富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

二 0 二六年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国民生银行股份有限公司

报告送出日期： 2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式
基金主代码	006750
交易代码	006750
基金运作方式	契约型，定期开放式
基金合同生效日	2019 年 03 月 07 日
报告期末基金份额总额	880,741,574.17 份
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	在封闭期内，本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。在债券投资策略的基础上，本基金还将根据债券市场的动态变化，采取多种灵活的策略，获取超额收益，主要包括骑乘收益率曲线策略、息差策略等。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	中债-高等级信用债财富（0-3 年）指数收益率*50%+中债-1-3 年国债及政策性金融债财富（总值）指数收益率*45%+活期存款基准利率*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

注：自 2026 年 7 月 27 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%”调整为“中债-高等级信用债财富（0-3 年）指数收益率×50%+中债-1-3 年国债及政策性金融债财富（总值）指数收益率×45%+活期存款基准利率×5%”。

§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 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）
1.本期已实现收益	5,382,476.83
2.本期利润	4,931,661.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0056
4.期末基金资产净值	961,572,857.65
5.期末基金份额净值	1.0918

注：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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 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。

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

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	0.52%	0.02%	0.58%	0.01%	-0.06%	0.01%
过去六个月	1.35%	0.03%	1.70%	0.03%	-0.35%	0.00%
过去一年	2.48%	0.03%	3.03%	0.04%	-0.55%	-0.01%
过去三年	8.36%	0.04%	11.89%	0.07%	-3.53%	-0.03%
过去五年	14.40%	0.04%	20.33%	0.06%	-5.93%	-0.02%
过去七年	20.58%	0.04%	29.69%	0.06%	-9.11%	-0.02%
自基金合同生效起至今	23.18%	0.04%	32.66%	0.06%	-9.48%	-0.02%

注： 自 2026 年 7 月 27 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%”调整为“中债-高等级信用债财富（0-3 年）指数收益率×50%+中债-1-3 年国债及政策性金融债财富（总值）指数收益率×45%+活期存款基准利率×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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



注：1、截止日期为 2026 年 9 月 30 日。

2、自 2026 年 7 月 27 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%”调整为“中债-高等级信用债财富（0-3 年）指数收益率×50%+中债-1-3 年国债及政策性金融债财富（总值）指数收益率×45%+活期存款基准利率×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

§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		
刘瀚驰	本基金现任基金经理	2021-04-21	-	11	硕士，曾任职于招商银行总行资产管理部、招银理财有限责任公司；自2020年6月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益基金经理助理、固定收益基金经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自2020年11月起任富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金(原富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金)基金经理；自2021年04月起任富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自2021年11月起任富国达利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自2022年06月起任富国碳中和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自2024年12月起任富国中债优选投资级信用债指数发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
吕春杰	本基金现任基金经理	2021-08-12	-	18	硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司研究员/董事，中国人保资产股份有限公司高级投资经理，上海证券有限责任公司资产管理总部副总经理；自

					2021 年 6 月加入富国基金管理有限公司，自 2021 年 8 月起历任固定收益基金经理；现任富国基金固定收益投资部副总经理，兼任富国基金高级固定收益基金经理。自 2021 年 08 月起任富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2021 年 11 月起任富国颐利纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2021 年 12 月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 07 月起任富国汇享三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2024 年 11 月起任富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金(原富国汇利回报分级债券型证券投资基金)基金经理；自 2024 年 12 月起任富国收益增强债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 09 月起任富国安景 120 天滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2026 年 03 月起任富国丰泰债券型证券投资基金基金经理；自 2026 年 03 月起任富国嘉汇债券型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。

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、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和相关法规要求，制定了《证券投资公平交易管理办法》，保证公司旗下不同投资组合在系统控制、日常操作层面享有公平的交易机会，并保持各投资组合的独立投资决策权。

本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度国内经济呈现总体平稳、结构分化的特征。7 月底政治局会议及时部署加大逆周期调节力度，8 月工业增加值和 CPI 同比回升，9 月 PMI 重新回到荣枯线以上。9 月底国常会进一步推出增量政策，央行下调 1 年期 PSL 利率 25 个基点至 1.5%，并优化结构性工具的支持领域、增加再贷款额度，加力引导资金有效投资。财政端安排地方政府债务结存限额使用，加快各类债券发行使用进度，同时落地现房销售新规与购房贷款贴息，以托底经济增长。整体来看，三季度出口强劲与内需偏弱并存，通胀压力可控，为债市提供了底层支撑，债券收益率整体下行，曲线走平。

投资操作上，本基金结合对基本面与资金面的研判灵活调整久期和杠杆，并持续优化持仓结构，报告期内净值有所增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为 0.52%；同期业绩比较基准收益率为 0.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§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	固定收益投资	1,000,653,838.45	99.95
	其中：债券	1,000,653,838.45	99.95
	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	461,033.18	0.05
7	其他资产	385.27	0.00
8	合计	1,001,115,256.90	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

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

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 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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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	66,479,544.68	6.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	535,706,250.42	55.71
	其中：政策性金融债	349,293,145.75	36.33
4	企业债券	56,089,556.72	5.83

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	243,318,127.66	25.30
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	99,060,358.97	10.30
9	其他	-	-
10	合计	1,000,653,838.45	104.06

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	250215	25 国开 15	1,039,000	103,842,499.18	10.80
2	112606159	26 交通银行 CD159	1,000,000	99,060,358.97	10.30
3	250208	25 国开 08	800,000	80,571,287.67	8.38
4	102482163	24 邮政 MTN003	700,000	70,846,532.05	7.37
5	102483985	24 汇金 MTN006	600,000	60,381,067.40	6.28

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不允许投资股指期货。

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

本基金不允许投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通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、中国人民银行、中共上海市委网络安全和信息化委员会办公室的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工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、中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局、中共上海市委网络安全和信息化委员会办公室的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业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。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余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 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	385.27
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	385.27

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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，投资组合报告中市值占净值比例的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

报告期期初基金份额总额	880,741,574.17
报告期期间基金总申购份额	—
减：报告期期间基金总赎回份额	—
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	880,741,574.17

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
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	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.14

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数（份）	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数（份）	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.14	10,000,000.00	1.14	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	1.14	10,000,000.00	1.14	3 年

注：截至 2022 年 3 月 7 日，本基金的基金合同生效届满 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况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-07-01 至 2026-09-30	870,741,361.69	-	-	870,741,361.69	98.86%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经基金管理人董事会七届十五次会议审议通过，李强先生自 2026 年 8 月 7 日起离任基金管理人首席信息官。具体可参见基金管理人于 2026 年 8 月 8 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的文件

2、富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同

3、富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

10.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

10.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址：http://www.fullgoal.com.cn。

富国基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日