

# 摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 29 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，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41

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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
7.12 投资组合报告附注 .....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
11.1 备查文件目录 .....	48
11.2 存放地点 .....	48
11.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金	
基金简称	大摩健康产业混合	
基金主代码	002708	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 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	
报告期末基金份额总额	1,137,123,547.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大摩健康产业混合 A	大摩健康产业混合 C
下属分级基金的交易代码	002708	014030
报告期末下属分级基金的份额总额	972,090,575.68 份	165,032,971.58 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取主动管理的投资策略，在控制风险的基础上，优选健康产业股票，力争获取超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将结合对包括宏观经济形势、政策走势、证券市场环境等在内的因素的分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置策略，合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例，最大限度地降低投资组合的风险，提高收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>股票组合的构建主要通过对健康产业子行业的灵活配置及子行业内个股的精选，实现基金资产的保值增值。</p> <p>3、衍生品投资策略</p> <p>本基金的衍生品投资将严格遵守相关法律法规的规定，合理利用股指期货、权证等衍生工具，充分考虑衍生品的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，追求稳定的当期收益或降低投资组合的整体风险。</p>

	<p>(1) 权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。</p> <p>(2) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。</p> <p>(3) 资产支持证券投资策略</p> <p>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方面研究，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。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本投资组合对于债券的投资主要为久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略等，并择机把握市场有效性不足情况下的交易机会。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其长期平均风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 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	任航
	联系电话	(0755)88318883	010-66060069
	电子邮箱	im-disclosure@morganstanley.com.cn	tgxxpl@abchina.com
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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.morganstanleyfunds.com.cn">https://www.morganstanleyfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	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

### § 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	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	大摩健康产业混合 A	大摩健康产业混合 C
本期已实现收益	-285,566,924.70	-54,114,615.13
本期利润	-385,020,028.79	-75,445,867.45
加权平均基金份额本期利润	-0.3836	-0.4004
本期加权平均净值利润率	-21.17%	-22.24%
本期基金份额净值增长率	-18.94%	-19.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	500,423,517.54	100,707,140.79
期末可供分配基金份额利润	0.5148	0.6102
期末基金资产净值	1,581,101,706.42	265,740,112.37
期末基金份额净值	1.626	1.610
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	62.60%	-53.33%

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

大摩健康产业混合 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
过去一个月	-6.87%	0.80%	-2.60%	0.38%	-4.27%	0.42%
过去三个月	-9.62%	0.94%	-1.54%	0.61%	-8.08%	0.33%
过去六个月	-18.94%	1.38%	1.10%	0.72%	-20.04%	0.66%
过去一年	-18.74%	1.34%	-7.29%	0.70%	-11.45%	0.64%
过去三年	-57.95%	1.79%	-26.12%	0.84%	-31.83%	0.95%
自基金合同生效起至今	62.60%	1.62%	16.77%	0.90%	45.83%	0.72%

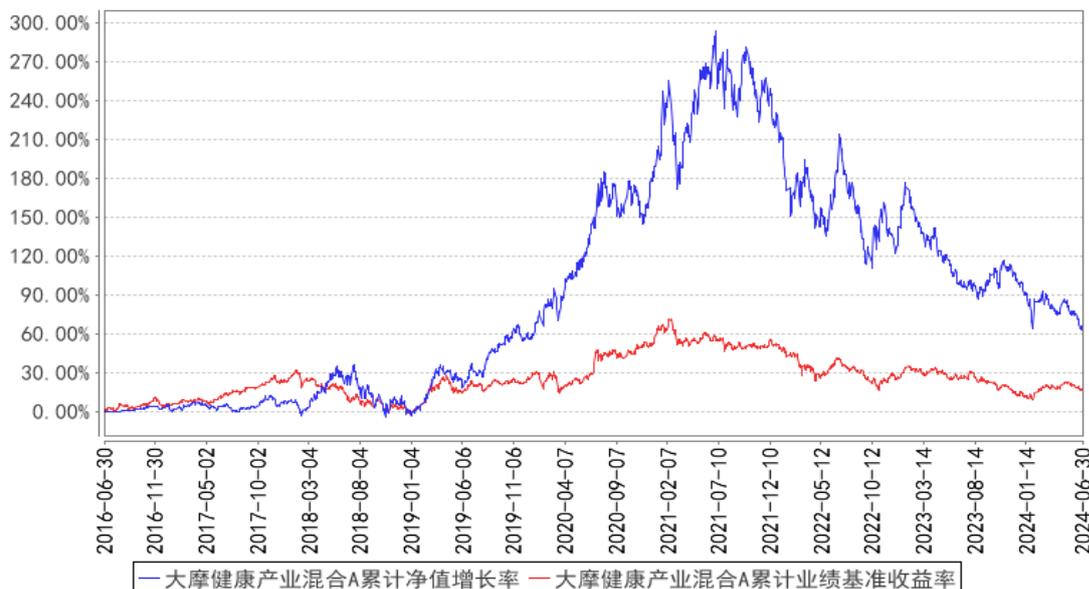
大摩健康产业混合 C

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
过去一个月	-6.88%	0.81%	-2.60%	0.38%	-4.28%	0.43%
过去三个月	-9.65%	0.95%	-1.54%	0.61%	-8.11%	0.34%
过去六个月	-19.10%	1.38%	1.10%	0.72%	-20.20%	0.66%
过去一年	-19.05%	1.34%	-7.29%	0.70%	-11.76%	0.64%
自基金合同生效起至今	-53.33%	1.72%	-22.46%	0.83%	-30.87%	0.89%

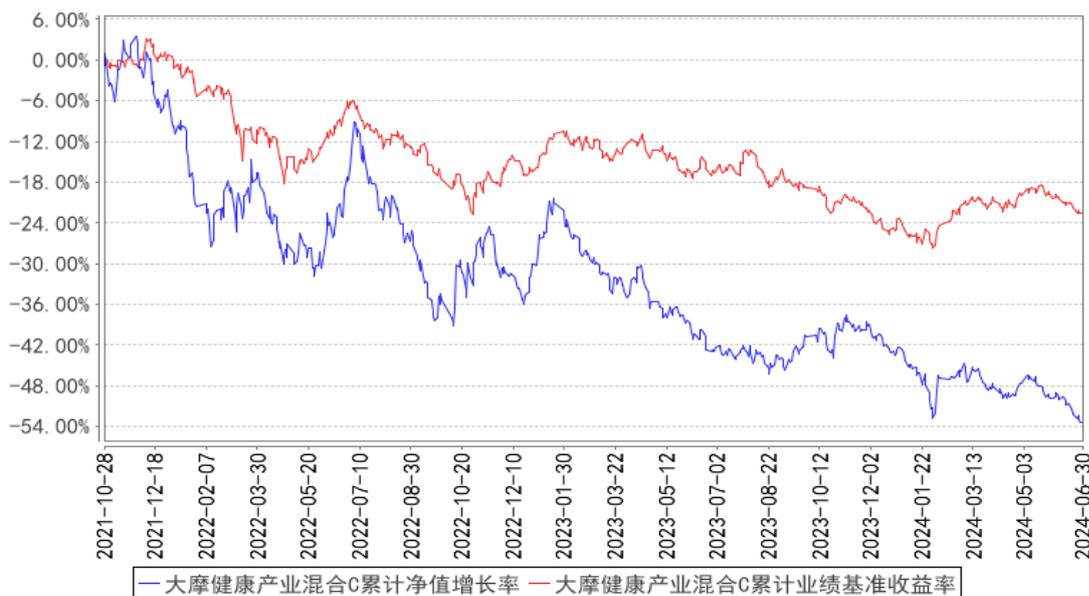
注：本基金从 2021 年 10 月 28 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2021 年 10 月 28 日起存续。

### 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

大摩健康产业混合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



大摩健康产业混合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 2016 年 6 月 30 日正式生效；
2. 按照本基金基金合同的规定，基金管理人自合同生效之日起 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各项资产配置比例符合基金合同约定。
3. 本基金自 2021 年 10 月 28 日起新增 C 类份额。

## § 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 2024 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 35 只公募基金，其中股票型 4 只，混合型 19 只，指数型 1 只，债券型 10 只、基金中基金 1 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		
王 大 鹏	研究管理部总监、基金经理	2016 年 6 月 30 日	-	16 年	中山大学金融学博士，注册会计师（CPA）。曾任长春工业大学工商管理学院金融学专业教师，宝盈基金管理有限公司医药行业研究员。2010 年 12 月加入本公司，历任研究管理部研究员、总监助理、副总监，现任研究管理部总监、基金经理。2015 年 1 月至 2017 年 6 月担任摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2016 年 2 月至 2017 年 4 月担任摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月起担任摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金基金经理，2017 年 5 月至 2023 年 3 月担任摩根士丹利基础行业证券投资基金基金经理，2017 年 6 月至 2018 年 12 月担任摩根士丹利品质生活精选股票型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月起担任摩根士丹利卓越成长混合型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月起担任摩根士丹利消费领航混合型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月起担任摩根士丹利内需增长混合型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月起担任摩根士丹利沪港深精选混合型证券投资基金基金经理。
潘 海 洋	基金经理助理	2022 年 1 月 12 日	-	8 年	南开大学金融学硕士。曾任华泰证券股份有限公司分析师、天风证券股份有限公司分析师、国海证券股份有限公司投资经理。2021 年 12 月加入本公司，担任研究管理

					部基金经理助理。
--	--	--	--	--	----------

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《证券投资基金经营机构董事、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 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

2024 年上半年权益市场整体表现平淡。国内经济处于缓慢复苏、不断巩固复苏基础的状态，海外市场 AI+硬件应用等产业趋势不断发展，在此背景下权益市场内部分化明显，红利显著占优，具备高股息属性的周期行业表现优异，银行、煤炭、石油石化等表现较好；海外 AI 延续高景气，因而通信、部分电子股表现也相对较好；消费年初以来呈现弱复苏状态，板块表现不佳，除家电具备红利属性表现较好外，消费者服务、零售、医药、食品饮料等行业表现较为疲弱。

报告期内，本基金主要配置方向仍然集中在健康产业中的医药板块。上半年本基金在医药细分行业上的配置进一步分散，持仓个股数量增加，整体估值下沉。本基金减持了 CDMO、疫苗等板块，增持了中药、医疗器械等板块，持仓集中在化学药、中药、医疗器械、医药流通、CXO 等方向。上半年医药行业面临消费相对疲软、政策扰动以及生物安全法提案等因素的冲击，表现较差，中信医药指数下跌 20%，本基金持仓个股受到一定的不利影响，业绩表现一般，但略好于中信医药指数。

#### 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 1.626 元，份额累计净值为 1.626 元，基金份额净值增长率为-18.94%，同期业绩比较基准收益率为 1.10%；C 类份额净值为 1.610 元，份额累计净值为 1.610 元，C 类基金份额净值增长率为-19.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

地产销售数据持续下滑叠加居民收入预期下降，上半年宏观经济表现总体平淡。展望下半年，随着地产放松、大规模设备更新和消费品以旧换新等政策逐渐显效，市场对消费及经济增长的悲观预期有望好转。美联储 9 月降息的概率在增加，国内货币政策放松的空间进一步提升，对 A 股市场的压制也有望缓解。目前 A 股的估值处于历史较低水平，横向比较也相对较低，具备修复空间。

尽管年初以来医药板块调整较多，但我们对后续医药板块仍保持乐观。内部看，反腐对诊疗的影响持续减弱，预计板块呈现环比持续恢复态势，长期看反腐有望常态化，有利于优质的头部企业竞争力提升；政策方面，2024 年集采提质扩面，继续全方位推进，预计市场逐步消化，同时政策持续鼓励创新基调不变，地方政府不断出台鼓励政策；外部看，美国通胀逐步缓解，有望在年内开启降息周期，对医药成长的压制有望迎来缓解。我们认为医药板块经过 3 年多的调整，估值性价比已经较为突出，具备较强的吸引力。

#### 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、基金会

计、风险管理部及监察稽核部相关业务人员)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、基金合同的相关规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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—摩根士丹利基金管理(中国)有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为,摩根士丹利基金管理(中国)有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，摩根士丹利基金管理（中国）有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	262,329,165.92	421,551,861.48
结算备付金		1,641,936.87	1,786,573.62
存出保证金		478,297.49	439,915.33
交易性金融资产	6.4.7.2	1,621,677,469.62	2,237,934,308.60
其中：股票投资		1,621,677,469.62	2,237,934,308.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		896,018.19	2,215,887.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,887,022,888.09	2,663,928,546.22
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>

<b>负债：</b>			
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		33,594,885.08	89,672,654.12
应付赎回款		3,103,862.11	4,256,619.38
应付管理人报酬		1,922,382.71	2,671,314.99
应付托管费		320,397.10	445,219.17
应付销售服务费		92,740.32	159,968.92
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,146,801.98	1,109,664.60
负债合计		40,181,069.30	98,315,441.18
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,137,123,547.26	1,280,702,409.82
未分配利润	6.4.7.12	709,718,271.53	1,284,910,695.22
净资产合计		1,846,841,818.79	2,565,613,105.04
负债和净资产总计		1,887,022,888.09	2,663,928,546.22

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金的份额净值 1.626 元，C 类基金的份额净值 1.610 元，基金份额总额 1,137,123,547.26 份，其中 A 类基金的份额总额 972,090,575.68 份，C 类基金的份额总额 165,032,971.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-444,629,388.59	-494,089,033.47
1. 利息收入		699,239.46	1,084,488.61
其中：存款利息收入	6.4.7.13	699,239.46	1,010,054.96
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		-	74,433.65
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		-324,876,666.38	-74,585,776.06

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-350,753,626.33	-103,336,754.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
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	25,876,959.95	28,750,977.99
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	-120,784,356.41	-422,683,771.46
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	332,394.74	2,096,025.44
<b>减：二、营业总支出</b>		15,836,507.65	25,390,101.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,881,413.90	20,684,301.24
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,146,902.26	3,447,383.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	674,832.00	1,125,791.72
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	133,359.49	132,625.41
<b>三、利润总额（亏损总额     以“-”号填列）</b>		-460,465,896.24	-519,479,135.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”     号填列）</b>		-460,465,896.24	-519,479,135.37
<b>五、其他综合收益的税后     净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-460,465,896.24	-519,479,135.37

### 6.3 净资产变动表

会计主体：摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,280,702,409. 82	-	1,284,910,695. 22	2,565,613,105.0 4
二、本期期初净资产	1,280,702,409. 82	-	1,284,910,695. 22	2,565,613,105.0 4
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-143,578,862.5 6	-	-575,192,423.6 9	-718,771,286.25
(一)、综合收益总额	-	-	-460,465,896.2 4	-460,465,896.24
(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)	-143,578,862.5 6	-	-114,726,527.4 5	-258,305,390.01
其中：1. 基金申购款	106,999,999.34	-	86,679,051.73	193,679,051.07
2. 基金赎回款	-250,578,861.9 0	-	-201,405,579.1 8	-451,984,441.08
(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	1,137,123,547. 26	-	709,718,271.53	1,846,841,818.7 9
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,131,697,177. 28	-	1,606,461,323. 23	2,738,158,500.5 1
二、本期期初净资产	1,131,697,177. 28	-	1,606,461,323. 23	2,738,158,500.5 1
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	256,989,354.28	-	-219,609,558.8 3	37,379,795.45

(一)、综合收益总额	-	-	-519,479,135.37	-519,479,135.37
(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)	256,989,354.28	-	299,869,576.54	556,858,930.82
其中：1. 基金申购款	803,249,386.90	-	1,033,955,736.12	1,837,205,123.02
2. 基金赎回款	-546,260,032.62	-	-734,086,159.58	-1,280,346,192.20
(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	1,388,686,531.56	-	1,386,851,764.40	2,775,538,295.96

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)

贺草

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

摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金(原名为“摩根士丹利华鑫健康产业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[2016]第 311 号《关于准予摩根士丹利华鑫健康产业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《摩根士丹利华鑫健康产业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 755,042,469.82 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(2016)第 844 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《摩根士丹利华鑫健康产业混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 755,267,548.94 份基金份额,其中认购资金利息折合 225,079.12 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,摩根士丹利华鑫健康产业混合型证券投资基金更名为摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金。

根据《摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金基金合同》和《摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,自 2021 年 10 月 28 日起,本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、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《摩根士丹利健康产业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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、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、证券公司短期公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、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、权证、股指期货、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)。本基金的投资组合范围为:股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%,投资于健康产业的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%,权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+中证综合债指数收益率 $\times$ 20%。

#### 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”)、中国证监会颁布的《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>》、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《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须作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[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]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(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。

(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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	262,329,165.92
等于: 本金	262,277,748.39
加: 应计利息	51,417.53
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	262,329,165.92

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,051,212,448.19	-	1,621,677,469.62	-429,534,978.57
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,051,212,448.19	-	1,621,677,469.62	-429,534,978.57

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,224.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,026,704.68
其中：交易所市场	1,026,704.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	118,872.44
合计	1,146,801.98

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 大摩健康产业混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,052,125,409.17	1,052,125,409.17
本期申购	64,079,616.80	64,079,616.80
本期赎回（以“-”号填列）	-144,114,450.29	-144,114,450.29
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	972,090,575.68	972,090,575.68

## 大摩健康产业混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	228,577,000.65	228,577,000.65
本期申购	42,920,382.54	42,920,382.54
本期赎回（以“-”号填列）	-106,464,411.61	-106,464,411.61
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	165,032,971.58	165,032,971.58

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 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

## 大摩健康产业混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	841,160,261.51	217,448,500.48	1,058,608,761.99
本期期初	841,160,261.51	217,448,500.48	1,058,608,761.99
本期利润	-285,566,924.70	-99,453,104.09	-385,020,028.79
本期基金份额交易产生的变动数	-55,169,819.27	-9,407,783.19	-64,577,602.46
其中：基金申购款	40,920,080.58	11,268,084.62	52,188,165.20
基金赎回款	-96,089,899.85	-20,675,867.81	-116,765,767.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	500,423,517.54	108,587,613.20	609,011,130.74

## 大摩健康产业混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	342,356,326.13	-116,054,392.90	226,301,933.23
本期期初	342,356,326.13	-116,054,392.90	226,301,933.23
本期利润	-54,114,615.13	-21,331,252.32	-75,445,867.45
本期基金份额交易产生的变动数	-88,211,079.09	38,062,154.10	-50,148,924.99
其中：基金申购款	58,490,614.67	-23,999,728.14	34,490,886.53
基金赎回款	-146,701,693.76	62,061,882.24	-84,639,811.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	200,030,631.91	-99,323,491.12	100,707,140.79

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	683,457.05
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	12,159.56
其他	3,622.85
合计	699,239.46

## 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-350,753,626.33
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	-350,753,626.33

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,182,975,640.20
减：卖出股票成本总额	1,531,340,443.10
减：交易费用	2,388,823.43
买卖股票差价收入	-350,753,626.33

#### 6.4.7.15 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	25,876,959.95
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	25,876,959.95

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-120,784,356.41
股票投资	-120,784,356.41
债券投资	-
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	-120,784,356.41

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	329,115.02
基金转换费收入	3,279.72
合计	332,394.74

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	54,700.10
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	9,987.05
债券账户维护费	9,000.00
合计	133,359.49

#### 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：于 2023 年 7 月 18 日，基金管理人公告公司股权变更交割手续办理完毕，由摩根士丹利国际控股公司依法受让原股东华鑫证券有限责任公司与深圳基石创业投资有限公司 51% 股权，Morgan Stanley 成为实际控制人。华鑫证券有限责任公司与深圳基石创业投资有限公司自 2023 年 7 月 18 日起不再作为本基金关联方。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
华鑫证券	-	-	22,027,212.69	0.67

注：华鑫证券有限责任公司自 2023 年 7 月 18 日起不再作为本基金关联方。

##### 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未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华鑫证券	16,111.68	0.67	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息

服务等。

3. 华鑫证券有限责任公司自 2023 年 7 月 18 日起不再作为本基金关联方。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,881,413.90	20,684,301.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,534,574.13	7,746,716.99
应支付基金管理人的净管理费	7,346,839.77	12,937,584.25

注：自 2016 年 06 月 30 日至 2023 年 10 月 15 日，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 1.50%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×1.50%/当年天数。

根据《摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 10 月 16 日起，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,146,902.26	3,447,383.53

注：自 2016 年 06 月 30 日至 2023 年 10 月 15 日，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 0.25%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×0.25%/当年天数。

根据《摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 10 月 16 日起，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大摩健康产业混合 A	大摩健康产业混合 C	合计
摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	-	1,369.25	1,369.25
中国农业银行	-	3,110.63	3,110.63
合计	-	4,479.88	4,479.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大摩健康产业混合 A	大摩健康产业混合 C	合计
摩根士丹利基金管理（中国）有限公司	-	109,358.37	109,358.37
中国农业银行	-	2,571.54	2,571.54
华鑫证券	-	-	-
合计	-	111,929.91	111,929.91

注：1、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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

2、华鑫证券有限责任公司自 2023 年 7 月 18 日起不再作为本基金关联方。

## 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未与关联方进行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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
		大摩健康产业混合 A
基金合同生效日（2016 年 6	-	-

月 30 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	373,622.59
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	-	-
报告期末持有的基金份额	-	373,622.59
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.23%
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	大摩健康产业混合 A	大摩健康产业混合 C
基金合同生效日 (2016 年 6 月 30 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	533,746.56
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	-	-
报告期末持有的基金份额	-	533,746.56
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.18%

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	262,329,165.92	683,457.05	318,132,948.25	987,694.43

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需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（2024 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/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 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通过采取主动管理的投资策略，在严控风险的基础上，力争为投资人获取稳健回报。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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，违约风险可能性很小。

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 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 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。

于 2024 年 6 月 30 日，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 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上市公司发行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% (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该比例限制)，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%。

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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

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 2024 年 6 月 30 日，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	262,329,165.92	-	-	-	262,329,165.92
结算备付金	1,641,936.87	-	-	-	1,641,936.87
存出保证金	478,297.49	-	-	-	478,297.49
交易性金融资产	-	-	-	1,621,677,469.62	1,621,677,469.62
应收申购款	-	-	-	896,018.19	896,018.19
资产总计	264,449,400.28	-	-	1,622,573,487.81	1,887,022,888.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,103,862.11	3,103,862.11
应付管理人报酬	-	-	-	1,922,382.71	1,922,382.71
应付托管费	-	-	-	320,397.10	320,397.10
应付清算款	-	-	-	33,594,885.08	33,594,885.08
应付销售服务费	-	-	-	92,740.32	92,740.32
其他负债	-	-	-	1,146,801.98	1,146,801.98
负债总计	-	-	-	40,181,069.30	40,181,069.30
利率敏感度缺口	264,449,400.28	-	-	1,582,392,418.51	1,846,841,818.79
上年度末 2023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	421,551,861.48	-	-	-	421,551,861.48
结算备付金	1,786,573.62	-	-	-	1,786,573.62
存出保证金	439,915.33	-	-	-	439,915.33
交易性金融资产	-	-	-	2,237,934,308.60	2,237,934,308.60
应收申购款	-	-	-	2,215,887.19	2,215,887.19
资产总计	423,778,350.43	-	-	2,240,150,195.79	2,663,928,546.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,256,619.38	4,256,619.38
应付管理人报酬	-	-	-	2,671,314.99	2,671,314.99
应付托管费	-	-	-	445,219.17	445,219.17
应付清算款	-	-	-	89,672,654.12	89,672,654.12

应付销售服务费	-	-	-	159,968.92	159,968.92
其他负债	-	-	-	1,109,664.60	1,109,664.60
负债总计	-	-	-	98,315,441.18	98,315,441.18
利率敏感度缺口	423,778,350.43	-	-	-2,141,834,754.61	2,565,613,105.04

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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 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，结合定性分析和定量分析方法的结论，以实现大类资产的动态配置。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。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%。此外，本基金的基金管理人日常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、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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	1,621,677,469.62	87.81	2,237,934,308.60	87.23
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	1,621,677,469.62	87.81	2,237,934,308.60	87.23

#### 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 7.4.1)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(2024年6月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	96,090,000.00	106,610,000.00
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-96,090,000.00	-106,610,000.00

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,621,677,469.62	2,237,934,308.60
第二层次	-	-
第三层次	-	-

合计	1,621,677,469.62	2,237,934,308.60
----	------------------	------------------

#### 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 2024 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(2023 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	1,621,677,469.62	85.94
	其中：股票	1,621,677,469.62	85.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	263,971,102.79	13.99
8	其他各项资产	1,374,315.68	0.07
9	合计	1,887,022,888.09	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

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	-	-
C	制造业	1,251,073,480.86	67.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	220,930,505.71	11.96
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	149,673,483.05	8.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,621,677,469.62	87.81

## 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	300760	迈瑞医疗	628,112	182,724,061.92	9.89
2	600276	恒瑞医药	4,087,180	157,192,942.80	8.51
3	600998	九州通	27,351,564	133,475,632.32	7.23
4	600079	人福医药	6,446,875	110,692,843.75	5.99
5	688575	亚辉龙	4,070,286	94,919,069.52	5.14
6	603259	药明康德	2,277,547	89,257,066.93	4.83
7	002262	恩华药业	3,320,700	78,833,418.00	4.27
8	300832	新产业	803,660	54,198,830.40	2.93
9	300122	智飞生物	1,792,800	50,252,184.00	2.72
10	000538	云南白药	931,800	47,661,570.00	2.58
11	600129	太极集团	1,103,600	31,916,112.00	1.73

12	300896	爱美客	176,020	30,293,042.00	1.64
13	000513	丽珠集团	812,190	30,221,589.90	1.64
14	000963	华东医药	1,013,119	28,174,839.39	1.53
15	002422	科伦药业	927,000	28,115,910.00	1.52
16	600529	山东药玻	1,097,300	27,805,582.00	1.51
17	601607	上海医药	1,345,100	25,704,861.00	1.39
18	603658	安图生物	556,800	25,651,776.00	1.39
19	600557	康缘药业	1,573,018	24,696,382.60	1.34
20	300347	泰格医药	494,700	24,042,420.00	1.30
21	002223	鱼跃医疗	638,600	24,011,360.00	1.30
22	000999	华润三九	523,900	22,307,662.00	1.21
23	603456	九洲药业	1,543,531	21,177,245.32	1.15
24	301333	诺思格	612,700	20,592,847.00	1.12
25	603998	方盛制药	1,986,100	20,397,247.00	1.10
26	600566	济川药业	594,000	18,835,740.00	1.02
27	000950	重药控股	3,748,900	18,257,143.00	0.99
28	300199	翰宇药业	1,641,400	17,809,190.00	0.96
29	000661	长春高新	192,600	17,674,902.00	0.96
30	000403	派林生物	639,800	17,057,068.00	0.92
31	300181	佐力药业	1,075,500	16,261,560.00	0.88
32	301096	百诚医药	271,714	15,781,149.12	0.85
33	600572	康恩贝	3,516,700	15,719,649.00	0.85
34	301015	百洋医药	651,000	15,318,030.00	0.83
35	300705	九典制药	561,960	15,026,810.40	0.81
36	300151	昌红科技	929,500	14,704,690.00	0.80
37	688389	普门科技	677,452	11,015,369.52	0.60
38	300406	九强生物	662,411	10,187,881.18	0.55
39	002864	盘龙药业	356,200	9,218,456.00	0.50
40	300463	迈克生物	780,300	8,879,814.00	0.48
41	600285	羚锐制药	330,100	7,991,721.00	0.43
42	688677	海泰新光	194,285	7,621,800.55	0.41

## 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(%)
1	600129	太极集团	62,518,989.80	2.44
2	000538	云南白药	60,792,358.42	2.37
3	300347	泰格医药	53,634,494.73	2.09
4	600529	山东药玻	48,771,561.27	1.90
5	000950	重药控股	39,910,898.00	1.56
6	300896	爱美客	36,194,341.31	1.41
7	600566	济川药业	35,098,849.00	1.37

8	002223	鱼跃医疗	35,050,515.00	1.37
9	603658	安图生物	33,877,411.00	1.32
10	300015	爱尔眼科	31,964,760.48	1.25
11	000513	丽珠集团	31,421,122.70	1.22
12	301333	诺思格	31,307,303.00	1.22
13	600276	恒瑞医药	29,056,085.80	1.13
14	301267	华夏眼科	28,347,644.61	1.10
15	000403	派林生物	28,030,656.63	1.09
16	601607	上海医药	25,407,561.00	0.99
17	000999	华润三九	24,945,225.70	0.97
18	600285	羚锐制药	23,730,974.60	0.92
19	688575	亚辉龙	22,933,805.30	0.89
20	300122	智飞生物	22,590,605.00	0.88

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	603456	九洲药业	88,676,826.13	3.46
2	300122	智飞生物	85,119,192.54	3.32
3	002422	科伦药业	82,084,936.00	3.20
4	300347	泰格医药	80,480,320.97	3.14
5	002821	凯莱英	65,142,059.21	2.54
6	603259	药明康德	51,218,320.72	2.00
7	600285	羚锐制药	51,046,710.40	1.99
8	600566	济川药业	45,583,182.00	1.78
9	000999	华润三九	42,787,955.00	1.67
10	000661	长春高新	37,352,989.31	1.46
11	002262	恩华药业	33,846,507.00	1.32
12	300760	迈瑞医疗	31,988,173.00	1.25
13	300015	爱尔眼科	30,756,235.89	1.20
14	688235	百济神州	30,275,756.35	1.18
15	688575	亚辉龙	28,222,643.47	1.10
16	300558	贝达药业	28,089,691.00	1.09
17	002223	鱼跃医疗	26,884,131.00	1.05
18	301096	百诚医药	25,598,893.01	1.00
19	301267	华夏眼科	23,353,051.00	0.91
20	000950	重药控股	22,542,309.00	0.88

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	1,035,867,960.53
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,182,975,640.20
--------------	------------------

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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，本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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规定，本基金不参与国债期货交易。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

#### 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未出现本报告期内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规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 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	478,297.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	896,018.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,374,315.68

## 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 (%)
大摩健康 产业混合 A	247,630.00	3,925.58	30,511,319.83	3.14	941,579,255.85	96.86
大摩健康 产业混合 C	18,338.00	8,999.51	31,979,687.45	19.38	133,053,284.13	80.62
合计	265,968	4,275.41	62,491,007.28	5.50	1,074,632,539.98	94.50

## 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 人所有从 业人员持 有本基金	大摩健康产业混合 A	425,676.11	0.043790
	大摩健康产业混合 C	12,712.97	0.007703

	合计	438,389.08	0.038552
--	----	------------	----------

### 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	大摩健康产业混合 A	10~50
	大摩健康产业混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大摩健康产业混合 A	0
	大摩健康产业混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大摩健康产业混合 A	大摩健康产业混合 C
基金合同生效日 (2016年6月30日) 基金份额总额	755,267,548.94	-
本报告期期初基金份额总额	1,052,125,409.17	228,577,000.65
本报告期基金总申购份额	64,079,616.80	42,920,382.54
减：本报告期基金总赎回份额	144,114,450.29	106,464,411.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	972,090,575.68	165,032,971.58

## § 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：

1、2024年1月1日至2024年4月30日期间，ZHOU WENTONG（周文桐）先生担任本公司

副总经理；自 2024 年 5 月 1 日起，ZHOU WENTONG（周文桐）先生由本公司副总经理转任本公司总经理，王鸿嫔女士于同日离任本公司总经理。

2、自 2024 年 3 月 31 日起，李锦女士离任本公司副总经理。

3、自 2024 年 5 月 1 日起，ZHOU HAN（周涵）先生担任本公司首席信息官，王鸿嫔女士于同日离任本公司首席信息官。

4、自 2024 年 5 月 16 日起，毛慧女士担任本公司督察长，许菲菲女士于同日离任本公司督察长。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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 (%)	
国联证券	1	476,887,506.75	21.49	355,710.69	21.49	-
德邦证券	2	457,488,987.40	20.62	341,243.08	20.62	-
中泰证券	1	394,485,616.55	17.78	294,248.84	17.78	-

华西证券	1	264,076,621.89	11.90	196,975.98	11.90	-
信达证券	1	254,546,643.26	11.47	189,862.58	11.47	-
东方财富	1	193,916,015.93	8.74	144,645.10	8.74	-
华福证券	2	76,035,647.34	3.43	56,716.70	3.43	-
兴业证券	1	46,305,712.50	2.09	34,539.89	2.09	-
华鑫证券	1	34,042,999.82	1.53	25,390.42	1.53	-
中信证券	2	21,057,849.29	0.95	15,708.66	0.95	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序

- (1) 实力雄厚，信誉良好。
  - (2) 财务状况良好，经营行为规范。
  - (3) 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，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
  - (5) 研究实力较强，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务。
  - (6) 为基金份额持有人提供高水平的综合服务。
2. 基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作券商。基金管理人与被选择的证券经营机构签订《证券交易单元租用协议》，报证券交易所办理交易单元相关租用手续。
3. 本报告期内，本基金新增租用长江证券 1 个交易单元。

## 10.7.2 基金租用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(%)
国联证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-

证券						
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 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）有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 2 日
2	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下全部基金 2023 年 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 19 日
3	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下全部基金 2023 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 19 日
4	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于提醒投资者及时更新、完善身份资料信息以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 23 日
5	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于北京分公司法定名称变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 24 日
6	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于暂停公司官网、网上交易系统、在线客服相关服务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 26 日
7	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于部分直销银行账户信息变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 2 月 5 日
8	摩根士丹利健康产业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	2024 年 2 月 7 日
9	摩根士丹利健康产业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	2024 年 2 月 7 日
10	摩根士丹利健康产业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	2024 年 2 月 7 日
11	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于旗下基金增加博时财富基金销售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	2024 年 3 月 11 日
12	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 19 日
13	摩根士丹利基金管理（中国）有限公	中国证监会规定报刊及	2024 年 3 月 22 日

	司关于旗下基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	网站	
14	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 28 日
15	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 28 日
16	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	2024 年 4 月 2 日
17	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下全部基金 2024 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 19 日
18	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下全部基金 2024 年 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 19 日
19	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	2024 年 5 月 1 日
20	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	2024 年 5 月 16 日
21	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
22	摩根士丹利基金管理（中国）有限公司旗下基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 6 月 14 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 11.3 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

2024 年 8 月 29 日