

# 摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

### 2024 年 3 月 31 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年四月二十二日

## §1 重要提示

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

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 摩根沪深 300 指数增强发起式   |
| 基金主代码      | 017445   |
| 交易代码       | 017445   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022 年 12 月 28 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 18,166,744.21 份  |
| 投资目标       | 在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略       | 1、资产配置策略<br>本基金为指数增强型基金，股票资产占基金资产的比例不低于 80%，一般情况下将保持资产配置的基               |

|  |   |
|--|---|
|  | <p>本稳定。基金运作过程中，将综合考量系统性风险、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p><b>2、股票投资策略</b></p> <p>本基金属于指数增强型股票基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不得超过 7.75%。</p> <p>本基金所采用的股票量化投资模型主要包含三个部分，以实现股票收益预测，风险控制和跟踪误差控制。这三个部分包括收益预测模型，风险模型和组合优化模型。</p> <p>收益预测模型以量化投资团队开发的多因子选股模型和事件驱动策略为基础，深入分析个股的估值水平、盈利指标、波动指标、运营指标、市场情绪面等指标，根据行情变化进行动态调整，争取做出全面优质的股票收益预测。</p> <p>风险模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括资产波动率、行业集中度、风格暴露等，力求主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内。</p> <p>组合优化模型结合收益预测模型和风险模型的产出，并综合考虑交易成本等因素，在风险约束条件下，将投研成果转化为实际的可投资组合。力争股票配置最优化，以期达到持续超越业绩比较基准收益率的投资目标。</p> <p><b>3、债券投资策略</b></p> <p>本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，</p> |
|--|---|

|  |   |
|--|---|
|  | <p>根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期管理策略、期限结构配置策略、信用债投资策略、可转换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>5、股票期权投资策略</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选择估值合理的期权合约。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易。</p> |
|--|---|

|             |   |                    |
|-------------|---|--------------------|
|             | <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。</p> <p>8、存托凭证投资策略</p> <p>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。</p> <p>9、融资及转融通证券出借策略</p> <p>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，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。</p> |                    |
| 业绩比较基准      | 沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%  |                    |
| 风险收益特征      | 本基金为指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。  |                    |
| 基金管理人       | 摩根基金管理（中国）有限公司  |                    |
| 基金托管人       | 江苏银行股份有限公司  |                    |
| 下属分级基金的基金简称 | 摩根沪深 300 指数增强发起式 A  | 摩根沪深 300 指数增强发起式 C |

|                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 017445          | 017446         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,671,471.27 份 | 1,495,272.94 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日) |                        |
|----------------|---|------------------------|
|                | 摩根沪深 300 指数增强<br>发起式 A                  | 摩根沪深 300 指数增强<br>发起式 C |
| 1.本期已实现收益      | -101,052.89                             | -11,852.45             |
| 2.本期利润         | 311,686.96                              | 36,480.25              |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0187                                  | 0.0197                 |
| 4.期末基金资产净值     | 14,444,625.79                           | 1,290,817.87           |
| 5.期末基金份额净值     | 0.8664                                  | 0.8633                 |

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 本报告期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

###### 1、摩根沪深 300 指数增强发起式 A：

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.00%      | 1.01%         | 2.95%          | 0.98%                 | -0.95% | 0.03% |
| 过去六个月 | -5.30%     | 0.90%         | -3.91%         | 0.87%                 | -1.39% | 0.03% |

|            |         |       |         |       |        |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | -12.92% | 0.86% | -12.02% | 0.85% | -0.90% | 0.01% |
| 过去三年       | -       | -     | -       | -     | -      | -     |
| 过去五年       | -       | -     | -       | -     | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | -13.36% | 0.84% | -8.54%  | 0.84% | -4.82% | 0.00% |

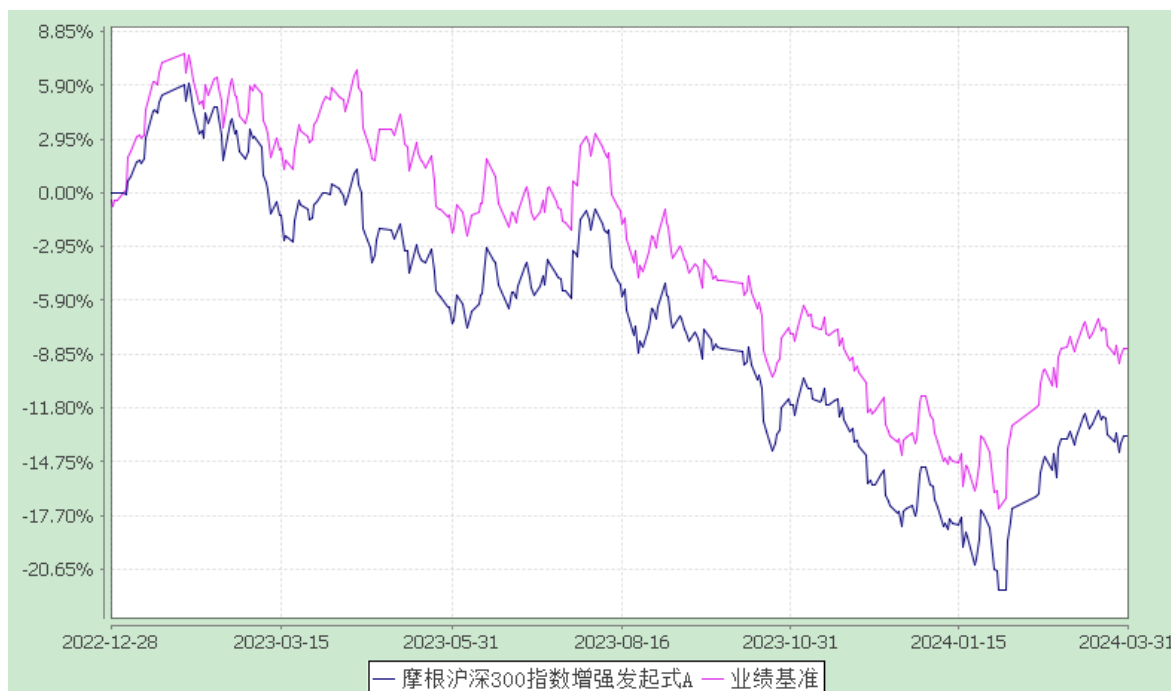
2、摩根沪深 300 指数增强发起式 C:

| 阶段         | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 1.94%      | 1.02%         | 2.95%          | 0.98%                 | -1.01% | 0.04% |
| 过去六个月      | -5.43%     | 0.90%         | -3.91%         | 0.87%                 | -1.52% | 0.03% |
| 过去一年       | -13.17%    | 0.86%         | -12.02%        | 0.85%                 | -1.15% | 0.01% |
| 过去三年       | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 过去五年       | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | -13.67%    | 0.84%         | -8.54%         | 0.84%                 | -5.13% | 0.00% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2022 年 12 月 28 日至 2024 年 3 月 31 日)

1. 摩根沪深 300 指数增强发起式 A:



注：本基金合同生效日为 2022 年 12 月 28 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。

## 2. 摩根沪深 300 指数增强发起式 C:



注：本基金合同生效日为 2022 年 12 月 28 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务      | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|---------|-------------|------|--------|---|
|     |         | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 毛时超 | 本基金基金经理 | 2022-12-28  | -    | 8 年    | 毛时超先生曾任平安基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理；自 2021 |



|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | 理 |  |  |  | 年 11 月加入摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司), 现任指数及量化投资部基金经理。 |
|--|---|--|--|--|--|

- 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. 毛时超先生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遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，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。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。

#### 4.3 公平交易专项说明

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

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A 股经历下跌之后的快速反弹行情，并且不同市值或行业的股票走势分化。偏向大盘价值风格类股票率先企稳；偏向小盘和微盘风格类股票，去年表现较好、投资者情绪较为乐观，当期间交易拥挤、资金流出时，出现了较大幅度的连续回撤。伴随着长期资金买入持有 ETF、海外资金回流中国市场，股市止跌回升。从具体的因子收益来看，大市值、低估值、高股息等防御类因子表现较好，成长类因子则表现一般。

本基金采用指数增强投资策略，采用多因子模型进行选股，重点关注估值相对业绩增速较为合理的公司，在严格控制行业和风格偏离与持股分散的情况下，力争实现相对基准指数长期稳健的超额收益表现。

展望未来，本基金跟踪的沪深 300 指数相关公司，与中国宏观经济发展紧密相关，估值水平处于历史较低位置，股息率与股权风险溢价率，也处于历史较高位置，或具有较好的中长期投资配置价值。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根沪深 300 增强 A 份额净值增长率为:2.00%，同期业绩比较基准收益率为:2.95%

摩根沪深 300 增强 C 份额净值增长率为:1.94%，同期业绩比较基准收益率为:2.95%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

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

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 1 | 权益投资              | 15,058,840.03 | 94.68  |
|   | 其中：股票             | 15,058,840.03 | 94.68  |
| 2 | 固定收益投资            | 203,890.41    | 1.28   |
|   | 其中：债券             | 203,890.41    | 1.28   |
|   | 资产支持证券            | -             | -      |
| 3 | 贵金属投资             | -             | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -             | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | -             | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 597,178.02    | 3.75   |
| 7 | 其他各项资产            | 44,259.59     | 0.28   |
| 8 | 合计                | 15,904,168.05 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

| 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         | 5,556.00     | 0.04         |
| B  | 采矿业              | 145,979.00   | 0.93         |
| C  | 制造业              | 1,434,843.89 | 9.12         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 59,785.00    | 0.38         |
| E  | 建筑业              | 8,548.40     | 0.05         |
| F  | 批发和零售业           | 41,485.00    | 0.26         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 99,481.20    | 0.63         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 82,294.34    | 0.52         |
| J  | 金融业              | 151,429.00   | 0.96         |

|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| K | 房地产业          | 19,604.00    | 0.12  |
| L | 租赁和商务服务业      | 28,329.90    | 0.18  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 57,487.60    | 0.37  |
| 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            | 4,349.00     | 0.03  |
| Q | 卫生和社会工作       | -            | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 13,176.00    | 0.08  |
| S | 综合            | -            | -     |
|   | 合计            | 2,152,348.33 | 13.68 |

### 5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 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         | 160,720.00   | 1.02         |
| B  | 采矿业              | 603,981.50   | 3.84         |
| C  | 制造业              | 7,073,616.20 | 44.95        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 459,480.00   | 2.92         |
| E  | 建筑业              | 354,068.20   | 2.25         |
| F  | 批发和零售业           | 25,658.00    | 0.16         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 330,345.00   | 2.10         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 458,147.40   | 2.91         |
| J  | 金融业              | 3,096,460.40 | 19.68        |
| K  | 房地产业             | 114,747.00   | 0.73         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 91,742.00    | 0.58         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 99,766.00    | 0.63         |
| 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          | 37,760.00    | 0.24         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -            |

|   |    |               |       |
|---|----|---------------|-------|
| S | 综合 | -             | -     |
|   | 合计 | 12,906,491.70 | 82.02 |

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 500.00    | 851,450.00 | 5.41         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 2,460.00  | 467,793.60 | 2.97         |
| 3  | 601318 | 中国平安 | 9,600.00  | 391,776.00 | 2.49         |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 9,900.00  | 318,780.00 | 2.03         |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 1,900.00  | 291,669.00 | 1.85         |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 4,400.00  | 282,568.00 | 1.80         |
| 7  | 002594 | 比亚迪  | 1,000.00  | 203,060.00 | 1.29         |
| 8  | 600900 | 长江电力 | 7,300.00  | 181,989.00 | 1.16         |
| 9  | 601166 | 兴业银行 | 10,800.00 | 170,424.00 | 1.08         |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 4,300.00  | 169,033.00 | 1.07         |

#### 5.3.2 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前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)    | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------|-----------|--------------|
| 1  | 600256 | 广汇能源 | 5,800.00 | 43,152.00 | 0.27         |
| 2  | 300476 | 胜宏科技 | 1,300.00 | 31,486.00 | 0.20         |
| 3  | 688516 | 奥特维  | 290.00   | 29,783.00 | 0.19         |
| 4  | 603886 | 元祖股份 | 1,800.00 | 29,430.00 | 0.19         |
| 5  | 603338 | 浙江鼎力 | 500.00   | 28,650.00 | 0.18         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------|--------------|
| 1  | 国家债券 | 203,890.41 | 1.30         |
| 2  | 央行票据 | -          | -            |
| 3  | 金融债券 | -          | -            |

|    |           |            |      |
|----|-----------|------------|------|
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -    |
| 4  | 企业债券      | -          | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -    |
| 6  | 中期票据      | -          | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | -          | -    |
| 8  | 同业存单      | -          | -    |
| 9  | 其他        | -          | -    |
| 10 | 合计        | 203,890.41 | 1.30 |

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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张) | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|-------|------------|--------------|
| 1  | 019703 | 23 国债 10 | 2,000 | 203,890.41 | 1.30         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 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。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

除上述主体外，本基金投资的其余前十名证券的发行主体本期未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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | -         |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 44,259.59 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 44,259.59 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 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。

##### 5.11.5.2 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。

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 摩根沪深300指数增强<br>发起式A | 摩根沪深300指数增强<br>发起式C |
|----------------|---------------------|---------------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 16,291,595.78       | 1,641,103.73        |
| 报告期期间基金总申购份额   | 791,891.21          | 2,671,834.51        |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 412,015.72          | 2,817,665.30        |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                   | -                   |
| 本报告期期末基金份额总额   | 16,671,471.27       | 1,495,272.94        |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                           | 摩根沪深300指数增强发起<br>式A | 摩根沪深300指数增强发起<br>式C |
|------------------------------|---------------------|---------------------|
| 报告期初管理人持有的本基金份额              | 15,158,738.63       | -                   |
| 报告期期间买入/申购总份额                | -                   | -                   |
| 报告期期间卖出/赎回总份额                | -                   | -                   |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额             | 15,158,738.63       | -                   |
| 报告期期末持有的本基金份额<br>占基金总份额比例（%） | 83.44               | -                   |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。



## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份<br>额总数        | 持有份<br>额占基<br>金总<br>份额比<br>例 | 发起份<br>额总数        | 发起份<br>额占<br>基金总<br>份额<br>比例 | 发起份<br>额承<br>诺持<br>有期<br>限 |
|-----------------|-------------------|------------------------------|-------------------|------------------------------|----------------------------|
| 基金管理人固有资金       | 15,158,7<br>38.63 | 83.44%                       | 10,000,<br>783.32 | 55.05%                       | 3 年                        |
| 基金管理人高级管理<br>人员 | -                 | -                            | -                 | -                            | -                          |
| 基金经理等人员         | -                 | -                            | -                 | -                            | -                          |
| 基金管理人股东         | -                 | -                            | -                 | -                            | -                          |
| 其他              | -                 | -                            | -                 | -                            | -                          |
| 合计              | 15,158,7<br>38.63 | 83.44%                       | 10,000,<br>783.32 | 55.05%                       | 3 年                        |

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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<br>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<br>况    |          |
|--|----------------|------------------------------------|-----------------------|----------|----------|-------------------|----------|
|  | 序号             | 持有基金份额<br>比例达到或者<br>超过20%的时<br>间区间 | 期初<br>份额              | 申购<br>份额 | 赎回份<br>额 | 持有份额              | 份额占<br>比 |
| 机构   | 1              | 20240101-2024<br>0331              | 14,99<br>9,675.<br>00 | 0.00     | 0.00     | 14,999,675.<br>00 | 82.57%   |
| 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。 |                |                                    |                       |          |          |                   |          |

## §10 备查文件目录

### 10.1 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)摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同

- (三)摩根沪深 300 指数增强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

## 10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 10.3 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

二〇二四年四月二十二日