

汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金
(F0F)

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08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01月20日（基金合同生效日）起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16

§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
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	48
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	48
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	48
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	48
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	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 本报告期投资基金情况	49

7.13 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	55
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.8 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	55
10.9 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62

12.3 查阅方式.....	62
----------------	----

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	
基金简称	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF)	
基金主代码	025972	
基金运作方式	契约型开放式，本基金对每份基金份额设置 3 个月的最短持有期，每份基金份额的最短持有期到期日起（含当日），基金份额持有人可对该基金份额提出赎回申请。	
基金合同生效日	2026 年 01 月 20 日	
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	430,128,584.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) A	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	025972	025973
报告期末下属分级基金的份额总额	267,599,962.40 份	162,528,621.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、 资产配置策略 本基金以多元资产配置和波动率控制作为指导资产配置的主要目标。 在多元资产配置上，一方面，基金经理会利用主动和量化的手段，强调底层资产间的比较，通过对底层资产特性的研究，找到资产之间定价的锚，比较各类资产的性价比，以便基于基准进行配置；另一方面，基金经理也会借助一些自上而下的方法，例如改良后的资产平价策略对经典的海外资产给予配置比例的建议。在波动率控制上，基金经理将基于风险预算，对各类资产的比例或者筛选标准进行战术性调整，以便使基金的风险始终控制在预设范围内。 2、 基金投资策略 本基金可投资的子基金需首先满足：子基金运作期限应当不少于 1 年，最近定期报告披露的基金净资产应当不低于 1 亿元。如法律法规或监管机构对被投资子基金条件进行变更的，以变更后的规定为准。 对于不同类别的公募基金，本基金将分别按照不同的指标进行筛选。此外，本基金还将定期对投资组合进行回顾和动态调

	整，剔除不再符合筛选标准的标的基金，增加符合筛选标准的基金。本基金将结合市场研判，调整基金投资比例和投资标的，动态优化投资组合。 3、股票投资策略 在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金可适度参与股票等权益类资产的投资，以增加基金收益。本基金将定性和定量分析，充分发挥基金管理人投研团队自上而下的主动选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司。 4、债券投资策略 本基金将采用自上而下的投资策略决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置；同时在对企业债券进行信用评级的基础上，综合考量企业债券（含公司债、企业短期融资券）的信用评级以及包括其它券种在内的债券流动性、供求关系、收益率水平等因素，自下而上地配置债券类属和精选个券。通过综合运用骑乘操作、套利操作、新股认购等策略，提高债券投资收益。 5、可转换债券及可交换债券投资策略 本基金在综合分析可转换债券及可交换债券的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上，审慎筛选其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，以及基础股票基本面优良的品种，并以合理的价格买入，争取稳健的投资回报。 6、资产支持证券投资策略 本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。 7、港股投资策略 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者 (QDII) 境外投资额度进行境外投资。本基金将优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。 8、存托凭证投资策略 本基金可投资存托凭证。本基金将结合宏观经济状况、市场估值、发行人基本面情况等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，精选出具有比较优势的存托凭证进行投资。
业绩比较基准	中债新综合财富（总值）指数收益率$\times$75%+中证 800 指数收益率$\times$14%+恒生指数收益率(经汇率调整)$\times$1%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率$\times$5%+银行活期存款利率(税后)$\times$5%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金及债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合

	交易所上市的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还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		汇丰晋信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周慧	方圆
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-20376888	95559
传真		021-20376999	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		刘鹏飞	任德奇

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金中期报告置备地点	汇丰晋信基金管理有限公司：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼；交通银行股份有限公司：中国（上海）长宁区仙霞路 18 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇丰晋信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

§ 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 01 月 20 日（基金合同生效日）-2026 年 06 月 30 日）	
	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合（FOF）A	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合（FOF）C
本期已实现收益	-2,717,599.50	-2,561,916.54
本期利润	1,291,564.43	731,170.26
加权平均基金份额本期利润	0.0043	0.0030
本期加权平均净值利润率	0.43%	0.30%
本期基金份额净值增长率	0.45%	0.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-2,444,192.38	-1,770,270.15
期末可供分配基金份额利润	-0.0091	-0.0109
期末基金资产净值	268,797,943.53	162,967,330.24
期末基金份额净值	1.0045	1.0027
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	0.45%	0.27%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

3. 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、红利再投资费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金的基金合同于 2026 年 1 月 20 日生效。

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

汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合（FOF）A 净值表现

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	1.56%	0.20%	1.97%	0.24%	-0.41%	-0.04%
自基金合同生效起至今	0.45%	0.20%	1.48%	0.28%	-1.03%	-0.08%

注：

过去三个月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2026 年 1 月 20 日-2026 年 6 月 30 日

汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合（FOF）C 净值表现

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		
过去三个月	1.45%	0.20%	1.97%	0.24%	-0.52%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	0.27%	0.20%	1.48%	0.28%	-1.21%	-0.08%

注：

过去三个月指 2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日

自基金合同生效起至今指 2026 年 1 月 20 日-2026 年 6 月 30 日

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

汇丰晋信多元稳健配置3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历史走势对比图

(2026年01月20日-2026年06月30日)



注：

1. 本基金的基金合同于 2026 年 1 月 20 日生效，截至 2026 年 6 月 30 日基金合同生效未满 1 年。
2. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金、混合型基金（基金合同约定股票资产（含存托凭证）投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金，或者根据基金披露的定期报告最近四个季度股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例均不低于 60%的混合型基金）等权益类资产的比例为基金资产的 5%-30%（其中，本基金投资于境内股票及境内股票型基金占基金资产的比例不低于 5%）。本基金投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本基金投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不超过基金资产的 10%。本基金投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。
3. 本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截至本报告期末，本基金已完成建仓。
4. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 中债新综合财富（总值）指数收益率 $\times$ 75% + 中证 800 指数收益

率 $\times 14\%$ +恒生指数收益率(经汇率调整) $\times 1\%$ +上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率 $\times 5\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

5. 本基金业绩比较基准中的中债新综合财富(总值)指数收益率考虑了付息日利息再投资因素,在样本券付息时利息再投资计入指数之中。

6. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含中证 800 指数、恒生指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

汇丰晋信多元稳健配置3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历史走势对比图

(2026年01月20日-2026年06月30日)



注:

1. 本基金的基金合同于 2026 年 1 月 20 日生效,截至 2026 年 6 月 30 日基金合同生效未满 1 年。
2. 按照基金合同的约定,本基金的投资组合比例为:本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%,其中,投资于股票、股票型基金、混合型基金(基金合同约定股票资产(含存托凭证)投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金,或者根据基金披露的定期报告最近四个季度股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例均不低于 60%的混合型基金)等权益类资产的比例为基金资产的 5%-30%(其中,本基金投资于境内股票及境内股票型基金占基金资产的比例不低于 5%)。本基金投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本基金投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金投资于商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)的比例不超过基金资产的 10%。本基金投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。
3. 本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截至本报告期末,本基金已完成建仓。
4. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 中债新综合财富(总值)指数收益率 $\times 75\%$ +中证 800 指数收益率 $\times 14\%$ +恒生指数收益率(经汇率调整) $\times 1\%$ +上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率 $\times 5\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。
5. 本基金业绩比较基准中的中债新综合财富(总值)指数收益率考虑了付息日利息再投资因素,在

样本券付息时利息再投资计入指数之中。

6. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含中证 800 指数、恒生指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

§ 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

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 11 月 16 日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在上海。截止 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 44 只开放式基金：汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金（2006 年 5 月 23 日成立）、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金（2006 年 9 月 27 日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007 年 4 月 9 日成立）、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金（2008 年 7 月 23 日成立）、汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金（自 2020 年 11 月 19 日起，原汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金转型为汇丰晋信平稳增利中短债债券型证券投资基金）、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金（2009 年 6 月 24 日成立）、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金（2009 年 12 月 11 日成立）、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金（2010 年 6 月 8 日成立）、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金（2010 年 12 月 8 日成立）、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金（2011 年 7 月 27 日成立）、汇丰晋信货币市场基金（2011 年 11 月 2 日成立）、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（2012 年 8 月 1 日成立）、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金（2014 年 11 月 26 日成立）、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金（2015 年 2 月 11 日成立）、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金（2015 年 9 月 30 日成立）、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金（2016 年 3 月 11 日成立）、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金（2016 年 11 月 10 日成立）、汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金（2017 年 6 月 2 日成立）、汇丰晋信价值先锋股票型证券投资基金（2018 年 11 月 14 日成立）、汇丰晋信港股通精选股票型证券投资基金（2019 年 3 月 20 日成立）、汇丰晋信港股通双核策略混合型证券投资基金（2019 年 8 月 2 日成立）、汇丰晋信慧盈混合型证券投资基金（2020 年 7 月 30 日成立）、汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金（2020 年 8 月 13 日成立）、汇丰晋信惠安纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金（2020 年 10 月 29 日成立）、汇丰晋信创新先锋股票型证券投资基金（2021 年 3 月 16 日成立）、汇丰晋信核心成长混合型证券投资基金（2021 年 5 月 24 日成立）、汇丰晋信医疗先锋混合型证券投资基金（2021 年 7 月 12 日成立）、汇丰晋信研究精选混合型证券投资基金（2022 年 1 月 21 日成立）、汇丰晋信慧悦混合型证券投资基金（2022 年 3 月 3 日成立）、汇丰晋信时代先锋混合型证券投资基金（2022 年 6 月 8 日成立）、汇丰晋信丰盈债券型证券投资基金（2022 年 8 月 16 日成立）、汇丰晋信策略优选混合型证券投资基金（2022 年 9 月 14 日成立）、汇丰晋信龙头优势混合型证券投资基金（2022 年 9 月 27 日成立）、汇丰晋信丰宁三个月定期开放债券型证券投资基金（2022 年 12 月 20 日成立）、汇丰晋信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有

期证券投资基金（2023 年 12 月 12 日成立）、汇丰晋信慧鑫六个月持有期债券型证券投资基金（2024 年 4 月 16 日成立）、汇丰晋信养老目标日期 2036 一年持有期混合型基金中基金 (FOF)（2024 年 6 月 12 日成立）、汇丰晋信绿色债券型证券投资基金（2024 年 12 月 11 日成立）、汇丰晋信景气优选混合型证券投资基金（2025 年 5 月 28 日成立）、汇丰晋信港股通核心资产股票型发起式证券投资基金（2025 年 8 月 12 日成立）、汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)（2026 年 1 月 20 日成立）、汇丰晋信周期优选股票型证券投资基金（2026 年 3 月 11 日成立）、汇丰晋信港股精选股票型证券投资基金 (QDII)（2026 年 4 月 30 日成立）和汇丰晋信慧泰债券型证券投资基金（2026 年 6 月 24 日成立）。

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		
何喆	汇丰晋信基金管理有限公司 FOF 投资部总监兼汇丰晋信养老目标日期 2036 一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理	2026-01-20	-	22 年	何喆先生，硕士研究生，特许金融分析师，中国保险精算师。曾任华安基金管理有限公司精算顾问、汇丰晋信基金管理有限公司企业战略拓展部经理、企业战略拓展部高级经理、产品开发部副总监、产品开发部总监（负责证券投资策略研究开发和产品设计）、投资经理、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金和汇丰晋信中小盘低波动策略股票型证券投资基金基金经理，现任汇丰晋信

					基金管理有限公司 FOF 投资部总监兼汇丰晋信养老目标日期 2036 一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限是证券投资相关的工作经历年限。

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《证券投资基金法》及其他相关法规、中国证监会的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，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

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

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待，充分保护基金份额持有人的合法权益，汇丰晋信基金管理有限公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》规定：在投资管理活动中应公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。《公平交易制度》适用于投资的全过程，用以规范基金投资相关工作，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、以及投资管理过程中涉及的行为监控和业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司各相关部门均按照公平交易制度的规定进行投资管理活动、研究分析活动以及交易活动。同时，我公司切实履行了各项公平交易行为监控、分析评估及报告义务，并建立了相关记录。

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，加强防范不同投资组合

之间可能发生的利益输送，密切监控可能会损害基金份额持有人利益的异常交易行为。

报告期内，公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》的规定，对同一投资组合以及不同投资组合中的交易行为进行了监控分析，未发现异常交易行为。

报告期内未发生各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。

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

由于三月份的美伊冲突，本基金承受了一定的回撤压力，在三月底时，我们已将权益持仓下调，此外，出于多元配置和波动率管理的考虑，我们持仓主题较为分散，并没有集中在 AI 板块主题。

在上半年，我们非科技的板块主要集中在有色、碳酸锂、贵金属的仓位，但事后看，美联储的鹰派发言和贵金属价格的下跌拖累了整个有色板块的表现，并裹挟了碳酸锂价格的进一步下跌。因此，新能源和有色板块是我们上半年影响组合表现的主要原因。

在黄金类的投资上，我们认为受制于高油价对于通胀的影响，今年联储的降息次数在最乐观的情景下可能也就是一次，这从很大程度上压制了黄金的空间，因此，我们在黄金类资产的权重在上半年逐步下降。

在国内债券品种上，由于 3 月份整个市场风险偏好的下降，导致大量资金涌入短债基金，我们注意到短债收益率已经相对较低，因此在二季度，我们将一部分短债基金仓位转换为二级债基。

在美债资产上，我们担忧油价长期维持在高位，并逐步抬升美国通胀压力，在观察到 10y 美债收益率突破 4.5% 后，我们认为亚洲美元债的风险在积累，此类资产的性价比和风险收益比不高，因此在二季度我们清仓了剩下的美债资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.45%，同期业绩比较基准收益率为 1.48%，净值表现落后同期比较基准 1.03%；本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.27%，同期业绩比较基准收益率为 1.48%，净值表现落后同期比较基准 1.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在国内权益市场上，除了传统的底仓类、红利类品种外，我们认为未来可能有三条可布局的方向：

对下半年的权益配置，我们预计主题间的再平衡是主要的趋势，但市场可能缺乏明确的主线。对科技类主题而言，景气度高而拥挤度过高，交易难度愈发加大，我们会维持小部分仓位进行配置；对于非科技类主题而言，我们认为低估值板块，尤其是内需相关的资产有修复的可能，但可能不具备较好弹性，仅在风险偏好急剧下降的时候可以起到支撑作用；相较而言，我们比较看好有色、AI 应用等资产。

在权益资产配置上，我们认为以红利加微盘策略可能是下半年比较稳健的策略，在此基础上，计划将维持一部分仓位在有色、科技、AI 应用、恒生互联网上，以期对组合提供一定的弹性。

对于黄金类资产，我们认为今年缺乏新的宏观事件驱动，黄金或将回归受实际利率和美元指数制约的框架，预计区间震荡。我们观察到黄金已经与地缘摩擦和油价逐步脱敏，价格低位特质已然出现，但进一步上涨的空间受联储政策和美债收益率的压制，因此，我们维持了中性持仓，但如果美联储政策发生改变，或美元信用逻辑出现变化，则我们会对黄金仓位进行调整。

在商品中，我们比较看好铜价的走势，因此对于有色商品类持仓，我们以配置的思路维持了部分有色 ETF 的持仓。

在亚洲美债资产上，我们认为缺乏上涨的动力，但尾部风险已经逐步消除。与国内债券资产持续低息的情况看，目前的票息具有吸引力。我们观察到最近美债收益率与油价逐步脱敏，且油价失控上涨的尾部风险已经降低，美国 CPI 若想逐步降低，联储加息的可能性会逐步降低，因此亚洲美元债资产作为美债资产的延升，具备了布局的可能性。我们未来也会关注此类产品的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，更好地保护基金份额持有人的合法权益，根据企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引，结合本基金基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司特设估值委员会作为公司基金估值的主要决策机关。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规以及基金估值运作等方面的专业胜任能力，估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的证券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂不进行利润分配。

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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 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

本报告期内，基金托管人在汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	41,102,442.62
结算备付金		106,750.91
存出保证金		55,955.41
交易性金融资产	6.4.7.2	397,770,607.15
其中：股票投资		-
基金投资		397,770,607.15
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		10,502,242.64

应收股利		-
应收申购款		42,106.72
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	1,062.86
资产总计		449,581,168.31
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 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		-
应付赎回款		17,573,428.83
应付管理人报酬		100,283.19
应付托管费		33,739.86
应付销售服务费		58,734.80
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	49,707.86
负债合计		17,815,894.54
净资产:		
实收基金	6.4.7.7	430,128,584.29
未分配利润	6.4.7.8	1,636,689.48
净资产合计		431,765,273.77
负债和净资产总计		449,581,168.31

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 430,128,584.29 份，其中 A 类基金份额总额为 267,599,962.40 份，基金份额净值 1.0045 元；C 类基金份额总额为 162,528,621.89 份，基金份额净值 1.0027 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2026 年 01 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 20 日 (基金合同 生效日) 至 2026 年 06 月 30 日
------------	------------	--

一、营业总收入		3,315,164.78
1. 利息收入		34,331.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	16,286.98
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		18,044.80
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,154,559.48
其中：股票投资收益	6.4.7.10	—
基金投资收益	6.4.7.11	-5,246,045.36
债券投资收益	6.4.7.12	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—
股利收益	6.4.7.16	1,091,485.88
其他投资收益		—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,302,250.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	133,141.75
减：二、营业总支出		1,292,430.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	625,690.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	210,110.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	431,267.99
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		0.85
8. 其他费用	6.4.7.20	25,360.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,022,734.69
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,022,734.69
五、其他综合收益的税后净额		—
六、综合收益总额		2,022,734.69

6.3 净资产变动表

会计主体：汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	584,275,656.04	-	584,275,656.04
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-154,147,071.75	1,636,689.48	-152,510,382.27
（一）、综合收益总额	-	2,022,734.69	2,022,734.69
（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）	-154,147,071.75	-386,045.21	-154,533,116.96
其中：1. 基金申购款	1,087,350.11	1,356.30	1,088,706.41
2. 基金赎回款	-155,234,421.86	-387,401.51	-155,621,823.37
（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	430,128,584.29	1,636,689.48	431,765,273.77

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：

李选进	苑忠磊	张薇
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

汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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[2025]第 2302 号《关于准予汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 注册的批复》核准，由汇丰晋信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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 584,106,471.81 元，业经普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2026)第 0002 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》于 2026 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日

的基金份额总额为 584,275,656.04 份基金份额，其中认购资金利息折合 169,184.23 份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据经批准的《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》和《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，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、但不计提销售服务费的，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，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金为 A 类基金份额及 C 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。投资人在认购/申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金设置基金份额持有人最短持有期，基金份额持有人持有的每份基金份额最短持有期为 3 个月。对于每份基金份额，最短持有期起始日指基金合同生效日 (对认购份额而言) 或该基金份额申购申请确认日 (对申购份额而言)；最短持有期到期日指该基金份额最短持有期起始日起 3 个月后的对应日。如无此对应日期或该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。在每份基金份额的最短持有期到期日前 (不含当日)，基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请；每份基金份额的最短持有期到期日起 (含当日)，基金份额持有人可对该基金份额提出赎回申请。因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在该基金份额的最短持有期到期日开放办理该基金份额的赎回业务的，该基金份额的最短持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金 (含公开募集基础设施证券投资基金 (以下简称“公募 REITs”)、QDII 基金、商品基金 (含商品期货基金和黄金 ETF) 和香港互认基金)、国内依法发行或上市的股票 (含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准上市或准予注册的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券 (国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券 (含可分离交易可转换债券)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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。基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金、混合型基金 (基金合同约定股票资产 (含存托凭证) 投资比例不低于基金资产 60% 的混合型基金，或者根据基金披露的定期报告最近四个季度股票资产 (含存托凭证) 占基金资产的比例均不低于 60% 的混合型基金) 等权益类资产的比例为基金资产的 5%-30% (其中，本基金投资于境内股票及境内股票型基金占基金资产的比例不低于 5%)。本基金投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本基金投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金投资于商品基金 (含商品期货基金和黄金 ETF) 的比例不超过基金资产的 10%。本基金投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%；本基金保留的现金或到期日在 1 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、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富（总值）指数收益率 $\times$ 75%+中证 800 指数收益率 $\times$ 14%+恒生指数收益率（经汇率调整） $\times$ 1%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率 $\times$ 5%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 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”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）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》、《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》和在财务报表附注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 2026 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方

式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本 and 努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和基金投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要

求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法

逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金

持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(3) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，按采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金 (LOF) 及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 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。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。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。

对基金通过港股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。基金通过港股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。基金通过港股通买卖、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 2026 年 06 月 30 日
活期存款	41,102,442.62
等于：本金	41,101,936.09
加：应计利息	506.53
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	41,102,442.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
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		390,468,356.42	-	397,770,607.15	7,302,250.73
其他		-	-	-	-
合计		390,468,356.42	-	397,770,607.15	7,302,250.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	1,062.86
待摊费用	-
合计	1,062.86

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	26,297.24
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	23,410.62
合计	49,707.86

6.4.7.7 实收基金

汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	312,348,667.40	312,348,667.40
本期申购	846,783.45	846,783.45
本期赎回 (以“-”号填列)	-45,595,488.45	-45,595,488.45

本期末	267,599,962.40	267,599,962.40
-----	----------------	----------------

汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合（FOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	271,926,988.64	271,926,988.64
本期申购	240,566.66	240,566.66
本期赎回（以“-”号填列）	-109,638,933.41	-109,638,933.41
本期末	162,528,621.89	162,528,621.89

注：1、本基金自 2025 年 12 月 22 日至 2026 年 1 月 16 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 584,106,471.81 元，折合为 584,106,471.81 份基金份额。根据《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 169,184.23 元在本基金成立后，折合为 584,275,656.04 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》、《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》及《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金 A 类份额和 C 类份额于 2026 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2026 年 2 月 11 日止期间暂不向投资人开放基金交易。本基金 A 类份额和 C 类份额申购业务和定期定额投资业务自 2026 年 2 月 12 日起开始办理，赎回业务自 2026 年 4 月 20 日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合（FOF）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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,717,599.50	4,009,163.93	1,291,564.43
本期基金份额交易产生的变动数	273,407.12	-366,990.42	-93,583.30
其中：基金申购款	-3,207.10	4,382.69	1,175.59
基金赎回款	276,614.22	-371,373.11	-94,758.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,444,192.38	3,642,173.51	1,197,981.13

汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合（FOF）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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,561,916.54	3,293,086.80	731,170.26
本期基金份额交易产	791,646.39	-1,084,108.30	-292,461.91

生的变动数			
其中：基金申购款	-1,343.91	1,524.62	180.71
基金赎回款	792,990.30	-1,085,632.92	-292,642.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,770,270.15	2,208,978.50	438,708.35

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	15,771.35
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	465.18
其他	50.45
合计	16,286.98

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	428,260,961.17
减：卖出/赎回基金成本总额	433,358,964.85
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	148,041.68
基金投资收益	-5,246,045.36

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,091,485.88
合计	1,091,485.88

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,302,250.73
——股票投资	—
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	7,302,250.73
——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	7,302,250.73

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	114,226.05
基金销售服务费返还收入	18,915.70
合计	133,141.75

注：本基金对于持有 A 类基金份额持有期少于 180 日的基金份额收取 0.5% 的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 归入基金财产；对于持有 A 类基金份额持有期不少于 180 日的基金份额不收取赎回费。本基金对于 C 类基金份额持有人不收取赎回费。

6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	105,789.79
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	946,418.75
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	230,243.58

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	23,410.62
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,950.00
合计	25,360.62

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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
汇丰晋信基金管理有限公司（“汇丰晋信”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	625,690.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	363,161.81
应支付基金管理人的净管理费	262,528.50

注：本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金管理人自身管理的基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.30% 年费率计提。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的公开募集证券投资基金份额所对应资产净值后的剩余部分，如扣除后 $E < 0$ ，则 E 取 0。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	210,110.32

注：本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金托管人自身托管的基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.10% 的年费率计提。基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的公开募集证券投资基金份额所对应资产净值后的剩余部分，如扣除后 $E < 0$ ，则 E 取 0。

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	本期
-----------	----

关联方名称	2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) A	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) C	合计
汇丰晋信	-	13.34	13.34
交通银行	-	429,966.84	429,966.84
合计	-	429,980.18	429,980.18

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额不收取认购/申购费，收取年费率为 0.40% 的销售服务费。本基金销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的市场推广、销售以及 C 类基金份额持有人的服务。在通常情况下，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的年费率计提。基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算方法如下：

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值。

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	41,102,442.62	15,771.35

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人汇丰晋信所管理的公开募集证券投资基金，成

本总额为人民币 37,954,350.82 元，估值总额为人民币 40,724,628.06 元，占本基金基金净资产的比例为 9.43%。

6.4.10.7.2 当期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

项目	本期 2026 年 01 月 20 日（基金合同生效日） 至 2026 年 06 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	28,973.30
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	18,915.70
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	149,789.80
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	38,600.97
当期交易基金产生的交易费（元）	-

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为零，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 06 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。

6.4.13 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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险控制与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司首席执行官负责，监察稽核部向督察长报告工作。

本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、监察稽核部、风险管理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是通过结合定性分析和定量分析方法，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的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，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交通银行，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，在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台或经批准的其他销售机构办理，违约可能性很小；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 06 月 30 日，本基金无债券投资。

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。

于 2026 年 06 月 30 日，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 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。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金 (ETF 联接基金除外) 不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券 (不含本基金所投资的基金份额) 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 (不含本基金所投资的基金份额) 不得超过该证券的 10% (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，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，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。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；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、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计 息	合 计
资产							
货币资金	41,102,442.62	-	-	-	-	-	41,102,442.62
结算备付金	106,750.91	-	-	-	-	-	106,750.91

							91
存出保证金	55,955.41	-	-	-	-	-	55,955.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	397,770,607.15	397,770,607.15
应收清算款	-	-	-	-	-	10,502,242.64	10,502,242.64
应收申购款	-	-	-	-	-	42,106.72	42,106.72

							· 7 2
其他资产	-	-	-	-	-	1,062.86	1,062.86
资产总计	41,265,148.94	-	-	-	-	408,316,019.37	444,915,831.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,573,428.83	17,573,428.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	100,283.19	100,283.19

							8 3 . 1 9
应付托管费	-	-	-	-	-	33,739.86	3 3 , 7 3 9 . 8 6
应付销售服务费	-	-	-	-	-	58,734.80	5 8 , 7 3 4 . 8 0
其他负债	-	-	-	-	-	49,707.86	4 9 , 7 0 7 . 8 6
负债总计	-	-	-	-	-	17,815.94	1 7 , 8 1 5 , 9 4 . 5 4

							4
利率敏感度缺口	41,265,148.94	-	-	-	-	390,500,124.83	431,765,124.83

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 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、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，本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金、混合型基金（基金合同约定股票资产（含存托凭证）投资比例不低于基金资产 60% 的混合型基金，或者根据基金披露的定期报告最近四个季度股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例均不低于 60% 的混合型基金）等权益类资产的比例为基金资产的 5%-30%（其中，本基金投资于境内股票及境内股票型基金占基金资产的比例不低于 5%）。本基金投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本基金投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%。

本基金投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不超过基金资产的 10%。本基金投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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 2026 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	—	—
交易性金融资产—基金投资	397,770,607.15	92.13
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	397,770,607.15	92.13

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(附注 6.4.1)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 06 月 30 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	14,114,439.00
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-14,114,439.00

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 06 月 30 日
第一层次	397,770,607.15
第二层次	—
第三层次	—
合计	397,770,607.15

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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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 06 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。

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	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	397,770,607.15	88.48
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	41,209,193.53	9.17
8	其他各项资产	10,601,367.63	2.36
9	合计	449,581,168.31	100.00

注：权益投资中未通过沪港通机制、深港通机制投资香港股票。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

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

无。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

在严格控制风险的前提下，本基金通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金以多元资产配置和波动率控制作为指导资产配置的主要目标，主要投资于其他公开募集的基金，对于不同类别的公募基金，本基金将分别按照不同的指标进行筛选。此外，本基金将对投资组合进行回顾和动态调整，将结合市场研判，优化投资组合。

本基金所持有的基金的业绩表现、持有基金的基金管理人水平等因素可能影响到本基金的基金业绩表现，同时，本基金可能会面临所持有的证券投资基金的基金运作风险、价格波动风险、流动性风险等。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策，投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

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	006829	鹏扬利沣 短债 A	契约型开 放式	33,536,9 47.98	36,632,4 08.28	8.48	否
2	519199	万家家享 中短债 A	契约型开 放式	34,747,3 48.59	36,557,6 85.45	8.47	否
3	511360	海富通中	交易型开	312,100.	35,457,6	8.21	否

		证短融 ETF	放式	00	81.00		
4	014910	东方红短 债债券 A	契约型开 放式	31,660,4 86.12	34,544,7 56.41	8.00	否
5	005079	兴银鑫日 享短债 A	契约型开 放式	30,935,1 29.83	33,768,7 87.72	7.82	否
6	540005	汇丰晋信 平稳增利 中短债债 券 A	契约型开 放式	28,649,3 96.73	32,290,7 35.05	7.48	是
7	001258	兴业收益 增强债券 C	契约型开 放式	12,980,0 30.81	20,742,0 89.23	4.80	否
8	007246	安信鑫日 享中短债 C	契约型开 放式	16,217,2 39.58	18,518,4 65.88	4.29	否
9	001257	兴业收益 增强债券 A	契约型开 放式	9,339,47 4.32	15,531,5 45.79	3.60	否
10	005159	华泰保兴 尊合债券 A	契约型开 放式	11,749,0 30.11	15,005,8 61.26	3.48	否
11	023392	景顺长城 稳健增益 债券 F	契约型开 放式	12,133,9 07.10	14,038,9 30.51	3.25	否
12	003824	天弘信利 债券 A	契约型开 放式	10,683,9 71.27	11,171,1 60.36	2.59	否
13	014088	永赢稳健 增强债券 A	契约型开 放式	8,291,78 2.01	10,395,4 07.11	2.41	否
14	750002	安信目标 收益债券 A	契约型开 放式	6,866,97 3.42	10,025,7 81.19	2.32	否
15	000181	景顺长城 四季金利 债券 A 类	契约型开 放式	7,757,17 6.10	9,960,21 4.11	2.31	否
16	014089	永赢稳健 增强债券 C	契约型开 放式	7,631,59 3.12	9,398,30 6.93	2.18	否
17	540010	汇丰晋信 科技先锋 股票	契约型开 放式	1,207,89 6.11	8,433,89 3.01	1.95	是
18	000385	景顺长城 景颐双利	契约型开 放式	4,248,00 8.49	8,139,18 4.27	1.89	否

		债券 A 类					
19	515080	招商中证红利 ETF	交易型开放式	2,636,100.00	3,716,901.00	0.86	否
20	002233	工银丰收回报灵活配置混合 C	契约型开放式	1,305,670.65	3,508,337.04	0.81	否
21	016462	华宝生态中国混合 C	契约型开放式	712,609.41	3,476,821.31	0.81	否
22	014156	国泰海通中证 500 指数增强 C	契约型开放式	1,971,285.66	3,136,709.74	0.73	否
23	018123	永赢数字经济智选混合发起 C	契约型开放式	1,068,461.88	3,024,388.20	0.70	否
24	159980	大成有色金属期货 ETF	交易型开放式	1,320,000.00	2,713,920.00	0.63	否
25	021982	安联中国精选混合 C	契约型开放式	1,062,011.32	2,540,118.68	0.59	否
26	159516	国泰中证半导体材料设备主题 ETF	交易型开放式	1,197,200.00	2,364,470.00	0.55	否
27	002170	东吴移动互联混合 C	契约型开放式	245,831.35	2,110,781.72	0.49	否
28	159937	博时黄金 ETF	交易型开放式	250,000.00	2,087,750.00	0.48	否
29	588000	华夏上证科创板 50 成份 ETF	交易型开放式	685,900.00	1,607,749.60	0.37	否
30	513500	博时标普 500ETF	交易型开放式	636,800.00	1,581,174.40	0.37	否
31	159985	华夏饲料豆粕期货 ETF	交易型开放式	745,100.00	1,479,023.50	0.34	否
32	513530	华泰柏瑞中证港股通高股息	交易型开放式	1,036,300.00	1,473,618.60	0.34	否

		投资 ETF (QDII)					
33	159326	华夏中证 电网设备 主题 ETF	交易型开 放式	691,200. 00	1,443,22 5.60	0.33	否
34	023671	华商收益 增强债券 C	契约型开 放式	279,791. 14	426,401. 70	0.10	否
35	159549	天弘中证 红利低波 动 100ETF	交易型开 放式	280,000. 00	306,040. 00	0.07	否
36	159998	天弘中证 计算机主 题 ETF	交易型开 放式	150,500. 00	160,282. 50	0.04	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本报告期末，本基金投资的前十名证券的发行主体除海富通基金管理有限公司（以下简称“海富通基金”）、汇丰晋信基金管理有限公司（以下简称“汇丰晋信基金”）外，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。

本基金持有的海富通中证短融 ETF（代码：511360）的发行主体海富通基金，因投资运作问题，2025 年 8 月 19 日，海富通基金受到中国证券监督管理委员会上海监管局出具警示函措施。根据海富通基金 2025 年年报披露显示，公司已完成有关整改工作。

本基金持有的汇丰晋信平稳增利中短债债券 A（代码：540005）的发行主体汇丰晋信基金，因信息披露问题，2025 年 12 月 16 日，汇丰晋信基金受到中国证券监督管理委员会上海监管局出具警示函措施。根据汇丰晋信基金 2025 年年报披露显示，公司高度重视，进一步完善制度，加强内部管理，公司所有业务均正常开展。

截至目前，本基金对海富通基金、汇丰晋信基金的投资决策流程符合本公司规定，本基金管理人会紧密跟踪并及时采取相应投资决策。

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票，不存在投资于超出基金合同约定的备选股票库之外的股票的情况。

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	55,955.41

2	应收清算款	10,502,242.64
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	42,106.72
6	其他应收款	1,062.86
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,601,367.63

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

投资组合报告中，由于四舍五入原因，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差；由于小数点后保留位数限制原因，市值占净值比例可能显示为零。

§ 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
汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) A	771	347,081.66	0.00	0.00%	267,599,962.40	100.00%
汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) C	440	369,383.23	0.00	0.00%	162,528,621.89	100.00%
合计	1,211	355,184.63	0.00	0.00%	430,128,584.29	100.00%

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	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) A	105,582.87	0.0395%
	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) C	35,121.97	0.0216%
	合计	140,704.84	0.0327%

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	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	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) A	0
	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) A	0
	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) A	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合 (FOF) C
基金合同生效日（2026 年 01 月 20 日）基金份额总额	312,348,667.40	271,926,988.64
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	846,783.45	240,566.66
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	45,595,488.45	109,638,933.41
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	267,599,962.40	162,528,621.89

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

2026 年 4 月 25 日，基金管理人发布公告，聘任吴坚隽先生担任公司风控负责人。

本报告期内，本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。自本基金成立以来，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）一直为本基金提供审计服务。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未有受调查或处罚等情况发生。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未有受调查或处罚等情况发生。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况发生。

10.8 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

10.8.1 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	
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-

野村东方	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：

1、报告期内退租广发证券交易单元；

2、选择证券公司参与证券交易的标准和程序

1) 选择证券公司参与证券交易的标准

a. 财务状况良好，经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

b. 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；

c. 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2) 选择证券公司参与证券交易的程序

(1) 本公司投资部根据上述评价标准对证券公司进行评估，经公司督察长和风控会审议批准后，可被选择成为提供证券交易服务的公司。

(2) 公司与被选中提供证券交易服务的证券公司签订协议，并通知基金托管人。

10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源	-	-	110,407,000.00	100.00%	-	-	126,606,871.90	48.50%
中信证券	-	-	-	-	-	-	134,445,976.31	51.50%
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

开源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前 海	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东 方	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同生效公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-01-21
2	汇丰晋信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在招商证券的交易限额的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-01-26
3	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-02-09
4	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增肯特瑞基金为汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-02-24

	有期混合型基金中基金 (FOF) 代销机构的公告		
5	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-02-24
6	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增部分销售机构为汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-02-27
7	汇丰晋信基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-04-22
8	汇丰晋信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-04-25
9	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增万家财富为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-05-18
10	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增腾安基金为汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-05-28
11	汇丰晋信基金管理有限公司关于新增易方达财富为旗下开放式基金代销机构的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-06-03
12	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-06-26
13	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-06-26

	金合同		
14	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 更新招募说明书 (2026 年第 1 号)	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-06-30
15	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 产品资料概要更新 (A 类份额)	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-06-30
16	汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 产品资料概要更新 (C 类份额)	本基金指定报刊、指定互联网网站	2026-06-30

§ 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

无。

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) 中国证监会准予汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 注册的文件
- (二) 《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》
- (三) 《汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议》
- (四) 关于申请募集注册汇丰晋信多元稳健配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

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：021-20376888

公司网址：<http://www.hsbcjt.cn>

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日