

**信澳盈丰多元三个月持有期混合型基金
中基金（FOF）
2026 年第 2 季度报告
2026 年 6 月 30 日**

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 8 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）
基金主代码	026793
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 4 月 8 日
报告期末基金份额总额	271,556,547.50 份
投资目标	本基金是基金中基金，通过大类资产配置，投资于多种具有不同风险收益特征的基金，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、基金优选策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、公募 REITs 投资策略。

业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率*60%+中证 800 指数收益率*21%+标准普尔全球大中盘指数(使用估值汇率折算)*6%+中证港股通综合指数收益率*2%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率*6%+银行活期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平理论上高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金若投资港股通标的证券，需承担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。	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）A	信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	026793	026794
报告期末下属分级基金的份额总额	203,234,765.96 份	68,321,781.54 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 (2026 年 4 月 8 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日)	
	信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）A	信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）C

1.本期已实现收益	-94,018.43	-78,596.48
2.本期利润	4,189,646.52	1,360,898.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0206	0.0199
4.期末基金资产净值	207,424,412.48	69,682,680.52
5.期末基金份额净值	1.02	1.02

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）A

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	2.06%	0.24%	2.70%	0.38%	-0.64%	-0.14%

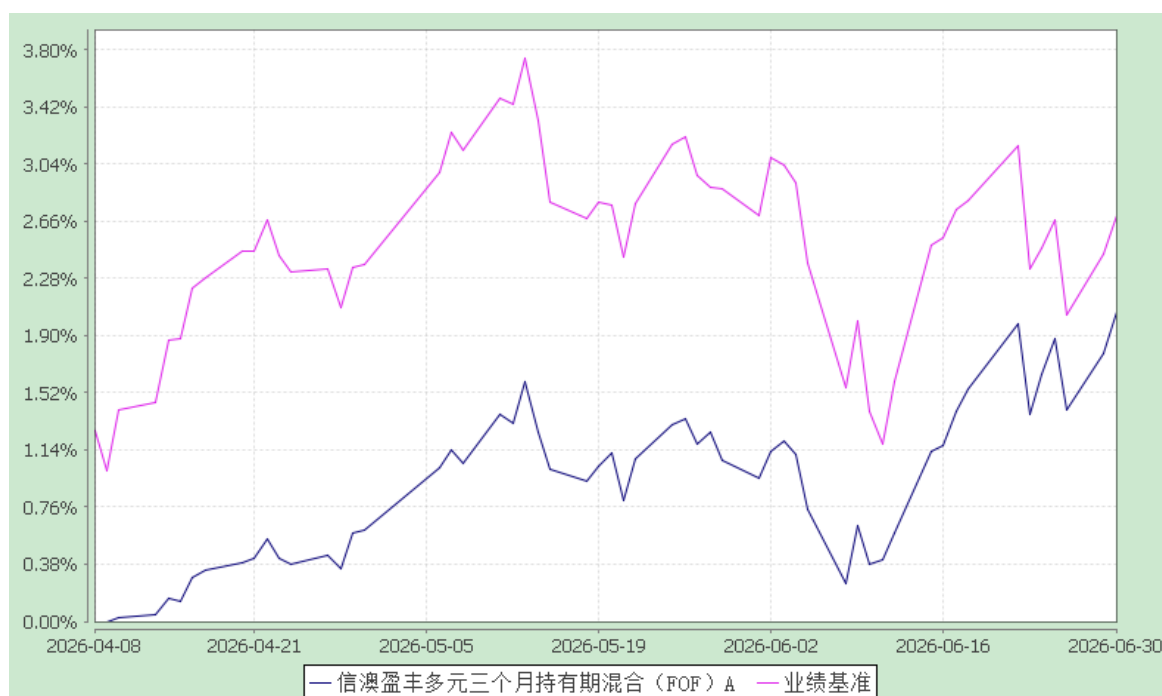
信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）C

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	1.99%	0.23%	2.70%	0.38%	-0.71%	-0.15%

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

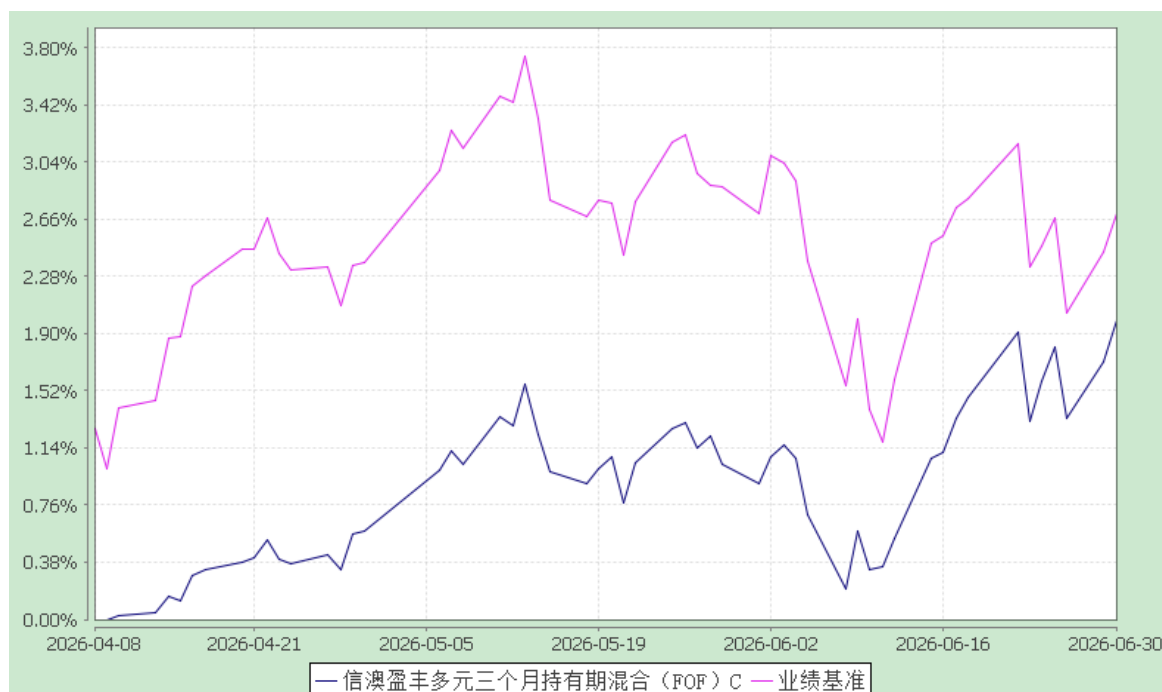
信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2026 年 4 月 8 日至 2026 年 6 月 30 日）



信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）C 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

（2026 年 4 月 8 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：1、本基金合同于 2026 年 04 月 08 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。截至

本报告期末，本基金尚处建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。

§ 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		
王奕蕾	本基金的基金经理	2026-04-08	-	13.5 年	中央财经大学金融学硕士。历任方正证券股份有限公司研究所研究员、固定收益分析师和基金分析师。2016 年 9 月加入新华基金管理股份有限公司，先后担任基金投资部总监和投资决策委员会委员、专户 FOF 产品投资经理、公募 FOF 基金经理。2022 年 9 月加入信达澳亚基金管理有限公司，现任 FOF 和养老投资部负责人。现任信澳通合稳健三个月持有期混合（FOF）基金经理（2023 年 7 月 28 日起至今）、信澳颐宁养老目标一年持有期混合型（FOF）基金经理（2024 年 11 月 28 日起至今）、信澳颐远养老目标 2055 五年持有期混合型发起式(FOF)基金经理（2025 年 1 月 27 日起至今）、信澳盈泰稳健 3 个月持有期混合型(FOF)基金经理(2026 年 2 月 3 日起至今)、信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）基金经理（2026 年 4 月 8 日起至今）。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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未出现超过该证券当日成交量的 5%的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年二季度，A 股走出触底反弹行情，市场完成对一季度地缘冲击的修复，但内部结构持续分化。季度伊始，随着美伊冲突缓和、地缘避险情绪消退，风险偏好快速回暖，主要指数在 4 月集体反弹；进入 5~6 月，指数层面的贝塔行情转为高度分化的结构行情，市场聚焦确定性景气赛道，AI 算力、半导体、通信等高景气科技成长板块凭借订单与业绩持续兑现，成为市场核心主线、持续超额收益显著；而前期走强的周期资源品随大宗商品价格回落走弱，消费、地产链受内需修复偏弱制约，整体

表现相对低迷。从指数表现看，二季度 A 股宽基普涨但内部严重分化：上证指数上涨 5.20%、沪深 300 上涨 11.90%、中证 800 上涨 13.71%、深证成指上涨 20.24%；成长风格显著占优，创业板指大涨 36.35%，科创 50 更是单季暴涨 75.74%，为全市场表现最强的宽基指数；与之相对，红利风格逆势走弱，中证红利二季度下跌 12.32%，凸显极致的“成长强、价值弱”分化格局。港股表现相对落后，恒生指数二季度下跌约 7.69%，恒生科技指数下跌约 3.82%。

本基金 4 月初成立，考虑稳健客户的持有体验，稳步建仓，同时根据安全垫的累积情况逐渐放大权益仓位。目前还在建仓过程中，由于产品成立不久市场就进入了高波动阶段，所以目前整体仓位低于业绩基准，从结构上来看，持仓整体均衡偏成长，在二季度权益市场触底反弹过程中，获得了一定收益，后续将根据市场情况进行进一步均衡配置。

展望后市，海外宏观方面，6 月中东局势迎来关键转折，美伊达成首轮谈判协议，霍尔木兹海峡逐步恢复通行，短期仍需跟踪海峡通航进展、中东原油复产与补库变化，但下半年全球宏观环境有望趋于缓和，地缘因素将不再主导市场，市场焦点或将转向美国内部变量，预计经济数据、美联储货币政策、中期选举等因素将持续主导全球流动性走向与大类资产行情。国内方面，今年以来国内经济的 K 型分化持续深化，供强需弱、新强旧弱的格局突出。一方面，全球 AI 产业浪潮带动相关科技制造、上游材料行业高景气；另一方面，国内投资、消费持续放缓，内需复苏动能依旧偏弱。现阶段经济走势呈现明显的结构性特征、总量修复偏弱，后续稳增长政策的节奏、力度与空间仍取决于后续宏观基本面的修复态势，需结合下半年核心经济数据的边际演绎，进一步观测政策对冲的调整窗口与发力维度。

权益市场方面，国内经济维持弱复苏节奏，信用环境整体保持平稳，宽基指数大概率以区间震荡为主；经济结构 K 型分化特征持续凸显，市场行情机会将集中于结构性主线。当前成长赛道交易拥挤度仍处高位，板块波动或进一步放大，但 K 型分化格局短期难以扭转，市场或将延续高位震荡、多风格轮动的运行格局。配置层面，组合继续秉持均衡偏成长的整体思路：成长端重点聚焦全球高景气赛道与产业趋势共振方向，围绕业绩确定性、预期差修复两条主线，积极把握市场结构性投资机会；价值端以优质底仓资产夯实组合安全垫，持续增强防御属性，对冲宏观环境波动带来的不确定性。债券方面，中长期来看，国内地产、消费内需修复力度偏弱，实体融资需

求不足，资产荒大环境并未发生改变，利率未见趋势性上行基础，预计债市震荡偏强的运行主线有望延续。

黄金方面，二季度，市场利率预期的反转推动美元走强，6 月美元指数升至 101 上方，为 2025 年 4 月以来新高。而美元作为黄金的计价货币，美元走强时金价天然受到被动压制，同时也直接抬升非美投资者持有黄金的机会成本。短期金价因加息预期充分计入，存在超跌修复行情；中期来看，美元与实际利率“双强”的基准情形仍将持续压制金价。拉长周期看，黄金的长期配置逻辑仍来自于全球主权国家去美元化进程，叠加美国债务风险并未消解，美债高利率环境难以长期持续，黄金对冲货币信用风险的价值依旧突出。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.0206 元，份额累计净值为 1.0206 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 2.06%，同期业绩比较基准收益率为 2.70%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.0199 元，份额累计净值为 1.0199 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 1.99%，同期业绩比较基准收益率为 2.70%。

4.6 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	256,692,785.84	92.56
3	固定收益投资	14,090,746.85	5.08
	其中：债券	14,090,746.85	5.08
	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	6,515,669.91	2.35
8	其他资产	25,985.02	0.01
9	合计	277,325,187.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	14,090,746.85	5.08
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	14,090,746.85	5.08
----	----	---------------	------

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	019827	26 国债 01	140,000	14,090,746.85	5.08

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

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序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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

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报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

本基金本报告期末无股票投资。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,985.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	25,985.02

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 报告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的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例	是否属于基金管理人
----	------	------	------	---------	---------	-----------	-----------

						(%)	及管理 人关联 方所管 理的基 金
1	000037	广发景 宁纯债 债券 A	契约型 开放式	12,445,2 37.31	15,101,05 0.95	5.45	否
2	019873	长城短 债债券 E	契约型 开放式	12,103,2 81.66	15,084,31 9.93	5.44	否
3	019070	永赢开 泰中高 等级中 短债债 券 E	契约型 开放式	11,467,8 04.96	13,561,82 6.15	4.89	否
4	022207	鹏华丰 恒债券 B	契约型 开放式	13,162,0 51.48	13,524,00 7.90	4.88	否
5	021601	交银施 罗德稳 利中短 债债券 E	契约型 开放式	12,638,6 86.13	13,044,38 7.95	4.71	否
6	006684	富国信 用债债 券 D	契约型 开放式	8,304,39 3.78	11,072,24 8.23	4.00	否
7	675163	西部利 得汇盈 债券 C	契约型 开放式	10,071,4 15.49	11,069,49 2.77	3.99	否
8	006337	华安安 浦债券 A	契约型 开放式	8,420,91 9.66	10,074,78 8.28	3.64	否
9	675113	西部利 得汇享 债券 C	契约型 开放式	7,288,09 8.54	10,021,86 4.30	3.62	否
10	000069	国投瑞 银中高 等级债 券 A	契约型 开放式	8,607,95 4.55	10,021,38 0.69	3.62	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026 年 4 月 8 日（基金合同 生效日）至 2026 年 6 月 30 日	其中：交易及持有基金管理 人以及管理人关联方所管理 基金产生的费用
----	---	---

当期交易基金产生的 申购费（元）	13,197.84	-
当期交易基金产生的 赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的 应支付销售服务费 （元）	28,846.57	-
当期持有基金产生的 应支付管理费（元）	227,464.41	6,651.35
当期持有基金产生的 应支付托管费（元）	57,932.61	1,662.81

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳盈丰多元三个 月持有期混合(FOF) A	信澳盈丰多元三个 月持有期混合(FOF) C
基金合同生效日基金份额总额	203,234,765.96	68,321,781.54
基金合同生效日起至报告期期末基 金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期 末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基 金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	203,234,765.96	68,321,781.54

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人报告期末未运用固有资金投资本基金。

§ 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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳盈丰多元三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《信澳盈丰多元三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二六年七月二十一日