

摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 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 1 月 1 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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	14
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	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 盈利投资者数量占比	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4 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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
10.7 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	53
10.8 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
§ 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	摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	大摩优享六个月持有期混合	
基金主代码	012368	
基金运作方式	契约型开放式。本基金每个工作日开放申购，但本基金对每份基金份额设置 6 个月的最短持有期限。	
基金合同生效日	2021 年 7 月 23 日	
基金管理人	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	267,238,597.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大摩优享六个月持有期混合 A	大摩优享六个月持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	012368	012369
报告期末下属分级基金的份额总额	250,668,369.40 份	16,570,228.58 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	（一）大类资产配置策略 本基金按照自上而下的方法，通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素，研判各类固定收益类资产的投资机会，以及参与可转换债券转股、股票市场交易等权益类投资工具类资产的投资机会。 （二）股票投资策略 1、A 股投资策略 本基金通过“自上而下”与“自下而上”相结合的框架挖掘优质上市公司：自上而下分析行业的发展阶段、增长空间、竞争格局、潜在风险等方面，选择景气度向好，成长空间较大，竞争格局良好的细分行业；自下而上评判企业的产品和服务竞争力、管理水平和治

	理结构、行业竞争地位等，通过对公司基本面和估值水平进行深度分析，挖掘优质个股。 2、港股投资策略 本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票投资策略外，还需关注： （1）香港股票市场制度与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面； （2）人民币与港币之间的汇兑比率变化情况。 （三）债券投资策略 基金管理人通过评估货币政策、财政政策和国际环境等因素，分析市场价格中隐含的对经济增长、通货膨胀、违约概率、提前偿付速度等因素的预测，根据债券市场中存在的各种投资机会的相对投资价值和相关风险决定总体的投资策略及类属（政府、企业/公司、可转换债券等）和期限（短期、中期和长期）等部分的投资比例，并基于价值分析精选投资品种构建债券投资组合。 （四）存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。 （五）其他金融工具投资策略 1、可转债投资策略 当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资。 2、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券的发行条款、基础资产的构成及质量等基本面研究，结合相关定价模型评估其内在价值，谨慎参与资产支持证券投资。 3、国债期货投资策略 本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。 4、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。因此股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以获取相应股票组合的超额收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+恒生指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其长期平均预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承

	担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。
--	--

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	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧
	联系电话	(0755)88318883
	电子邮箱	im-disclosure@morganstanley.com.cn
客户服务电话	400-8888-668	95599
传真	(0755)82990384	010-68121816
注册地址	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	ZHOU WENTONG（周文桐）	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.morganstanleyfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人、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	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层
港股投资顾问	摩根士丹利亚洲有限公司 (Morgan Stanley Asia Limited)	香港九龙柯士甸道西一号环球贸易广场3、8、9、30-32、35-42以及45-47

§ 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	报告期(2026年1月1日-2026年6月30日)	
和指标	大摩优享六个月持有期混合 A	大摩优享六个月持有期混合 C
本期已实现收益	11,938,853.11	709,355.27
本期利润	-12,283,165.16	-846,623.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0431	-0.0468

本期加权平均净值利润率	-4.65%	-5.14%
本期基金份额净值增长率	-6.20%	-6.38%
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	-38,768,606.38	-2,837,174.79
期末可供分配基金份额利润	-0.1547	-0.1712
期末基金资产净值	211,899,763.02	13,733,053.79
期末基金份额净值	0.8453	0.8288
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	-15.47%	-17.12%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 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，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

大摩优享六个月持有期混合 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	-9.28%	0.64%	8.13%	1.02%	-17.41%	-0.38%
过去六个月	-6.20%	0.71%	4.77%	0.93%	-10.97%	-0.22%

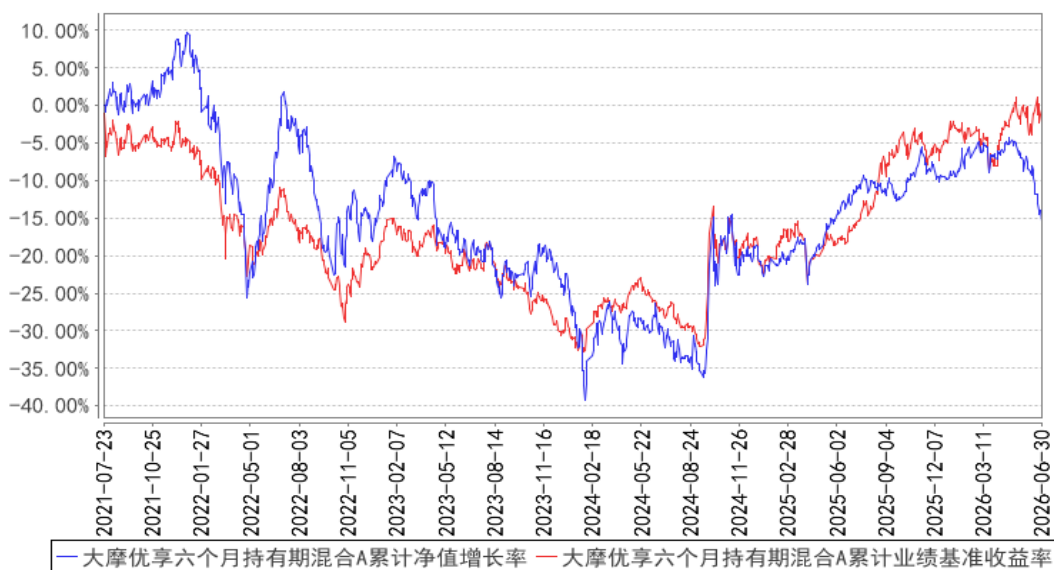
过去一年	-2.59%	0.62%	19.45%	0.84%	-22.04%	-0.22%
过去三年	4.71%	1.23%	26.66%	0.93%	-21.95%	0.30%
自基金合同生效起至今	-15.47%	1.27%	-0.50%	0.95%	-14.97%	0.32%

大摩优享六个月持有期混合 C

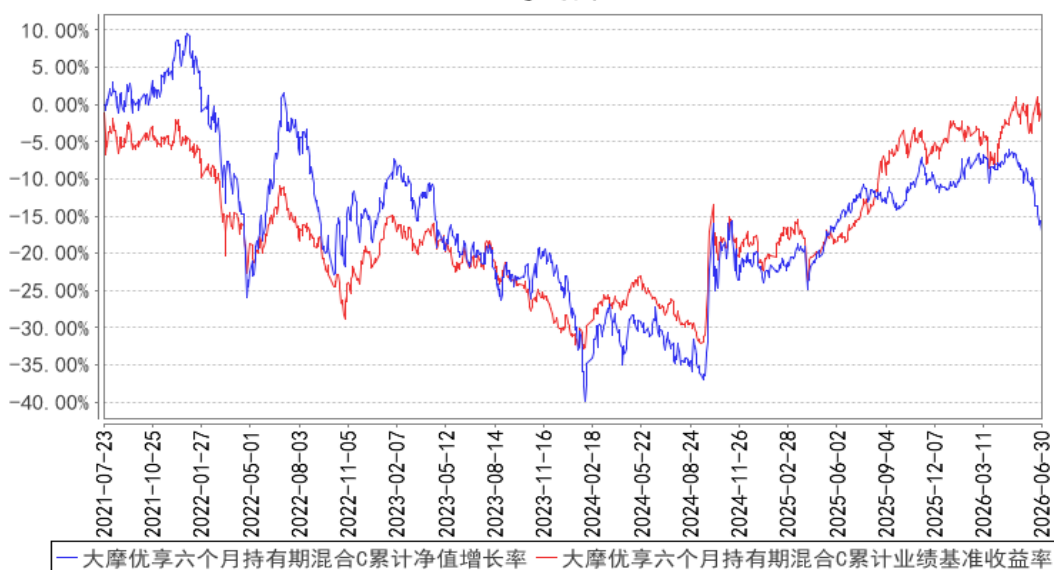
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-9.37%	0.64%	8.13%	1.02%	-17.50%	-0.38%
过去六个月	-6.38%	0.71%	4.77%	0.93%	-11.15%	-0.22%
过去一年	-2.97%	0.62%	19.45%	0.84%	-22.42%	-0.22%
过去三年	3.47%	1.23%	26.66%	0.93%	-23.19%	0.30%
自基金合同生效起至今	-17.12%	1.27%	-0.50%	0.95%	-16.62%	0.32%

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

大摩优享六个月持有期混合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



大摩优享六个月持有期混合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：1、本基金基金合同于 2021 年 7 月 23 日正式生效。

2、按照本基金基金合同的规定,基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 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

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司（以下简称“公司”）是一家外国法人独资基金管理公

司，前身为经中国证监会证监基金字[2003]33 号文批准设立并于 2003 年 3 月 14 日成立的巨田基金管理有限公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司。公司的股东为摩根士丹利国际控股公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 41 只公募基金，其中股票型 4 只、混合型 21 只、指数型 3 只、债券型 13 只。同时，公司还管理着多个私募资产管理计划。

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		
缪 东 航	基金经理	2024 年 12 月 2 日	—	16 年	北京大学金融学硕士。曾任华安基金管理有限公司建材行业研究员，2012 年 9 月加入本公司，历任研究管理部研究员、基金经理助理，现任权益投资部基金经理。2017 年 1 月起担任摩根士丹利主题优选混合型证券投资基金基金经理，2017 年 5 月至 2021 年 1 月担任摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至 2020 年 12 月担任摩根士丹利华鑫新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2020 年 5 月担任摩根士丹利万众创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2023 年 2 月担任摩根士丹利卓越成长混合型证券投资基金基金经理，2017 年 5 月至 2020 年 5 月及 2021 年 4 月起担任摩根士丹利进取优选股票型证券投资基金基金经理，2024 年 11 月至 2026 年 6 月担任摩根士丹利领先优势混合型证券投资基金、摩根士丹利品质生活精选股票型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月起担任摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。
余 斌	数量化投 资 部 总 监、基金 经理	2024 年 12 月 2 日	—	18 年	南开大学经济学硕士，金融风险管理师（FRM）。曾任招商证券股份有限公司风险管理部风险分析师、鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部基金经理。2019 年 5 月加入本公司，现任数量化投资部总监、基金经理。2019 年 8 月起担任摩根士丹利深证 300 指数增强型证券投资基金、摩根士丹利量化多策略股票型证券投资基金、摩根士丹利多因子精选策略混合型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起担任摩根士丹利 ESG 量化先行混合型证券投资基金

					基金经理，2020 年 7 月至 2023 年 4 月担任摩根士丹利华鑫 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月起担任摩根士丹利量化配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月起担任摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起担任摩根士丹利添益债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；基金的基金经理助理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在认真控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及内部相关制度和流程，通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求，并通过对投资交易行为的监控和分析，确保基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待。本报告期，基金管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

经对报告期内公司管理所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异，连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合参与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%的情况，基金管理人未发现异常交易行为。

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

回顾 2026 年上半年，A 股走出震荡上行的结构性行情，上证指数上涨 3.16%，创业板指大涨 35.58%，科创 50 指数更是累计上涨 64.25%，迭创历史新高，成长风格明显占优。板块之间的分化极大，涨幅居前的板块主要是电子、通信和建筑材料，其中电子板块半年涨幅高达 86.29%，而食品饮料、商贸零售和农林牧渔等板块表现相对落后。

上半年市场风险偏好整体抬升，尽管俄乌、中东等地缘政治局势一度扰动全球市场、美联储降息步伐有所放缓，但国内经济稳步修复、流动性保持合理宽裕，叠加活跃资本市场的一系列政策持续发力，为 A 股营造了良好的资金环境。上半年两市日均成交额约 2.74 万亿元，同比近乎翻倍，刷新半年度历史纪录；融资资金大幅净买入，保险、被动指数基金等中长期资金加速入场，市场情绪与增量资金形成正向循环，带动指数重心稳步上移。

上半年国内科技创新继续取得重大突破，在全球人工智能资本开支高景气的带动下，算力需求爆发式增长，半导体国产替代持续深化，硬科技赛道成为全市场最强主线。截至二季度末，电子设备行业总市值首次超越金融成为 A 股市值最大的行业。这些进展进一步巩固并大幅提升了资本市场对中国科技创新和新质生产力发展的信心。

2026 年上半年本基金重点配置的方向包括：1) 具备低波红利特征的个股。十年期国债的收益率维持低位，持有股票获得分红收益，优于持有十年期国债。未来红利板块的估值有望进一步提升。此外，由于中国的经济发展日趋成熟，经济增长出现一定程度的放缓。未来中国企业的利润增长速度也将跟随经济放缓，企业将减少资本开支，自由现金流将大幅改善，企业将提升分红以回报投资者。2) 具备核心竞争力的蓝筹白马。此类公司通常拥有稳固的竞争壁垒、良好的商业模式和持续的现金流创造能力，在经济增速放缓的环境下仍能保持相对稳健的盈利增长。随着市场风格逐步由主题押注回归基本面，业绩确定性强、分红稳定的优质蓝筹有望重新获得资金青睐，估值修复的空间与确定性均相对可观。本基金将重点选择兼具核心竞争力与合理估值的蓝筹白马，力争为投资者获取长期稳健的超额收益。

卓越的业绩是本基金的主要目标，此外，未来本基金将努力降低基金的波动率，为投资人创造更好的持有体验。本基金坚持以定量和定性相结合的方法精选各行业的个股，实现基金相对于基准的稳定超额收益。在资产配置方面，除非出现重大的宏观利空因素，本基金将维持中性偏高的仓位。企业的核心竞争力，以及持续的分红能力是本基金相对看重的指标，我们始终坚信，具有核心竞争力的公司，才能为股东持续创造超额利润，从而为投资者持续创造超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 0.8453 元，份额累计净值为 0.8453 元，基金份额净值增长率为-6.20%，同期业绩比较基准收益率为 4.77%；C 类份额净值为 0.8288 元，份额累计净值为 0.8288 元，C 类基金份额净值增长率为-6.38%，同期业绩比较基准收益率为 4.77%。

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 2026 年下半年，我们认为在传统部门的拖累下，通缩的压力仍然存在，居民的信心有小幅恢复，但不足以支撑经济的大幅反弹，国内的经济增长对出口的依赖度在提升。地方政府受制于较高的负债率，财政发力的空间较小，企业家的信心不足导致民间投资低迷。我们认为未来政府刺激经济的重点是提高民生的保障水平，促进居民消费和产业升级，以实现高质量发展。

从远期看，高端制造和产业升级能够提升中国经济在全球的竞争力。尽管目前全球的贸易壁垒在提升，我国在新能源汽车和光伏等领域仍然保持了较强的竞争力，半导体产业也在逐渐完成进口替代。同时，我们认为在发展高端制造业的同时，可适当加强居民消费能力的培育，居民的消费能力和信心对经济的健康持续发展也具备重要意义。

我们对 2026 年下半年 A 股的表现相对乐观。新经济、新消费和新技术预计将有不错表现，但个股的表现会因为估值的差异而有所分化。传统部门的基本面仍然低迷，机会主要来源于过于悲观的预期带来的股价超跌。下半年 A 股的流动性仍然将比较充裕，大部分 A 股板块估值仍有提升空间。尽管短期经济承压，但我们也注意到中国的部分产业具有全球竞争力，我们对中国经济的中期走势并不悲观。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人设有基金估值委员会，委员会由主任委员（基金运营部的业务条线负责人）以及相关成员（包括研究管理部负责人、固定收益投资部信用研究员、基金运营部负责人、基金估值核算业务负责人、风险管理部负责人、监察稽核部负责人）构成。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和估值方法的最终决策和日常估值的执行。

由于基金经理、相关投资研究人员对特定投资品种的估值有深入的理解，经估值委员会主任委员同意，在需要时可以列席估值委员会议并提出估值建议，估值委员会对特定品种估值方法需经委员充分讨论后确定。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和监管部门、基金合同的相关约定以及本基金的实际运作情况，本基金本报告期未实施利润分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、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：摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	7,497,229.26	3,011,566.03
结算备付金		491,083.22	284,313.73
存出保证金		35,415.31	55,589.52
交易性金融资产	6.4.7.2	218,717,649.86	312,809,899.84
其中：股票投资		205,230,792.16	296,345,327.89
基金投资		—	—
债券投资		13,486,857.70	16,464,571.95
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		657,082.75	468,794.88
应收申购款		4,964.63	6,796.89
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		227,403,425.03	316,636,960.89
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 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		21.17	60.75
应付赎回款		1,225,023.90	475,436.98

应付管理人报酬		243,272.33	330,461.36
应付托管费		40,545.38	55,076.90
应付销售服务费		4,869.70	6,390.10
应付投资顾问费		—	—
应交税费		438.46	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.9	256,437.28	348,482.45
负债合计		1,770,608.22	1,215,908.54
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	267,238,597.98	350,383,485.27
未分配利润	6.4.7.12	-41,605,781.17	-34,962,432.92
净资产合计		225,632,816.81	315,421,052.35
负债和净资产总计		227,403,425.03	316,636,960.89

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，大摩优享六个月持有期混合 A 基金份额净值 0.8453 元，基金份额总额 250,668,369.40 份；大摩优享六个月持有期混合 C 基金份额净值 0.8288 元，基金份额总额 16,570,228.58 份。本基金基金份额总额合计为 267,238,597.98 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-11,047,494.89	26,224,369.11
1. 利息收入		18,393.69	29,037.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,393.69	29,037.98
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		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,711,069.78	10,074,464.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	10,207,555.81	1,924,905.86
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.15	87,453.33	115,156.60
资产支持证券投资	6.4.7.16	—	—
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	—	—

衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,416,060.64	8,034,401.73
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-25,777,997.40	16,120,355.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,039.04	511.34
减：二、营业总支出		2,082,294.13	2,614,560.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,674,034.12	2,120,006.13
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	279,005.66	353,334.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	32,688.14	42,679.75
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		115.88	-
8. 其他费用	6.4.7.23	96,450.33	98,540.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,129,789.02	23,609,808.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,129,789.02	23,609,808.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,129,789.02	23,609,808.43

6.3 净资产变动表

会计主体：摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 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	350,383,485.27	-	-34,962,432.92	315,421,052.35
二、本期期初净资产	350,383,485.27	-	-34,962,432.92	315,421,052.35
三、本期增减变动额（减少以“-”	-83,144,887.29	-	-6,643,348.25	-89,788,235.54

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-13,129,789.02	-13,129,789.02
(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)	-83,144,887.29	-	6,486,440.77	-76,658,446.52
其中：1. 基金申购款	1,540,167.74	-	-117,587.54	1,422,580.20
2. 基金赎回款	-84,685,055.03	-	6,604,028.31	-78,081,026.72
(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、本期期末净资产	267,238,597.98	-	-41,605,781.17	225,632,816.81
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	453,225,868.69	-	-85,500,480.15	367,725,388.54
二、本期期初净资产	453,225,868.69	-	-85,500,480.15	367,725,388.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-31,464,267.69	-	29,402,506.42	-2,061,761.27
(一)、综合收益总额	-	-	23,609,808.43	23,609,808.43
(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)	-31,464,267.69	-	5,792,697.99	-25,671,569.70
其中：1. 基金申购款	1,003,065.51	-	-169,614.13	833,451.38
2. 基金赎回款	-32,467,333.20	-	5,962,312.12	-26,505,021.08
(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、本期期末净资产	421,761,601.00	-	-56,097,973.73	365,663,627.27

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：

ZHOU WENTONG（周文桐）

谢先斌

杜志强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金（原名为“摩根士丹利华鑫优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金”，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[2021]第 1462 号《关于准予摩根士丹利华鑫优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准，由摩根士丹利基金管理(中国)有限公司(原摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，已于 2023 年 6 月 1 日办理完成股权及相应董事变更的工商变更登记，于 2023 年 6 月 2 日办理完成名称的相关工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》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 728,058,676.39 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0366 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根士丹利华鑫优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 728,260,589.16 份基金份额，其中认购资金利息折合 201,912.77 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根士丹利基金管理(中国)有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2023 年 6 月 8 日发布的《摩根士丹利基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，自 2023 年 6 月 8 日起，摩根士丹利华鑫优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金更名为摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金。

本基金每个工作日开放申购，但本基金对每份基金份额设置 6 个月的最短持有期限。即：自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言，下同）至该日 6 个月后的对日的前一日的期间

内，投资者不能提出赎回及转换转出业务申请；该日 6 个月后的对日（含该日）起，投资者可以提出赎回及转换转出业务申请。若该对日为非工作日，则顺延至下一个工作日；若该日历月中实际不存在对应日期，则顺延至该日历月最后一日的下一工作日。根据《摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金自募集期起根据认购/申购费用与销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。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；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》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，包括国内依法上市的股票（包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据及其他中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、股指期货、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于港股通股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75% + 恒生指数收益率×10%+ 中证综合债指数收益率×15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 年上半年度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 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、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》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融

同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、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》的规定，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。对在该日期之前已发行的国债、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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	7,497,229.26
等于：本金	7,496,286.55
加：应计利息	942.71
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,497,229.26

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	224,091,946.88	-	205,230,792.16	-18,861,154.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	13,411,763.00	74,797.70	13,486,857.70	297.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	13,411,763.00	74,797.70	13,486,857.70	297.00
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		237,503,709.88	74,797.70	218,717,649.86	-18,860,857.72

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	5.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	169,651.81
其中：交易所市场	169,651.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	256,437.28

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大摩优享六个月持有期混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	329,645,065.65	329,645,065.65
本期申购	683,617.67	683,617.67
本期赎回（以“-”号填列）	-79,660,313.92	-79,660,313.92
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	250,668,369.40	250,668,369.40

大摩优享六个月持有期混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,738,419.62	20,738,419.62
本期申购	856,550.07	856,550.07
本期赎回（以“-”号填列）	-5,024,741.11	-5,024,741.11
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	16,570,228.58	16,570,228.58

注：申购含红利再投份额（如适用）、转换入份额（如适用）；赎回含转换出份额（如适用）。

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

大摩优享六个月持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-38,733,715.90	6,150,255.51	-32,583,460.39
本期期初	-38,733,715.90	6,150,255.51	-32,583,460.39
本期利润	11,938,853.11	-24,222,018.27	-12,283,165.16
本期基金份额交易产生的变动数	7,577,341.69	-1,479,322.52	6,098,019.17
其中：基金申购款	-61,052.85	15,054.08	-45,998.77
基金赎回款	7,638,394.54	-1,494,376.60	6,144,017.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,217,521.10	-19,551,085.28	-38,768,606.38

大摩优享六个月持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,755,656.83	376,684.30	-2,378,972.53
本期期初	-2,755,656.83	376,684.30	-2,378,972.53
本期利润	709,355.27	-1,555,979.13	-846,623.86
本期基金份额交易产生的变动数	478,851.56	-90,429.96	388,421.60
其中：基金申购款	-92,384.53	20,795.76	-71,588.77
基金赎回款	571,236.09	-111,225.72	460,010.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,567,450.00	-1,269,724.79	-2,837,174.79

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,232.53
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,072.71
其他	88.45
合计	18,393.69

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1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	10,207,555.81
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	10,207,555.81

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1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	488,425,869.30
减：卖出股票成本总额	477,349,909.95
减：交易费用	868,403.54
买卖股票差价收入	10,207,555.81

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	88,468.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,015.00
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	87,453.33

6.4.7.15.2 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1月1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	16,516,913.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,301,956.00
减：应计利息总额	215,972.05
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,015.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,416,060.64
其中：证券出借权益补偿收入	—

基金投资产生的股利收益	-
合计	4,416,060.64

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-25,777,997.40
股票投资	-25,775,360.40
债券投资	-2,637.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-25,777,997.40

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	972.15
基金转换费收入	66.89
合计	1,039.04

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,951.29
证券组合费	4,718.59
合计	96,450.33

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

截至财务报表批准报出日，本基金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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,674,034.12	2,120,006.13
其中：应支付销售机构的客户维护费	820,302.21	1,047,507.01
应支付基金管理人的净管理费	853,731.91	1,072,499.12

注：支付基金管理人摩根士丹利基金管理（中国）有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值

1.20%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×1.20%/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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	279,005.66	353,334.35

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/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方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大摩优享六个月持有 期混合 A	大摩优享六个月持有 期混合 C	合计
摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	—	915.46	915.46
中国农业银行股份有限公司	—	18,088.15	18,088.15
合计	—	19,003.61	19,003.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大摩优享六个月持有 期混合 A	大摩优享六个月持有 期混合 C	合计
摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	—	1,427.27	1,427.27
中国农业银行股份有限公司	—	22,543.96	22,543.96
合计	—	23,971.23	23,971.23

注：支付 C 类基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%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：日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.40%/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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

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**

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	大摩优享六个月持有期混合 A	大摩优享六个月持有期混合 C
基金合同生效日(2021 年 7 月 23 日)持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	3,928,847.11	643,564.56
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减: 报告期间赎回/卖出总份额	—	440,747.67
报告期末持有的基金份额	3,928,847.11	202,816.89
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.57%	1.22%
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	大摩优享六个月持有期混合 A	大摩优享六个月持有期混合 C
基金合同生效日(2021 年 7 月 23 日)持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	1,012,153.49
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—

减：报告期间赎回/卖出总份额	-	368,588.93
报告期末持有的基金份额	-	643,564.56
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.54%

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

注：本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	7,497,229.26	16,232.53	7,673,607.71	24,302.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配事项。

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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括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市场风险、流动性风险及信用风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下通过基金主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类金融工具，力争使投资者获得长期稳定的投资回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，其下设的风险控制和审计委员会负责制定风险管理政策，检查公司和基金运作的合法合规情况；公司经营层对内部控制制度的有效执行承担责任，其下设的风险管理委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；督察长监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况；监察稽核部、风险管理部分工负责风险监督与控制，前者负责合规风险管理，后者主要负责操作风险和基金投资的信用风险、市场风险以及流动性风险的监督管理；基金经理、投资总监以及投资决策委员会负责对基金投资业务风险进行直接管理。

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。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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，因而与银行存款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，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计

及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	13,486,857.70	16,464,571.95
合计	13,486,857.70	16,464,571.95

注：本基金持有的未评级的债券为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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于开放期内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。

6.4.13.3.1 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%。于开放期内，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%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

于开放期内，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。于本期末，本基金最近工作日确认的净赎回金额未超过组合资产中 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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券等固定收益类资产等。
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	7,497,229.26	-	-	-	7,497,229.26
结算备付金	491,083.22	-	-	-	491,083.22
存出保证金	35,415.31	-	-	-	35,415.31
交易性金融资产	13,486,857.70	-	-	-205,230,792.16	218,717,649.86
应收股利	-	-	-	657,082.75	657,082.75
应收申购款	-	-	-	4,964.63	4,964.63
资产总计	21,510,585.49	-	-	-205,892,839.54	227,403,425.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,225,023.90	1,225,023.90
应付管理人报酬	-	-	-	243,272.33	243,272.33
应付托管费	-	-	-	40,545.38	40,545.38
应付清算款	-	-	-	21.17	21.17
应付销售服务费	-	-	-	4,869.70	4,869.70
应交税费	-	-	-	438.46	438.46
其他负债	-	-	-	256,437.28	256,437.28
负债总计	-	-	-	1,770,608.22	1,770,608.22
利率敏感度缺口	21,510,585.49	-	-	-204,122,231.32	225,632,816.81
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,011,566.03	-	-	-	3,011,566.03
结算备付金	284,313.73	-	-	-	284,313.73
存出保证金	55,589.52	-	-	-	55,589.52
交易性金融资产	16,464,571.95	-	-	-296,345,327.89	312,809,899.84
应收股利	-	-	-	468,794.88	468,794.88
应收申购款	-	-	-	6,796.89	6,796.89
资产总计	19,816,041.23	-	-	-296,820,919.66	316,636,960.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	475,436.98	475,436.98
应付管理人报酬	-	-	-	330,461.36	330,461.36
应付托管费	-	-	-	55,076.90	55,076.90
应付清算款	-	-	-	60.75	60.75

应付销售服务费	-	-	-	6,390.10	6,390.10
其他负债	-	-	-	348,482.45	348,482.45
负债总计	-	-	-	1,215,908.54	1,215,908.54
利率敏感度缺口	19,816,041.23	-	-	-295,605,011.12	315,421,052.35

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

注：于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金净资产的比例为 5.98%（2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 5.22%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日，同）。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	94,836,275.36	-	94,836,275.36
应收股利	-	657,082.75	-	657,082.75
资产合计	-	95,493,358.11	-	95,493,358.11
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	95,493,358.11	-	95,493,358.11
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	138,824,009.02	-	138,824,009.02
资产合计	-	138,824,009.02	-	138,824,009.02
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	138,824,009.02	-	138,824,009.02

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
	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）	上年度末（2025年12月31日）
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	4,774,667.91	6,941,200.45
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-4,774,667.91	-6,941,200.45

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，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要

求进行资产配置。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		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	205,230,792.16	90.96	296,345,327.89	93.95
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	205,230,792.16	90.96	296,345,327.89	93.95

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（附注 6.4.1）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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	3,480,000.00	8,200,000.00
	业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-3,480,000.00	-8,200,000.00

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	205,230,792.16	296,345,327.89
第二层次	13,486,857.70	16,464,571.95
第三层次	—	—
合计	218,717,649.86	312,809,899.84

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工具（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	205,230,792.16	90.25
	其中：股票	205,230,792.16	90.25
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	13,486,857.70	5.93
	其中：债券	13,486,857.70	5.93
	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	7,988,312.48	3.51
8	其他各项资产	697,462.69	0.31
9	合计	227,403,425.03	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 94,836,275.36 元，占基金资产净值比例为 42.03%。

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

金额单位：人民币元

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	7,884,322.80	3.49
C	制造业	29,152,884.00	12.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,366,949.00	4.59
E	建筑业	3,547,457.00	1.57
F	批发和零售业	1,637,094.00	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	13,236,157.00	5.87
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,491,129.00	1.55
J	金融业	31,972,777.00	14.17
K	房地产业	1,887,311.00	0.84
L	租赁和商务服务业	1,954,876.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,804,794.00	0.80
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	3,458,766.00	1.53
S	综合	—	—
	合计	110,394,516.80	48.93

7.2.2 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	831,280.52	0.37
消费者常用品	3,625,340.73	1.61
能源	12,611,380.74	5.59
金融	39,043,902.12	17.30
医疗保健	—	—
工业	5,854,443.91	2.59
信息技术	—	—
电信服务	6,985,461.03	3.10
公用事业	16,194,688.00	7.18
房地产	9,689,778.31	4.29
合计	94,836,275.36	42.03

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

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

金额单位：人民币元

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	00941	中国移动	75,000	4,960,506.19	2.20
1	600941	中国移动	30,300	2,609,739.00	1.16
2	00005	汇丰控股	50,800	6,525,694.09	2.89
3	01398	工商银行	767,000	4,283,523.58	1.90
3	601398	工商银行	287,200	2,030,504.00	0.90
4	00270	粤海投资	872,000	5,877,234.66	2.60
5	00998	中信银行	557,000	3,217,152.63	1.43
5	601998	中信银行	256,800	1,779,624.00	0.79
6	03328	交通银行	515,000	3,014,823.91	1.34
6	601328	交通银行	299,600	1,926,428.00	0.85
7	01088	中国神华	123,000	4,286,085.80	1.90
7	601088	中国神华	14,800	577,792.00	0.26
8	03988	中国银行	1,071,000	4,641,783.08	2.06
9	00939	建设银行	646,000	4,527,942.23	2.01
10	01658	邮储银行	573,000	2,274,393.72	1.01
10	601658	邮储银行	396,800	1,956,224.00	0.87
11	00012	恒基地产	180,000	3,877,207.20	1.72
12	601009	南京银行	389,300	3,850,177.00	1.71
13	02388	中银香港	100,000	3,680,914.90	1.63
14	600919	江苏银行	339,900	3,664,122.00	1.62

15	00288	万洲国际	503,500	3,625,340.73	1.61
16	00883	中国海洋石油	200,000	3,529,787.20	1.56
17	000651	格力电器	88,700	3,326,250.00	1.47
18	03968	招商银行	52,000	2,028,793.83	0.90
18	600036	招商银行	33,200	1,178,600.00	0.52
19	01038	长江基建集团	61,000	3,162,998.54	1.40
20	00016	新鸿基地产	31,500	3,072,452.20	1.36
21	601000	唐山港	729,700	3,028,255.00	1.34
22	002142	宁波银行	99,500	2,954,155.00	1.31
23	01988	民生银行	1,066,500	2,908,608.93	1.29
24	00857	中国石油股份	386,000	2,843,007.34	1.26
25	00267	中信股份	300,000	2,764,594.65	1.23
26	00002	中电控股	42,500	2,702,059.05	1.20
27	600018	上港集团	569,500	2,688,040.00	1.19
28	600256	广汇能源	498,200	2,461,108.00	1.09
29	300628	亿联网络	70,200	2,374,164.00	1.05
30	000429	粤高速 A	168,800	2,304,120.00	1.02
31	00836	华润电力	154,000	2,263,163.36	1.00
32	600285	羚锐制药	114,800	2,224,824.00	0.99
33	00135	昆仑能源	392,000	2,189,232.39	0.97
34	600886	国投电力	163,400	2,174,854.00	0.96
35	600566	济川药业	96,700	2,145,773.00	0.95
36	00066	港铁公司	80,500	2,132,507.39	0.95
37	000001	平安银行	211,300	2,123,565.00	0.94
38	600900	长江电力	77,600	2,054,072.00	0.91
39	00728	中国电信	546,000	2,024,954.84	0.90
40	601985	中国核电	221,000	1,995,630.00	0.88
41	002027	分众传媒	403,900	1,954,876.00	0.87
42	00386	中国石油化工股份	562,000	1,952,500.40	0.87
43	601919	中远海控	147,000	1,949,220.00	0.86
44	02328	中国财险	156,000	1,940,271.22	0.86
45	600064	南京高科	264,700	1,887,311.00	0.84
46	601838	成都银行	106,400	1,883,280.00	0.83
47	01113	长实集团	49,000	1,880,254.41	0.83
48	600535	天士力	141,400	1,870,722.00	0.83
49	600177	雅戈尔	246,300	1,854,639.00	0.82
50	600901	江苏金租	314,300	1,807,225.00	0.80
51	000937	冀中能源	444,510	1,769,149.80	0.78
52	002839	张家港行	450,600	1,757,340.00	0.78
53	000729	燕京啤酒	171,600	1,738,308.00	0.77
54	600461	洪城环境	187,800	1,701,468.00	0.75
55	000895	双汇发展	75,000	1,680,000.00	0.74
56	600008	首创环保	601,000	1,634,720.00	0.72

57	600502	安徽建工	370,400	1,611,240.00	0.71
58	002966	苏州银行	229,400	1,596,624.00	0.71
59	601006	大秦铁路	342,800	1,580,308.00	0.70
60	000333	美的集团	18,700	1,412,411.00	0.63
61	601928	凤凰传媒	154,800	1,360,692.00	0.60
62	601098	中南传媒	126,100	1,240,824.00	0.55
63	600660	福耀玻璃	24,000	1,210,560.00	0.54
64	600132	重庆啤酒	29,100	1,201,830.00	0.53
65	603565	中谷物流	111,000	1,088,910.00	0.48
66	600519	贵州茅台	900	1,066,941.00	0.47
67	600729	重百集团	56,600	1,062,948.00	0.47
68	301109	军信股份	85,100	1,060,346.00	0.47
69	600031	三一重工	60,200	1,040,256.00	0.46
70	002032	苏泊尔	26,100	1,033,560.00	0.46
71	600329	达仁堂	27,600	1,027,272.00	0.46
72	601077	渝农商行	166,500	1,017,315.00	0.45
73	601916	浙商银行	375,400	987,302.00	0.44
74	600066	宇通客车	36,500	978,565.00	0.43
75	601886	江河集团	121,300	974,039.00	0.43
76	601668	中国建筑	221,700	962,178.00	0.43
77	00390	中国中铁	333,000	957,341.87	0.42
78	603195	公牛集团	24,200	947,430.00	0.42
79	002327	富安娜	156,700	930,798.00	0.41
80	603699	纽威股份	18,000	905,400.00	0.40
81	601168	西部矿业	32,700	887,478.00	0.39
82	600845	宝信软件	53,000	881,390.00	0.39
83	01109	华润置地	33,000	859,864.50	0.38
84	000719	中原传媒	75,000	857,250.00	0.38
85	00667	中国东方教育	261,500	831,280.52	0.37
86	600546	山煤国际	75,600	826,308.00	0.37
87	000543	皖能电力	106,500	806,205.00	0.36
88	601818	光大银行	272,400	787,236.00	0.35
89	601225	陕西煤业	37,300	759,055.00	0.34
90	601827	三峰环境	102,400	744,448.00	0.33
91	601997	贵阳银行	131,200	673,056.00	0.30
92	002128	电投能源	26,100	603,432.00	0.27
93	600012	皖通高速	37,900	597,304.00	0.26
94	603233	大参林	38,200	574,146.00	0.25
95	600750	华润江中	8,300	183,181.00	0.08

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	601658	邮储银行	4,143,337.00	1.31
1	01658	邮储银行	3,959,734.71	1.26
2	00883	中国海洋石油	6,594,443.67	2.09
2	600938	中国海油	1,305,479.00	0.41
3	000651	格力电器	7,405,548.00	2.35
4	01988	民生银行	3,770,828.64	1.20
4	600016	民生银行	2,663,222.00	0.84
5	601998	中信银行	2,985,906.00	0.95
5	00998	中信银行	2,797,168.59	0.89
6	600028	中国石化	3,606,874.00	1.14
6	00386	中国石油化工股份	2,165,150.92	0.69
7	601000	唐山港	5,717,808.40	1.81
8	600177	雅戈尔	5,400,909.00	1.71
9	601919	中远海控	5,288,336.00	1.68
10	600566	济川药业	5,087,759.00	1.61
11	000538	云南白药	4,880,018.00	1.55
12	600900	长江电力	4,852,278.00	1.54
13	601328	交通银行	4,209,494.00	1.33
13	03328	交通银行	467,684.02	0.15
14	600642	申能股份	4,642,988.00	1.47
15	00005	汇丰控股	4,611,782.74	1.46
16	600941	中国移动	3,338,511.00	1.06
16	00941	中国移动	1,168,909.27	0.37
17	600887	伊利股份	4,473,336.00	1.42
18	02388	中银香港	4,312,191.33	1.37
19	000423	东阿阿胶	4,274,798.00	1.36
20	00267	中信股份	4,074,578.42	1.29

注：“买入金额”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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	01919	中远海控	9,376,308.85	2.97
1	601919	中远海控	3,108,120.00	0.99
2	601229	上海银行	8,908,629.56	2.82
3	600273	嘉化能源	7,682,275.00	2.44
4	00883	中国海洋石油	5,958,193.88	1.89
4	600938	中国海油	1,481,043.00	0.47
5	600741	华域汽车	7,262,945.00	2.30
6	00386	中国石油化工股份	3,645,223.21	1.16

6	600028	中国石化	3,381,340.00	1.07
7	601963	重庆银行	6,890,965.89	2.18
8	600642	申能股份	6,840,361.00	2.17
9	601577	长沙银行	6,520,408.00	2.07
10	600350	山东高速	6,157,852.00	1.95
11	600919	江苏银行	6,076,728.00	1.93
12	00011	恒生银行	5,763,005.40	1.83
13	00101	恒隆地产	5,738,595.55	1.82
14	601009	南京银行	5,718,926.00	1.81
15	601838	成都银行	5,319,068.00	1.69
16	601169	北京银行	5,315,432.00	1.69
17	600548	深高速	5,313,602.00	1.68
18	002807	江阴银行	5,156,169.00	1.63
19	00019	太古股份公司 A	4,965,282.29	1.57
20	600019	宝钢股份	4,840,055.00	1.53

注：“卖出金额”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	412,010,734.62
卖出股票收入（成交）总额	488,425,869.30

注：“买入股票成本”、“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	13,486,857.70	5.98
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	13,486,857.70	5.98

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	019827	26 国债 01	134,000	13,486,857.70	5.98
---	--------	----------	---------	---------------	------

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

注：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

注：根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

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

注：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

根据本基金基金合同的规定，本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。因此股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以获取相应股票组合的超额收益。

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同的规定，本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易；截至报告期末，本基金未持有国债期货合约。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚；中国银行股份有限公司在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；中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局的处罚；南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚；中国神华能源股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到鄂尔多斯市应急管理局、北京铁路督察室的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 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	35,415.31
2	应收清算款	-
3	应收股利	657,082.75
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,964.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	697,462.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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 (%)
大摩优享 六个月持 有期混合 A	5,035	49,785.18	5,133,756.75	2.05	245,534,612.65	97.95
大摩优享 六个月持	1,354	12,237.98	237,566.36	1.43	16,332,662.22	98.57

有期混合 C						
合计	6,389	41,827.92	5,371,323.11	2.01	261,867,274.87	97.99

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	34.54

8.3 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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大摩优享六个月持有期混合 A	0.00	0.0000
	大摩优享六个月持有期混合 C	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

8.4 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	大摩优享六个月持有期混合 A	0
	大摩优享六个月持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大摩优享六个月持有期混合 A	0
	大摩优享六个月持有期混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大摩优享六个月持有期混合 A	大摩优享六个月持有期混合 C
基金合同生效日 （2021 年 7 月 23 日） 基金份额总额	675,656,157.23	52,604,431.93
本报告期期初基金份额总额	329,645,065.65	20,738,419.62
本报告期基金总申购份额	683,617.67	856,550.07
减：本报告期基金总赎回份额	79,660,313.92	5,024,741.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	250,668,369.40	16,570,228.58
--------------	----------------	---------------

§ 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

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

自 2026 年 1 月 1 日起，谭雨杭女士担任本公司首席信息官，ZHOU HAN（周涵）先生不再担任本公司首席信息官。

自 2026 年 6 月 24 日起，彭玥女士担任本公司首席运营官兼财务负责人，ZHOU WENTONG（周文桐）先生不再代履行财务负责人职务。

本报告期内，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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未改变投资策略。

10.5 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改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.7 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

10.7.1 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	247,889,246.67	27.71	110,486.04	27.78	—
长江证券	1	206,094,981.65	23.03	90,685.51	22.80	—
招商证券	1	165,904,285.25	18.54	73,977.88	18.60	—
华福证券	2	124,431,159.20	13.91	55,482.95	13.95	—
国投证券	2	51,796,250.92	5.79	23,097.22	5.81	—
华西证券	1	41,803,245.92	4.67	18,640.34	4.69	—
信达证券	1	29,610,480.56	3.31	13,203.63	3.32	—
中泰证券	1	26,576,869.00	2.97	11,850.86	2.98	—
德邦证券	2	618,668.00	0.07	275.85	0.07	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
东方财富	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
华鑫证券	1	—	—	—	—	—
国泰海通	1	—	—	—	—	—
国联民生	1	—	—	—	—	—
太平洋证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
诚通证券	1	—	—	—	—	—

注：1、专用交易单元的选择标准

(1) 遵守相关法律、法规、规范性文件及交易所的相关规定，履行其作为交易单元所有人的义务和责任，能够保持交易单元的有效性、合法性。

(2) 实力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，经营行为规范。

(4) 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。

(5) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，符合证券交易所的相关指导性意见及交易规则，交易设施符合基金进行证券交易的需要，并能为基金管理人提供全面的信息服务。

(6) 研究服务能力较强，能及时、合规、全面地为基金管理人提供专业、审慎的研究服务。

2、基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作的证券公司。基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

3、本报告期内，本基金租用证券公司交易单元情况未发生变化。

10.7.2 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	
	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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	13,411,763.00	85.36	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	2,300,941.00	14.64	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金增加万和证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-14
2	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于直销银行账户信息更新的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-19
3	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-21
4	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-21
5	摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-23
6	摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-23
7	摩根士丹利优享臻选六个月持有期混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-23
8	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-27
9	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-27
10	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
11	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-21
12	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-21
13	2025 年度摩根士丹利基金管理（中国）有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-30
14	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-30

	销售有限公司合作关系的公告		
15	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-25

§ 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的批复文件；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、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，还可以通过基金管理人网站查阅或下载。

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

2026 年 8 月 28 日