457.00
其中：基金申购款	1,324.08	11,611.81	12,935.89
基金赎回款	298,643.81	-1,841,036.70	-1,542,392.89

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,858,915.23	5,438,228.04	7,297,143.27

摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,244,265.25	15,075,070.64	17,319,335.89
本期基金份额交易产生的变动数	815,025.37	-3,605,837.03	-2,790,811.66
其中：基金申购款	-650.38	31,531.58	30,881.20
基金赎回款	815,675.75	-3,637,368.61	-2,821,692.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,059,290.62	11,469,233.61	14,528,524.23

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	34,107.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	18,764.02
结算备付金利息收入	-
其他	44.60
合计	52,915.97

注：其他存款利息收入所列金额为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的利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月11日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-233,386.06
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-233,386.06

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,966,695.97
减：卖出股票成本总额	2,196,975.00
减：交易费用	3,107.03
买卖股票差价收入	-233,386.06

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,076,875,488.41
减：卖出/赎回基金成本总额	1,070,976,676.14
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	171,810.03
减：交易费用	387,512.73
基金投资收益	5,339,489.51

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月11日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	261,246.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	72,617.36
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	333,863.72

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月11日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	85,466,827.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	85,070,000.84
减：应计利息总额	324,209.77
减：交易费用	-

买卖债券差价收入	72,617.36
----------	-----------

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	619,014.57
合计	619,014.57

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	22,342,723.57
——股票投资	-
——债券投资	9,996.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	22,332,727.57
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	22,342,723.57

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,777,666.35
销售服务费返还	15,772.51
合计	1,793,438.86

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	54,778.91
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	793,470.11
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	223,870.09

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	25,926.60
信息披露费	34,567.40
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	60,894.00

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根基金管理（中国）有限公司（“摩根基金管理（中国）有限公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司（“北京银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,447,845.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,245,744.63
应支付基金管理人的净管理费	1,202,101.30

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 0.6% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	624,824.02

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	摩根聚利稳健三个月 持有期混合 (FOF) A	摩根聚利稳健三个月 持有期混合 (FOF) C	合计
北京银行	-	861,843.16	861,843.16
合计	-	861,843.16	861,843.16

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
	31,444,396.16	34,107.35

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人关联方公司摩根基金管理(中国)有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计 25,557,443.36 元，占本基金资产净值的比例为 3.03%。

6.4.10.8.2 当期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

项目	本期 2026 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
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）	—
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	16,122.61
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	48,186.82
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	9,353.76
当期交易基金产生的交易费（元）	26,164.77

注：上述费用为本基金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，其中赎回费是实际产生的归入被投资基金资产部分；销售服务费、管理费和托管费为估算费用。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责建立并完善公司市场风险、流动性风险、信用风险管理框架，运用系统化分析工具对以上进行分析和识别，提升公司风险科技水平。运营风险管理部负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。投资准则管理部负责执行和管控投资准则，通过设立投资准则、事前管控、事后管控，保障基金投资运作符合法规、合同及公司内部要求。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的货币资金存放于信用良好的银行，与货币资金相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	41,560,192.90	-	-	-	41,560,192.90
结算备付金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	47,678,337.86	-	-	787,272,837.27	834,951,175.13
应收申购款	-	-	-	677,786.56	677,786.56
其他资产	-	-	-	15,772.51	15,772.51
资产总计	89,238,530.76	-	-	787,966,396.34	877,204,927.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,989,574.66	31,989,574.66
应付管理人报酬	-	-	-	437,167.01	437,167.01
应付托管费	-	-	-	112,330.01	112,330.01
应付销售服务费	-	-	-	202,469.88	202,469.88
应交税费	-	-	-	193,856.21	193,856.21
其他负债	-	-	-	60,494.00	60,494.00
负债总计	-	-	-	32,995,891.77	32,995,891.77
利率敏感度缺口	89,238,530.76	-	-	-754,970,504.57	844,209,035.33

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 5.65%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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投资组合。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于基金资产的 80%；投资于权益类资产(包括股票型基金、计入权益类资产的混合型基金、国内依法发行或上市的股票、存托凭证、港股通标的股票)合计占基金资产的比例为 10%-40%(其中港股通标的股票投资占股票资产的比例不超过 50%)，计入权益类资产的混合型基金是指基金合同中明确约定股票投资占基金资产的比例为 60%以上或者根据定期报告最近 4 个季度披露的股票投资占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金；投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%，投资于商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)的比例不超过基金资产的 10%，投资于 QDII 基金和香港互认基金比例合计不超过基金资产的 20%。本基金应保持现金或到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	—	—
交易性金融资产—基金投资	787,272,837.27	93.26

交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	787,272,837.27	93.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2026年6月30日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	12,650,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	-12,650,000.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	787,272,837.27
第二层次	47,678,337.86
第三层次	-

合计	834,951,175.13
----	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日:同)。
--

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。
--

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	787,272,837.27	89.75
3	固定收益投资	47,678,337.86	5.44
	其中：债券	47,678,337.86	5.44
	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	41,560,192.90	4.74

8	其他各项资产	693,559.07	0.08
9	合计	877,204,927.10	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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境内股票。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600938	中国海油	1,161,429.00	0.14
2	600150	中国船舶	1,035,546.00	0.12

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600938	中国海油	1,010,329.00	0.12
2	600150	中国船舶	956,366.97	0.11

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,196,975.00
卖出股票收入（成交）总额	1,966,695.97

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	47,678,337.86	5.65

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	47,678,337.86	5.65

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019835	26 国债 09	476,000	47,678,337.86	5.65

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 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。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

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	511580	招商中证国债及政策性金融	交易型开放式(ETF)	1,315,400.00	143,958,691.40	17.05	否

		债 0-3 年 ETF					
2	511030	平安中高等级公司债利因子 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,154,800.00	124,786,533.20	14.78	否
3	511220	海富通上证城投债 ETF	交易型开放式 (ETF)	10,362,900.00	107,515,087.50	12.74	否
4	511060	海富通上证 5 年期地方政府债 ETF	交易型开放式 (ETF)	993,690.00	107,414,907.93	12.72	否
5	511110	易方达上证基准做市公司债 ETF	交易型开放式 (ETF)	895,900.00	92,111,062.60	10.91	否
6	159816	0-4 地债	交易型开放式 (ETF)	303,800.00	34,538,718.20	4.09	否
7	159650	博时中债 0-3 年国开行 ETF	交易型开放式 (ETF)	240,800.00	25,958,962.40	3.07	否
8	014642	摩根新兴动力混合 C 类	契约型开放式	1,917,589.67	25,557,443.36	3.03	是
9	022184	富国全球科技互联网股票	契约型开放式	2,573,716.58	16,366,263.73	1.94	否

		(QDII)C					
10	159649	华安中 债 1-5 年国开 行债券 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	127,900.00	14,092,789.40	1.67	否
11	588200	嘉实上 证科创 板芯片 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	2,841,300.00	14,024,656.80	1.66	否
12	512100	南方中 证 1000ETF	交易 型开 放式 (ETF)	3,865,600.00	13,827,251.20	1.64	否
13	563300	华泰柏 瑞中证 2000ETF	交易 型开 放式 (ETF)	8,419,700.00	13,547,297.30	1.60	否
14	159516	国泰中 证半导 体材料 设备主 题 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	5,392,600.00	10,650,385.00	1.26	否
15	021277	广发全 球精选 股票 (QDII) 人民币 C	契约 型开 放式	1,070,926.49	7,965,229.95	0.94	否
16	159363	华宝创 业板人 工智能 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	4,273,500.00	6,636,745.50	0.79	否
17	515880	国泰中 证全指 通信设	交易 型开 放式	3,582,000.00	6,433,272.00	0.76	否

		备 ETF	(ETF)				
18	159796	汇添富中证电池主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	5,862,100.00	6,143,480.80	0.73	否
19	159326	华夏中证电网设备主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,818,400.00	5,884,819.20	0.70	否
20	588230	华泰柏瑞上证科创板 200ETF	交易型开放式 (ETF)	1,689,000.00	3,906,657.00	0.46	否
21	512400	南方中证申万有色金属 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,782,000.00	3,303,828.00	0.39	否
22	562800	嘉实中证稀有金属主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,319,400.00	2,648,754.80	0.31	否

7.12.2 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

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。

7.13.2

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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	677,786.56
6	其他应收款	15,772.51
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	693,559.07

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
摩根聚利 稳健三个 月持有期 混合 (FOF)A	1,572	168,145.43	0.00	0.00%	264,324,611.55	100.00%
摩根聚利 稳健三个 月持有期 混合 (FOF)C	3,087	180,777.05	5,591,772.93	1.00%	552,466,983.35	99.00%
合计	4,659	176,515.00	5,591,772.93	0.68%	816,791,594.90	99.32%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所	摩根聚利稳健三个月持有期混 合 (FOF) A	0.00	-

有从业人员持有本基金	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) C	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) A	0
	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) A	0
	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) A	摩根聚利稳健三个月持有期混合 (FOF) C
基金合同生效日 （2026 年 2 月 11 日） 基金份额总额	380,622,531.56	790,140,287.68
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	728,038.80	2,061,644.85
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	117,025,958.81	234,143,176.25
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	264,324,611.55	558,058,756.28

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：无。

基金托管人：本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，管理人未受调查或处罚。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，未发现管理人相关从业人员受调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	2	4,163,670.97	100.00	337,243.75	100.00	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 证券公司的选择标准：

- 1) 资本金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- 3) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 5) 具备较完善的清算系统，能及时、高效地完成资金的结算交收。
- 6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 证券公司的选择程序：

- 1) 本基金管理人定期组织相关部门依据证券公司的选择标准对候选券商进行评估，确定选用的券商。
- 2) 本基金管理人与券商签订协议，并通知基金托管人。
4. 本基金本年度成立，所有席位均为新增。
5. 《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间，本公司旗下管理基金的股票交易佣金费率符合法规要求，即被动股票型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率，其他类型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。市场平均股票交易佣金费率由中国证券业协会定期测算并向行业机构通报。

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信证券	217,788,343.04	100.00	1,943,198,000.00	100.00	-	-	2,865,792,274.25	100.00

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同生效公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2026 年 2 月 12 日

2	摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理变更公告	同上	2026 年 2 月 12 日
3	摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告	同上	2026 年 5 月 8 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予本基金募集注册的文件
- (二) 摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同
- (三) 摩根聚利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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

12.3 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 8 月 31 日