富国汇优纯债63个月定期开放债券型证券投资基金

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	富国汇优纯债 63 个月定期开放债券
基金主代码	008521
交易代码	008521
基金运作方式	契约型、开放式 本基金以 63 个月为一个封闭期。本基金第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为基金合同生效日的 63 个月后月度对日（指日历月，如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日）的前一日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日，结束之日为第二个封闭期起始之日的 63 个月后月度对日（指日历月，如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日）的前一日，依此类推。 本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起或下一个封闭期开始前进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。每个开放期不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。
基金合同生效日	2020 年 01 月 13 日
报告期末基金份额总额	8,175,847,193.61 份
投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	在封闭期内，本基金严格采用买入并持有到期策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产在封闭期结束前可完全变现。本基金成立后，在每一封闭期的建仓期内将根据基金合同的规定，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。一般情况下，本基金将在封闭期内持有这些品种到期，持有的固定收益品种和结构在封闭期内不会发生变化。同时，本基金主要通过信用利差曲线配置和信用债券精选两个方面的策略进行信用债投资，本基金还采用杠杆投资策略和再投资策略。在开放期，本基金原则上将使基金资产保持现金状态。
业绩比较基准	该封闭期起始日中国人民银行公布的三年期定期存款利率（税后）+1.5%
风险收益特征	本基金为定期开放债券型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、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

§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	32,106,575.25
2.本期利润	32,106,575.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0039
4.期末基金资产净值	8,390,040,414.49
5.期末基金份额净值	1.0262

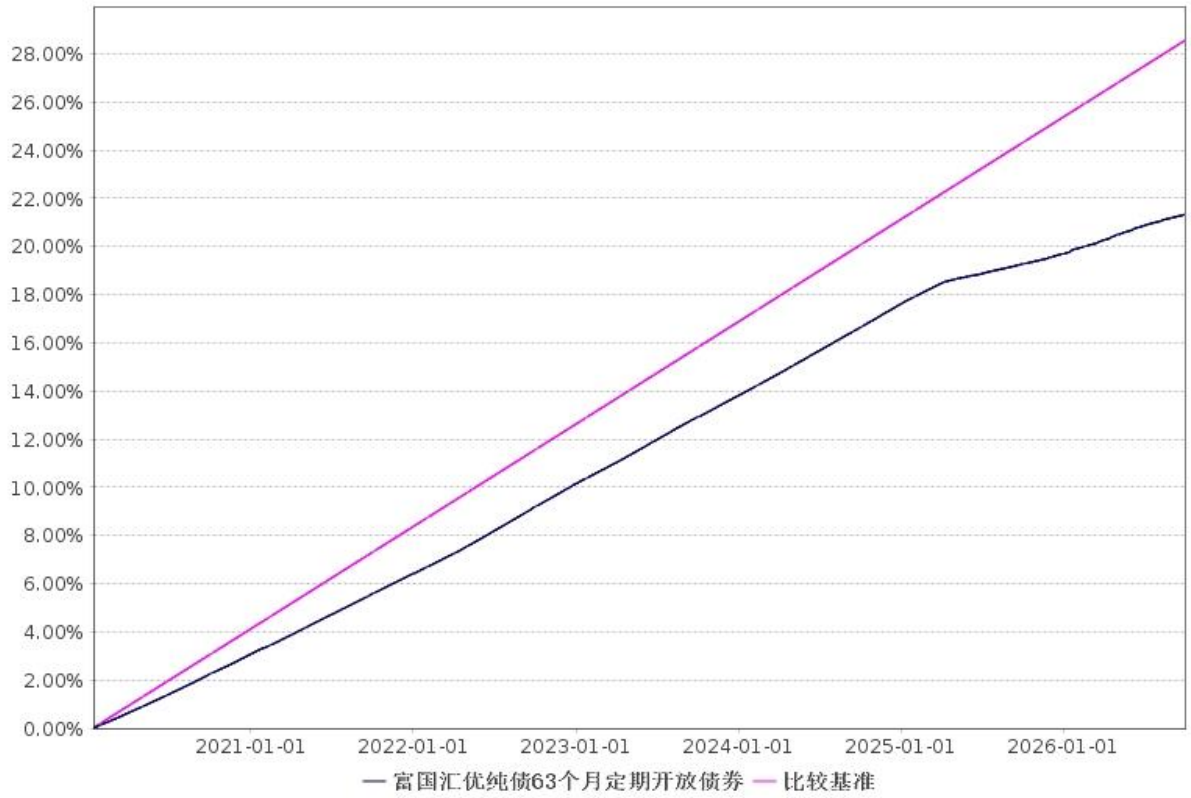
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.38%	0.01%	1.07%	0.01%	-0.69%	0.00%
过去六个月	0.88%	0.01%	2.13%	0.01%	-1.25%	0.00%
过去一年	1.72%	0.01%	4.25%	0.01%	-2.53%	0.00%
过去三年	7.46%	0.01%	12.76%	0.01%	-5.30%	0.00%
过去五年	14.92%	0.01%	21.26%	0.01%	-6.34%	0.00%
自基金合同生效起至今	21.33%	0.01%	28.55%	0.01%	-7.22%	0.00%

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。

§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		
朱梦娜	本基金现任基金经理	2020-01-13	—	14	硕士，曾任中国国际金融股份有限公司研究员；自 2017 年 4 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投资总监助理兼固定收益基金经理。自 2019 年 02 月起任富国景利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2019 年 03 月起任富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2019 年 09 月起任富国投资级信用债债券型证券投资基金基金经理；自 2019 年 11 月起任富国汇远纯债三年定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2020 年 01 月起任富国汇优纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2024 年 08 月起任富国诚益回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2024 年 08 月起任富国精诚回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2024 年 08 月起任富国稳进回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2024 年 08 月起任富国信享回

					报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2025 年 02 月起任富国新优享灵活配置混合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汇优纯债 63 个月定期开放债券型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》、《富国汇优纯债 63 个月定期开放债券型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，全球能源供给压力增加，海外通胀偏高，主要发达经济体在三季度实施加息。人民币结汇需求强劲，人民币兑美元保持升势。国内经济来看，财政支出力度仍然偏弱，对投资支撑不足，制造业内部分化延续，出口维持高景气，消费增速持续走低，通胀整体温和，实体融资需求疲弱。国内生产强需求弱，出口强投资弱的格局，给债券收益率下行提供基本面逻辑支持。三季度央行增加隔夜逆回购操作频率，DR001 中枢围绕 7 天逆回购政策利率，较二季度中枢小幅上移，银行主动负债需求旺盛，NCD 发行价格亦小幅上行。长端上，10 年国债呈现窄幅震荡下行态势，超长国债表现突出，收益率曲线形态呈现平坦化。我们在三季度积极关注经济基本面和市场供需层面的变化，优化融资结构，积极进行到期再投资，组合净值有所增长。

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 0.38%；同期业绩比较基准收益率为 1.07%。

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	9,766,972,493.46	99.93
	其中：债券	9,766,972,493.46	99.93
	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	2,250,403.12	0.02
	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	4,464,379.46	0.05
7	其他资产	-	-
8	合计	9,773,687,276.04	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	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	976,943,146.48	11.64
	其中：政策性金融债	234,128,923.86	2.79
4	企业债券	494,920,858.88	5.90

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	8,295,108,488.10	98.87
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,766,972,493.46	116.41

5.5 报告期末按摊余成本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）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	102582268	25 汇金 MTN003	6,500,000	651,366,003.64	7.76
2	102580348	25 电网 MTN004	4,500,000	453,269,882.55	5.40
3	102485173	24 诚通控股 MTN014(稳增长扩投资专项债)	3,300,000	337,734,933.17	4.03
4	102581668	25 沪港务 MTN003	3,000,000	301,179,742.73	3.59
5	102581864	25 宝武集团 MTN001	2,500,000	251,563,178.94	3.00

5.6 报告期末按摊余成本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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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	-
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	-

注：本基金本报告期末未持有其它资产。

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	8,175,847,193.61
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	8,175,847,193.61

§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

注：本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

8.2 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》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国汇优纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金的文件

2、富国汇优纯债 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同

3、富国汇优纯债 63 个月定期开放债券型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、富国汇优纯债 63 个月定期开放债券型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

9.2 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

9.3 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