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 年第 3 季度报告

2026 年 9 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

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	253,902,795.39 份
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。	
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	
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	237,564,990.16 份	16,337,805.23 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 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
1.本期已实现收益	-661,855.77	-58,282.12
2.本期利润	20,101,509.17	1,325,603.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0829	0.0799
4.期末基金资产净值	220,165,989.61	14,829,689.02
5.期末基金份额净值	0.9268	0.9077

注：1. 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。

2. 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。

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

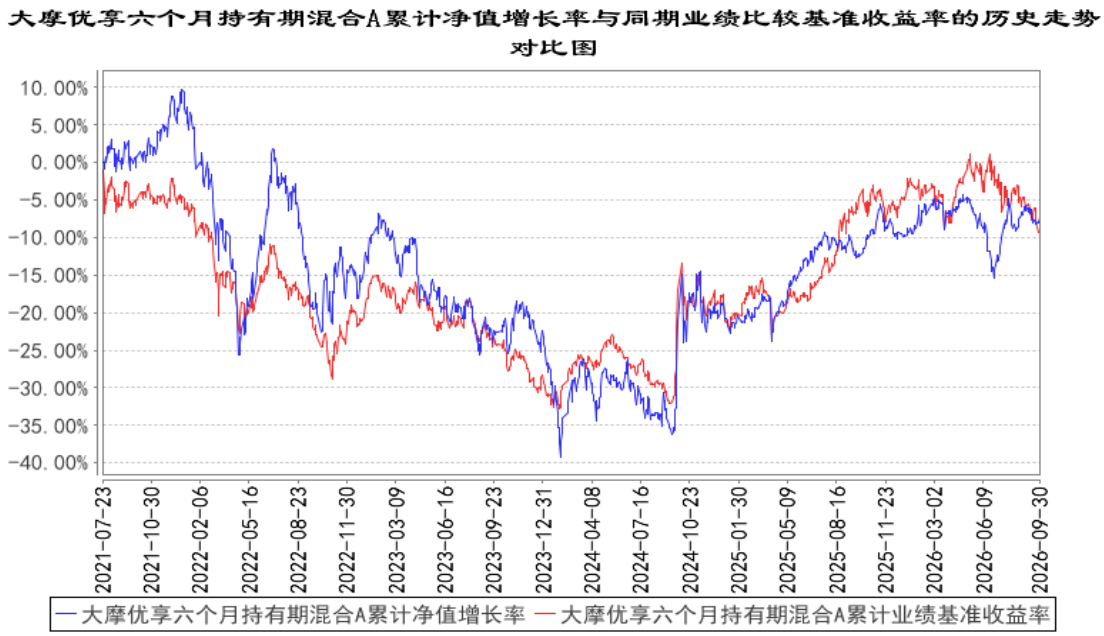
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	9.64%	0.67%	-8.66%	0.99%	18.30%	-0.32%

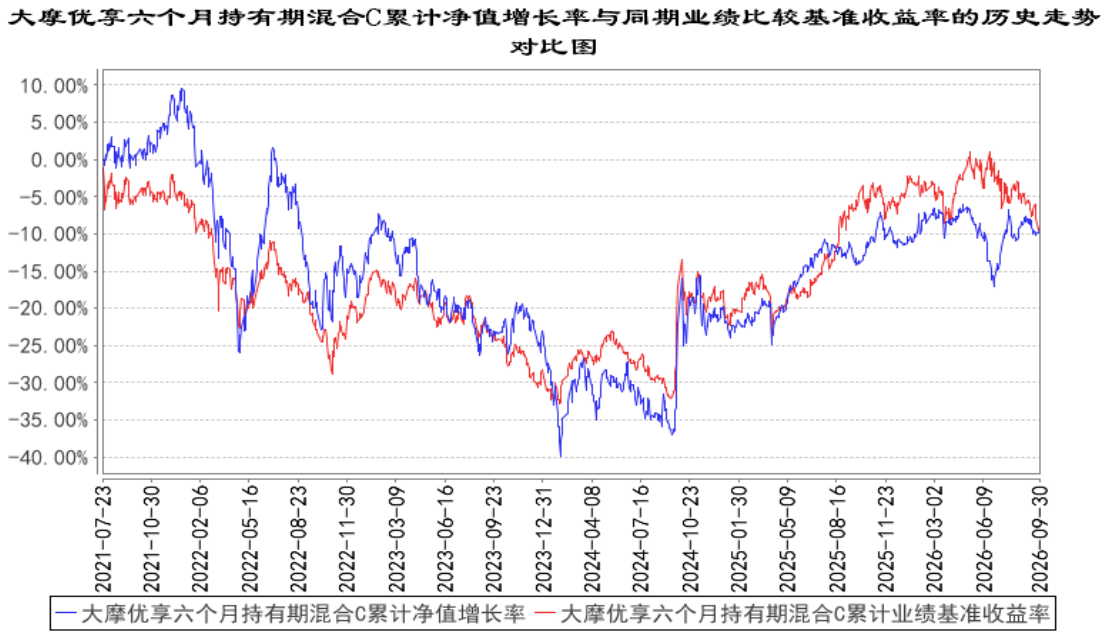
过去六个月	-0.54%	0.67%	-1.24%	1.01%	0.70%	-0.34%
过去一年	5.91%	0.66%	-4.78%	0.92%	10.69%	-0.26%
过去三年	19.80%	1.21%	19.77%	0.95%	0.03%	0.26%
过去五年	-7.78%	1.26%	-4.17%	0.95%	-3.61%	0.31%
自基金合同生效起至今	-7.32%	1.25%	-9.12%	0.95%	1.80%	0.30%

大摩优享六个月持有期混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	9.52%	0.67%	-8.66%	0.99%	18.18%	-0.32%
过去六个月	-0.74%	0.67%	-1.24%	1.01%	0.50%	-0.34%
过去一年	5.47%	0.66%	-4.78%	0.92%	10.25%	-0.26%
过去三年	18.38%	1.21%	19.77%	0.95%	-1.39%	0.26%
过去五年	-9.61%	1.26%	-4.17%	0.95%	-5.44%	0.31%
自基金合同生效起至今	-9.23%	1.25%	-9.12%	0.95%	-0.11%	0.30%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余斌	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。
缪东航	数量化投资部总监、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。

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”为公司公告

的解聘日期；非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别为公司公告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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2026 年三季度，A 股整体呈现深幅调整与剧烈分化的格局。大盘主要指数普遍走低，上证综指下跌 6.16%，深证成指下跌 20.47%，创业板指跌幅居前，达 27.80%。行业表现呈现出极强的高低切换与防御属性特征，此前高景气度的电子、通信和电力设备等科技成长板块大幅回调；而具备防御属性与避险价值的农林牧渔、银行、医药和房地产板块则逆势上涨。

尽管海外 Anthropic、OpenAI 等 AI 巨头的 ARR 维持高速增长，但在前期超高预期被充分定价后，市场对硬件端资本开支的持续性与回报率产生了分歧。特别是随着海外贸易政策风险升温，前期估值处在高位的电子、通信及电气设备板块遭遇资金获利了结与出清。与此同时，智谱

等国产大模型在编程等应用端持续取得突破，国内基础设施建设与半导体国产化进程依然在稳步推进，但短期板块估值出现了明显挤水分的过程。

出口链与海外业务敞口板块遭遇了较大幅度的回吐。三季度全球宏观外需边际放缓，欧美针对中国高科技及高端制造产品的贸易壁垒和关税审议增多，加之人民币相对于美元汇率持续升值，使得机械设备等传统出口高增长板块的盈利预期受到压制。不过，中国企业在成本控制、技术创新与海外本地化产能布局上的核心优势并未改变，“货物出海”向“技术与服务出海”的长期演进趋势依然明确。

面对大盘指数的持续下行以及科技板块的估值回调，市场资金表现出避险情绪，显著偏向防御型与高股息资产。资金从前期高溢价的成长赛道大幅流出，转而涌入估值处于历史低位、现金流稳定或具备政策托底预期的银行、农林牧渔及房地产板块。目前国内资金利率维持低位，在宏观经济与企业盈利尚待全面修复的阶段，低估值、高分红的避险资产依然是支撑市场流动性与风险偏好的核心力量；随着海外降息周期的开启，部分全球资金也在重新评估 A 股低位资产的长期配置价值。

2026 年三季度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，实现基金相对于指数的稳定超额收益。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。在个股风格方面，本基金将关注具备低波红利特征的个股，我们不仅看重公司当下的股息率，更加关注公司未来的利润增长潜力和自由现金流的创造能力，同时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。

（文章所提品牌仅作举例使用，不代表对具体公司及个股推荐）

4.5 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 0.9268 元，份额累计净值为 0.9268 元，基金份额净值增长率为 9.64%，同期业绩比较基准收益率为-8.66%；C 类份额净值为 0.9077 元，份额累计净值为 0.9077 元，C 类基金份额净值增长率为 9.52%，同期业绩比较基准收益率为-8.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	217,245,244.69	92.04
	其中：股票	217,245,244.69	92.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,296,958.25	4.79
	其中：债券	11,296,958.25	4.79
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,620,100.83	2.80
8	其他资产	871,653.30	0.37
9	合计	236,033,957.07	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 105,017,014.69 元，占基金资产净值比例为 44.69%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,622,190.00	1.97
C	制造业	36,525,225.00	15.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,051,531.00	2.58

E	建筑业	3,035,648.00	1.29
F	批发和零售业	2,091,804.00	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	12,450,536.00	5.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,332,768.00	1.84
J	金融业	35,159,870.00	14.96
K	房地产业	2,511,016.00	1.07
L	租赁和商务服务业	1,433,190.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,014,452.00	1.71
S	综合	-	-
	合计	112,228,230.00	47.76

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	5,595,242.94	2.38
能源	13,901,983.13	5.92
金融	44,974,529.49	19.14
医疗保健	-	-
工业	8,008,161.55	3.41
信息技术	-	-
电信服务	10,798,447.17	4.60
公用事业	12,483,165.97	5.31
房地产	9,255,484.44	3.94
合计	105,017,014.69	44.69

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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00005	汇丰控股	46,400	6,293,248.70	2.68
2	03328	交通银行	573,000	4,112,072.16	1.75
2	601328	交通银行	270,500	2,096,375.00	0.89
3	00941	中国移动	77,000	5,251,513.11	2.23

3	600941	中国移动	8,700	833,460.00	0.35
4	01988	民生银行	1,291,000	3,839,983.06	1.63
4	600016	民生银行	588,900	2,067,039.00	0.88
5	00939	建设银行	675,000	5,690,036.97	2.42
6	03988	中国银行	1,038,000	5,421,978.16	2.31
7	01398	工商银行	794,000	5,255,024.05	2.24
8	00728	中国电信	660,000	2,546,674.61	1.08
8	601728	中国电信	399,600	2,509,488.00	1.07
9	00012	恒基地产	197,000	4,521,967.71	1.92
10	00998	中信银行	589,000	4,338,128.48	1.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,296,958.25	4.81
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	11,296,958.25	4.81

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	112,000	11,296,958.25	4.81

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期内，本基金未参与股指期货交易；截至报告期末，本基金未持有股指期货合约。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,716.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	845,639.79
4	应收利息	-
5	应收申购款	297.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	871,653.30

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	250,668,369.40	16,570,228.58
报告期期间基金总申购份额	471,697.42	714,134.83
减:报告期期间基金总赎回份额	13,575,076.66	946,558.18
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	237,564,990.16	16,337,805.23

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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
报告期期初管理人持有的本基金份额	3,928,847.11	202,816.89
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,928,847.11	202,816.89

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.65	1.24

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，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 10 月 26 日