富国安怡120天持有期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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	富国安怡 120 天持有期债券发起式	
基金主代码	023057	
基金运作方式	契约型开放式。本基金每个开放日开放申购，但对每份基金份额设置 120 天的最短持有期限。	
基金合同生效日	2025 年 03 月 20 日	
报告期末基金份额总额	478,253,294.95 份	
投资目标	本基金在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，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金采取稳健灵活的投资策略，力求在有效控制风险的基础上，获得基金资产的稳定增值，力求提高基金总体收益率。主要投资策略包括：资产配置策略、债券投资策略、动态收益增强策略、国债期货投资策略、信用衍生品投资策略。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富国安怡 120 天持有期债券发起式 A	富国安怡 120 天持有期债券发起式 C
下属分级基金的交易代码	023057	023058
报告期末下属分级基金的份额总额	369,644,369.17 份	108,608,925.78 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 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	富国安怡 120 天持有期债券发起式 A	富国安怡 120 天持有期债券发起式 C
1.本期已实现收益	783,709.30	226,436.03
2.本期利润	-1,088,909.22	-459,389.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0045	-0.0042
4.期末基金资产净值	389,211,909.21	114,003,020.33
5.期末基金份额净值	1.0529	1.0497

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

（1）富国安怡 120 天持有期债券发起式 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	-0.35%	0.11%	0.49%	0.02%	-0.84%	0.09%
过去六个月	0.78%	0.12%	1.07%	0.03%	-0.29%	0.09%
过去一年	3.70%	0.12%	1.49%	0.03%	2.21%	0.09%
自基金合同生效起至今	5.29%	0.10%	1.60%	0.05%	3.69%	0.05%

（2）富国安怡 120 天持有期债券发起式 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	-0.39%	0.11%	0.49%	0.02%	-0.88%	0.09%
过去六个月	0.69%	0.12%	1.07%	0.03%	-0.38%	0.09%
过去一年	3.50%	0.12%	1.49%	0.03%	2.01%	0.09%
自基金合同生效起至今	4.97%	0.10%	1.60%	0.05%	3.37%	0.05%

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

（1）富国安怡 120 天持有期债券发起式 A



注：1、截止日期为 2026 年 9 月 30 日。

（2）富国安怡 120 天持有期债券发起式 C



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		
张洋	本基金现任基金经理	2025-03-20	—	15	硕士，曾任招商银行总行交易员，招商银行总行投资经理，平安银行总行投资经理；自 2020 年 3 月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2020 年 08 月起任富国长江经济带纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2020 年 09 月起任富国荣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 2020 年 12 月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 01 月起任富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 03 月起任富国安怡 120 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2025 年 07 月起任富国中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数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安怡 120 天持有期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》、《富国安怡 120 天持有期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，出现 3 次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 5%的情况，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，债券市场整体表现偏强。具体看，7 月上旬债市整体震荡，但进入 7 月下旬后，市场风险偏好降低，收益率迎来快速下行，期限利差压缩明显。重要政策会议后，收益率继续下行，10 年期国债收益率下行至 1.70%以下，期间超长信用债和 30 年期国债超额收益明显。8 月下旬后，利率债横盘震荡，但部分长久期信用债受益于配置需求，收益率继续下行。9 月中下旬之后，收益率再度下行，30 年期与 10 年期国债利差进一步压缩。报告期内，本基金择机调整纯债和可转债的仓位，努力不断优化组合持仓，适时调整组合久期，灵活调整产品杠杆。

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情况：富国安怡 120 天持有期债券发起式 A 为-0.35%，富国安怡 120 天持有期债券发起式 C 为-0.39%；同期业绩比较基准收益率情况：富国安怡 120 天持有期债券发起式 A 为 0.49%，富国安怡 120 天持有期债券发起式 C 为 0.49%。

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	486,416,189.05	96.55
	其中：债券	486,416,189.05	96.55
	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	14,000,625.10	2.78
	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	1,673,583.94	0.33
7	其他资产	1,716,992.09	0.34
8	合计	503,807,390.18	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	65,103,586.89	12.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	265,946,061.14	52.85
	其中：政策性金融债	101,866,063.02	20.24
4	企业债券	32,108,287.40	6.38

5	企业短期融资券	20,046,504.11	3.98
6	中期票据	64,030,113.90	12.72
7	可转债（可交换债）	39,181,635.61	7.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	486,416,189.05	96.66

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	092303003	23 进出口行二级资本债 01	200,000	20,750,673.97	4.12
2	220208	22 国开 08	200,000	20,351,715.07	4.04
3	232680003	26 中行二级资本债 01BC	200,000	20,346,760.55	4.04
4	230023	23 附息国债 23	100,000	11,983,524.59	2.38
5	2600004	26 超长特别国债 04	100,000	10,293,710.38	2.05

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

本基金根据基金合同的约定，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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

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，上海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上海监管局的处罚。

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，中国进出口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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信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、国家金融监督管理总局云南监管局、中国人民银行的处罚。

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	13,111.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,703,880.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,716,992.09

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

1	113052	兴业转债	1,573,221.80	0.31
2	113043	财通转债	1,530,710.14	0.30
3	123241	欧通转债	1,487,171.45	0.30
4	118031	天 23 转债	1,405,153.97	0.28
5	113691	和邦转债	1,208,163.70	0.24
6	113699	金 25 转债	1,002,063.08	0.20
7	118058	微导转债	958,587.29	0.19
8	127089	晶澳转债	913,572.60	0.18
9	123178	花园转债	907,121.30	0.18
10	123247	万凯转债	895,404.11	0.18
11	118056	路维转债	867,809.85	0.17
12	110099	福能转债	867,568.44	0.17
13	113067	燃 23 转债	812,945.69	0.16
14	127049	希望转 2	758,294.47	0.15
15	123264	双乐转债	726,733.81	0.14
16	118064	联瑞转债	724,507.92	0.14
17	113666	爱玛转债	718,219.73	0.14
18	123195	蓝晓转 02	690,395.40	0.14
19	111021	奥锐转债	665,637.40	0.13
20	123165	回天转债	652,522.60	0.13
21	123124	晶瑞转 2	651,008.22	0.13
22	127105	龙星转债	634,718.21	0.13
23	113694	清源转债	617,521.51	0.12
24	127070	大中转债	612,493.84	0.12
25	127108	太能转债	606,669.73	0.12
26	123257	安克转债	584,415.23	0.12
27	113677	华懋转债	565,271.78	0.11
28	127038	国微转债	556,626.71	0.11
29	110098	南药转债	524,941.92	0.10
30	123149	通裕转债	513,425.42	0.10
31	123176	精测转 2	468,000.33	0.09
32	118051	皓元转债	447,133.73	0.09

33	127061	美锦转债	431,994.52	0.09
34	118012	微芯转债	431,736.58	0.09
35	123225	翔丰转债	414,000.82	0.08
36	127110	广核转债	409,600.93	0.08
37	127104	姚记转债	404,657.26	0.08
38	127111	金威转债	400,672.85	0.08
39	127082	亚科转债	387,591.78	0.08
40	123196	正元转 02	376,697.26	0.07
41	111018	华康转债	369,392.88	0.07
42	123253	永贵转债	369,005.54	0.07
43	123211	阳谷转债	366,742.47	0.07
44	123215	铭利转债	362,891.92	0.07
45	127050	麒麟转债	356,574.74	0.07
46	127088	赫达转债	338,640.09	0.07
47	113625	江山转债	231,132.88	0.05
48	118034	晶能转债	161,964.85	0.03
49	113070	渝水转债	150,763.96	0.03
50	118062	天准转债	124,238.75	0.02
51	127092	运机转债	61,064.58	0.01
52	123114	三角转债	36,035.47	0.01
53	123090	三诺转债	32,365.43	0.01
54	127030	盛虹转债	22,481.21	0.00
55	118059	颀中转债	19,041.55	0.00
56	127103	东南转债	13,170.40	0.00

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

项目	富国安怡 120 天持有期债券发起式 A	富国安怡 120 天持有期债券发起式 C
报告期期初基金份额总额	114,298,895.19	108,593,640.62
报告期期间基金总申购份额	267,839,452.50	6,630,641.27
减：报告期期间基金总赎回份额	12,493,978.52	6,615,356.11
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	369,644,369.17	108,608,925.78

§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	10,000,416.71
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	10,000,416.71
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.09

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	10,000,416.71	2.09	10,000,416.71	2.09	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	10,000,416.71	2.09	10,000,416.71	2.09	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

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。

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安怡120天持有期债券型发起式证券投资基金的文件

2、富国安怡120天持有期债券型发起式证券投资基金基金合同

3、富国安怡120天持有期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、富国安怡120天持有期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