

摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券 投资基金 2026 年中期报告

2026 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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。

本报告期自 2026 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
1.2 目录	3
§ 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	7
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49

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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	摩根 MSCI 中国 A 股 ETF
场内简称	MSCIAETF
基金主代码	515770
交易代码	515770
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 13 日
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	36,727,323.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 6 月 19 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。 1、资产配置策略 为了实现跟踪误差最小化，本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产 80%。 2、股票投资策略 (1) 投资组合构建 本基金采用完全复制法构建股票资产组合，对于因法规限制、流动性限制而无法交易的成份股，将采用与被限制股预期收益率相近的股票或股票组合进行相应的替代。本基金根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。 (2) 投资组合调整 1) 定期调整 本基金所构建的投资组合将定期根据标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。若成份股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。 2) 不定期调整 ①根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。

	②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将选择相关股票进行适当的替代。 ③本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，保证基金正常运行。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 3、金融衍生品投资策略 本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约，力争利用金融衍生品提高投资效率，降低交易成本和跟踪误差。 4、债券投资策略 在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。 5、资产支持证券投资策略：综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例。 6、融资及转融通证券出借策略 本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障投资组合流动性以及控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。转融通证券出借策略按照分散化投资原则，分批、分期进行交易。 7、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即 MSCI 中国 A 股人民币指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭海明	潘琦
	联系电话	021-38794888	0755-22168257
	电子邮箱	services@jpmamc.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95511-3
传真		021-20628400	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200120	518001
法定代表人		王琼慧	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	am.jpmorgan.com/cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,063,155.27
本期利润	5,527,548.46
加权平均基金份额本期利润	0.1249
本期加权平均净值利润率	8.67%
本期基金份额净值增长率	8.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	19,171,158.69
期末可供分配基金份额利润	0.5220
期末基金资产净值	55,898,481.69
期末基金份额净值	1.5220
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	52.20%

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

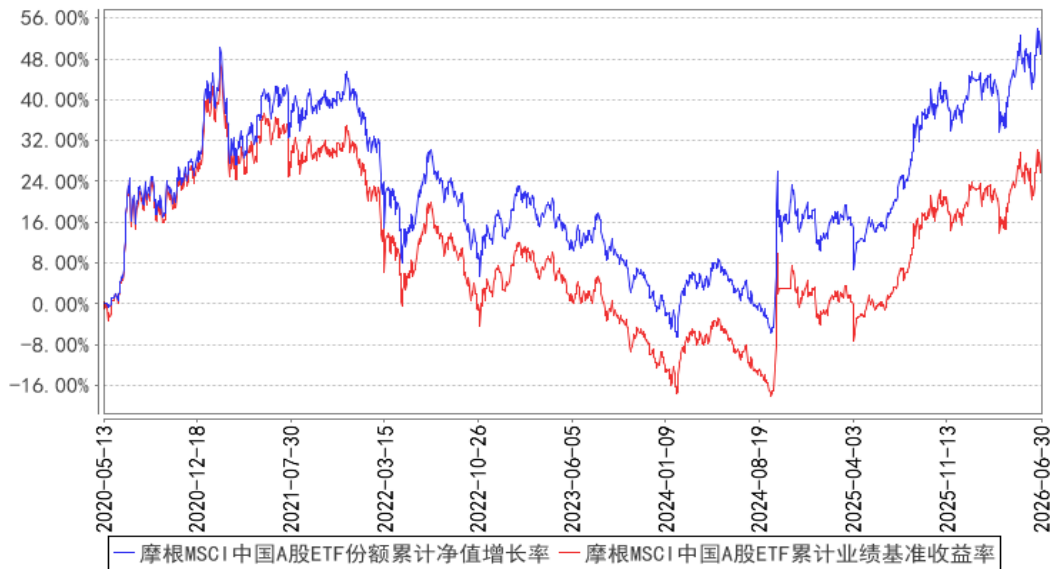
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	12.77%	1.29%	11.74%	1.30%	1.03%	-0.01%
过去六个月	8.80%	1.17%	7.81%	1.18%	0.99%	-0.01%
过去一年	29.48%	1.04%	26.95%	1.04%	2.53%	0.00%
过去三年	35.51%	1.11%	27.14%	1.13%	8.37%	-0.02%

过去五年	6.81%	1.09%	-5.77%	1.12%	12.58%	-0.03%
自基金合同生效起至今	52.20%	1.13%	28.45%	1.15%	23.75%	-0.02%

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MSCI中国A股ETF份额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：本基金合同生效日为 2020 年 5 月 13 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 2026 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有一百二十二只，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

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、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金 (QDII)、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 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、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、摩根盈元稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、摩根沪深 300 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根汇智优选混合型证券投资基金、摩根中证 A500 指数增强型证券投资基金、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联接基金、 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发起式联接基金、摩根上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金、摩根恒生港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧启成长混合型证券投资基金、摩根中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金、摩根恒睿债券型证券投资基金、摩根聚利稳健三个月持有期 FOF 基金、摩根恒悦纯债债券型证券投资基金、摩根恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金、摩根港股通宁远成长混合型证券投资基金、摩根均衡成长混合型证券投资基金、摩根恒利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (ETF-FOF)。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲蕾蕾	本基金的基金经理	2025 年 10 月 22 日	-	12 年	曲蕾蕾女士曾任法国兴业证券（香港）有限公司衍生品交易组交易助理；摩根资产管理香港分公司量化交易部门量化研究

					员、数据科学部投资研究组长；自 2024 年 4 月加入摩根基金管理(中国)有限公司，历任投资经理，现任指数及量化投资部基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

4.2 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，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、交易方向等的分析，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易共有 2 次，均为指数投资组合因跟踪指数

需要而发生的反向交易。

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

MSCI 中国 A 股指数在 2026 年上半年收涨 7.8%，大幅跑赢离岸 MSCI 中国指数，其中 A 股相对港股的科技溢价是本季度主要收益来源。北向资金二季度净流入加速，重点加仓 AI 算力链（光模块、服务器、存储）和新能源龙头；境内 ETF 资金同步放量。MSCI 中国 A 股指数在 5 月进行成分股调整，本次剔除了 24 只成份股，主要涵盖金融、消费、及传统互联网软件及应用等领域；新纳入 22 只成份股，主要集中在 AI 相关的光通信与算力基础设施，以及高端制造等领域。指数成分整体呈现新经济硬科技替代传统板块的现象。

本基金采用完全复制的方法跟踪标的指数，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整，以实现基金的投资目标并争取将跟踪误差保持在合理范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 份额净值增长率为:8.80%，同期业绩比较基准收益率为:7.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，中报是三季度是主要变量，AI 板块若业绩兑现则有望继续走强。中长期来看，A 股基础依然稳固，结构性机会丰富。随着政策支持，基本面延续修复和人民币汇率走强，有望吸引外资回流。中国核心资产的估值仍然在全球范围内相对低估，政策预期等催化下配置型外资有望进一步回流中国核心资产。

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研究、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投资基金行业从业经验。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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	865,454.71	576,131.77
结算备付金		28,281.30	17,534.37
存出保证金		8,535.11	11,655.78
交易性金融资产	6.4.7.2	55,821,400.04	67,684,754.56
其中：股票投资		55,821,400.04	67,684,754.56
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		398,193.29	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		57,121,864.45	68,290,076.48
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		335,410.84	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,536.00	8,583.65
应付托管费		2,512.01	2,861.24
应付销售服务费		-	-
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	877,923.91	111,929.77
负债合计		1,223,382.76	123,374.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	36,727,323.00	48,727,323.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,171,158.69	19,439,378.82
净资产合计		55,898,481.69	68,166,701.82
负债和净资产总计		57,121,864.45	68,290,076.48

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值：1.5220 元，基金份额总额：36,727,323.00 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,645,293.06	521,677.05
1. 利息收入		987.55	793.55
其中：存款利息收入	6.4.7.13	987.55	793.55
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）		10,107,673.10	335,623.69
其中：股票投资收益	6.4.7.14	9,558,880.09	-685,600.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	2,106.62
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	548,793.01	1,019,117.30
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	-4,535,606.81	162,725.77
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	72,239.22	22,534.04
减：二、营业总支出		117,744.60	168,884.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	47,397.44	61,615.08
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,799.19	20,538.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		-	0.05

8. 其他费用	6.4.7.23	54,547.97	86,730.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,527,548.46	352,793.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,527,548.46	352,793.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,527,548.46	352,793.00

6.3 净资产变动表

会计主体：摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	48,727,323.00	-	19,439,378.82	68,166,701.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	48,727,323.00	-	19,439,378.82	68,166,701.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,000,000.00	-	-268,220.13	-12,268,220.13
（一）、综合收益总额	-	-	5,527,548.46	5,527,548.46
（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）	-12,000,000.00	-	-5,795,768.59	-17,795,768.59
其中：1. 基金申购款	39,000,000.00	-	18,043,326.38	57,043,326.38
2. 基金赎回款	-51,000,000.00	-	-23,839,094.97	-74,839,094.97
（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	36,727,323.00	-	19,171,158.69	55,898,481.69
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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	75,727,323.00	-	12,657,874.74	88,385,197.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	75,727,323.00	-	12,657,874.74	88,385,197.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	-	-417,385.88	-6,417,385.88
（一）、综合收益总额	-	-	352,793.00	352,793.00
（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）	-6,000,000.00	-	-770,178.88	-6,770,178.88
其中：1. 基金申购款	6,000,000.00	-	1,021,460.15	7,021,460.15
2. 基金赎回款	-12,000,000.00	-	-1,791,639.03	-13,791,639.03
（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	69,727,323.00	-	12,240,488.86	81,967,811.86

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：

<u>王琼慧</u>	<u>徐振晨</u>	<u>俞文涵</u>
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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金(原名为上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金,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[2020]5 号《关于准予上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,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《上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 744,727,323.00 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(2020)第 0323 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 744,727,323.00 份基金份额,无有效认购资金产生的利息折份额。

本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]154 号文审核同意,本基金 744,727,323.00 份基金份额于 2020 年 6 月 19 日在上交所挂牌交易。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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金自该日起更名为摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资

基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股及备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股人民币指数收益率。本基金的基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司以本基金为目标 ETF，成立了摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金”）。MSCI 中国 A 股 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、

地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	865,454.71
等于：本金	865,353.83
加：应计利息	100.88
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	865,454.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		49,895,370.82	-	55,821,400.04	5,926,029.22
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		49,895,370.82	-	55,821,400.04	5,926,029.22

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 2026 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	12,375.48
其中：交易所市场	12,375.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	134,547.97
应退退补款	731,000.46
合计	877,923.91

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,727,323.00	48,727,323.00
本期申购	39,000,000.00	39,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-51,000,000.00	-51,000,000.00
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	36,727,323.00	36,727,323.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,825,061.74	-5,385,682.92	19,439,378.82
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	24,825,061.74	-5,385,682.92	19,439,378.82
本期利润	10,063,155.27	-4,535,606.81	5,527,548.46
本期基金份额交易产生的变动数	-7,709,899.79	1,914,131.20	-5,795,768.59
其中：基金申购款	25,205,078.74	-7,161,752.36	18,043,326.38
基金赎回款	-32,914,978.53	9,075,883.56	-23,839,094.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,178,317.22	-8,007,158.53	19,171,158.69

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	919.87
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	49.16
其他	18.52
合计	987.55

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,748,500.99
股票投资收益——赎回差价收入	2,810,379.10
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	9,558,880.09

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	45,905,716.21

减：卖出股票成本总额	39,112,760.78
减：交易费用	44,454.44
买卖股票差价收入	6,748,500.99

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	74,839,094.97
减：现金支付赎回款总额	34,057,757.97
减：赎回股票成本总额	37,970,957.90
减：交易费用	—
赎回差价收入	2,810,379.10

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	548,793.01
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	548,793.01

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,535,606.81
——股票投资	-4,535,606.81
——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	-4,535,606.81

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	72,239.22
合计	72,239.22

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	54,547.97

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、关联关系

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（“摩根基金管理（中国）有限公司”）	基金管理人、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构
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	本基金的联接基金

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	47,397.44	61,615.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,727.40	9,598.10
应支付基金管理人的净管理费	38,670.04	52,016.98

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,799.19	20,538.34

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
摩根MSCI中国 A股ETF联接	19,065,300.00	51.91	24,008,600.00	49.27

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
平安银行	865,454.71	919.87	1,260,629.45	749.32

注：本基金的银行存款由基金托管人平安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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有 21,526.00 股托管人平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 243,788.14 元，估值总额为人民币 216,336.30 元，占基金资产净值的比例为 0.39%(于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 28,226.00 股托管人平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 354,193.87 元，估值总额为人民币 322,058.66 元，占基金资产净值的比例为 0.47%)

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（2026 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	283	96,348.83	235,456.00	-

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

本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。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进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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同责任，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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2025 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公司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 2026 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	865,454.71	-	-	-	865,454.71
结算备付金	28,281.30	-	-	-	28,281.30

存出保证金	8,535.11	-	-	-	8,535.11
交易性金融资产	-	-	-	55,821,400.04	55,821,400.04
应收清算款	-	-	-	398,193.29	398,193.29
资产总计	902,271.12	-	-	56,219,593.33	57,121,864.45
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	7,536.00	7,536.00
应付托管费	-	-	-	2,512.01	2,512.01
应付清算款	-	-	-	335,410.84	335,410.84
其他负债	-	-	-	877,923.91	877,923.91
负债总计	-	-	-	1,223,382.76	1,223,382.76
利率敏感度缺口	902,271.12	-	-	54,996,210.57	55,898,481.69
上年度末 2025 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	576,131.77	-	-	-	576,131.77
结算备付金	17,534.37	-	-	-	17,534.37
存出保证金	11,655.78	-	-	-	11,655.78
交易性金融资产	-	-	-	67,684,754.56	67,684,754.56
资产总计	605,321.92	-	-	67,684,754.56	68,290,076.48
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,583.65	8,583.65
应付托管费	-	-	-	2,861.24	2,861.24
其他负债	-	-	-	111,929.77	111,929.77
负债总计	-	-	-	123,374.66	123,374.66
利率敏感度缺口	605,321.92	-	-	67,561,379.90	68,166,701.82

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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 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(2025 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。

本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票资产组合，对于因法规限制、流动性限制而无法交易的成份股，将采用与被限制股预期收益率相近的股票或股票组合进行相应的替代。在投资运作过程中，本基金根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	55,821,400.04	99.86	67,684,754.56	99.29
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	55,821,400.04	99.86	67,684,754.56	99.29

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,780,000.00	3,400,000.00
	2. 业绩比较基准下	-2,780,000.00	-3,400,000.00

	降 5%		
--	------	--	--

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	55,585,944.04	67,366,558.39
第二层次	235,456.00	318,196.17
第三层次	-	-
合计	55,821,400.04	67,684,754.56

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 2026 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(2025 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	55,821,400.04	97.72
	其中：股票	55,821,400.04	97.72
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	893,736.01	1.56
8	其他各项资产	406,728.40	0.71
9	合计	57,121,864.45	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资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	291,290.22	0.52
B	采矿业	2,474,384.23	4.43
C	制造业	35,525,993.94	63.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,633,011.92	2.92
E	建筑业	599,656.36	1.07
F	批发和零售业	298,043.12	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	1,312,805.75	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,142,966.32	5.62

J	金融业	9,343,008.34	16.71
K	房地产业	245,709.05	0.44
L	租赁和商务服务业	322,316.13	0.58
M	科学研究和技术服务业	376,740.91	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	30,390.88	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	83,525.12	0.15
R	文化、体育和娱乐业	34,101.75	0.06
S	综合	107,456.00	0.19
	合计	55,821,400.04	99.86

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

7.3.1 期末指数投资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	300750	宁德时代	4,699	1,846,753.99	3.30
2	600519	贵州茅台	1,336	1,583,814.64	2.83
3	300308	中际旭创	1,130	1,435,100.00	2.57
4	688256	寒武纪	694	1,107,311.70	1.98
5	300502	新易盛	1,469	891,683.00	1.60
6	688041	海光信息	2,200	814,660.00	1.46
7	601138	工业富联	11,281	813,924.15	1.46
8	600036	招商银行	21,040	746,920.00	1.34
9	002371	北方华创	781	690,841.36	1.24
10	600900	长江电力	24,759	655,370.73	1.17
11	002475	立讯精密	7,986	562,214.40	1.01
12	601318	中国平安	11,324	540,607.76	0.97
13	601899	紫金矿业	20,816	523,314.24	0.94
14	601288	农业银行	85,832	521,000.24	0.93
15	002384	东山精密	1,900	498,465.00	0.89
16	688012	中微公司	1,025	480,212.50	0.86

17	002594	比亚迪	5,710	455,087.00	0.81
18	601398	工商银行	63,433	448,471.31	0.80
19	600183	生益科技	2,577	446,851.80	0.80
20	603986	兆易创新	532	433,580.00	0.78
21	688008	澜起科技	1,331	412,476.90	0.74
22	601166	兴业银行	23,609	390,965.04	0.70
23	600030	中信证券	13,605	390,871.65	0.70
24	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.67
25	600276	恒瑞医药	6,872	357,618.88	0.64
26	300059	东方财富	17,535	357,363.30	0.64
27	300394	天孚通信	1,164	352,319.52	0.63
28	301308	江波龙	500	351,900.00	0.63
29	300274	阳光电源	2,202	350,162.04	0.63
30	601328	交通银行	53,922	346,718.46	0.62
31	300408	三环集团	1,984	331,129.60	0.59
32	000725	京东方 A	36,668	318,278.24	0.57
33	600176	中国巨石	4,311	314,185.68	0.56
34	603993	洛阳钼业	17,744	311,407.20	0.56
35	603259	药明康德	2,493	310,403.43	0.56
36	300476	胜宏科技	893	309,361.99	0.55
37	002463	沪电股份	2,020	308,656.00	0.55
38	000858	五粮液	4,168	308,432.00	0.55
39	002916	深南电路	653	299,008.70	0.53
40	688525	佰维存储	600	296,838.00	0.53
41	600487	亨通光电	2,677	292,703.18	0.52
42	300433	蓝思科技	5,358	287,510.28	0.51
43	601211	国泰海通	15,752	286,686.40	0.51
44	001309	德明利	300	282,870.00	0.51
45	000333	美的集团	3,668	277,044.04	0.50
46	600150	中国船舶	8,133	274,814.07	0.49
47	600000	浦发银行	30,704	264,361.44	0.47
48	688072	拓荆科技	283	235,456.00	0.42
49	000657	中钨高新	2,400	229,728.00	0.41
50	601988	中国银行	40,142	229,612.24	0.41
51	601088	中国神华	5,841	228,032.64	0.41
52	601939	建设银行	23,609	227,354.67	0.41
53	601816	京沪高铁	49,562	224,515.86	0.40
54	600309	万华化学	3,273	223,905.93	0.40
55	688521	芯原股份	600	222,684.00	0.40
56	600522	中天科技	3,669	222,634.92	0.40
57	600919	江苏银行	20,286	218,683.08	0.39
58	601869	长飞光纤	400	218,360.00	0.39
59	601857	中国石油	25,107	217,928.76	0.39

60	000001	平安银行	21,526	216,336.30	0.39
61	601225	陕西煤业	10,614	215,994.90	0.39
62	002142	宁波银行	7,125	211,541.25	0.38
63	601601	中国太保	7,338	209,279.76	0.37
64	002938	鹏鼎控股	1,979	208,547.02	0.37
65	300604	长川科技	600	204,852.00	0.37
66	002281	光迅科技	794	204,010.36	0.36
67	002714	牧原股份	5,818	203,571.82	0.36
68	000988	华工科技	1,100	203,071.00	0.36
69	000338	潍柴动力	7,339	199,987.75	0.36
70	600406	国电南瑞	8,634	197,286.90	0.35
71	300033	同花顺	810	195,210.00	0.35
72	300857	协创数据	560	190,344.00	0.34
73	601985	中国核电	20,816	187,968.48	0.34
74	600111	北方稀土	3,867	185,809.35	0.33
75	601919	中远海控	13,975	185,308.50	0.33
76	601668	中国建筑	41,630	180,674.20	0.32
77	688120	华海清科	546	175,910.28	0.31
78	600584	长电科技	1,686	174,585.30	0.31
79	688082	盛美上海	400	172,800.00	0.31
80	688361	中科飞测	400	172,000.00	0.31
81	300760	迈瑞医疗	1,257	170,738.31	0.31
82	000792	盐湖股份	5,554	167,675.26	0.30
83	002353	杰瑞股份	1,091	166,377.50	0.30
84	601688	华泰证券	8,036	165,702.32	0.30
85	600887	伊利股份	6,844	163,982.24	0.29
86	603288	海天味业	4,932	163,545.12	0.29
87	600989	宝丰能源	8,036	163,371.88	0.29
88	002080	中材科技	1,800	162,000.00	0.29
89	002352	顺丰控股	5,156	161,176.56	0.29
90	600999	招商证券	7,528	158,840.80	0.28
91	000063	中兴通讯	4,365	157,969.35	0.28
92	600031	三一重工	9,126	157,697.28	0.28
93	601100	恒立液压	1,453	156,284.68	0.28
94	688702	盛科通信	400	155,996.00	0.28
95	688347	华虹宏力	458	154,025.40	0.28
96	600160	巨化股份	2,875	152,403.75	0.27
97	300475	香农芯创	500	150,000.00	0.27
98	601658	邮储银行	30,228	149,024.04	0.27
99	300442	润泽科技	1,787	148,446.09	0.27
100	300223	北京君正	594	147,846.60	0.26
101	000776	广发证券	6,246	146,156.40	0.26
102	300014	亿纬锂能	2,228	144,886.84	0.26

103	600549	厦门钨业	1,694	144,328.80	0.26
104	688126	沪硅产业	3,600	143,604.00	0.26
105	600809	山西汾酒	1,309	143,165.33	0.26
106	601872	招商轮船	8,026	141,016.82	0.25
107	605117	德业股份	1,313	139,414.34	0.25
108	002600	领益智造	8,036	139,344.24	0.25
109	601229	上海银行	15,739	136,614.52	0.24
110	601009	南京银行	13,691	135,403.99	0.24
111	000100	TCL 科技	23,153	134,750.46	0.24
112	601336	新华保险	2,234	133,280.44	0.24
113	601066	中信建投	4,562	132,617.34	0.24
114	600690	海尔智家	6,345	129,501.45	0.23
115	601766	中国中车	24,681	128,341.20	0.23
116	000568	泸州老窖	1,645	127,520.40	0.23
117	600050	中国联通	31,616	126,464.00	0.23
118	601818	光大银行	42,882	123,928.98	0.22
119	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.22
120	688110	东芯股份	600	122,220.00	0.22
121	600089	特变电工	5,417	121,882.50	0.22
122	002156	通富微电	1,600	121,392.00	0.22
123	601600	中国铝业	14,681	120,677.82	0.22
124	600028	中国石化	27,006	120,446.76	0.22
125	600019	宝钢股份	22,004	119,481.72	0.21
126	300136	信维通信	1,000	119,250.00	0.21
127	688396	华润微	1,200	117,060.00	0.21
128	000408	藏格矿业	1,684	116,734.88	0.21
129	603501	豪威集团	1,226	116,286.10	0.21
130	601169	北京银行	23,609	115,684.10	0.21
131	600926	杭州银行	7,949	114,863.05	0.21
132	002602	世纪华通	8,100	114,210.00	0.20
133	300620	光库科技	300	113,460.00	0.20
134	002460	赣锋锂业	1,731	113,207.40	0.20
135	688629	华丰科技	600	112,506.00	0.20
136	688249	晶合集成	1,900	112,157.00	0.20
137	000651	格力电器	2,977	111,637.50	0.20
138	002709	天赐材料	2,165	111,345.95	0.20
139	601995	中金公司	3,075	111,161.25	0.20
140	000977	浪潮信息	1,586	111,020.00	0.20
141	688313	仕佳光子	600	110,790.00	0.20
142	600346	恒力石化	6,235	110,421.85	0.20
143	600893	航发动力	2,875	110,227.50	0.20
144	000166	申万宏源	24,899	109,555.60	0.20
145	601127	赛力斯	1,784	109,270.00	0.20

146	002837	英维克	1,360	108,201.60	0.19
147	601012	隆基绿能	8,233	108,016.96	0.19
148	600105	永鼎股份	1,600	107,968.00	0.19
149	600673	东阳光	3,200	107,456.00	0.19
150	600905	三峡能源	28,943	107,378.53	0.19
151	600886	国投电力	8,027	106,839.37	0.19
152	002493	荣盛石化	9,855	105,941.25	0.19
153	688183	生益电子	800	105,920.00	0.19
154	600016	民生银行	32,779	105,548.38	0.19
155	600703	三安光电	4,958	105,208.76	0.19
156	000425	徐工机械	12,996	105,137.64	0.19
157	600660	福耀玻璃	2,083	105,066.52	0.19
158	600498	烽火通信	1,400	103,040.00	0.18
159	600188	兖矿能源	5,775	102,621.75	0.18
160	688111	金山办公	478	101,837.90	0.18
161	002230	科大讯飞	2,479	101,242.36	0.18
162	688271	联影医疗	1,000	101,230.00	0.18
163	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.18
164	688048	长光华芯	200	100,400.00	0.18
165	002851	麦格米特	600	100,308.00	0.18
166	601689	拓普集团	1,777	100,258.34	0.18
167	688777	中控技术	850	99,875.00	0.18
168	601727	上海电气	14,088	98,616.00	0.18
169	601888	中国中免	1,827	98,128.17	0.18
170	600460	士兰微	1,788	97,732.08	0.17
171	002466	天齐锂业	1,586	97,253.52	0.17
172	300124	汇川技术	1,437	95,316.21	0.17
173	001389	广合科技	400	94,900.00	0.17
174	601390	中国中铁	22,716	94,725.72	0.17
175	000630	铜陵有色	14,887	94,681.32	0.17
176	601006	大秦铁路	20,518	94,587.98	0.17
177	601998	中信银行	13,644	94,552.92	0.17
178	600010	宝钢股份	41,892	93,419.16	0.17
179	603893	瑞芯微	495	93,238.20	0.17
180	600489	中金黄金	5,155	93,047.75	0.17
181	688002	睿创微纳	600	92,814.00	0.17
182	600795	国电电力	19,739	92,181.13	0.16
183	002001	新 和 成	3,238	92,023.96	0.16
184	600015	华夏银行	14,381	91,894.59	0.16
185	600875	东方电气	3,174	91,315.98	0.16
186	688019	安集科技	268	90,975.28	0.16
187	601669	中国电建	19,146	89,986.20	0.16
188	601881	中国银河	7,137	89,712.09	0.16

189	000938	紫光股份	3,107	89,668.02	0.16
190	000538	云南白药	1,866	88,392.42	0.16
191	600547	山东黄金	3,827	88,365.43	0.16
192	688469	芯联集成	8,300	88,063.00	0.16
193	300498	温氏股份	7,120	87,718.40	0.16
194	002202	金风科技	3,669	87,689.10	0.16
195	002050	三花智控	1,985	87,002.55	0.16
196	300661	圣邦股份	606	86,948.88	0.16
197	601868	中国能建	32,407	86,526.69	0.15
198	600362	江西铜业	1,982	85,820.60	0.15
199	603296	华勤技术	1,150	85,410.50	0.15
200	002241	歌尔股份	3,768	84,893.04	0.15
201	300751	迈为股份	300	84,738.00	0.15
202	603799	华友钴业	1,747	84,310.22	0.15
203	300390	天华新能	900	84,159.00	0.15
204	601628	中国人寿	2,377	84,026.95	0.15
205	300316	晶盛机电	1,388	83,835.20	0.15
206	002648	卫星化学	3,567	83,788.83	0.15
207	300015	爱尔眼科	10,112	83,525.12	0.15
208	300548	长芯博创	300	83,400.00	0.15
209	000301	东方盛虹	7,141	81,764.45	0.15
210	601179	中国西电	5,456	81,403.52	0.15
211	000807	云铝股份	3,668	81,209.52	0.15
212	600104	上汽集团	8,231	80,334.56	0.14
213	300395	菲利华	600	80,238.00	0.14
214	002311	海大集团	1,788	79,762.68	0.14
215	002049	紫光国微	893	79,253.75	0.14
216	601838	成都银行	4,463	78,995.10	0.14
217	601825	沪农商行	10,514	78,749.86	0.14
218	601958	金钼股份	2,772	77,920.92	0.14
219	002027	分众传媒	16,070	77,778.80	0.14
220	002185	华天科技	3,472	77,460.32	0.14
221	000960	锡业股份	1,800	76,842.00	0.14
222	600958	东方证券	8,094	76,407.36	0.14
223	000895	双汇发展	3,369	75,465.60	0.14
224	600674	川投能源	5,255	74,463.35	0.13
225	600585	海螺水泥	4,313	73,105.35	0.13
226	601991	大唐发电	10,288	72,839.04	0.13
227	600115	中国东航	18,947	72,188.07	0.13
228	605499	东鹏饮料	584	72,083.12	0.13
229	603228	景旺电子	989	71,613.49	0.13
230	301269	华大九天	595	71,054.90	0.13
231	601168	西部矿业	2,578	69,966.92	0.13

232	601319	中国人保	10,317	69,742.92	0.12
233	600026	中远海能	3,868	69,391.92	0.12
234	002625	光启技术	2,282	69,190.24	0.12
235	301358	湖南裕能	900	68,283.00	0.12
236	601231	环旭电子	2,100	68,040.00	0.12
237	002422	科伦药业	1,743	67,140.36	0.12
238	002812	恩捷股份	1,000	66,910.00	0.12
239	601360	三六零	7,635	66,348.15	0.12
240	300866	安克创新	633	66,148.50	0.12
241	688578	艾力斯	600	65,520.00	0.12
242	688387	信科移动	3,300	65,472.00	0.12
243	300782	卓胜微	597	65,419.26	0.12
244	600011	华能国际	8,616	65,395.44	0.12
245	600436	片仔癀	597	65,240.16	0.12
246	601111	中国国航	10,686	64,650.30	0.12
247	601901	方正证券	8,924	64,252.80	0.11
248	000066	中国长城	3,372	64,236.60	0.11
249	000625	长安汽车	8,924	63,985.08	0.11
250	600066	宇通客车	2,380	63,807.80	0.11
251	002304	洋河股份	1,668	63,634.20	0.11
252	601916	浙商银行	23,978	63,062.14	0.11
253	600895	张江高科	1,685	62,766.25	0.11
254	001979	招商蛇口	9,719	62,493.17	0.11
255	002736	国信证券	6,244	62,377.56	0.11
256	600601	方正科技	4,500	62,280.00	0.11
257	688047	龙芯中科	400	61,868.00	0.11
258	600418	江淮汽车	2,381	61,501.23	0.11
259	600029	南方航空	11,798	61,113.64	0.11
260	603659	璞泰来	2,111	61,071.23	0.11
261	000831	中国稀土	1,091	60,539.59	0.11
262	601788	光大证券	4,167	60,129.81	0.11
263	600415	小商品城	5,851	59,446.16	0.11
264	002414	高德红外	4,480	59,404.80	0.11
265	000426	兴业银锡	1,800	59,328.00	0.11
266	002653	海思科	893	59,241.62	0.11
267	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.11
268	600221	海航控股	43,315	58,475.25	0.10
269	002595	豪迈科技	1,241	57,830.60	0.10
270	600233	圆通速递	3,669	57,786.75	0.10
271	600438	通威股份	4,753	57,558.83	0.10
272	600096	云天化	1,886	57,334.40	0.10
273	002236	大华股份	3,471	57,236.79	0.10
274	601877	正泰电器	2,282	57,209.74	0.10

275	000783	长江证券	5,851	57,047.25	0.10
276	002850	科达利	300	56,790.00	0.10
277	601377	兴业证券	9,323	56,310.92	0.10
278	600580	卧龙电驱	1,700	56,270.00	0.10
279	300418	昆仑万维	1,389	56,060.04	0.10
280	000617	中油资本	8,426	55,527.34	0.10
281	600023	浙能电力	10,499	55,224.74	0.10
282	002128	电投能源	2,380	55,025.60	0.10
283	688187	时代电气	800	54,928.00	0.10
284	600039	四川路桥	7,017	54,872.94	0.10
285	600426	华鲁恒升	2,292	54,824.64	0.10
286	002558	巨人网络	1,976	54,458.56	0.10
287	300803	指南针	593	54,360.31	0.10
288	600048	保利发展	11,693	54,138.59	0.10
289	000157	中联重科	7,735	53,912.95	0.10
290	601077	渝农商行	8,721	53,285.31	0.10
291	002532	天山铝业	4,958	53,199.34	0.10
292	600741	华域汽车	3,372	52,333.44	0.09
293	300058	蓝色光标	3,800	52,288.00	0.09
294	688188	柏楚电子	489	52,176.30	0.09
295	688331	荣昌生物	400	52,104.00	0.09
296	002074	国轩高科	1,886	51,883.86	0.09
297	688223	晶科能源	10,900	51,775.00	0.09
298	600196	复星医药	2,282	51,276.54	0.09
299	001203	大中矿业	1,700	50,915.00	0.09
300	002064	华峰化学	5,358	50,847.42	0.09
301	002129	TCL 中环	4,218	50,700.36	0.09
302	000975	山金国际	2,977	50,609.00	0.09
303	000933	神火股份	2,380	50,456.00	0.09
304	688122	西部超导	800	50,248.00	0.09
305	000963	华东医药	1,786	50,222.32	0.09
306	001965	招商公路	5,449	49,912.84	0.09
307	688036	传音控股	840	49,518.00	0.09
308	601456	国联民生	5,568	49,221.12	0.09
309	601117	中国化学	6,647	48,855.45	0.09
310	002920	德赛西威	598	48,737.00	0.09
311	300454	深信服	500	48,100.00	0.09
312	300759	康龙化成	1,636	47,329.48	0.08
313	002379	宏桥控股	3,200	47,264.00	0.08
314	600988	赤峰黄金	1,788	47,060.16	0.08
315	600021	上海电力	3,100	46,717.00	0.08
316	600642	申能股份	5,254	45,867.42	0.08
317	601607	上海医药	2,977	45,845.80	0.08

318	601699	潞安环能	3,175	45,339.00	0.08
319	000559	万向钱潮	3,500	45,255.00	0.08
320	601021	春秋航空	992	45,215.36	0.08
321	002555	三七互娱	2,380	44,910.60	0.08
322	600061	国投资本	6,844	44,828.20	0.08
323	300628	亿联网络	1,318	44,574.76	0.08
324	000688	国城矿业	1,300	44,499.00	0.08
325	300919	中伟新材	1,013	44,318.75	0.08
326	600219	南山铝业	11,097	44,277.03	0.08
327	301236	软通动力	1,043	44,275.35	0.08
328	603806	福斯特	2,630	44,157.70	0.08
329	601618	中国中冶	18,039	44,015.16	0.08
330	600143	金发科技	2,800	43,260.00	0.08
331	600027	华电国际	9,721	43,258.45	0.08
332	603260	合盛硅业	892	43,047.92	0.08
333	601198	东兴证券	3,147	42,767.73	0.08
334	002601	龙佰集团	2,578	42,485.44	0.08
335	601878	浙商证券	4,458	42,351.00	0.08
336	600352	浙江龙盛	3,471	42,033.81	0.08
337	300115	长盈精密	1,500	41,910.00	0.07
338	600570	恒生电子	1,972	41,786.68	0.07
339	688375	国博电子	400	41,720.00	0.07
340	688568	中科星图	1,000	41,470.00	0.07
341	000999	华润三九	1,843	41,449.07	0.07
342	002738	中矿资源	700	41,293.00	0.07
343	688099	晶晨股份	400	41,160.00	0.07
344	688472	阿特斯	3,800	41,116.00	0.07
345	601216	君正集团	9,126	40,701.96	0.07
346	600803	新奥股份	2,576	40,700.80	0.07
347	002195	岩山科技	6,200	40,548.00	0.07
348	601058	赛轮轮胎	3,471	40,020.63	0.07
349	000596	古井贡酒	496	39,580.80	0.07
350	601108	财通证券	4,548	39,340.20	0.07
351	601777	千里科技	4,800	39,168.00	0.07
352	601555	东吴证券	4,944	39,156.48	0.07
353	600157	永泰能源	24,104	38,807.44	0.07
354	600918	中泰证券	7,236	38,495.52	0.07
355	600845	宝信软件	2,301	38,265.63	0.07
356	601577	长沙银行	4,365	38,019.15	0.07
357	002294	信立泰	1,191	37,980.99	0.07
358	601696	中银证券	2,977	37,659.05	0.07
359	002517	恺英网络	2,300	37,375.00	0.07
360	002078	太阳纸业	2,977	37,182.73	0.07

361	601212	白银有色	7,300	37,084.00	0.07
362	300748	金力永磁	1,200	37,020.00	0.07
363	601162	天风证券	10,908	36,759.96	0.07
364	000983	山西焦煤	6,269	36,360.20	0.07
365	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.06
366	000708	中信特钢	2,870	36,219.40	0.06
367	600711	盛屯矿业	3,300	36,201.00	0.06
368	002340	格林美	5,456	36,064.16	0.06
369	688303	大全能源	2,059	35,888.37	0.06
370	300207	欣旺达	1,885	35,796.15	0.06
371	002939	长城证券	4,265	35,570.10	0.06
372	000728	国元证券	4,661	34,910.89	0.06
373	600515	海南机场	12,696	34,787.04	0.06
374	002487	大金重工	600	34,782.00	0.06
375	002131	利欧股份	7,300	34,675.00	0.06
376	600839	四川长虹	4,958	34,606.84	0.06
377	002465	海格通信	2,700	34,479.00	0.06
378	000786	北新建材	1,902	34,407.18	0.06
379	600085	同仁堂	1,487	34,364.57	0.06
380	300251	光线传媒	3,075	34,101.75	0.06
381	300832	新产业	795	33,390.00	0.06
382	300765	石药创新	1,226	33,383.98	0.06
383	600733	北汽蓝谷	6,850	33,359.50	0.06
384	002966	苏州银行	4,760	33,129.60	0.06
385	600588	用友网络	3,600	33,048.00	0.06
386	000661	长春高新	496	33,033.60	0.06
387	600298	安琪酵母	893	32,326.60	0.06
388	603606	东方电缆	775	32,170.25	0.06
389	000002	万科 A	10,650	31,524.00	0.06
390	300896	爱美客	357	31,130.40	0.06
391	600600	青岛啤酒	596	31,129.08	0.06
392	688599	天合光能	2,200	31,064.00	0.06
393	002252	上海莱士	7,140	30,987.60	0.06
394	603568	伟明环保	1,976	30,390.88	0.05
395	300122	智飞生物	2,557	29,891.33	0.05
396	000876	新希望	4,760	29,845.20	0.05
397	002459	晶澳科技	3,527	28,568.70	0.05
398	600536	中国软件	1,013	28,485.56	0.05
399	300413	芒果超媒	1,920	28,089.60	0.05
400	600009	上海机场	1,189	27,465.90	0.05
401	601799	星宇股份	297	26,914.14	0.05
402	000564	供销大集	20,036	26,647.88	0.05
403	000932	华菱钢铁	7,537	26,153.39	0.05

404	601933	永辉超市	8,918	25,327.12	0.05
405	603486	科沃斯	497	25,222.75	0.05
406	601238	广汽集团	4,747	24,114.76	0.04
407	300255	常山药业	1,000	23,420.00	0.04
408	603392	万泰生物	868	23,409.96	0.04
409	601567	三星电气	1,486	22,200.84	0.04
410	300347	泰格医药	396	19,008.00	0.03

7.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300750	宁德时代	2,311,822.00	3.39
2	300308	中际旭创	1,398,907.00	2.05
3	002371	北方华创	930,431.00	1.36
4	300502	新易盛	844,022.60	1.24
5	002594	比亚迪	659,340.00	0.97
6	300394	天孚通信	629,754.00	0.92
7	600036	招商银行	611,759.00	0.90
8	002475	立讯精密	604,689.00	0.89
9	002384	东山精密	601,034.00	0.88
10	002916	深南电路	560,444.00	0.82
11	300059	东方财富	504,280.00	0.74
12	300476	胜宏科技	497,736.00	0.73
13	300274	阳光电源	453,600.00	0.67
14	688498	源杰科技	405,202.00	0.59
15	000657	中钨高新	388,334.00	0.57
16	000858	五粮液	372,883.00	0.55
17	002463	沪电股份	360,548.00	0.53
18	300408	三环集团	355,507.00	0.52
19	600900	长江电力	354,663.00	0.52
20	000001	平安银行	350,043.00	0.51

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	300750	宁德时代	2,956,876.00	4.34

2	300308	中际旭创	1, 831, 334. 54	2. 69
3	002371	北方华创	1, 111, 222. 00	1. 63
4	300502	新易盛	1, 083, 528. 00	1. 59
5	002594	比亚迪	859, 637. 00	1. 26
6	002475	立讯精密	758, 947. 00	1. 11
7	300394	天孚通信	742, 534. 00	1. 09
8	002384	东山精密	731, 788. 00	1. 07
9	002916	深南电路	676, 809. 00	0. 99
10	300476	胜宏科技	623, 468. 00	0. 91
11	300059	东方财富	618, 955. 00	0. 91
12	300274	阳光电源	581, 522. 00	0. 85
13	601138	工业富联	574, 478. 00	0. 84
14	688256	寒武纪	534, 980. 00	0. 78
15	000858	五 粮 液	510, 843. 00	0. 75
16	000333	美的集团	451, 031. 00	0. 66
17	002463	沪电股份	448, 711. 00	0. 66
18	300408	三环集团	445, 079. 00	0. 65
19	000725	京东方 A	432, 893. 00	0. 64
20	000001	平安银行	421, 572. 00	0. 62

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	40, 085, 060. 97
卖出股票收入（成交）总额	45, 905, 716. 21

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他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。

7.12.2

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	8,535.11
2	应收清算款	398,193.29
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	406,728.40

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

7.12.5.1 期末指数投资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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资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

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
597	61,519.80	6,501,106.00	17.70	11,160,917.00	30.39	19,065,300.00	51.91

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年5月13日） 基金份额总额	744,727,323.00
本报告期期初基金份额总额	48,727,323.00
本报告期基金总申购份额	39,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	51,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	36,727,323.00

§ 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：无。

基金托管人：2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，未发现管理人相关从业人员受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
中信证券	4	85,990,777.18	100.00	15,985.63	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. 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，2026 年 01 月 01 日至 2026 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 基金租用或者通过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 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-

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）有限公司关于旗下部分上交所基金变更场内扩位简称的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2026 年 1 月 21 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	20260101-20260630	24,008,600.00	372,300.00	5,315,600.00	19,065,300.00	51.91%
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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三) 摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数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

2026 年 8 月 31 日