

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 年第 1 季度报告

2026 年 03 月 31 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 04 月 22 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规定，于2026年04月21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01月20日（基金合同生效日）起至2026年03月31日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	584,505,647.57 份
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	<p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p><b>3、 股票投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>4、 债券投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>5、可转换债券及可交换债券投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>6、资产支持证券投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>7、港股投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>8、存托凭证投资策略</b></p> <p>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。</p>
业绩比较基准	<p>中债新综合财富（总值）指数收益率×75%+中证 800 指数收益率×14%+恒生指数收益率（经汇率调整）×1%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率×5%+银行活期存款利率</p>

	(税后) × 5%	
风险收益特征	<p>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。</p> <p>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。</p>	
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	
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	312, 543, 465. 65 份	271, 962, 181. 92 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 01 月 20 日 (基金合同生效日) - 2026 年 03 月 31 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
1. 本期已实现收益	-1, 316, 607. 68	-1, 353, 170. 27
2. 本期利润	-3, 402, 842. 40	-3, 166, 922. 71
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0109	-0. 0116
4. 期末基金资产净值	309, 140, 943. 37	268, 795, 143. 20
5. 期末基金份额净值	0. 9891	0. 9884

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。

#### 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	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	①-③	②-④
----	------------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

				准差④		
自基金合同生效起至今	-1.09%	0.20%	-0.48%	0.34%	-0.61%	-0.14%

注：

自基金合同生效起至今指 2026 年 1 月 20 日-2026 年 3 月 31 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	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	-1.16%	0.20%	-0.48%	0.34%	-0.68%	-0.14%

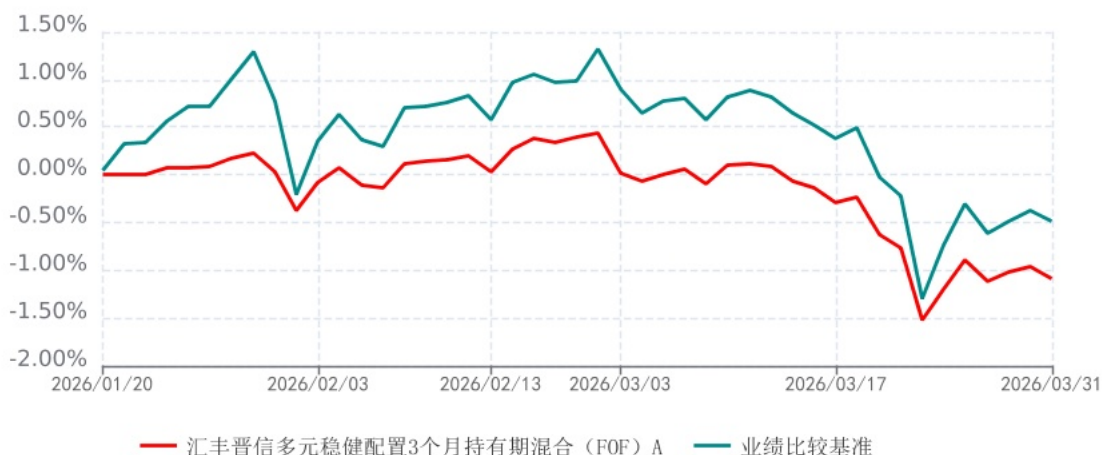
注：

自基金合同生效起至今指 2026 年 1 月 20 日-2026 年 3 月 31 日

### 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

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03月31日)



注：

1. 本基金的基金合同于 2026 年 1 月 20 日生效，截至 2026 年 3 月 31 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。

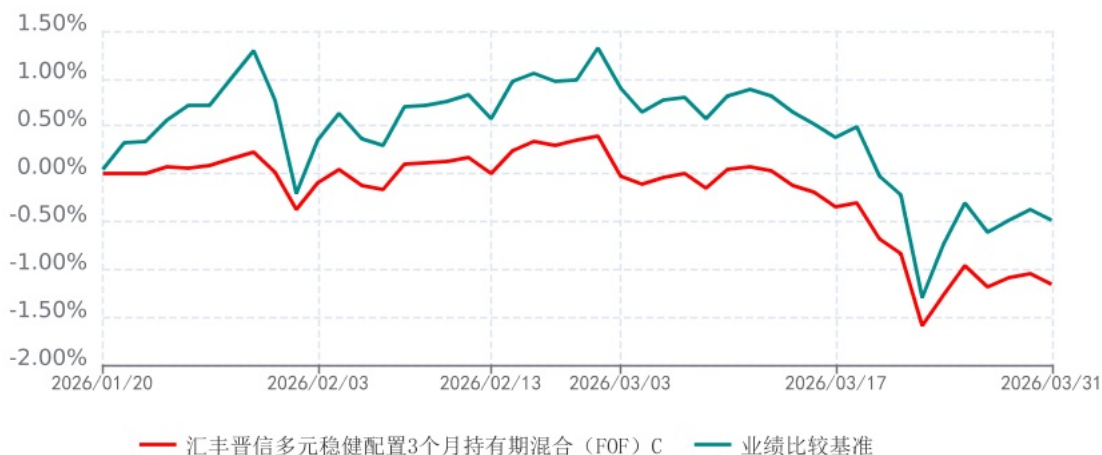
4. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 中债新综合财富（总值）指数收益率 × 75% + 中证 800 指数收益率 × 14% + 恒生指数收益率（经汇率调整） × 1% + 上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率 × 5% + 银行活期存款利率（税后） × 5%。

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03月31日)



注：

1. 本基金的基金合同于 2026 年 1 月 20 日生效，截至 2026 年 3 月 31 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 × 75% + 中证 800 指数收益

率×14%+恒生指数收益率(经汇率调整) ×1%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×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		
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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

由于本报告期内，本基金处于建仓期，我们在一季度的风险资产仓位控制在比较低的水平，但由于一季度前期的贵金属价格大幅波动和 3 月份的中东冲突，影响了我们建仓的节奏，我们希望可以有效的减少回撤，所以暂时将弹性资产控制在有限的范围内，且不过分暴露海外和商品的弹性。

对于本基金，我们希望通过把波动率控制在较低水平，以更好控制回撤。策略选择上，我们希望通过回撤控制以期提供合适收益。在投资品种上，目前本基金选择的主题以新能源和科技类为主。

我们在一季度的操作分为两个时期。我们在中东冲突发生前，我们的建仓策略以杠铃策略为主，成长类板块主要覆盖了海外算力、智驾、有色等主题，价值类板块主要选择了量化类的低估值产品及偏重化工、航空等题材的全市场产品。

在中东冲突发生后，我们认为本次冲突或将对美国经济复苏、美国中期选举产生较大的不确定。因此，从原则上看，我们在三月初就将其作为风险事件来应对，应对策略是尽量控制组合波动。

在操作上分为了两个阶段，在前两周内，我们将组合的权益仓位控制在了合同约定的低位，对一些基本面对估值支撑较弱的板块，如机器人、AI 应用等，转换为资源品相关的板块，如化工等。我们也注意到了冲突前期因避险情绪推动的黄金和美债上涨，因此在前两周我们控制了黄金资产的仓位。在后两周的操作上，我们进一步调整了组合的结构，进一步增加了红利资产的比例，并将成长属性的板块转换为新能源板块为主，仅保留了部分医药、科技板块的仓位。

在 3 月中旬时，我们增持了黄金资产至中性仓位，后来看这部分操作低估了冲突对市场和黄金流动性的影响。

在国内债券品种上，我们对长债类资产的暴露度较低，但对长期国债 ETF 品种有部分交易增强的操作。此外，我们维持了部分低价可转债基金和一些波动较低的二级债基的仓位，作为弹性资产的补充。

在美债资产上，我们在中东冲突后，认为美元指数会有短期的上涨，因此对美债资产转换为了非对冲级别。但随着冲突演绎的加剧，出于对美元指数后续走势的考虑，我们在 3 月下旬后又转换为了对冲级别。从操作上看，我们赚取了一部分汇兑收益。

#### 4.5 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-1.09%，同期业绩比较基准收益率为-0.48%；本基金 C 类基金份额净值增长率为-1.16%，同期业绩比较基准收益率为-0.48%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	517,996,502.74	88.79
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	65,335,078.56	11.20
8	其他资产	42,921.36	0.01
9	合计	583,374,502.66	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。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

#### 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

无。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 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

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 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。

本基金持有的汇丰晋信平稳增利中短债债券 A（代码：540005）和汇丰晋信货币 B（代码：541011）

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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规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规定备选股票库之外的股票的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,650.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	15,106.36
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,601.94
6	其他应收款	6,562.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,921.36

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.11.6 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。

## § 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	519199	万家家享中短债 A	契约型开放式	43,002,540.54	45,178,469.09	7.82	否
2	005079	兴银鑫日享短债 A	契约型开放式	41,339,022.48	45,167,015.96	7.82	否
3	014910	东方红短债债券 A	契约型开放式	41,560,486.12	45,159,624.22	7.81	否
4	006829	鹏扬利沣短债 A	契约型开放式	41,436,947.98	45,128,980.05	7.81	否
5	540005	汇丰晋信平稳增利中短债债券 A	契约型开放式	35,749,396.73	40,175,172.05	6.95	是
6	968124	高腾亚洲收益基金 M 类(人民币)-累积	契约型开放式	3,017,097.55	29,567,555.99	5.12	否
7	511360	海富通中证短融 ETF	契约型开放式	260,000.00	29,446,820.00	5.10	否
8	541011	汇丰晋信货币 B	契约型开放式	20,056,774.22	20,056,774.22	3.47	是
9	001258	兴业收益增强债券 C	契约型开放式	13,082,850.90	20,016,761.88	3.46	否
10	005159	华泰保兴尊合债券 A	契约型开放式	11,749,030.11	14,981,188.29	2.59	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 01 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2026 年 03 月 31 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)	23,300.00	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	40,001.62	7,060.23
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	44,378.47	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	412,545.94	-
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	102,143.37	-

当期交易基金产生的交易费 (元)	4,204.12	-
---------------------	----------	---

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

### 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

	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	194,798.25	35,193.28
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	312,543,465.65	271,962,181.92

## § 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

无。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 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

无。

### 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

- (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。

### 10.2 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

### 10.3 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

二〇二六年四月二十二日