

摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	44
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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 本报告期投资基金情况	45
7.13 投资组合报告附注	45
8 基金份额持有人信息	46

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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的情况	46
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	47
9	开放式基金份额变动	47
10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8	其他重大事件	49
11	影响投资者决策的其他重要信息	49
12	备查文件目录	50
12.1	备查文件目录	50
12.2	存放地点	50
12.3	查阅方式	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金	
基金简称	摩根世代趋势混合发起式	
基金主代码	018430	
交易代码	018430	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 22 日	
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,956,109.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	摩根世代趋势混合发起式 A	摩根世代趋势混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	018430	018431
报告期末下属分级基金的份额总额	12,235,691.90 份	720,417.37 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过长期追踪中国人口结构变化的大趋势，识别受益其中的多个明确产业子趋势，自下而上精选产业链中最有竞争力优势的个股，基于严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>人口作为经济社会发展的基本要素和动力，其结构的变化将影响长期经济走势和增长方式。本基金将持续关注中国人口结构中年轻代，中年代，年长代的世代趋势变化，以其年龄结构，财富增长，知识结构，行为和消费理念的深度研究为线索，力争前瞻性地识别多个明确的长期产业发展趋势，并聚焦产业链分析，投资到具有长期竞争壁垒的优质企业。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，结合股票、债券等各类资产风险收益特征，确定合适的资产配置比例。本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例，动态优化投资组合。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>基金管理人依托本公司研究平台，基于对上市公司系统、全面、细致的基本面研究，重点投资于受益于上述世代趋势发展的优势产业链中最具有竞争力的个股构建股票投资组合。深度研究并长期追踪上述符合世代趋势的行业中其用户年龄结构、财富积累水平、不同年龄段人群的消费行为及消费理念的变化趋势，识别受益产业及具备稀缺投资价值的产业链环节，捕</p>

	<p>捉推动世代趋势变化的长期投资机会。在具体操作上，综合运用定量分析与定性分析的手段，获取个股的超额收益。</p> <p>3、港股投资策略 本基金可通过港股通机制投资于香港股票市场。对于港股投资，本基金将主要关注港股中受益于中国人口结构变化大趋势及子趋势的产业链，自下而上精选产业链中最有竞争力优势的个股，在具体操作上，综合运用定量分析与定性分析的手段，获取个股的超额收益；于此同时结合宏观基本面，包含资金流向等对香港上市公司的投资价值进行综合判断。</p> <p>4、其他投资策略包括债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、股票期权投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*15%+银行活期存款利率（税后）*15%
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。本基金若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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邹树波	张姗
	联系电话	021-38794888	400-61-95555
	电子邮箱	services@jpmamc.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-4888	400-61-95555
传真		021-20628400	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		王琼慧	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根基金管理（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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024年1月1日至2024年6月30日）	
	摩根世代趋势混合发起式 A	摩根世代趋势混合发起式 C
本期已实现收益	-2,447,138.46	-149,849.28
本期利润	-2,118,289.74	-134,513.10
加权平均基金份额本期利润	-0.1702	-0.1788
本期加权平均净值利润率	-20.17%	-21.25%
本期基金份额净值增长率	-18.00%	-18.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	摩根世代趋势混合发起式 A	摩根世代趋势混合发起式 C
期末可供分配利润	-2,813,592.01	-168,458.19
期末可供分配基金份额利润	-0.2299	-0.2338
期末基金资产净值	9,445,858.61	553,314.23
期末基金份额净值	0.7720	0.7680
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	摩根世代趋势混合发起式 A	摩根世代趋势混合发起式 C
基金份额累计净值增长率	-22.80%	-23.20%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

摩根世代趋势混合发起式 A

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	-4.96%	1.04%	-3.23%	0.44%	-1.73%	0.60%
过去三个月	-8.28%	0.86%	-1.09%	0.68%	-7.19%	0.18%
过去六个月	-18.00%	0.99%	-0.26%	0.85%	-17.74%	0.14%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	-22.80%	0.84%	-6.11%	0.78%	-16.69%	0.06%

摩根世代趋势混合发起式 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	-5.01%	1.04%	-3.23%	0.44%	-1.78%	0.60%
过去三个月	-8.42%	0.85%	-1.09%	0.68%	-7.33%	0.17%
过去六个月	-18.25%	0.99%	-0.26%	0.85%	-17.99%	0.14%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	-23.20%	0.84%	-6.11%	0.78%	-17.09%	0.06%

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

摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023 年 8 月 22 日至 2024 年 6 月 30 日)

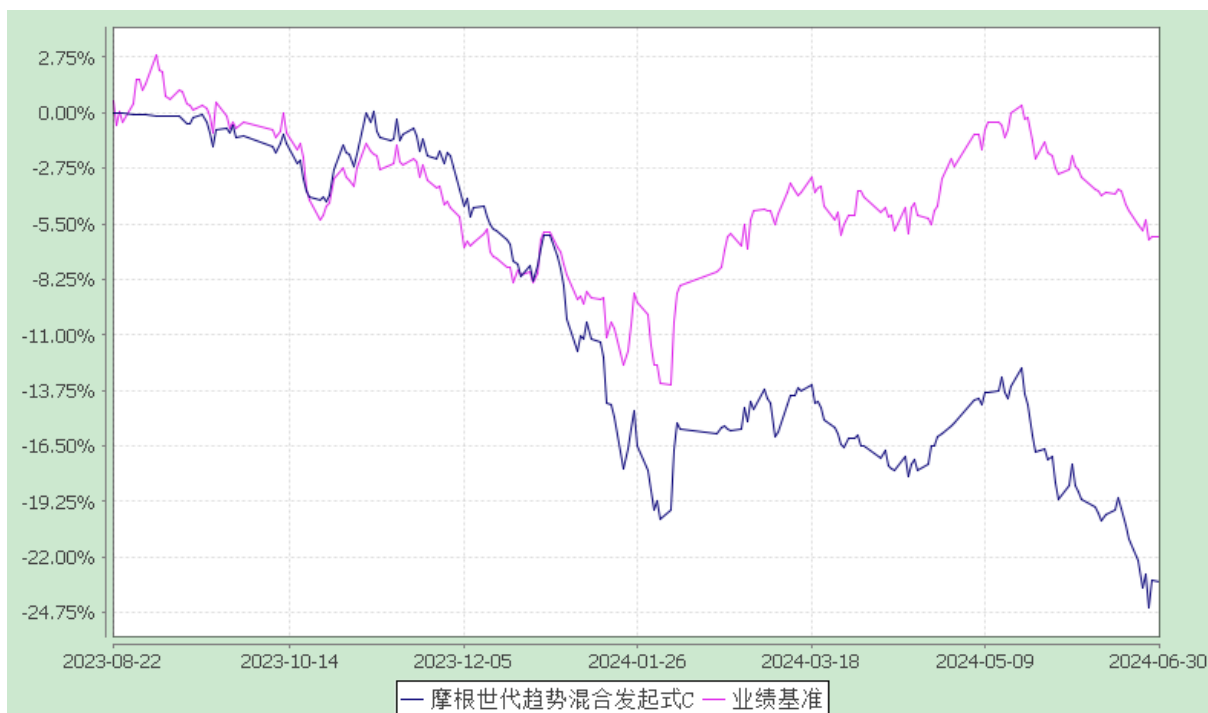
摩根世代趋势混合发起式 A



注：本基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

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。

摩根世代趋势混合发起式 C



注：本基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

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 2024 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有九十八只，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、摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、摩根行业睿选股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、摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、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、摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金、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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
方钰涵	本基金基金经理	2023-08-22	2024-06-18	11 年	方钰涵女士曾任兴业证券资产管理有限公司研究员, 国泰基金管理有限公司研究员。2015 年 6 月起加入摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司), 历任行业专家、基金经理, 现任高级基金经理。
赵隆隆	本基金基金经理	2024-05-06	-	15 年	赵隆隆先生曾任上海申银万国证券研究所有限公司制造业研究部资深高级分析师。2016 年 5 月起加入摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司), 历任行业专家、行业专家兼研究组长、行业专家兼研究组长/基金经理助理, 现任基金经理。

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 方钰涵女士为本基金首任基金经理, 其任职日期指本基金基金合同生效之日。

3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内, 基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为, 勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。除以下情况外, 基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制, 基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求: 本基金曾出现个别由于市场原因等基金管理人之外的因素引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形, 但已在规定时间内调整完毕。

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, 严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动, 通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析, 以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动, 本公司执行集中交易制度, 确保不同投资组合在买卖同一证券时, 按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量; 对于银行间市场投资活动, 本公

司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，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

摩根世代趋势基金旨在中国人口结构发生趋势性变化的背景下，以年轻代、中年代、年长代趋势为视角，前瞻性地挖掘趋势投资机会，并识别受益产业及具备稀缺投资价值的产业链环节，捕捉推动世代趋势变化的长期投资机会。

我们认为，在老龄化、社会保障制度和医疗制度改革的背景下，医疗服务和养老金融的需求不断提升。在科技日新月异的发展过程中，AI（人工智能）已在宏观经济各大领域赋能方面产生了积极影响。在报告期内，本基金二季度在科技新技术领域加大了配置比例，特别是在 AI 全球产业链中中国的优势产业进行了超配。另外，基金对 A 股、港股市场中的高股息标的也有所布局，以降低整体组合的波动率。本基金重点配置了通信、电子、电力设备、有色金属、医药等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根世代趋势 A 份额净值增长率为:-18.00%，同期业绩比较基准收益率为:-0.26%

摩根世代趋势 C 份额净值增长率为:-18.25%，同期业绩比较基准收益率为:-0.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金将继续挖掘世代趋势变化下的长期机会，结合宏观经济动能换挡，研究不同世代年龄结构、财富积累水平、知识结构储备、行为及消费理念在目前的经济周期对各个产业所产生的直接或间接影响，从而发掘长期投资机会。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：		-	-
货币资金		1,150,116.13	4,485,100.97
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	9,039,084.40	8,251,029.36
其中：股票投资		9,039,084.40	8,251,029.36
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	-	-
应收清算款		-	61,521.11
应收股利		3,200.00	-
应收申购款		515.67	1,275.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		10,192,916.20	12,798,927.42
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款	6.4.7.3	-	-
应付清算款		83,562.59	22,232.45
应付赎回款		1.51	20,323.12
应付管理人报酬		12,831.35	16,391.21
应付托管费		2,138.54	2,731.83
应付销售服务费		290.83	489.17
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	6.4.7.6	94,918.54	110,001.16
负债合计		193,743.36	172,168.94
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	12,956,109.27	13,412,773.71
未分配利润	6.4.7.8	-2,956,936.43	-786,015.23
净资产合计		9,999,172.84	12,626,758.48
负债和净资产总计		10,192,916.20	12,798,927.42

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日,基金份额总额:12,956,109.27 份,其中:

A 类,基金份额净值:0.7720 元,基金份额:12,235,691.90 份,

C 类,基金份额净值:0.7680 元,基金份额:720,417.37 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,138,476.01
1.利息收入		5,817.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,817.86
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）		-2,489,264.71
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,566,639.26
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	77,374.55
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	344,184.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	785.94
减：二、营业总支出		114,326.83

1. 管理人报酬		83,006.99
2. 托管费		13,834.48
3. 销售服务费		1,884.93
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		-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.16	15,600.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,252,802.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,252,802.84
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-2,252,802.84

6.3 净资产变动表

会计主体：摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	13,412,773.71	-	-786,015.23	12,626,758.48
二、本期期初净资产	13,412,773.71	-	-786,015.23	12,626,758.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-456,664.44	-	-2,170,921.20	-2,627,585.64
（一）、综合收益总额	-	-	-2,252,802.84	-2,252,802.84
（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）	-456,664.44	-	81,881.64	-374,782.80
其中：1. 基金申购款	186,003.90	-	-28,565.19	157,438.71
2. 基金赎回	-642,668.34	-	110,446.83	-532,221.51

款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	12,956,109.27	-	-2,956,936.43	9,999,172.84

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：

基金管理人负责人：王琼慧，主管会计工作负责人：王敏，会计机构负责人：俞文涵

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金(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[2023]303 号《关于准予上投摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册，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《摩根世代趋势混合型发起式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 14,129,041.05 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(2023)第 0435 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 8 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 14,130,141.15 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,100.10 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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”。

本基金为发起式基金，发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 10,000,333.33 元，且发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持期限不少于 3 年。

根据《摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时，收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，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，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，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《摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、公开发行的次级债、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、证券公司短期公司债等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、股票期权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(须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%；其中，港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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 800 指数收益率 X 70%+中证港股通综合指数收益率 X 15%+银行活期存款利率(税后) X 15%。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司于 2024 年 8 月 29 日批准报出。

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》、《摩根世代趋势混合型发起式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 2024 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生

的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或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。基金通过沪港通或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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	81,844.11
等于: 本金	81,833.78
加: 应计利息	10.33
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
其他存款	1,068,272.02
等于: 本金	1,068,152.88

加：应计利息	119.14
合计	1,150,116.13

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	9,038,926.70	-	9,039,084.40	157.70
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	9,038,926.70	-	9,039,084.40	157.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-

其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,918.54
合计	94,918.54

6.4.7.7 实收基金

摩根世代趋势混合发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	12,590,010.41	12,590,010.41
本期申购	14,457.75	14,457.75
本期赎回（以“-”号填列）	-368,776.26	-368,776.26
本期末	12,235,691.90	12,235,691.90

摩根世代趋势混合发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	822,763.30	822,763.30
本期申购	171,546.15	171,546.15
本期赎回（以“-”号填列）	-273,892.08	-273,892.08
本期末	720,417.37	720,417.37

6.4.7.8 未分配利润

摩根世代趋势混合发起式 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-420,461.64	-315,752.10	-736,213.74
本期期初	-420,461.64	-315,752.10	-736,213.74
本期利润	-2,447,138.46	328,848.72	-2,118,289.74
本期基金份额交易产生的	54,008.09	10,662.10	64,670.19

变动数			
其中：基金申购款	-932.39	-1,064.64	-1,997.03
基金赎回款	54,940.48	11,726.74	66,667.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,813,592.01	23,758.72	-2,789,833.29

摩根世代趋势混合发起式 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-29,200.65	-20,600.84	-49,801.49
本期期初	-29,200.65	-20,600.84	-49,801.49
本期利润	-149,849.28	15,336.18	-134,513.10
本期基金份额交易产生的变动数	10,591.74	6,619.71	17,211.45
其中：基金申购款	-22,625.57	-3,942.59	-26,568.16
基金赎回款	33,217.31	10,562.30	43,779.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-168,458.19	1,355.05	-167,103.14

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	625.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,191.83
结算备付金利息收入	-
其他	0.29
合计	5,817.86

注：其他存款利息收入为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	21,155,661.26
减：卖出股票成本总额	23,652,372.21
减：交易费用	69,928.31
买卖股票差价收入	-2,566,639.26

6.4.7.11 债券投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	77,374.55
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	77,374.55

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	344,184.90
——股票投资	344,184.90
——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	344,184.90

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	759.40
转换费收入	26.54
合计	785.94

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	56.89
银行汇划费	625.00
合计	15,600.43

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

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
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金代销机构

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

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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 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	83,006.99
其中：支付销售机构的客户维护费	9,728.35
应支付基金管理人的净管理费	73,278.64

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,834.48

注：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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	摩根世代趋势混合发起式 A	摩根世代趋势混合发起式 C	合计
招商银行	-	225.85	225.85
摩根基金管理(中国)有限公司	-	1.32	1.32
合计	-	227.17	227.17

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 0.60% 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 $\times 0.60\%$ / 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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	摩根世代趋势混合发起式A	摩根世代趋势混合发起式C
报告期初持有的基金份额	10,000,333.33	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,333.33	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	77.19%	-

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	81,844.11	625.74

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

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（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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长期追踪中国人口结构变化的大趋势，识别受益其中的多个明确产业子

趋势，自下而上精选产业链中最有竞争力优势的个股，基于严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。

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。本基金的银行存款存

放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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。

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,150,116.13	-	-	-	1,150,116.13
交易性金融资产	-	-	-	9,039,084.40	9,039,084.40
应收股利	-	-	-	3,200.00	3,200.00
应收申购款	-	-	-	515.67	515.67
资产总计	1,150,116.13	-	-	9,042,800.07	10,192,916.20
负债					
应付清算款	-	-	-	83,562.59	83,562.59
应付赎回款	-	-	-	1.51	1.51
应付管理人报酬	-	-	-	12,831.35	12,831.35
应付托管费	-	-	-	2,138.54	2,138.54
应付销售服务费	-	-	-	290.83	290.83
其他负债	-	-	-	94,918.54	94,918.54
负债总计	-	-	-	193,743.36	193,743.36
利率敏感度 缺口	1,150,116.13	-	-	8,849,056.71	9,999,172.84
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	4,485,100.97	-	-	-	4,485,100.97
交易性金融 资产	-	-	-	8,251,029.36	8,251,029.36
应收清算款	-	-	-	61,521.11	61,521.11
应收申购款	-	-	-	1,275.98	1,275.98
资产总计	4,485,100.97	-	-	8,313,826.45	12,798,927.42
负债					
应付清算款	-	-	-	22,232.45	22,232.45
应付赎回款	-	-	-	20,323.12	20,323.12
应付管理人 报酬	-	-	-	16,391.21	16,391.21
应付托管费	-	-	-	2,731.83	2,731.83
应付销售服 务费	-	-	-	489.17	489.17
其他负债	-	-	-	110,001.16	110,001.16
负债总计	-	-	-	172,168.94	172,168.94
利率敏感 度缺口	4,485,100.97	-	-	8,141,657.51	12,626,758.48

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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，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 2024年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资产	-	1,816,060.00	1,816,060.00
应收股利	-	3,200.00	3,200.00
资产合计	-	1,819,260.00	1,819,260.00
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	-	1,819,260.00	1,819,260.00
项目	上年度末 2023年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资产	-	2,282,014.00	2,282,014.00
资产合计	-	2,282,014.00	2,282,014.00
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	-	2,282,014.00	2,282,014.00

额			
---	--	--	--

6.4.13.4.2 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：人民币万元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	增加约 9	增加约 11
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 9	减少约 11

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 60%-95%；其中，港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,039,084.40	90.40	8,251,029.36	65.35
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	9,039,084.40	90.40	8,251,029.36	65.35

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除市场利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：人民币万元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 35	增加约 18
	2.业绩比较基准下降 5%	减少约 35	减少约 18

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	9,039,084.40	8,251,029.36
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	9,039,084.40	8,251,029.36

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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

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

1	权益投资	9,039,084.40	88.68
	其中：股票	9,039,084.40	88.68
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	1,150,116.13	11.28
8	其他各项资产	3,715.67	0.04
9	合计	10,192,916.20	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 1,816,060.00 元,占期末净值比例为 18.16%。

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

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	139,520.00	1.40
B	采矿业	573,527.00	5.74
C	制造业	6,060,952.76	60.61
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	292,044.90	2.92
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	156,979.74	1.57

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	7,223,024.40	72.24

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（%）
A 基础材料	270,720.00	2.71
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	216,000.00	2.16
D 能源	265,720.00	2.66
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	141,376.00	1.41
I 电信服务	729,844.00	7.30
J 公用事业	192,400.00	1.92
K 房地产	-	-
合计	1,816,060.00	18.16

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	占基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	17,400.00	305,718.00	3.06
1	02899	紫金矿业	18,000.00	270,720.00	2.71
2	601567	三星医疗	9,100.00	318,500.00	3.19
3	00941	中国移动	4,500.00	316,260.00	3.16
4	000400	许继电气	8,800.00	302,808.00	3.03
5	300014	亿纬锂能	7,500.00	299,400.00	2.99
6	601179	中国西电	37,000.00	297,480.00	2.98
7	688256	寒武纪	1,470.00	292,044.90	2.92
8	300760	迈瑞医疗	1,000.00	290,910.00	2.91
9	601138	工业富联	10,600.00	290,440.00	2.90
10	002938	鹏鼎控股	7,300.00	290,248.00	2.90

11	300757	罗博特科	3,300.00	288,255.00	2.88
12	300750	宁德时代	1,600.00	288,048.00	2.88
13	002463	沪电股份	7,800.00	284,700.00	2.85
14	300476	胜宏科技	8,800.00	283,888.00	2.84
15	002422	科伦药业	9,300.00	282,069.00	2.82
16	688097	博众精工	13,217.00	281,257.76	2.81
17	002922	伊戈尔	12,800.00	279,808.00	2.80
18	300308	中际旭创	2,000.00	275,760.00	2.76
19	00700	腾讯控股	800.00	271,904.00	2.72
20	603979	金诚信	5,300.00	267,809.00	2.68
21	00883	中国海洋石油	13,000.00	265,720.00	2.66
22	001301	尚太科技	5,500.00	237,710.00	2.38
23	600312	平高电气	12,000.00	233,400.00	2.33
24	06969	思摩尔国际	25,000.00	216,000.00	2.16
25	603606	东方电缆	4,400.00	214,764.00	2.15
26	300502	新易盛	2,000.00	211,100.00	2.11
27	002475	立讯精密	5,200.00	204,412.00	2.04
28	600584	长电科技	6,400.00	202,944.00	2.03
29	02380	中国电力	52,000.00	192,400.00	1.92
30	000922	佳电股份	13,300.00	158,669.00	1.59
31	688248	南网科技	5,298.00	156,979.74	1.57
32	001696	宗申动力	13,800.00	146,832.00	1.47
33	00788	中国铁塔	154,000.00	141,680.00	1.42
34	01810	小米集团-W	9,400.00	141,376.00	1.41
35	002714	牧原股份	3,200.00	139,520.00	1.40
36	002241	歌尔股份	5,000.00	97,550.00	0.98

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	03993	洛阳钼业	608,403.48	4.82
1	603993	洛阳钼业	554,181.00	4.39
2	02899	紫金矿业	601,326.35	4.76
2	601899	紫金矿业	406,321.00	3.22
3	002463	沪电股份	622,092.00	4.93
4	300014	亿纬锂能	543,254.00	4.30
5	300757	罗博特科	514,553.00	4.08
6	02269	药明生物	464,793.47	3.68
7	000921	海信家电	433,903.00	3.44

8	001696	宗申动力	388,454.00	3.08
9	603979	金诚信	384,775.00	3.05
10	601398	工商银行	354,602.00	2.81
11	601988	中国银行	346,501.00	2.74
12	000801	四川九洲	339,592.00	2.69
13	300750	宁德时代	334,987.00	2.65
14	002567	唐人神	332,004.00	2.63
15	688223	晶科能源	331,419.71	2.62
16	688617	惠泰医疗	329,349.59	2.61
17	09863	零跑汽车	327,680.69	2.60
18	603191	望变电气	327,145.00	2.59
19	600131	国网信通	325,844.00	2.58
20	002840	华统股份	325,440.00	2.58
21	603477	巨星农牧	323,919.00	2.57
22	002100	天康生物	321,889.00	2.55
23	01951	锦欣生殖	319,536.24	2.53
24	601728	中国电信	318,138.00	2.52
25	002714	牧原股份	316,488.00	2.51
26	601288	农业银行	315,405.00	2.50
27	601567	三星医疗	315,260.00	2.50
28	000922	佳电股份	309,849.00	2.45
29	000333	美的集团	308,110.00	2.44
30	01378	中国宏桥	308,096.43	2.44
31	01810	小米集团-W	307,202.64	2.43
32	002938	鹏鼎控股	302,329.00	2.39
33	300394	天孚通信	298,038.00	2.36
34	300476	胜宏科技	292,218.00	2.31
35	688256	寒武纪	291,396.76	2.31
36	601138	工业富联	289,970.00	2.30
37	688097	博众精工	285,332.02	2.26
38	688301	奕瑞科技	283,334.84	2.24
39	600975	新五丰	282,240.00	2.24
40	002922	伊戈尔	282,114.00	2.23
41	603087	甘李药业	281,311.40	2.23
42	00883	中国海洋石油	275,533.88	2.18
43	002422	科伦药业	272,323.00	2.16
44	300308	中际旭创	271,980.00	2.15
45	688271	联影医疗	268,970.63	2.13
46	000400	许继电气	268,373.00	2.13
47	601179	中国西电	266,273.00	2.11
48	00700	腾讯控股	262,888.00	2.08
49	000423	东阿阿胶	261,950.00	2.07
50	603882	金域医学	259,587.00	2.06

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	03993	洛阳钼业	561,698.98	4.45
1	603993	洛阳钼业	512,373.00	4.06
2	688212	澳华内镜	911,908.66	7.22
3	688271	联影医疗	632,226.28	5.01
4	02269	药明生物	624,833.04	4.95
5	000963	华东医药	494,898.00	3.92
6	688789	宏华数科	480,012.33	3.80
7	09969	诺诚健华	477,224.15	3.78
8	688235	百济神州	268,741.22	2.13
8	06160	百济神州	198,278.71	1.57
9	301080	百普赛斯	446,024.00	3.53
10	688617	惠泰医疗	412,559.18	3.27
11	000921	海信家电	400,820.00	3.17
12	02899	紫金矿业	298,671.23	2.37
12	601899	紫金矿业	92,840.00	0.74
13	300253	卫宁健康	383,385.00	3.04
14	002567	唐人神	383,088.00	3.03
15	601398	工商银行	363,128.00	2.88
16	601988	中国银行	355,392.00	2.81
17	601288	农业银行	352,895.00	2.79
18	000333	美的集团	339,741.00	2.69
19	02162	康诺亚-B	337,602.46	2.67
20	300633	开立医疗	329,368.00	2.61
21	601728	中国电信	324,576.00	2.57
22	603087	甘李药业	317,243.00	2.51
23	600131	国网信通	317,150.00	2.51
24	688223	晶科能源	314,355.52	2.49
25	000801	四川九洲	312,417.00	2.47
26	603477	巨星农牧	307,956.00	2.44
27	300760	迈瑞医疗	306,979.00	2.43
28	002463	沪电股份	305,779.00	2.42
29	688065	凯赛生物	303,495.36	2.40
30	09863	零跑汽车	301,486.32	2.39
31	01951	锦欣生殖	294,497.30	2.33

32	603191	望变电气	285,551.00	2.26
33	002840	华统股份	285,257.00	2.26
34	000423	东阿阿胶	284,040.00	2.25
35	002100	天康生物	277,983.00	2.20
36	01378	中国宏桥	272,836.87	2.16
37	600975	新五丰	268,346.00	2.13
38	300394	天孚通信	260,482.00	2.06

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

买入股票的成本（成交）总额	24,096,242.35
卖出股票的收入（成交）总额	21,155,661.26

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	3,200.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	515.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,715.67

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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

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
摩根世代趋势混合发起式 A	84	145,663.00	10,000,333.33	81.73%	2,235,358.57	18.27%
摩根世代趋势混合发起式 C	325	2,216.67	-	0.00%	720,417.37	100.00%
合计	409	31,677.53	10,000,333.33	77.19%	2,955,775.94	22.81%

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	摩根世代趋势混合发起式 A	1,048.50	0.0086%
	摩根世代趋势混合发起式 C	20.00	0.0028%
	合计	1,068.50	0.0082%

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的情况

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	摩根世代趋势混合发起式 A	0
	摩根世代趋势混合发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	摩根世代趋势混合发起式 A	0
	摩根世代趋势混合发起式 C	0

	合计	0
--	----	---

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,333.33	77.19%	10,000,333.33	77.19%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,333.33	77.19%	10,000,333.33	77.19%	3 年

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	摩根世代趋势混合发起式 A	摩根世代趋势混合发起式 C
基金合同生效日（2023 年 8 月 22 日）基金份额总额	12,595,941.57	1,534,199.58
本报告期期初基金份额总额	12,590,010.41	822,763.30
本报告期基金总申购份额	14,457.75	171,546.15
减：本报告期基金总赎回份额	368,776.26	273,892.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,235,691.90	720,417.37

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

基金管理人于 2024 年 1 月 18 日公告，自 2024 年 1 月 18 日起，刘富伟先生担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	2	45,251,903.61	100.00%	48,804.44	100.00%	-

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. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,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. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本基金本期无新增席位、无注销席位。

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		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
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

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	摩根基金管理（中国）有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2024-01-18
2	摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金增聘基金经理公告	同上	2024-05-06
3	摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	同上	2024-06-18

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	20240101-20240630	10,000,333.33	0.00	0.00	10,000,333.33	77.19%
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) 中国证监会准予本基金募集注册的文件
- (二) 摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金基金合同
- (三) 摩根世代趋势混合型发起式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

二〇二四年八月三十日