

**摩根安隆回报混合型证券投资基金**  
**2024 年第 2 季度报告**  
**2024 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：杭州银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

## §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。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 18 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 摩根安隆回报混合  |
| 基金主代码      | 004738  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2018 年 2 月 8 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 269,540,901.28 份  |
| 投资目标       | 以追求稳健收益作为基金的投资目标，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、国家政策、资金面、市场估值水平和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行综合分析，评估股票、债券等各类资产风险收益特征，预测不同类别资产表现，确定合适的资产配置比例。同时采用严格的仓位控制策略，根据基金单位净值的变化和对未来市场的判断，灵活控制股票仓位，控制下行风险。</p> |

|               |  |
|---------------|--|
|               | <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金根据对财政政策、货币政策的分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略、中小企业私募债策略、证券公司短期债等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金将采用自下而上的分析方法，根据上市公司财务分析、盈利预期、治理结构等因素，结合股票的价值评估，以及对公司经营有实质性影响的事件，精选个股，构建投资组合。</p> <p>4、其他投资策略：包括股指期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率×80%</p>  |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于中等风险收益水平的基金产品。</p> <p>根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。</p>  |
| <p>基金管理人</p>  | <p>摩根基金管理（中国）有限公司</p>  |
| <p>基金托管人</p>  | <p>杭州银行股份有限公司</p>  |

|                     |                  |                  |
|---------------------|------------------|------------------|
| 下属分级基金的基金简称         | 摩根安隆回报混合 A       | 摩根安隆回报混合 C       |
| 下属分级基金的交易代码         | 004738           | 004739           |
| 报告期末下属分级基金的份<br>额总额 | 150,606,137.10 份 | 118,934,764.18 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<br>(2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |                |
|----------------|---|----------------|
|                | 摩根安隆回报混合 A                              | 摩根安隆回报混合 C     |
| 1.本期已实现收益      | 1,359,676.67                            | 897,998.99     |
| 2.本期利润         | 1,951,306.08                            | 1,450,390.12   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0123                                  | 0.0114         |
| 4.期末基金资产净值     | 199,233,763.47                          | 154,219,863.66 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.3229                                  | 1.2967         |

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

###### 1、摩根安隆回报混合 A：

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.92%      | 0.18%         | 0.97%          | 0.14%                 | -0.05% | 0.04% |
| 过去六个月 | 1.29%      | 0.34%         | 3.28%          | 0.17%                 | -1.99% | 0.17% |
| 过去一年  | -0.81%     | 0.29%         | 2.80%          | 0.17%                 | -3.61% | 0.12% |
| 过去三年  | 2.11%      | 0.27%         | 5.91%          | 0.21%                 | -3.80% | 0.06% |

|            |        |       |        |       |       |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去五年       | 25.81% | 0.25% | 18.15% | 0.22% | 7.66% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.29% | 0.25% | 26.84% | 0.24% | 5.45% | 0.01% |

**2、摩根安隆回报混合 C:**

| 阶段         | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.84%      | 0.18%         | 0.97%          | 0.14%                 | -0.13% | 0.04% |
| 过去六个月      | 1.15%      | 0.34%         | 3.28%          | 0.17%                 | -2.13% | 0.17% |
| 过去一年       | -1.11%     | 0.29%         | 2.80%          | 0.17%                 | -3.91% | 0.12% |
| 过去三年       | 1.19%      | 0.27%         | 5.91%          | 0.21%                 | -4.72% | 0.06% |
| 过去五年       | 23.96%     | 0.25%         | 18.15%         | 0.22%                 | 5.81%  | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.67%     | 0.25%         | 26.84%         | 0.24%                 | 2.83%  | 0.01% |

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

摩根安隆回报混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2018 年 2 月 8 日至 2024 年 6 月 30 日)

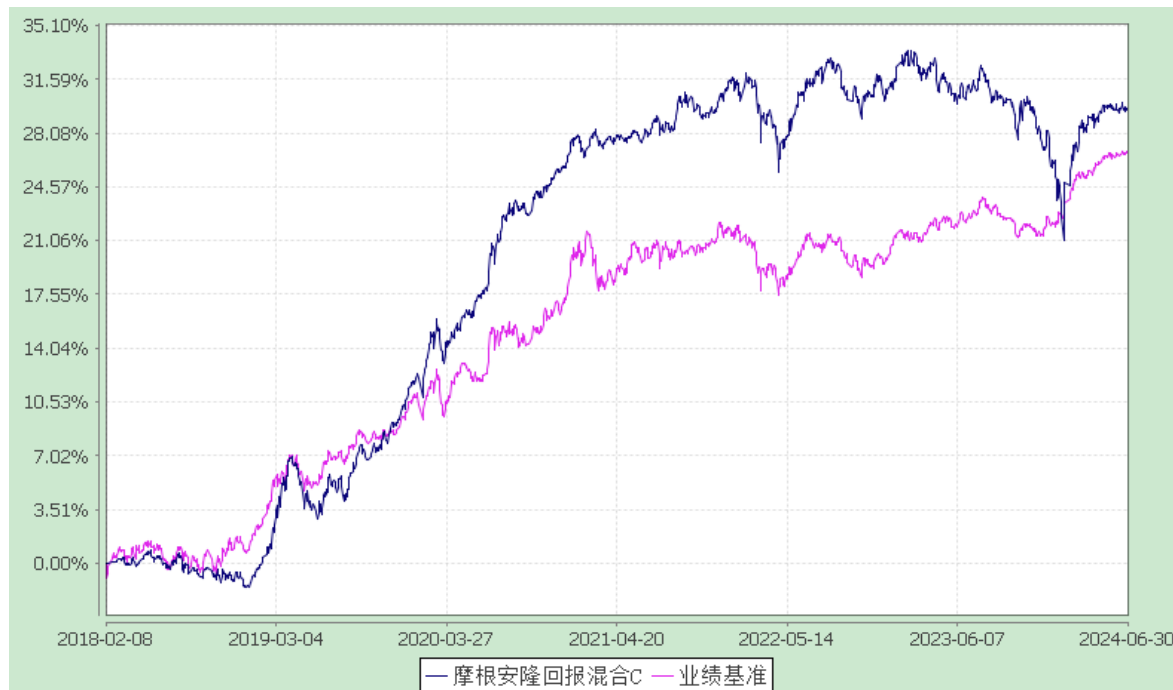
**1. 摩根安隆回报混合 A:**



注：本基金合同生效日为 2018 年 2 月 8 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

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

## 2. 摩根安隆回报混合 C:



注：本基金合同生效日为 2018 年 2 月 8 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|-------------------|-------------|------|--------|---|
|     |                   | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 陈圆明 | 本基金基金经理、绝对收益投资部总监 | 2019-04-12  | -    | 15 年   | 陈圆明先生曾任东海证券有限责任公司研究员，国联安基金管理有限公司研究员，国投瑞银基金管理有限公司研究员、投资经理，鹏华基金管理有限公司投资经理、绝对收益副总监。2019 年 2 月起加入摩根基金管理(中国)有限公司(原 |

|    |         |            |   |      |   |
|----|---------|------------|---|------|---|
|    |         |            |   |      | 上投摩根基金管理有限公司), 现担任绝对收益投资部总监兼资深基金经理。   |
| 王娟 | 本基金基金经理 | 2022-11-25 | - | 11 年 | 王娟女士曾任海通期货有限公司研究所金融期货部经理, 中国农业银行金融市场部投资经理, 尚腾资本管理有限公司投资经理; 自 2020 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), 历任绝对收益投资部基金经理助理, 现任基金经理。                                |
| 杨鹏 | 本基金基金经理 | 2023-09-15 | - | 13 年 | 杨鹏先生曾就职于华泰柏瑞基金管理有限公司和华金证券, 曾任建信人寿保险股份有限公司 FOF 投资经理, 鹏华基金管理有限公司绝对收益投资部投资经理, 太平养老保险股份有限公司年金和养老金投资经理。自 2023 年 5 月加入摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司), 现任绝对收益投资部高级基金经理。 |

注: 1. 任职日期和离任日期均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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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, 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、基金合同的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制, 基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形:无。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度经济延续修复形态,但环比动能较一季度有所放缓。工业稳增长政策对生产扩张有积极支撑。从需求看,由于前期释放集中,内需增速有所回调。投资整体受累于房地产,制造业在设备更新政策支持下表现亮眼;专项债发行进度慢导致资金到位不足,因而基建实物工作量恢复低于预期。消费节奏上节假日效应明显,但社零环比增速持续低于疫情前的平均水平,服务消费好于商品消费。外需上欧美进入补库周期对出口形成持续支撑。从供给看,当前工业企业整体的盈利基础仍需巩固,补库呈现平坦化,工业生产的持续性仍待需求发力支撑。海外方面,美国相对欧日基本面强韧,美元指数震荡偏强,国内汇率有波动加大的可能。

政策方面,二季度宏观政策继续围绕稳经济和化风险展开,重点在于拉动消费与投资,同时加速对房地产市场的调整。4 月政策集中在大规模设备更新和消费品以旧换新,以促进经济结构调整和消费升级。5 月政策侧重于财政和房地产领域,地产需求侧限制解除基本打满预期,设立 3000 亿元保障性住房再贷款,提振居民购房信心。6 月高层会议密集,三中全会的方向逐渐明朗,指向财税体制、土地要素改革等提升社会效率的方面。财政方面,地方财政支出和基建投资增速偏低,受限于卖地收入和税收收入不及预期。货币政策上,央行侧重于平衡银行净息差、汇率稳定和防资金空转。

在这样的情况下,我们认为,宏观调控存在一定的滞后效应,经济复苏依然不稳定。部分政



策效应尚未完全显现，需要更多时间发挥效用。宏观调控可能在 7 月三中全会后进一步加强。同时，在美联储进入降息通道后，汇率压力和利率预计下调。

展望三季度，经济形势的不确定性主要在四个方面：第一，地方财政和基建投资方面，地方专项债和超长期特别国债发行进度加快，能否顺利形成实物工作量，以及土地财政下行等导致的地方财政紧平衡能否推动相应投资回升；第二，外需贸易摩擦和地缘政治风险显现，是否会对出口造成不利影响；第三，市场主体和预期方面，下阶段宏观政策和改革措施加码，能否有效提振居民和企业信心；第四，房地产方面，稳地产政策持续发力和较长时间的调整后，房地产市场能否企稳回升以及企稳的程度。后续市场操作将主要跟踪这四个主要矛盾的进度。

A 股市场从趋势性机会来看，利润弹性的修复有待相关指标的出现，包括企业居民存款增速差回升、M1（狭义货币供应量）同比回升、PMI（采购经理人指数）回升、通胀中内需影响部分减缓拖累等。往后看，市场具备结构性机会，需寻找高性价比的资产进行布局。具体策略上，紧密跟踪宏观经济的预期差，寻找价值触底的优秀公司。当前周期认识和价值发现的思维策略仍有效，继续持有必选消费板块，在市场估值水平极低的情况下，具有稳健商业模式的必选消费型公司仍是当下估值性价比较好标的，同时也兼具一定的股息率和防御力。关注部分低风险的红利高股息品种，如环保及公用事业相关公司；以及中美制造业共振下库存周期回升出口链条受益的个股；此外，关注供给驱动下需求扩张的板块。对于债券市场，在央行二级市场买卖国债工具出台后，债市波动可能加大，曲线存在变陡的概率，对债券市场操作略偏谨慎。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根安隆回报 A 份额净值增长率为:0.92%，同期业绩比较基准收益率为:0.97%

摩根安隆回报 C 份额净值增长率为:0.84%，同期业绩比较基准收益率为:0.97%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|----|-------|--------------|
|    |    |       |              |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资              | 49,942,801.44  | 14.04  |
|   | 其中：股票             | 49,942,801.44  | 14.04  |
| 2 | 固定收益投资            | 286,691,078.06 | 80.58  |
|   | 其中：债券             | 286,691,078.06 | 80.58  |
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 3 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | 14,653,000.00  | 4.12   |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 2,521,907.23   | 0.71   |
| 7 | 其他各项资产            | 1,961,092.17   | 0.55   |
| 8 | 合计                | 355,769,878.90 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 34,446,259.90 | 9.75         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,437,586.12 | 2.95         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 694,266.14    | 0.20         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,364,689.28  | 1.23  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 49,942,801.44 | 14.13 |

### 5.3 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  | 002557 | 洽洽食品 | 295,777.00   | 8,337,953.63 | 2.36         |
| 2  | 002475 | 立讯精密 | 180,830.00   | 7,108,427.30 | 2.01         |
| 3  | 600008 | 首创环保 | 2,331,942.00 | 6,249,604.56 | 1.77         |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 146,666.00   | 3,789,849.44 | 1.07         |
| 5  | 603661 | 恒林股份 | 88,729.00    | 3,745,251.09 | 1.06         |
| 6  | 600021 | 上海电力 | 356,964.00   | 3,530,373.96 | 1.00         |
| 7  | 000625 | 长安汽车 | 207,815.00   | 2,790,955.45 | 0.79         |
| 8  | 300750 | 宁德时代 | 11,239.00    | 2,023,357.17 | 0.57         |
| 9  | 601677 | 明泰铝业 | 158,009.00   | 1,826,584.04 | 0.52         |
| 10 | 600323 | 瀚蓝环境 | 75,606.00    | 1,580,165.40 | 0.45         |

### 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 35,374,273.81  | 10.01        |
|    | 其中：政策性金融债 | 35,374,273.81  | 10.01        |
| 4  | 企业债券      | 101,794,338.46 | 28.80        |
| 5  | 企业短期融资券   | 61,632,861.39  | 17.44        |
| 6  | 中期票据      | 36,553,787.56  | 10.34        |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -     |
| 8  | 同业存单      | 51,335,816.84  | 14.52 |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 286,691,078.06 | 81.11 |

### 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  | 155525    | 19 中证 G2      | 200,000 | 20,557,153.97 | 5.82         |
| 2  | 138816    | 23 华泰 G1      | 200,000 | 20,312,160.00 | 5.75         |
| 3  | 102280756 | 22 国电 MTN001  | 190,000 | 19,269,366.90 | 5.45         |
| 4  | 042480159 | 24 南电 CP001   | 180,000 | 18,108,287.01 | 5.12         |
| 5  | 112405097 | 24 建设银行 CD097 | 170,000 | 16,739,765.68 | 4.74         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，华泰证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行江苏省分行的处罚。中信证券股份有限公司本期被中国证监会立案调查，在报告编制日

前一年内曾受到中国证监会的处罚。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国家金融监督管理总局的处罚。深圳市地铁集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局、深圳市福田区水务局、深圳市市场监管局南山监管局、深圳市光明区凤凰街道办事处、深圳市南山区招商街道办事处的处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

除上述主体外，本基金投资的其余前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 224,464.24   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,724,143.25 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 12,484.68    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,961,092.17 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 摩根安隆回报混合A      | 摩根安隆回报混合C      |
|----------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 165,428,524.58 | 137,048,834.43 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 298,796.95     | 2,313,891.81   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 15,121,184.43  | 20,427,962.06  |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额   | 150,606,137.10 | 118,934,764.18 |

## §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                       | 摩根安隆回报混合A | 摩根安隆回报混合C |
|--------------------------|-----------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 90,402.20 | -         |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -         | -         |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | 29,832.73 | -         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 60,569.47 | -         |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.02      | -         |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份）   | 交易金额（元）    | 适用费率 |
|----|------|------------|-----------|------------|------|
| 1  | 赎回   | 2024-04-23 | 29,832.73 | -39,265.84 | -    |
| 合计 |      |            | 29,832.73 | -39,265.84 |      |

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

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2.《摩根安隆回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《摩根安隆回报混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《摩根基金管理（中国）有限公司开放式基金业务规则》；
- 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和营业执照。

## 8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

## 8.3 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

二〇二四年七月十九日