

# 摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

§1 重要提示

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

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

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                           |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 大摩健康产业混合                                                                                                                                                  |
| 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                                                                                                                                           |
| 报告期末基金份额总额 | 781,434,055.97 份                                                                                                                                          |
| 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       | 1、资产配置策略<br>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。<br>2、股票投资策略<br>股票组合的构建主要通过对健康产业子行业的灵活配 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>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 and 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 | 中证医药卫生指数收益率*85%+中债-综合财富(1年以下)指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 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。 |                    |
| 基金管理人           | 摩根士丹利基金管理（中国）有限公司        |                    |
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司             |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 大摩健康产业混合 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 | 734, 974, 226. 11 份      | 46, 459, 829. 86 份 |

注：自 2026 年 9 月 22 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%”调整为“中证医药卫生指数收益率\*85%+中债-综合财富(1 年以下)指数收益率\*10%+活期存款基准利率\*5%”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日） |                  |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
|                 | 大摩健康产业混合 A                          | 大摩健康产业混合 C       |
| 1. 本期已实现收益      | 92, 547, 196. 26                    | 5, 875, 011. 30  |
| 2. 本期利润         | 281, 675, 921. 89                   | 18, 239, 314. 60 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 3703                             | 0. 3610          |
| 4. 期末基金资产净值     | 1, 519, 240, 971. 68                | 94, 218, 972. 70 |
| 5. 期末基金份额净值     | 2. 067                              | 2. 028           |

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大摩健康产业混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|
|----|--------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|

|                |         |       |        | 准差④   |         |       |
|----------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三个月          | 21.23%  | 2.78% | -6.39% | 1.07% | 27.62%  | 1.71% |
| 过去六个月          | 25.12%  | 2.39% | 2.62%  | 1.05% | 22.50%  | 1.34% |
| 过去一年           | 2.89%   | 2.02% | -0.42% | 0.92% | 3.31%   | 1.10% |
| 过去三年           | 0.44%   | 1.68% | 21.71% | 0.92% | -21.27% | 0.76% |
| 过去五年           | -45.73% | 1.74% | -0.69% | 0.90% | -45.04% | 0.84% |
| 过去七年           | 36.35%  | 1.80% | 23.30% | 0.94% | 13.05%  | 0.86% |
| 过去十年           | 103.65% | 1.68% | 44.60% | 0.93% | 59.05%  | 0.75% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 106.70% | 1.66% | 48.70% | 0.92% | 58.00%  | 0.74% |

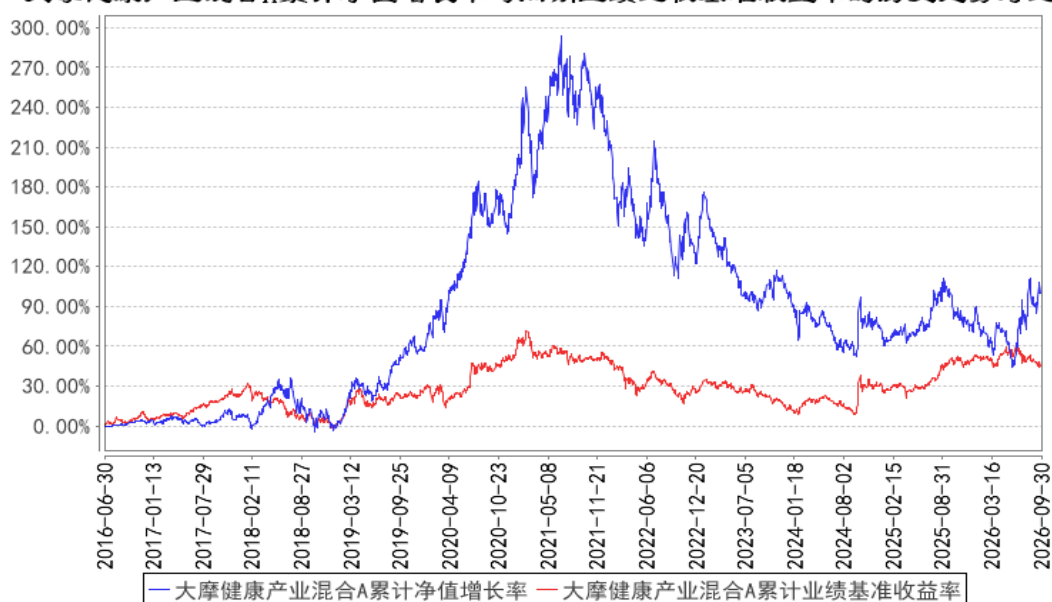
大摩健康产业混合 C

| 阶段             | 净值增长率①  | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 21.15%  | 2.78%         | -6.39%         | 1.07%                 | 27.54%  | 1.71% |
| 过去六个月          | 24.88%  | 2.38%         | 2.62%          | 1.05%                 | 22.26%  | 1.33% |
| 过去一年           | 2.48%   | 2.01%         | -0.42%         | 0.92%                 | 2.90%   | 1.09% |
| 过去三年           | -0.78%  | 1.68%         | 21.71%         | 0.92%                 | -22.49% | 0.76% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -41.22% | 1.74%         | -1.26%         | 0.90%                 | -39.96% | 0.84% |

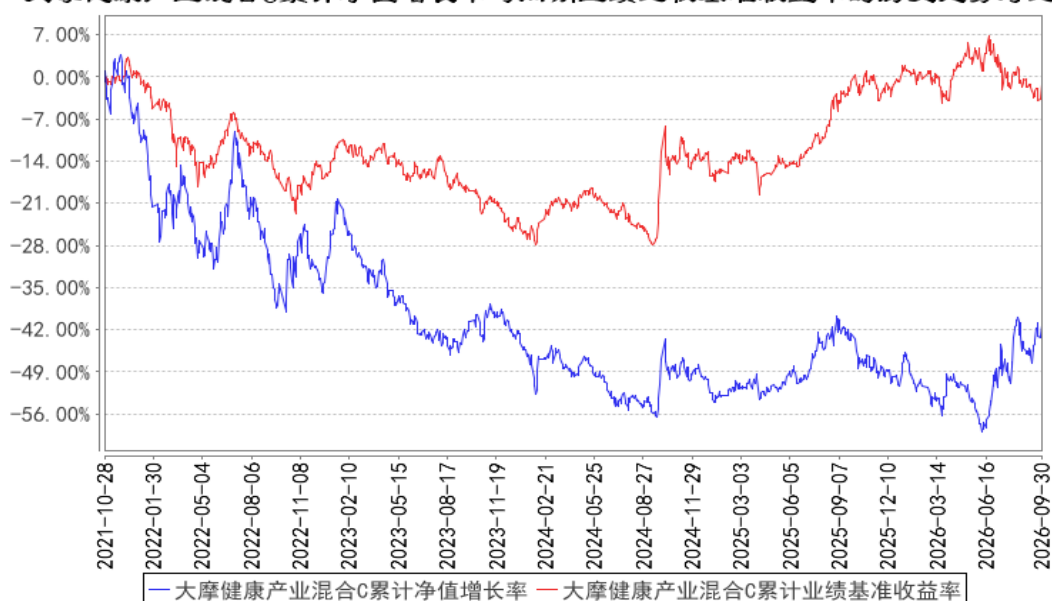
注：本基金从 2021 年 10 月 28 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2021 年 10 月 28 日起存续。

### 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. 自 2026 年 9 月 22 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%”调整为“中证医药卫生指数收益率\*85%+中债-综合财富（1 年以下）指数收益率\*10%+活期存款基准利率\*5%”。基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于健康产业股票，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，力争实现基金资产的保值增值。综合考虑基准指数与产品定位、投资风格与主题库的匹配度，同时

兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数主题界定、市值覆盖、行业与个股分布等，将股票资产中的 A 股股票部分的指数由沪深 300 指数调整为中证医药卫生指数。调整后的新业绩比较基准中，中证医药卫生指数由中证指数有限公司编制并发布，由中证 800 指数样本股中的全部医药卫生行业成份股编制而成，综合反映了 A 股市场的医药卫生行业整体表现，更适合作为股票部分的业绩比较基准要素。在债券指数的选取方面，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，债券部分的指数选取中证综合债指数调整为中债-综合财富（1 年以下）指数，中债-综合财富（1 年以下）指数由在境内公开发行且上市流通的国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等成份券组成，成份券待偿期在 1 年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现。本基金对债券的配置以流动性管理为主，整体组合久期主要为短久期，中债-综合财富（1 年以下）指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。另外，新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。基金业绩比较收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务           | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----|--------------|-----------------|------|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |              | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 王大鹏 | 研究管理部总监、基金经理 | 2016 年 6 月 30 日 | -    | 18 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 月至 2024 年 12 月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，2026 年 1 月起担任摩根士丹利港股通多元成长混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为公司公告的解聘日期；非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别为公司公告的聘任日期和解聘日期。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，权益市场整体表现较弱。国内经济相对稳健，出口延续良好表现，投资、消费等有待复苏；外围看，美以伊冲突反复，美国通胀及加息预期升温，美债收益率持续向上突破。权益市场表现分化，风格切换明显。市场对 AI 资本开支持续性的担忧加剧，叠加 AI 板块上半年涨幅较大、机构持仓拥挤度较高，电子、通信、建材、机械等 AI 相关细分领域跌幅较大；与之相反，红利相关板块受到青睐，银行、煤炭等行业领涨；社零等数据显示内需仍处于筑底阶段，但二季度末机构持仓处于历史极低水平，消费板块受益于板块的轮动切换。医药、消费者服务、商贸零售、食品饮料涨幅靠前，纺服、家电等行业亦录得正收益。

本基金的投资仍然以健康产业中的医药板块为主，三季度中证医药指数上涨 8.97%。根据细分行业景气趋势变化，三季度本基金进一步增加了对 CXO（医疗研发外包，下同）板块的配置。

展望后续行情，我们看好 CXO、创新药等方向。CXO 领域，外需及内需订单均延续良好增长趋势，头部公司多数上调 26 年业绩展望，显示出行业景气度持续超预期，是医药板块内部基本面最好的细分领域之一，此外 AI 技术日新月异，AI 在制药领域的应用不断突破，跨国药企及海外 AI 巨头纷纷加码 AI 制药，有望显著放大前端研发分子池，长期看整个 CXO 链条有望显著受益，强化了行业长期增长的潜力。创新药领域，政策持续支持创新药发展，众多创新药品种迎来医保放量期，有望催化创新药企业绩持续向上，加速完成创新转型；与此同时，创新药企业国际化进入新的阶段，在跨国药企面临专利悬崖的背景下，高质量对外授权持续落地，交易金额及占全球比重不断创新高，在全球创新产业地位提升，有望打开海外更为广阔的成长空间。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 2.067 元，份额累计净值为 2.067 元，基金份额净值增长率为 21.23%，同期业绩比较基准收益率为-6.39%；C 类份额净值为 2.028 元，份额累计净值为 2.028 元，C 类基金份额净值增长率为 21.15%，同期业绩比较基准收益率为-6.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目   | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资 | 1,348,994,510.55 | 83.34        |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：股票             | 1,348,994,510.55 | 83.34  |
| 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      | 268,916,604.32   | 16.61  |
| 8 | 其他资产              | 778,699.05       | 0.05   |
| 9 | 合计                | 1,618,689,813.92 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —                | —            |
| B  | 采矿业              | 3,390.75         | 0.00         |
| C  | 制造业              | 597,668,928.60   | 37.04        |
| 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  | 22,413.48        | 0.00         |
| 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       | 742,125,261.72   | 46.00        |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 9,174,516.00     | 0.57         |
| 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               | 1,348,994,510.55 | 83.61        |

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 603259 | 药明康德 | 961,400   | 160,880,676.00 | 9.97         |
| 2  | 002821 | 凯莱英  | 762,353   | 143,795,022.86 | 8.91         |
| 3  | 300759 | 康龙化成 | 2,566,260 | 115,404,712.20 | 7.15         |
| 4  | 300347 | 泰格医药 | 1,958,186 | 114,358,062.40 | 7.09         |
| 5  | 000739 | 普洛药业 | 3,525,800 | 97,805,692.00  | 6.06         |
| 6  | 688710 | 益诺思  | 765,600   | 80,541,120.00  | 4.99         |
| 7  | 688382 | 益方生物 | 4,000,497 | 76,289,477.79  | 4.73         |
| 8  | 688235 | 百济神州 | 243,099   | 64,277,806.59  | 3.98         |
| 9  | 688621 | 阳光诺和 | 895,121   | 63,553,591.00  | 3.94         |
| 10 | 688073 | 毕得医药 | 687,400   | 52,654,840.00  | 3.26         |

**5.4 报告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。

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

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

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金基金合同的规定，本基金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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 426,803.86 |
| 2  | 应收证券清算款 | —          |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | 351,895.19 |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 其他      | —          |
| 8  | 合计      | 778,699.05 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 大摩健康产业混合 A     | 大摩健康产业混合 C    |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 787,738,074.57 | 53,233,800.22 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 27,263,582.34  | 24,932,252.72 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 80,027,430.80  | 31,706,223.08 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 734,974,226.11 | 46,459,829.86 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：截至本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，还可以通过基金管理人网站查阅或下载。

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

2026 年 10 月 26 日