摩根健康品质生活混合型证券投资基金(原摩根健康品质生活混合型证券投资基金)
2025 年中期报告

2025 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本基金经基金份额持有人大会决议变更注册，自 2025 年 5 月 8 日起，变更后的《摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同》生效。转型前报告期为 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 5 月 7 日止；转型后报告期为 2025 年 5 月 8 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 6

2.1 基金基本情况（转型后） 6
2.1 基金基本情况（转型前） 6
2.2 基金产品说明（转型后） 6
2.2 基金产品说明（转型前） 7
2.3 基金管理人和基金托管人 8
2.4 信息披露方式 9
2.5 其他相关资料(转型后) 9
2.5 其他相关资料(转型前) 9

§3 主要财务指标和基金净值表现 9

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后) 9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前) 10
3.2 基金净值表现（转型后） 11
3.2 基金净值表现（转型前） 12

§4 管理人报告 15

4.1 基金管理人及基金经理情况 15
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 18
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 18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 19
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 20
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 20

§5 托管人报告 20

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 20
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 20
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 20

§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型后） 20

6.1 资产负债表 20
6.2 利润表 22
6.3 净资产变动表 23
6.4 报表附注 24

§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型前） 52

6.1 资产负债表 52

6.2 利润表 54
6.3 净资产变动表 55
6.4 报表附注 57
§7 投资组合报告（转型后） 78
7.1 期末基金资产组合情况 78
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 79
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 80
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 82
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 82
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 82
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 82
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 82
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 82
7.12 投资组合报告附注 82
§7 投资组合报告（转型前） 83
7.1 期末基金资产组合情况 83
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 84
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 84
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 85
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 86
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 87
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 87
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 87
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 87
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 87
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 87
7.12 投资组合报告附注 87
§8 基金份额持有人信息（转型后） 88
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 88
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 88
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 88
§8 基金份额持有人信息（转型前） 89
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 89
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 89
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 89
§9 开放式基金份额变动（转型后） 89
§9 开放式基金份额变动（转型前） 90
§10 重大事件揭示 90

10.1 基金份额持有人大会决议 90
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 91
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 91
10.4 基金投资策略的改变 91
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 91
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 91
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后) 91
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前) 94
10.8 其他重大事件 96
10.9 其他重大事件（转型后） 96
10.8 其他重大事件（转型前） 97

§11 影响投资者决策的其他重要信息 97

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 97
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 97

§12 备查文件目录 97

12.1 备查文件目录 97
12.2 存放地点 98
12.3 查阅方式 98

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	摩根健康品质生活混合型证券投资基金	
基金简称	摩根健康品质生活混合	
基金主代码	377150	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 5 月 8 日	
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	239,478,353.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C
下属分级基金的交易代码	377150	015346
报告期末下属分级基金的份额总额	237,507,660.61 份	1,970,692.88 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	摩根健康品质生活混合型证券投资基金	
基金简称	摩根健康品质生活混合	
基金主代码	377150	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 2 月 1 日	
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	217,746,697.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C
下属分级基金的交易代码	377150	015346
报告期末下属分级基金的份额总额	212,738,832.71 份	5,007,865.06 份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业及公司，力争把握经济结构调整和消费升级所带来的投资机会。在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略： 本基金对大类资产的配置是从宏观层面出发，采用定量分析和定性分析相结合的手段，综合宏观经济环境、宏观经济政策、

	产业政策、行业景气度、证券市场走势和流动性的综合分析，积极进行大类资产配置。 在控制风险的前提下，本基金将优先配置股票资产，本基金股票资产占基金资产的投资比例为 70%-95%，其中港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%。 2、股票投资策略： 本基金将围绕健康生活与品质生活这两大主题，重点关注有利于提升民众健康水平以及物质生活和精神生活质量的行业和个股。 本基金的股票投资包含健康生活和品质生活这两大主题。健康生活对应的是有利于公众建立健康体质和生活的行业或公司，如医疗及服务、健康食品、文体产业、户外运动服装及器械等。品质生活对应的是符合公众消费趋势，建立品质生活的行业和公司，如食品饮料、汽车、家电、商贸零售、旅游、航空、消费电子等。本基金将不低于 80%的非现金基金资产投资于健康品质生活主题相关的股票。 行业配置方面，本基金将从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度，综合评估各个行业的投资价值。在行业配置的基础上，本基金管理人将采用“自下而上”的研究方法，充分发挥投研团队的主动选股能力，紧密围绕健康品质生活的投资主题，精选优质股票构建投资组合。 此外，本基金采用的投资策略还包括：债券投资策略；股指期货投资策略；股票期权投资策略；国债期货投资策略；资产支持证券投资策略；存托凭证投资策略；融资业务策略
业绩比较基准	中证内地消费指数收益率*65%+中证港股通大消费主题指数收益率*15%+银行活期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	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。 本基金可投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 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。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金主要投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业及公司，力争把握经济结构调整和消费升级所带来的投资机会。在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金对大类资产的配置是从宏观层面出发，采用定量分析和定性分析相结合的手段，综合宏观经济环境、宏观经济政策、产业政策、行业景气度、证券市场走势和流动性的综合分析，积极进行大类资产配置。 影响资产收益的关键驱动因素主要包括基本面和流动性。基本面驱动，主要指在经济周期和通胀周期影响下，业绩增长、利率环境、通胀预期等因素的变动；流动性驱动主要体现为货币市场环境变动的影响，具体包括汇率变动、流动性结构变动等。随着各类资产风险收益特征的相对

	变化，本基金将适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例。 2、股票投资策略 人类的需求主要来自于两方面:一是延长生命长度，提升健康水平；二是拓展生命宽度，提高生活品质。随着居民收入水平的提升、城镇化进程的推进以及社会保障体制的完善，居民的各方面需求将逐步释放，尤其是对于身体健康和生活品质的要求会逐步提高，由此带来对相关产品和服务的需求的增加，并推动提供此类产品和服务的上市公司的快速成长。本基金将围绕健康生活与品质生活这两大主题，重点关注有利于提升民众健康水平以及物质生活和精神生活质量的行业和个股。 3、固定收益类投资策略 对于固定收益类资产的选择，本基金将以价值分析为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。在券种选择上，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。 4、其他投资策略: 包括可转换债券投资策略、权证投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证内地消费指数收益率*80%+银行活期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，主要投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业和公司，属于主题类混合型基金，预期风险和收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金产品。 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		摩根基金管理（中国）有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邹树波	许俊
	联系电话	021-38794888	010-66596688
	电子邮箱	services@jpmamc.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-889-4888	95566
传真		021-20628400	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 42 层和 43 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 42 层和 43 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818

法定代表人	王琼慧	葛海蛟

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	am.jpmorgan.com/cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料(转型后)

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

2.5 其他相关资料(转型前)

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日） - 2025 年 6 月 30 日	
	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C
本期已实现收益	23,651,687.17	345,503.06
本期利润	-1,936,832.46	29,394.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0094	0.0109
本期加权平均净值利润率	-0.30%	0.36%
本期基金份额净值增长率	-0.72%	-0.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	291,607,840.87	2,334,197.24
期末可供分配基金份额利润	1.2278	1.1845

期末基金资产净值	731,088,746.77	5,965,964.20
期末基金份额净值	3.0782	3.0273
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-0.72%	-0.81%

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

2.基金合同在当期生效。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 5 月 7 日)	
	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C
本期已实现收益	-27,932,924.01	-1,611,107.54
本期利润	33,993,011.01	-981,904.60
加权平均基金份额本期利润	0.1544	-0.0575
本期加权平均净值利润率	5.25%	-1.99%
本期基金份额净值增长率	5.54%	5.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 5 月 7 日)	
期末可供分配利润	235,624,997.97	5,351,291.69
期末可供分配基金份额利润	1.1076	1.0686
期末基金资产净值	659,579,531.01	15,283,517.73
期末基金份额净值	3.1004	3.0519

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 5 月 7 日)	
基金份额累计净值增长率	210.04%	-17.36%

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（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

摩根健康品质生活混合 A

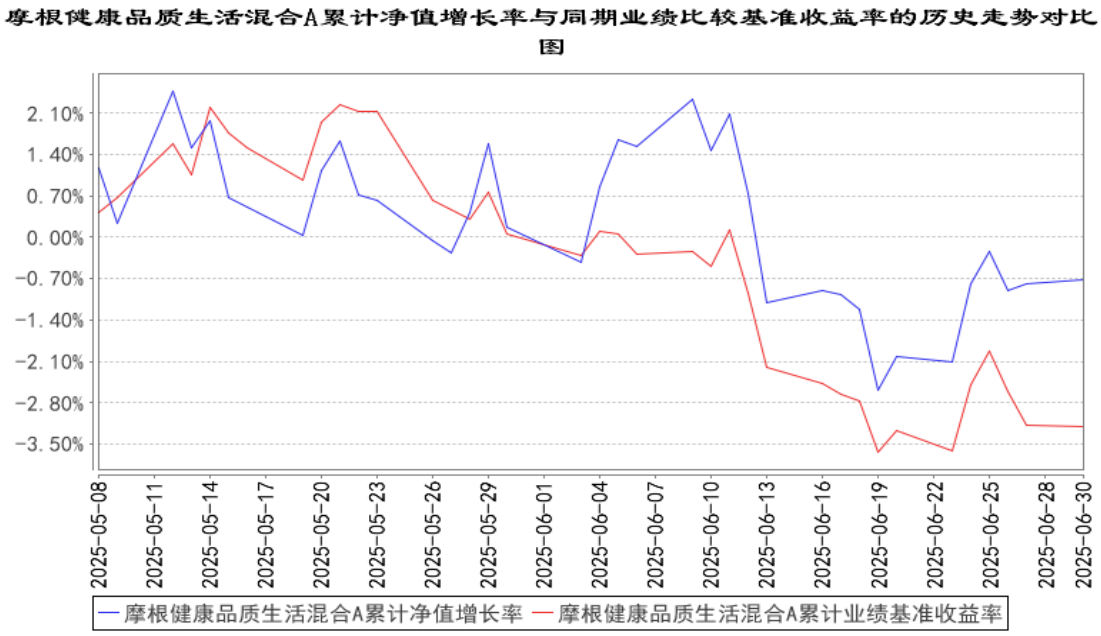
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.89%	0.87%	-3.27%	0.60%	2.38%	0.27%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-0.72%	0.93%	-3.20%	0.63%	2.48%	0.30%

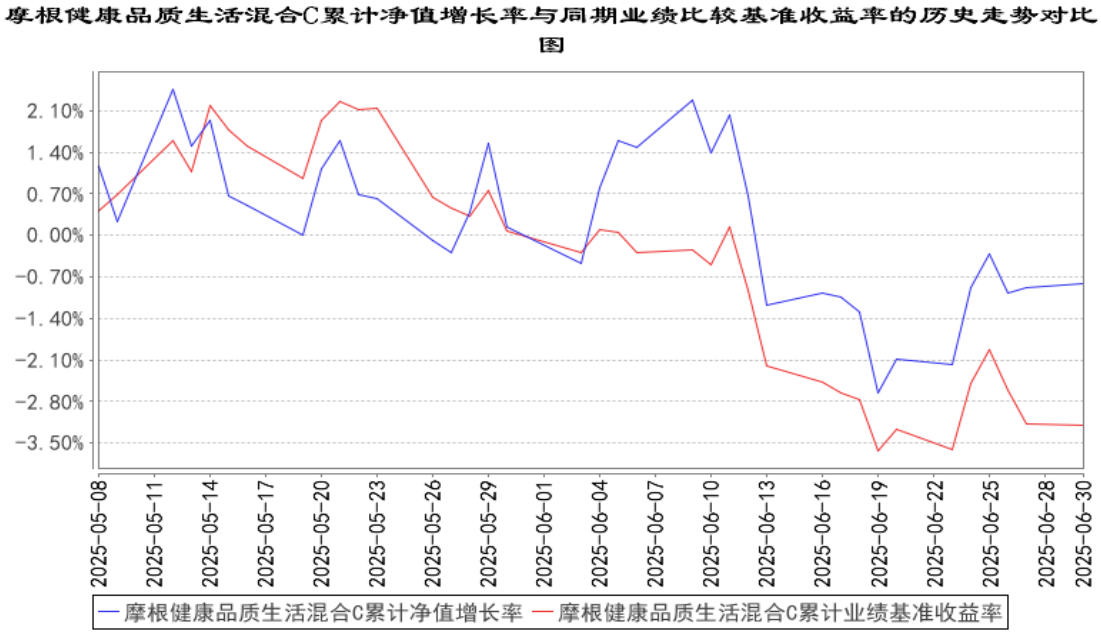
摩根健康品质生活混合 C

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	-0.94%	0.87%	-3.27%	0.60%	2.33%	0.27%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同	-0.81%	0.93%	-3.20%	0.63%	2.39%	0.30%

生效起至今						

3.2.2 自基金转型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





注：本基金转型日期为 2025 年 5 月 8 日，截至本报告期末，本基金转型未满一年，图示时间段为 2025 年 5 月 8 日至 2025 年 6 月 30 日。

本基金建仓期自 2025 年 5 月 8 日至 2025 年 11 月 7 日，目前本基金还处于建仓期。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

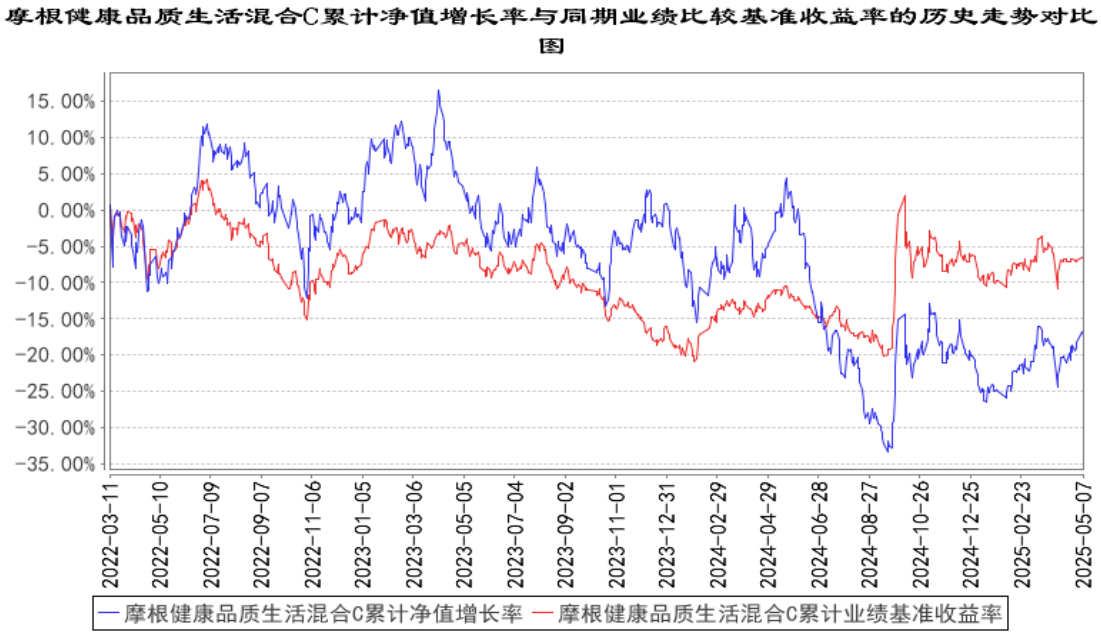
摩根健康品质生活混合 A

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	-	-	-	-	-	-
过去三个月	1.92%	1.69%	-1.08%	1.19%	3.00%	0.50%
过去六个月	5.54%	1.31%	0.45%	0.94%	5.09%	0.37%
过去一年	-1.86%	1.70%	9.58%	1.24%	-11.44%	0.46%
过去三年	-24.78%	1.49%	-9.81%	0.95%	-14.97%	0.54%
自基金合同生效起至今	210.04%	1.65%	57.75%	1.16%	152.29%	0.49%

摩根健康品质生活混合 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	-	-	-	-	-	-
过去三个月	1.87%	1.69%	-1.08%	1.19%	2.95%	0.50%
过去六个月	5.35%	1.31%	0.45%	0.94%	4.90%	0.37%
过去一年	-2.29%	1.70%	9.58%	1.24%	-11.87%	0.46%
过去三年	-25.86%	1.49%	-9.81%	0.95%	-16.05%	0.54%
自基金合同生效起至今	-17.36%	1.54%	-6.39%	0.99%	-10.97%	0.55%

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



注：本基金合同生效日为 2012 年 2 月 1 日，图示时间段为 2012 年 2 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日

本基金自 2022 年 3 月 10 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根基金管理（中国）有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。2023 年 1 月 19 日，经中国证监会批准，本公司原股东之一上海国际信托有限公司将其持有的本公司 51%股权，与原另一股东 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 将其持有的本公司 49%股权转让给摩根资产管理控股公司（JPMorgan Asset Management Holdings Inc.），从而摩根资产管理控股公司取得本公司全部股权。2023 年 4 月 10 日，基金管理人的名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理（中国）有限公司”。截至 2025 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有一百零七只，均为开放式基金，分别是：摩根中国优势证券投资基金、摩根货币市场基金、摩根阿尔法混合型证券投资基金、摩根双息平衡混合型证券投资基金、摩根成长先锋混合型证券投资基金、摩根内需动力混合型证券投资基金、摩根亚太优势混合型证券投资基金(QDII)、摩根双核平衡混合型证券投资基金、摩根中小盘混合型证券投资基金、摩根纯债债券型证券投资基金、摩根行业轮动混合型证券投资基金、摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)、摩根新兴动力混合型证券投资基金、摩根强化回报债券型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根全球天然资源混合型证券投资基金(QDII)、摩根核心优选混合型证券投资基金、摩根智选 30 混合型证券投资基金、摩根成长动力混合型证券投资基金、摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、摩根双债增利债券型证券投资基金、摩根核心成长股票型证券投资基金、摩根民生需求股票型证券投资基金、摩根纯债丰利债券型证券投资基金、摩根天添盈货币市场基金、摩根天添宝货币市场基金、摩根安全战略股票型证券投资基金、摩根卓越制造股票型证券投资基金、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、摩根智慧互联股票型证券投资基金、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、摩根新兴服务股票型证券投资基金、摩根医疗健康股票型证券投资基金、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)、摩根安通回报混合型证券投资基金、摩根丰瑞债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、摩根安隆回报混合型证券投资基金、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)、摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、摩根安裕回报混合型证券投资基金、摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、摩根核心精选股票型证券投资基金、摩根动力精

选混合型证券投资基金、摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、摩根领先优选混合型证券投资基金、摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、摩根慧选成长股票型证券投资基金、摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、摩根研究驱动股票型证券投资基金、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、摩根行业睿选股票型证券投资基金、摩根优势成长混合型证券投资基金、摩根安荣回报混合型证券投资基金、摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、摩根景气甄选混合型证券投资基金、摩根均衡优选混合型证券投资基金、摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、摩根全景优势股票型证券投资基金、摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧享成长混合型证券投资基金、摩根时代睿选股票型证券投资基金、摩根瑞享纯债债券型证券投资基金、摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根锦颐养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、摩根海外稳健配置混合型证券投资基金(QDII-FOF)、摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII) 、摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金、摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根瑞锦纯债债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、摩根悦享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、摩根瑞欣利率债债券型证券投资基金、摩根红利优选股票型证券投资基金、摩根均衡精选混合型证券投资基金、摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根共同分类目录绿色债券债券型证券投资基金、摩根上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金、摩根恒鑫债券型证券投资基金、摩根 90 天持有期债券型证券投资基金、摩根 60 天持有期债券型证券投资基金、摩根沪深 300 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、摩根 30 天持有期债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
徐项楠	本基金基金经理	2025 年 5 月 8 日	-	11 年	徐项楠先生曾任中海基金管理有限公司行业分析师，中银基金管理有限公司高级分析师。2017 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），历任研究员、行业专家、行业专家/基金经理助理，现任高级基金经理。

注：1.对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期；对非首任基金经理，"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
徐项楠	本基金基金经理	2021 年 11 月 12 日	-	11 年	徐项楠先生曾任中海基金管理有限公司行业分析师，中银基金管理有限公司高级分析师。2017 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），历任研究员、行业专家、行业专家/基金经理助理，现任高级基金经理。

注：1.对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期；对非首任基金经理，"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会的相关规定。

3.本基金经基金份额持有人大会决议变更注册，变更注册后的《摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同》自 2025 年 5 月 8 日起生效。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，在控制风险的前提下，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，公司未发现存在异常交易行为。

报告期内，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 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

2025 年上半年经济整体呈现前高后低走势。虽然面临去年同期的高基数，但是在政策前置发力和抢出口效应的带动下，一季度 GDP 同比+5.4%，持平 2024 年四季度。4 月美国对中国加征关税率大幅提升，使得二季度经济环比增速较 2025 年第一季度有所放缓，但整体仍然保持平稳走势。供给端来看，1-5 月工业增加值同比+6.3%，服务业生产指数同比+5.9%。需求端来看，1-5 月以人民币计价的出口同比+7.2%，社会消费品零售总额同比+5.0%，固定资产投资同比+3.7%。虽然关税对出口形成较大扰动，但是一方面 5 月日内瓦会谈后关税显著缓和，另一方面中国对美国以外地区出口保持高增速，有效对冲了对美国出口的下行，因此出口整体好于内需。以旧换新是支撑社零的最主要因素，而以旧换新支持品类以外的内生性消费需求仍然偏弱。总体来看，需求弱于供给的趋势持续，受此影响，物价继续维持偏弱走势。一季度 GDP 平减指数同比-0.8%，已经连续八

个季度为负，1-5 月 CPI、PPI 同比分别-0.1%、-2.6%，皆处于负增长区间。从市场表现来看，市场呈现震荡走势，沪深 300 上涨 0.0%，创业板指数上涨 0.5%。从行业表现来看，上半年综合金融、有色金属、银行等行业涨幅排名靠前，煤炭、房地产、食品饮料等行业表现较为靠后。报告期内，本基金新增了港股通的投资标的，有效解决了对于新消费标的的配置问题。其本质原因在于 A 股消费行业更多集中在传统消费领域，而香港市场则涌现出一批代表新一代年轻人消费观的新消费行业及公司，因此我们也看到今年来，AH 两地主要消费指数表现迥异。基于投资范围的改变，本基金在报告期内从重点聚焦A股各消费子行业的优质龙头公司逐步将结构调整为AH两地各消费子行业的优质公司，报告期内亦实现了超赢基准的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日转型前摩根健康品质生活混合 A 份额净值增长率为：5.54%，同期业绩比较基准收益率为：0.45%；摩根健康品质生活混合 C 份额净值增长率为：5.35%，同期业绩比较基准收益率为：0.45%。

2025 年 5 月 8 日转型后至 2025 年 6 月 30 日摩根健康品质生活混合 A 份额净值增长率为：-0.72%，同期业绩比较基准收益率为：-3.20%；摩根健康品质生活混合 C 份额净值增长率为：-0.81%，同期业绩比较基准收益率为：-3.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们保持谨慎乐观。外部不确定性虽然仍高，但边际上有所下降，类似 4 月的关税极端情形再度出现的可能性较小。我们预计美国经济整体维持缓慢走弱态势，但仍有一定韧性，或将限制美联储降息的时点和幅度。在此背景下，中国出口或仍将维持一定韧性，成为下半年经济的重要支撑因素。财政政策预计将保持积极，或将以加快落地现有财政资金为主，使得基建仍将保持较高增速。行业上，我们认为伴随着 AI 带来的科技浪潮，科技领域增长空间巨大，消费受益于政策托举亦有阶段性机会。另外，新一代年轻人消费观的改善，带来了这个群体消费跨期主观偏好的显著提升，从而带动新消费行业的繁荣。该现象在美国、日本等国家历史上均有发生，伴随着经济高速发展成长起来的新一代年轻人往往具备更高的消费跨期主观偏好，而消费人群整体跨期主观偏好的提升将对消费社会产生深远影响。我们认为消费方向虽然仍面临众多不确定性，但估值水平已释放一定风险，当下消费社会亦呈现出较为明显的 M 型特征，即传统消费的“高性价比消费”特点和新消费的“小众的功能性优质消费”特点，两个方向都保持相对较好的趋势，本基金看好并持有受益于以上方向的细分板块优质公司。未来我们亦将继续严格按照基金契约的要求重点投资品质消费相关行业中具有相对估值优势、增长前景确定的优质公司。我们将加强对上市公司基本面的研究力度，力争为持有人创造较好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在摩根健康品质生活混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根健康品质生活混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	125,969,882.65
结算备付金		2,374,267.66
存出保证金		526,863.38
交易性金融资产	6.4.7.2	627,501,889.22
其中：股票投资		627,501,889.22
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		9,782,482.04
应收股利		802,805.53
应收申购款		14,374.71
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		766,972,565.19
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		28,131,935.19
应付赎回款		116,499.44
应付管理人报酬		640,959.82
应付托管费		106,826.63
应付销售服务费		2,720.61
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	918,912.53
负债合计		29,917,854.22
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	239,478,353.49
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	497,576,357.48
净资产合计		737,054,710.97
负债和净资产总计		766,972,565.19

注：1.报告截止日 2025 年 6 月 30 日,基金份额总额：239,478,353.49 份,其中：A 类,基金份额净值:3.0782 元,基金份额：237,507,660.61 份。C 类,基金份额净值:3.0273 元,基金份额：1,970,692.88 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：摩根健康品质生活混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-461,257.29
1.利息收入		55,370.60
其中：存款利息收入	6.4.7.13	55,370.60
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）		25,382,694.57
其中：股票投资收益	6.4.7.14	18,674,120.41
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	6,708,574.16
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.20	-25,904,628.56

号填列）		
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	5,306.10
减：二、营业总支出		1,446,181.04
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,153,925.23
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	192,320.85
3．销售服务费	6.4.10.2.3	6,076.15
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	93,858.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,907,438.33
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,907,438.33
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-1,907,438.33

6.3 净资产变动表

会计主体：摩根健康品质生活混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	217,746,697.77	-	457,116,350.97	674,863,048.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	21,731,655.72	-	40,460,006.51	62,191,662.23
（一）、综合收益总额	-	-	-1,907,438.33	-1,907,438.33

（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）	21,731,655.72	-	42,367,444.84	64,099,100.56
其中：1.基金申购款	39,995,262.37	-	81,530,218.04	121,525,480.41
2.基金赎回款	-18,263,606.65	-	-39,162,773.20	-57,426,379.85
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	239,478,353.49	-	497,576,357.48	737,054,710.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王琼慧	王敏	俞文涵
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

摩根健康品质生活混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由原上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金更名而来。根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1753 号《关于核准上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金募集的批复》、基金管理人 2015 年 7 月 21 日发布的《上投摩根基金管理有限公司关于旗下十二只基金变更基金名称的公告》和基金管理人 2023 年 4 月 12 日发布的《关于公司法定名称变更的公告》、《摩根基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，原上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金先后更名为上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金。根据基金管理人 2025 年 5 月 8 日发布的《关于摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2025 年 5 月 8 日起，本基金的投资范围、投资策略、业绩比

较基准、基金费率及支付方式等相关事宜进行变更。自 2025 年 5 月 8 日起，变更后的《摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金的基金管理人为摩根基金管理（中国）有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《摩根健康品质生活混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票、存托凭证、港股通标的股票、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。在法律法规允许的前提下，本基金可进行融资交易。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产净值的 70%-95%，其中，港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%。本基金将不低于 80%的非现金基金资产投资于健康品质生活主题相关的股票。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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：中证内地消费指数收益率*65%+中证港股通大消费主题指数收益率*15%+银行活期存款利率（税后）*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》、《摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2025 年 6 月 30 日的财务状况、自 2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1)金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持

证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2)金融负债

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际

利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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 [2004] 78

号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《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 号文《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 号文《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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部 税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81 号《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[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地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。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e） 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	125,969,882.65
等于：本金	125,958,572.07
加：应计利息	11,310.58
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	125,969,882.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		636,132,491.15	-	627,501,889.22	-8,630,601.93
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		636,132,491.15	-	627,501,889.22	-8,630,601.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无余额。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无余额。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无余额。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无余额。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无余额。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无余额。

6.4.7.8 其他资产

无余额。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.58
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	709,651.80
其中：交易所市场	709,651.80
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,260.15
合计	918,912.53

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

摩根健康品质生活混合 A

项目	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	212,738,832.71	212,738,832.71
2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	39,674,380.82	39,674,380.82
本期赎回（以“-”号填列）	-14,905,552.92	-14,905,552.92
本期末	237,507,660.61	237,507,660.61

摩根健康品质生活混合 C

项目	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,007,865.06	5,007,865.06
2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2025 年 5 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	320,881.55	320,881.55
本期赎回（以“-”号填列）	-3,358,053.73	-3,358,053.73
本期末	1,970,692.88	1,970,692.88

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

摩根健康品质生活混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	235,624,997.97	211,215,700.33	446,840,698.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	235,624,997.97	211,215,700.33	446,840,698.30
本期利润	23,651,687.17	-25,588,519.63	-1,936,832.46
本期基金份额交易产生的变动数	32,331,155.73	16,346,064.59	48,677,220.32
其中：基金申购款	49,476,759.67	31,392,236.69	80,868,996.36
基金赎回款	-17,145,603.94	-15,046,172.10	-32,191,776.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	291,607,840.87	201,973,245.29	493,581,086.16

摩根健康品质生活混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	5,351,291.69	4,924,360.98	10,275,652.67
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,351,291.69	4,924,360.98	10,275,652.67
本期利润	345,503.06	-316,108.93	29,394.13
本期基金份额交易产生的变动数	-3,362,597.51	-2,947,177.97	-6,309,775.48
其中：基金申购款	370,106.18	291,115.50	661,221.68
基金赎回款	-3,732,703.69	-3,238,293.47	-6,970,997.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,334,197.24	1,661,074.08	3,995,271.32

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	51,146.46
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	3,954.88
其他	269.26
合计	55,370.60

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 2025年5月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	18,674,120.41
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	18,674,120.41

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 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	382,261,265.78
减：卖出股票成本总额	362,672,199.93
减：交易费用	914,945.44
买卖股票差价收入	18,674,120.41

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

无。

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

无。

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 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,708,574.16
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	6,708,574.16

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-25,904,628.56
——股票投资	-25,904,628.56
——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	-25,904,628.56

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,320.28
基金转换费收入	1,985.82
合计	5,306.10

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	8,876.52
信息披露费	17,753.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,767.97
公证费	10,000.00
其他	1,460.74
律师费	50,000.00
合计	93,858.81

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金销售机构
摩根大通证券（中国）有限公司	基金管理人的实际控制人摩根大通公司(JPMorgan Chase &Co.)控制的公司，证券经纪商

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
摩根大通证券（中国）有限公司	54,344,970.00	6.17

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年5月8日（基金合同生效日）至2025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（%）
摩根大通证券（中国）有限公司	19,237.17	5.21	19,237.17	2.71

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 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,153,925.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	71,658.23
应支付基金管理人的净管理费	1,082,267.00

注：支付基金管理人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

	2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	192,320.85

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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 × 0.2% / 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 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C	合计
摩根基金管理（中国）有限公司	-	629.26	629.26
合计	-	629.26	629.26

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费＝前一日 C 类的基金资产净值 × 0.50%/ 当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C

基金合同生效日（ 2025 年 5 月 8 日）持有的基金份额	149,844.21	-
报告期初持有的基金份额		-
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	3,070.42	-
报告期末持有的基金份额	146,773.79	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.06%	-

注：上述基金管理人持有的份额包括基金管理人的高级管理人员、主要业务部门负责人、基金经理根据《基金管理公司绩效考核与薪酬管理指引》的要求，将一定比例的绩效薪酬购买本基金的部分。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 5 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	125,969,882.65	51,146.46

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是主动投资的混合型基金，主要投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业和公司，属于主题类混合型基金，预期风险和收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金产品。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信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业及公司，力争把握经济结构调整和消费升级所带来的投资机会。在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	125,969,882.65	-	-	-	125,969,882.65
结算备付金	2,374,267.66	-	-	-	2,374,267.66
存出保证金	526,863.38	-	-	-	526,863.38
交易性金融资产	-	-	-	627,501,889.22	627,501,889.22
应收股利	-	-	-	802,805.53	802,805.53
应收申购款	-	-	-	14,374.71	14,374.71
应收清算款	-	-	-	9,782,482.04	9,782,482.04
资产总计	128,871,013.69	-	-	638,101,551.50	766,972,565.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	116,499.44	116,499.44
应付管理人报酬	-	-	-	640,959.82	640,959.82
应付托管费	-	-	-	106,826.63	106,826.63
应付清算款	-	-	-	28,131,935.19	28,131,935.19
应付销售服务费	-	-	-	2,720.61	2,720.61
其他负债	-	-	-	918,912.53	918,912.53
负债总计	-	-	-	29,917,854.22	29,917,854.22

利率敏感度缺口	128,871,013.69	-	-	-608,183,697.28	737,054,710.97

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日:同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024 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。本基金持有以非记账本位币人民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 2025 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	276,072,416.60	-	276,072,416.60
应收股利	-	802,805.53	-	802,805.53
资产合计	-	276,875,222.13	-	276,875,222.13
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	-	276,875,222.13	-	276,875,222.13

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 （2025 年 6 月 30 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	13,840,000.00

	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-13,840,000.00

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，采用“自上而下”的策略，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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 70%-95%，其中，港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%。本基金将不低于 80%的非现金基金资产投资于健康品质生活主题相关的股票。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	627,501,889.22	85.14
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	627,501,889.22	85.14

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 （2025 年 6 月 30 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	43,350,000.00
	2.业绩比较基准下降 5%	-43,350,000.00

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	627,501,889.22
第二层次	-
第三层次	-
合计	627,501,889.22

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根健康品质生活混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 5 月 7 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 5 月 7 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	154,861,161.34	337,786,112.51
结算备付金		1,413,261.95	2,524,951.32
存出保证金		464,816.07	460,403.20
交易性金融资产	6.4.7.2	516,932,215.13	680,643,097.43
其中：股票投资		516,932,215.13	680,643,097.43
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		3,404,059.43	63,497,328.34
应收股利		-	-
应收申购款		41,620.42	116,964.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		677,117,134.34	1,085,028,857.54
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 5 月 7 日**	**上年度末 2024 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		-	-
应付赎回款		757,996.03	273,879,910.38
应付管理人报酬		819,539.69	1,329,220.41
应付托管费		136,589.96	221,536.73
应付销售服务费		16,337.61	92,639.39
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	523,622.31	1,844,099.34
负债合计		2,254,085.60	277,367,406.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	217,746,697.77	275,267,438.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	457,116,350.97	532,394,013.29
净资产合计		674,863,048.74	807,661,451.29
负债和净资产总计		677,117,134.34	1,085,028,857.54

注： 1.报告截止日 2025 年 5 月 7 日,基金份额总额：217,746,697.77 份,其中：A 类,基金份额净值:3.1004 元,基金份额：212,738,832.71 份。C 类,基金份额净值:3.0519 元,基金份额：5,007,865.06 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2012 年 2 月 1 日(基金合同生效日)至 2025 年 5 月 7 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：摩根健康品质生活混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		36,728,622.35	-241,097,637.08
1.利息收入		125,372.40	219,150.04
其中：存款利息收入	6.4.7.13	125,372.40	219,150.04
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）		-26,112,538.40	-27,962,176.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-28,833,455.78	-32,116,752.77
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	2,720,917.38	4,154,576.24
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	62,555,137.96	-213,589,731.24
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	160,650.39	235,120.65
减：二、营业总支出		3,717,515.94	13,492,658.60
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,045,243.79	10,650,944.90
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	507,540.65	1,775,157.47
3．销售服务费	6.4.10.2.3	86,120.37	933,665.49
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	78,611.13	132,890.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,011,106.41	-254,590,295.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,011,106.41	-254,590,295.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		33,011,106.41	-254,590,295.68

6.3 净资产变动表

会计主体：摩根健康品质生活混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 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	275,267,438.00	-	532,394,013.29	807,661,451.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	275,267,438.00	-	532,394,013.29	807,661,451.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-57,520,740.23	-	-75,277,662.32	-132,798,402.55
（一）、综合收益总额	-	-	33,011,106.41	33,011,106.41
（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）	-57,520,740.23	-	-108,288,768.73	-165,809,508.96
其中：1.基金申购款	10,894,963.80	-	21,840,327.07	32,735,290.87
2.基金赎	-68,415,704.03	-	-130,129,095.8	-198,544,799.83

回款			0	
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	217,746,697.77	-	457,116,350.97	674,863,048.74
项目	上年度可比期间 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	405,526,058.50	-	1,114,675,681.49	1,520,201,739.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	405,526,058.50	-	1,114,675,681.49	1,520,201,739.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,227,775.87	-	-214,767,706.42	-201,539,930.55
（一）、综合收益总额	-	-	-254,590,295.68	-254,590,295.68
（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）	13,227,775.87	-	39,822,589.26	53,050,365.13
其中：1.基金申购款	176,692,933.68	-	442,446,944.32	619,139,878.00
2.基金赎回款	-163,465,157.81	-	-402,624,355.06	-566,089,512.87
（三）、本期向基	-	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	418,753,834.37	-	899,907,975.07	1,318,661,809.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王琼慧	王敏	俞文涵
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

摩根健康品质生活混合型证券投资基金(原名为上投摩根健康品质生活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[2011]1753 号《关于核准上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金募集的批复》核准，由摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司，已于 2023 年 4 月 10 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根健康品质生活股票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 671,919,547.42 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(2012)第 11 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 2 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 672,073,525.19 份基金份额，其中认购资金利息折合 153,977.77 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 21 日公告后更名为上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金。

根据摩根基金管理(中国)有限公司 2023 年 4 月 12 日发布的《关于公司法定名称变更的公告》，

本基金管理人的中文法定名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理(中国)有限公司”。根据同一天发布的《摩根基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金自该日起更名为摩根健康品质生活混合型证券投资基金。

根据《关于上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》以及更新的《摩根健康品质生活混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，自 2022 年 3 月 10 日起，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根健康品质生活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 A 股股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产净值的 70%-95%，债券等固定收益类资产占基金资产净值的 0-30%，权证投资占基金资产净值的 0-3%，现金或到期日在一年期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。本基金将不低于 80%的股票资产投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的公司。本基金的业绩比较基准为：中证内地消费指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%。

根据基金管理人于 2025 年 5 月 8 日发布的《关于摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金费率及支付方式等相关事宜进行变更。自 2025 年 5 月 8 日起，变更后的《摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同》生效，变更前的《摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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》、《摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2025 年 5 月 7 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日(基金转型日前一日)止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 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会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

根据财税[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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证

券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a）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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b）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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c）对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金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。

d）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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e）对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2025 年 5 月 7 日
活期存款	154,861,161.34
等于：本金	154,812,739.39
加：应计利息	48,421.95

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	154,861,161.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 5 月 7 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		499,658,188.50	-	516,932,215.13	17,274,026.63
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		499,658,188.50	-	516,932,215.13	17,274,026.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

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

无余额。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 5 月 7 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	352.60
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	340,639.66
其中：交易所市场	340,639.66
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	182,630.05
合计	523,622.31

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

摩根健康品质生活混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	250,786,912.80	250,786,912.80
本期申购	988,785.74	988,785.74
本期赎回（以“-”号填列）	-39,036,865.83	-39,036,865.83
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	212,738,832.71	212,738,832.71

摩根健康品质生活混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,480,525.20	24,480,525.20
本期申购	9,906,178.06	9,906,178.06
本期赎回（以“-”号填列）	-29,378,838.20	-29,378,838.20
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	5,007,865.06	5,007,865.06

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

摩根健康品质生活混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	310,279,287.31	175,677,640.28	485,956,927.59
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	310,279,287.31	175,677,640.28	485,956,927.59
本期利润	-27,932,924.01	61,925,935.02	33,993,011.01
本期基金份额交易产生的变动数	-46,721,365.33	-26,387,874.97	-73,109,240.30
其中：基金申购款	1,199,557.76	712,604.05	1,912,161.81
基金赎回款	-47,920,923.09	-27,100,479.02	-75,021,402.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	235,624,997.97	211,215,700.33	446,840,698.30

摩根健康品质生活混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,410,943.51	17,026,142.19	46,437,085.70
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	29,410,943.51	17,026,142.19	46,437,085.70
本期利润	-1,611,107.54	629,202.94	-981,904.60
本期基金份额交易产生的变动数	-22,448,544.28	-12,730,984.15	-35,179,528.43
其中：基金申购款	11,786,887.74	8,141,277.52	19,928,165.26
基金赎回款	-34,235,432.02	-20,872,261.67	-55,107,693.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,351,291.69	4,924,360.98	10,275,652.67

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日
活期存款利息收入	113,608.38
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	1,056.63
其他	10,707.39
合计	125,372.40

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 2025年1月1日至2025年5月7日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-28,833,455.78
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	-28,833,455.78

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日
卖出股票成交总额	817,409,184.34
减：卖出股票成本总额	845,115,795.33
减：交易费用	1,126,844.79
买卖股票差价收入	-28,833,455.78

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

无。

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

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日
股票投资产生的股利收益	2,720,917.38
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	2,720,917.38

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日
1.交易性金融资产	62,555,137.96
——股票投资	62,555,137.96
——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	62,555,137.96

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日
基金赎回费收入	156,708.16
基金转换费收入	3,942.23
合计	160,650.39

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日
审计费用	20,876.26
信息披露费	41,753.79
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,981.08
账户维护费	9,000.00
合计	78,611.13

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行)	基金托管人、基金销售机构
摩根大通证券（中国）有限公司	基金管理人的实际控制人摩根大通公司(JPMorgan Chase &Co.)控制的公司，证券经纪商

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,045,243.79	10,650,944.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	206,537.69	684,417.73
应支付基金管理人的净管理费	2,838,706.10	9,966,527.17

注：2025 年 1 月 24 日之前，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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 × 1.5% / 当年天数。

2025 年 1 月 24 日（含）之后，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%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 × 1.2% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	507,540.65	1,775,157.47

注:2025 年 1 月 24 日之前,支付基金托管人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

2025 年 1 月 24 日（含）之后，支付基金托管人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	本期

方名称	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C	合计
摩根基金管理（中国）有限公司	-	32,793.07	32,793.07
合计	-	32,793.07	32,793.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C	合计
摩根基金管理（中国）有限公司	-	755,409.40	755,409.40
合计	-	755,409.40	755,409.40

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费＝前一日 C 类的基金资产净值 × 0.50%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日	
	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C

基金合同生效日（2012 年 2 月 1 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	49,435.08	-
报告期间申购/买入总份额	120,175.03	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	19,765.90	-
报告期末持有的基金份额	149,844.21	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0688%	-
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C
基金合同生效日（2012 年 2 月 1 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	59,896.68	-
报告期间申购/买入总份额	9,304.30	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	19,765.90	-
报告期末持有的基金份额	49,435.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0100%	-

注：上述基金管理人持有的份额包括基金管理人的高级管理人员、主要业务部门负责人、基金经理根据《基金管理公司绩效考核与薪酬管理指引》的要求，将一定比例的绩效薪酬购买本基金的部分。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 5 月 7 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
中国银行	154,861,161.34	113,608.38	108,728,272.38	184,918.50

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 5 月 7 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是主动投资的混合型基金，主要投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业和公司，属于主题类混合型基金，预期风险和收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基

金，属于较高风险、较高预期收益的基金产品。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信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业及公司，力争把握经济结构调整和消费升级所带来的投资机会。在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2025 年 5 月 7 日，本基金未持有债券投资(2024 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。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间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%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具

还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 5 月 7 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	154,861,161.34	-	-	-	154,861,161.34
结算备付金	1,413,261.95	-	-	-	1,413,261.95
存出保证金	464,816.07	-	-	-	464,816.07
交易性金融资产	-	-	-	516,932,215.13	516,932,215.13
应收申购款	-	-	-	41,620.42	41,620.42
应收清算款	-	-	-	3,404,059.43	3,404,059.43
资产总计	156,739,239.36	-	-	520,377,894.98	677,117,134.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	757,996.03	757,996.03
应付管理人报酬	-	-	-	819,539.69	819,539.69
应付托管费	-	-	-	136,589.96	136,589.96
应付销售服务费	-	-	-	16,337.61	16,337.61
其他负债	-	-	-	523,622.31	523,622.31
负债总计	-	-	-	2,254,085.60	2,254,085.60
利率敏感度缺口	156,739,239.36	-	-	518,123,809.38	674,863,048.74
上年度末 2024 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	337,786,112.51	-	-	-	337,786,112.51
结算备付金	2,524,951.32	-	-	-	2,524,951.32
存出保证金	460,403.20	-	-	-	460,403.20
交易性金融资产	-	-	-	680,643,097.43	680,643,097.43
应收清算款	-	-	-	63,497,328.34	63,497,328.34
应收申购款	-	-	-	116,964.74	116,964.74
资产总计	340,771,467.03	-	-	744,257,390.51	1,085,028,857.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	273,879,910.38	273,879,910.38
应付管理人报酬	-	-	-	1,329,220.41	1,329,220.41
应付托管费	-	-	-	221,536.73	221,536.73
应付销售服务费	-	-	-	92,639.39	92,639.39
其他负债	-	-	-	1,844,099.34	1,844,099.34
负债总计	-	-	-	277,367,406.25	277,367,406.25

利率敏感度缺口	340,771,467.03	-	-	-466,889,984.26	807,661,451.29

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 5 月 7 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024 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，采用“自上而下”的策略，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。本基金投资组合中股票资产占基金资产净值的 70%-95%,债券等固定收益类资产占基金资产净值的 0-30%,权证投资占基金资产净值的 0-3%,现金或到期日在一年期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。本基金将不低于 80%的股票资产投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的公司。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 2025 年 5 月 7 日		上年度末 2024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	516,932,215.13	76.60	680,643,097.43	84.27
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	516,932,215.13	76.60	680,643,097.43	84.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2025 年 5 月 7 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	1.业绩比较基准上升 5%	39,640,000.00	46,360,000.00
	2.业绩比较基准下降 5%	-39,640,000.00	-46,360,000.00

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 2025 年 5 月 7 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	516,932,215.13	680,643,097.43
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	516,932,215.13	680,643,097.43

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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 5 月 7 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 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（转型后）

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	627,501,889.22	81.82
	其中：股票	627,501,889.22	81.82
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	128,344,150.31	16.73
8	其他各项资产	11,126,525.66	1.45
9	合计	766,972,565.19	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 276,072,416.60 元，占期末净值比例为 37.46%。

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	16,549,674.54	2.25
B	采矿业	-	-
C	制造业	334,879,798.08	45.43
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	-	-
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	-	-
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	351,429,472.62	47.68

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	161,815,696.69	21.95
消费者常用品	25,183,699.88	3.42
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	12,922,240.31	1.75
电信服务	76,150,779.72	10.33
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	276,072,416.60	37.46

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	09988	阿里巴巴-W	647,200	64,805,501.59	8.79
2	600519	贵州茅台	45,200	63,710,304.00	8.64
3	01024	快手-W	840,800	48,536,386.55	6.59
4	002475	立讯精密	1,300,700	45,121,283.00	6.12
5	06862	海底捞	3,277,000	44,528,056.24	6.04
6	03690	美团-W	376,200	42,987,371.43	5.83
7	002568	百润股份	1,659,047	42,488,193.67	5.76
8	000333	美的集团	477,408	34,468,857.60	4.68
9	002594	比亚迪	86,495	28,708,555.45	3.90
10	00700	腾讯控股	60,200	27,614,393.17	3.75
11	600809	山西汾酒	144,000	25,400,160.00	3.45
12	02367	巨子生物	478,600	25,183,699.88	3.42
13	000568	泸州老窖	198,778	22,541,425.20	3.06
14	300979	华利集团	388,900	20,444,473.00	2.77
15	003021	兆威机电	175,430	18,972,754.50	2.57
16	603027	千禾味业	1,429,206	16,593,081.66	2.25
17	603477	巨星农牧	804,163	16,549,674.54	2.25
18	000596	古井贡酒	123,400	16,430,710.00	2.23
19	00981	中芯国际	317,000	12,922,240.31	1.75
20	02020	安踏体育	49,400	4,257,256.19	0.58
21	06181	老铺黄金	2,500	2,298,114.00	0.31
22	09992	泡泡玛特	7,800	1,896,381.79	0.26
23	00325	布鲁可	8,100	1,043,015.45	0.14

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	09988	阿里巴巴-W	69,497,237.58	9.43
2	600519	贵州茅台	64,296,391.00	8.72
3	000568	泸州老窖	58,465,382.00	7.93
4	06862	海底捞	47,593,661.29	6.46
5	03690	美团-W	46,002,639.62	6.24
6	01024	快手-W	39,253,423.51	5.33
7	00700	腾讯控股	27,878,092.64	3.78
8	600809	山西汾酒	27,096,992.00	3.68
9	02367	巨子生物	25,260,979.02	3.43
10	000596	古井贡酒	20,381,676.00	2.77
11	603027	千禾味业	16,702,304.85	2.27
12	002594	比亚迪	16,414,642.00	2.23
13	00981	中芯国际	11,712,106.93	1.59
14	600779	水井坊	6,539,234.88	0.89
15	002568	百润股份	6,156,258.00	0.84
16	02020	安踏体育	4,113,238.55	0.56
17	003021	兆威机电	3,156,612.00	0.43
18	09992	泡泡玛特	1,840,120.53	0.25
19	06181	老铺黄金	1,580,900.69	0.21
20	01579	颐海国际	1,436,851.05	0.19

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002050	三花智控	42,536,746.25	5.77
2	601689	拓普集团	41,476,973.07	5.63
3	002594	比亚迪	31,219,534.61	4.24
4	000568	泸州老窖	30,320,406.18	4.11
5	002384	东山精密	24,129,783.16	3.27
6	300394	天孚通信	22,039,326.74	2.99
7	603305	旭升集团	21,513,706.00	2.92
8	600660	福耀玻璃	20,586,409.00	2.79
9	688400	凌云光	19,984,847.29	2.71
10	603009	北特科技	19,196,234.00	2.60
11	600104	上汽集团	15,089,934.37	2.05

12	300570	太辰光	14,026,441.42	1.90
13	603728	鸣志电器	13,682,179.14	1.86
14	300476	胜宏科技	13,465,048.76	1.83
15	600779	水井坊	9,788,002.00	1.33
16	002003	伟星股份	7,951,337.00	1.08
17	600418	江淮汽车	7,943,609.96	1.08
18	002568	百润股份	7,623,880.53	1.03
19	000423	东阿阿胶	7,086,220.00	0.96
20	600661	昂立教育	6,760,027.00	0.92

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	499,146,502.58
卖出股票收入（成交）总额	382,261,265.78

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券

的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	526,863.38
2	应收清算款	9,782,482.04
3	应收股利	802,805.53
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,374.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,126,525.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§7 投资组合报告（转型前）

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	516,932,215.13	76.34
	其中：股票	516,932,215.13	76.34
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	156,274,423.29	23.08
8	其他各项资产	3,910,495.92	0.58
9	合计	677,117,134.34	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	16,404,925.20	2.43
B	采矿业	-	-
C	制造业	493,735,273.93	73.16
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	-	-
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	-	-
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	6,792,016.00	1.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	516,932,215.13	76.60

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	002568	百润股份	1,709,388	43,879,989.96	6.50
2	002594	比亚迪	122,028	43,832,457.60	6.50
3	002050	三花智控	1,553,500	41,851,290.00	6.20
4	002475	立讯精密	1,300,700	40,998,064.00	6.08

5	601689	拓普集团	777,100	40,758,895.00	6.04
6	000333	美的集团	477,408	35,500,058.88	5.26
7	002384	东山精密	819,224	21,881,473.04	3.24
8	603305	旭升集团	1,588,900	20,973,480.00	3.11
9	603009	北特科技	468,300	20,820,618.00	3.09
10	003021	兆威机电	162,309	20,783,667.45	3.08
11	600660	福耀玻璃	360,200	20,733,112.00	3.07
12	300979	华利集团	386,400	20,440,560.00	3.03
13	688400	凌云光	709,888	20,331,192.32	3.01
14	300394	天孚通信	283,409	20,190,057.16	2.99
15	603477	巨星农牧	804,163	16,404,925.20	2.43
16	600104	上汽集团	917,501	15,111,241.47	2.24
17	603728	鸣志电器	211,500	13,899,780.00	2.06
18	300570	太辰光	164,065	12,326,203.45	1.83
19	300476	胜宏科技	159,200	12,288,648.00	1.82
20	002003	伟星股份	724,100	8,319,909.00	1.23
21	600418	江淮汽车	204,548	7,404,637.60	1.10
22	000423	东阿阿胶	124,800	6,880,224.00	1.02
23	600661	昂立教育	655,600	6,792,016.00	1.01
24	600779	水井坊	97,100	4,529,715.00	0.67

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	002384	东山精密	39,008,266.00	4.83
2	002050	三花智控	38,605,589.00	4.78
3	601689	拓普集团	37,941,212.00	4.70
4	603009	北特科技	29,933,109.00	3.71
5	002475	立讯精密	28,692,844.20	3.55
6	300394	天孚通信	25,643,537.20	3.18
7	300570	太辰光	25,546,841.15	3.16
8	000157	中联重科	21,705,816.69	2.69
9	000425	徐工机械	21,626,385.00	2.68
10	600031	三一重工	21,625,468.00	2.68
11	300502	新易盛	21,468,698.68	2.66
12	600887	伊利股份	20,908,055.00	2.59
13	300979	华利集团	20,745,615.00	2.57
14	600519	贵州茅台	20,594,480.00	2.55
15	000596	古井贡酒	20,403,002.96	2.53
16	003021	兆威机电	19,685,074.20	2.44
17	603305	旭升集团	19,537,390.00	2.42
18	688400	凌云光	19,196,752.59	2.38

19	002594	比亚迪	16,847,399.00	2.09
20	002568	百润股份	15,809,009.64	1.96

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	000568	泸州老窖	80,723,100.04	9.99
2	000858	五 粮 液	74,274,070.70	9.20
3	600809	山西汾酒	70,181,270.95	8.69
4	603477	巨星农牧	65,449,844.45	8.10
5	600519	贵州茅台	56,758,502.64	7.03
6	002384	东山精密	49,862,510.51	6.17
7	000651	格力电器	42,942,116.54	5.32
8	002714	牧原股份	23,186,796.30	2.87
9	300750	宁德时代	22,890,801.00	2.83
10	000596	古井贡酒	22,782,512.69	2.82
11	600559	老白干酒	21,468,701.45	2.66
12	000425	徐工机械	21,370,275.00	2.65
13	600887	伊利股份	21,271,095.00	2.63
14	600031	三一重工	20,964,057.00	2.60
15	000157	中联重科	20,334,588.80	2.52
16	600197	伊力特	19,008,939.03	2.35
17	300502	新易盛	18,535,792.00	2.29
18	600600	青岛啤酒	18,505,908.11	2.29
19	002154	报 喜 鸟	15,829,788.88	1.96
20	601633	长城汽车	12,624,164.60	1.56

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	618,849,775.07
卖出股票收入（成交）总额	817,409,184.34

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	464,816.07
2	应收清算款	3,404,059.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,620.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,910,495.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
摩根健康品质生活混合 A	10,396	22,846.06	211,744,250.29	89.15%	25,763,410.32	10.85%
摩根健康品质生活混合 C	2,225	885.70	0.00	0.00%	1,970,692.88	100.00%
合计	12,621	18,974.59	211,744,250.29	88.42%	27,734,103.20	11.58%

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	摩根健康品质生活混合 A	340,556.82	0.1434
	摩根健康品质生活混合 C	7,134.02	0.3620
	合计	347,690.84	0.1452

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	摩根健康品质生活混合 A	0~10
	摩根健康品质生活混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	摩根健康品质生活混合 A	0
	摩根健康品质生活混合 C	0

	合计	0

§8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
摩根健康品质生活混合 A	10,702	19,878.42	186,145,998.43	87.50%	26,592,834.28	12.50%
摩根健康品质生活混合 C	4,068	1,231.04	0.00	0.00%	5,007,865.06	100.00%
合计	14,770	14,742.50	186,145,998.43	85.49%	31,600,699.34	14.51%

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	摩根健康品质生活混合 A	354,606.16	0.1667
	摩根健康品质生活混合 C	7,134.02	0.1425
	合计	361,740.18	0.1661

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	摩根健康品质生活混合 A	0~10
	摩根健康品质生活混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	摩根健康品质生活混合 A	0
	摩根健康品质生活混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C
基金合同生效日（2025 年 5 月 8 日）基金份额总额	212,738,832.71	5,007,865.06
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	39,674,380.82	320,881.55
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	14,905,552.92	3,358,053.73
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	237,507,660.61	1,970,692.88

§9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	摩根健康品质生活混合 A	摩根健康品质生活混合 C
基金合同生效日（2012 年 2 月 1 日）基金份额总额	672,073,525.19	-
本报告期期初基金份额总额	250,786,912.80	24,480,525.20
本报告期基金总申购份额	988,785.74	9,906,178.06
减：本报告期基金总赎回份额	39,036,865.83	29,378,838.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	212,738,832.71	5,007,865.06

§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，本基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会。本次基金份额持有人大会于 2025 年 5 月 7 日表决通过了《关于摩根健康品质生活混合型证券投资基金修改基金合同等法律文件有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。本次基金份额持有人大会决议生效后，本基金管理人根据基金份额持有人大会通过的议案及其方案说明修订了基金合同等法律文件。修订后的基金合同等法律文件于 2025 年 5 月 8 日起生效。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：无。

基金托管人：本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金根据基金份额持有人大会表决通过的议案及其方案说明修订了本基金的投资策略，重新界定与“健康品质生活主题”相关的行业的范围，并根据上述变更后的投资范围相应调整和补充本基金的投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

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

报告期内，管理人未受稽查或处罚，亦未发现管理人的高级管理人员受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

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(%)	
长江证券	2	280,012,356.20	31.77	122,062.89	33.08	-
中信证券	1	103,541,865.53	11.75	39,700.95	10.76	-
国盛证券	1	95,051,711.46	10.78	36,322.64	9.84	-
天风证券	1	71,254,014.29	8.08	28,976.89	7.85	-
浙商证券	2	62,319,700.7	7.07	27,168.06	7.36	-

		7				
摩根大通证券(中国)	1	50,050,344.92	5.68	19,237.17	5.21	-
广发证券	1	49,117,681.75	5.57	21,412.71	5.80	-
东方证券	2	38,140,254.96	4.33	16,625.05	4.51	-
财通证券	2	36,474,804.88	4.14	15,899.68	4.31	-
东吴证券	1	31,830,882.90	3.61	13,876.27	3.76	-
方正证券	1	30,320,406.18	3.44	13,216.84	3.58	-
华泰证券	1	30,095,454.52	3.41	13,118.55	3.56	-
中金公司	1	3,198,290.00	0.36	1,394.44	0.38	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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

2.证券公司的选择标准：

1）资本金雄厚，信誉良好。

2）财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。

3）合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

5）具备较完善的清算系统，能及时、高效地完成资金的结算交收。

6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3.证券公司的选择程序：

1）本基金管理人定期组织相关部门依据证券公司的选择标准对候选券商进行评估，确定选用的券

商。

2）本基金管理人与券商签订协议，并通知基金托管人。

4.本基金本年度无新增席位，无注销席位。

5.《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日期间，本公司旗下管理基金的股票交易佣金费率符合法规要求，即被动股票型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率，其他类型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。市场平均股票交易佣金费率由中国证券业协会定期测算并向行业机构通报。

10.7.2 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(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

上海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

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(%)	
浙商证券	2	268,416,567.79	18.69	117,001.51	18.69	-
长江证券	2	254,771,254.53	17.74	111,057.11	17.74	-
方正证券	1	231,741,970.18	16.14	101,016.61	16.14	-
中泰证券	1	179,156,479.61	12.47	78,094.68	12.47	-
华泰证券	1	148,941,335.92	10.37	64,923.48	10.37	-
天风证券	1	96,837,576.71	6.74	42,215.27	6.74	-
中金国际	1	73,728,794.04	5.13	32,137.60	5.13	-
财通证券	2	44,424,080.75	3.09	19,364.82	3.09	-
东方证券	2	40,551,611.28	2.82	17,675.26	2.82	-
国盛证券	1	27,019,666.13	1.88	11,778.63	1.88	-
广发证券	1	24,461,886.94	1.70	10,659.21	1.70	-
招商证券	2	21,056,795.24	1.47	9,178.78	1.47	-
中信证券	1	16,329,801.29	1.14	7,117.57	1.14	-
东吴证券	1	6,724,082.00	0.47	2,933.08	0.47	-
华西证券	2	2,097,057.00	0.15	914.04	0.15	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-

证券(中国)						
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

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

2.证券公司的选择标准：

1）资本金雄厚，信誉良好。

2）财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。

3）合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

5）具备较完善的清算系统，能及时、高效地完成资金的结算交收。

6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3.证券公司的选择程序：

1）本基金管理人定期组织相关部门依据证券公司的选择标准对候选券商进行评估，确定选用的券商。

2）本基金管理人与券商签订协议，并通知基金托管人。

4. 本基金本年度无新增席位，无注销席位。

5.《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 07 日期间，本公司旗下管理基金的股票交易佣金费率符合法规要求，即被动股票型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率，其他类型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。市场平均股票交易佣金费率由中国证券业协会定期测算并向行业机构通报。

10.7.2 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(%)

浙商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

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	关于摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2025 年 5 月 8 日
2	摩根基金管理（中国）有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	同上	2025 年 6 月 7 日

10.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2025 年 5 月 8 日
2	摩根基金管理（中国）有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	同上	2025 年 6 月 7 日

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	摩根基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同份额类别相互转换业务的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2025 年 3 月 13 日
2	关于以通讯开会方式召开摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	同上	2025 年 4 月 3 日
3	关于以通讯开会方式召开摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	同上	2025 年 4 月 7 日
4	关于以通讯开会方式召开摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	同上	2025 年 4 月 8 日
5	摩根基金管理（中国）有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	同上	2025 年 4 月 9 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250101-20250630	57,960,892.57	39,499,341.67	7,400,000.00	90,060,234.24	37.61%
	2	20250101-20250622	55,966,132.67	0.00	10,000,000.00	45,966,132.67	19.19%
产品特有风险							
本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一） 中国证监会批准本基金募集的文件

（二） 摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同

（三） 摩根健康品质生活混合型证券投资基金托管协议

（四） 法律意见书

（五） 基金管理人业务资格批件、营业执照

（六） 基金托管人业务资格批件、营业执照

（七） 摩根基金管理(中国)有限公司开放式基金业务规则

（八） 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根基金管理（中国）有限公司

2025 年 8 月 29 日