信澳盈丰多元三个月持有期混合型基金中基金（FOF）
2026 年第 3 季度报告
2026 年 9 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：二〇二六年十月二十七日

§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 10 月 26 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 7 月 1 日起至 9 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	222,512,072.81 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	169,118,767.99 份	53,393,304.82 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 7 月 1 日-2026 年 9 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	420,341.91	97,958.23

2.本期利润	-3,852,492.76	-1,297,619.99
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0210	-0.0226
4.期末基金资产净值	169,210,681.40	53,345,330.95
5.期末基金份额净值	1.0005	0.9991

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
过去三个月	-1.97%	0.31%	-2.35%	0.36%	0.38%	-0.05%
自基金合同生效起至今	0.05%	0.28%	0.29%	0.37%	-0.24%	-0.09%

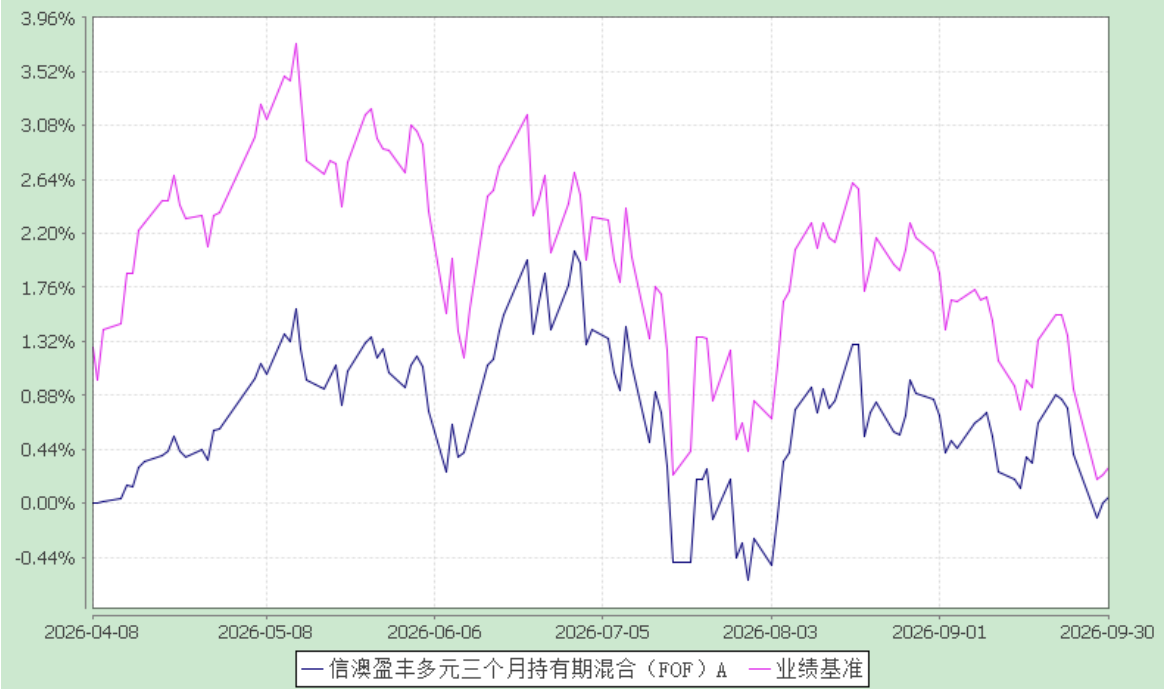
信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）C

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
过去三个月	-2.04%	0.31%	-2.35%	0.36%	0.31%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-0.09%	0.28%	0.29%	0.37%	-0.38%	-0.09%

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

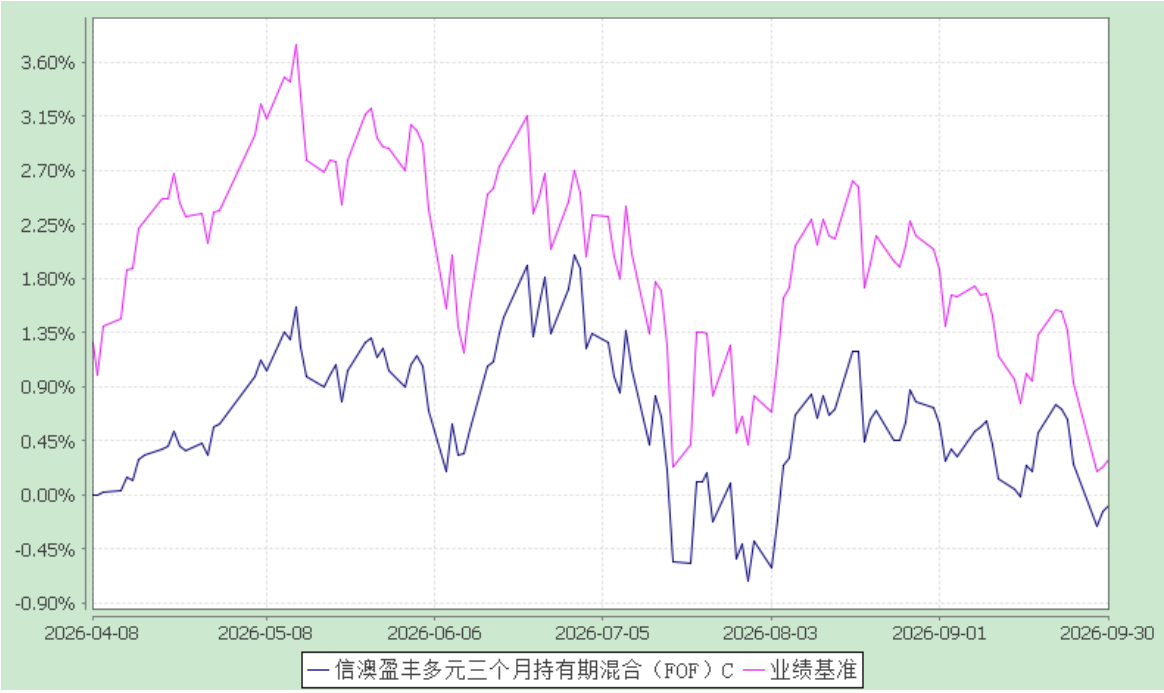
信澳盈丰多元三个月持有期混合（FOF）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2026 年 4 月 8 日至 2026 年 9 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 9 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	-	14 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。曾任信澳颐远养老目标 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 2026 年 8 月 24 日），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遵规守信情况的说明

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同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 年三季度，A 股在二季度强势反弹后转入深度调整，风格由成长向价值防御极致切换。7 月，美联储加息预期升温、长端美债利率快速上行，叠加成长板块前期涨幅较大、交易拥挤，市场风险偏好迅速回落；8 月在流动性呵护下主要指数小幅反弹；9 月加息落地后成长板块再度承压。全季度看，上证指数下跌 6.16%、深证成指

下跌 20.47%、沪深 300 下跌 12.49%、中证 800 下跌 13.97%，创业板指与科创 50 分别下跌 27.80%、30.70%，而中证红利逆势上涨 9.38%；行业层面，煤炭、石油石化、银行等低估值方向涨幅居前，电子、通信、电力设备等前期高景气成长赛道跌幅居前。港股表现相对抗跌，恒生指数上涨 7.57%，但恒生科技指数下跌 4.88%。

本基金 4 月初成立，考虑稳健客户的持有体验，稳步建仓，目前建仓期刚满，鉴于市场还在回调过程中，并没有进一步加大权益的配置比例，目前整体仓位仍然低于业绩基准，从结构上来看，持仓整体均衡偏成长，而三季度市场风格由成长单边切换至价值，成长赛道出现系统性、大幅度的估值与股价双杀，成为净值回撤的主要原因。后续将根据市场回调的幅度以及时间，同时结合外部环境的变化寻找合适的位置逐渐增加权益的配置比例。

展望后市，海外方面，美联储 9 月 17 日加息 25 个基点至 3.75%–4.00%，为 2023 年 7 月以来首次加息；但 9 月非农仅增 2.9 万、核心 PCE 偏弱，市场对后续加息的定价已明显回落。与此同时，长端利率继续上行，10 年期美债收益率一度达 5.34%、30 年期盘中触及 5.73%，均创 2002 年以来新高，美元指数回升至 102 附近；中东局势仍处”边打边谈”、油价高位震荡。中期来看，全球流动性收紧的斜率与美国就业、通胀的边际变化，仍是决定大类资产定价的核心变量。国内方面，9 月制造业 PMI 升至 50.1%、重返扩张区间，但内需修复仍偏缓，8 月社会消费品零售总额同比仅增长 0.4%、社融存量增速降至 7.2%，信用扩张乏力。下半年经济承压较为明确，增量政策可期但难见强刺激、更多以托底为主，货币政策维持宽松、降准降息相机抉择。

权益市场方面，短期全球长端利率高企压制高估值成长资产的估值中枢，叠加市场风险偏好与成交低迷，A 股短期或仍以震荡寻底为主。中长期看，经过本轮调整，A 股估值与交易结构已有所出清，超跌修复与均值回归的力量仍在积累。全球 AI 产业趋势仍在快速推进，短期利空充分消化后，科技主线行情并未终结，但行情大概率难以普涨，更可能呈现轮动、分化的特征。配置上，组合继续秉持均衡偏成长的整体思路：成长端聚焦全球高景气赛道与产业趋势共振方向，围绕业绩确定性与预期差修复把握结构性机会；价值端以优质底仓与高股息资产夯实安全垫，对冲宏观环境波动。

债券方面，三季度基本面偏弱、货币政策维持宽松，对债市形成支撑，10 年期国债收益率围绕 1.70%低位窄幅波动。展望四季度，政府债供给节奏、增量稳增长政策的力度以及资金面的波动或阶段性影响利率走势，但在内需磨底、资产荒延续叠加货

币适度宽松，利率尚不具备趋势性上行基础，债市震荡偏强的主线有望延续。

黄金方面，三季度国际金价先扬后抑、整体小幅收涨。季度初金价在 4000 美元/盎司附近，随后在地缘避险与央行购金等因素推动下持续上行，进入 9 月，"紧缩交易"成为主导，金价自高点回撤超过 10%。短期看，金价仍将跟随美联储加息路径与美债实际利率波动定价，年内是否进一步加息、美元指数走向是核心变量，金价或将以高位震荡为主。中长期看，全球地缘安全重构、央行持续购金，以及美国债务风险对美元信用构成的结构性压力，仍将抬升黄金的配置价值。我们维持对黄金的中长期战略性配置，短期波动不改变其在大类资产中的分散作用。

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 1.0005 元，份额累计净值为 1.0005 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-1.97%，同期业绩比较基准收益率为-2.35%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 0.9991 元，份额累计净值为 0.9991 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-2.04%，同期业绩比较基准收益率为-2.35%。

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	208,840,896.16	92.60
3	固定收益投资	12,709,078.03	5.64
	其中：债券	12,709,078.03	5.64

	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	3,815,327.10	1.69
8	其他资产	162,081.37	0.07
9	合计	225,527,382.66	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

本基金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	12,709,078.03	5.71
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	12,709,078.03	5.71

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	126,000	12,709,078.03	5.71

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，投资超出基金合同约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	27,052.37
2	应收证券清算款	134,972.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	57.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	162,081.37

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	019873	长城短债债券 E	契约型开放式	12,103,281.66	15,184,777.17	6.82	否
2	000037	广发景宁纯债债券 A	契约型开放式	11,445,237.31	13,981,501.90	6.28	否
3	021601	交银施罗德稳利中短债债券 E	契约型开放式	10,938,686.13	11,347,792.99	5.10	否
4	006684	富国信用债债券 D	契约型开放式	8,304,393.78	11,133,700.74	5.00	否
5	006337	华安安浦债券 A	契约型开放式	8,000,919.66	9,651,509.39	4.34	否
6	675113	西部利得汇享债券 C	契约型开放式	6,838,098.54	9,432,473.13	4.24	否
7	675163	西部利得汇盈债券 C	契约型开放式	8,071,415.49	8,931,828.38	4.01	否
8	003949	兴全稳泰债券 A	契约型开放式	7,146,530.61	8,887,425.47	3.99	否
9	022403	信澳稳悦 60 天滚动持有债券 A	契约型开放式	8,313,213.70	8,754,645.35	3.93	是
10	007562	景顺长城景泰	契约型开放式	6,786,732.32	8,210,588.76	3.69	否

		纯利债券 A					

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 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）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	1,484.04	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	31,184.55	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	238,535.88	4,400.04
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	58,638.17	1,100.01

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
报告期期初基金份额总额	203,234,765.96	68,321,781.54
报告期期间基金总申购份额	29,731.47	32,013.01
减：报告期期间基金总赎回份额	34,145,729.44	14,960,489.73
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	169,118,767.99	53,393,304.82

§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未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

二〇二六年十月二十七日