华富安盈一年持有期债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设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 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华富安盈一年持有期债券	
基金主代码	013211	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 26 日	
报告期末基金份额总额	177,852,230.01 份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。	
投资策略	根据对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合流动性、估值水平、风险偏好等因素，综合评价各类资产的风险收益水平。本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×6%+恒生指数收益率×4%+中证可转换债券指数收益率×5%+中债-新综合全价(1-3 年)指数收益率×80%+活期存款基准利率×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 本基金如果投资港股通标的股票，还将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。	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富安盈一年持有期债券 A	华富安盈一年持有期债券 C

下属分级基金的交易代码	013211	013212
报告期末下属分级基金的份额总额	161,941,880.86 份	15,910,349.15 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）	
	华富安盈一年持有期债券 A	华富安盈一年持有期债券 C
1.本期已实现收益	-1,093,350.70	-119,541.27
2.本期利润	-1,875,327.85	-196,592.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0113	-0.0123
4.期末基金资产净值	157,264,034.55	15,143,528.53
5.期末基金份额净值	0.9711	0.9518

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、所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，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

华富安盈一年持有期债券 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	-1.18%	0.25%	-0.09%	0.10%	-1.09%	0.15%
过去六个月	-3.36%	0.29%	0.58%	0.11%	-3.94%	0.18%
过去一年	-4.97%	0.31%	0.17%	0.11%	-5.14%	0.20%
过去三年	6.12%	0.27%	7.67%	0.11%	-1.55%	0.16%
过去五年	-1.20%	0.30%	7.70%	0.12%	-8.90%	0.18%
自基金合同生效起至今	-2.89%	0.30%	7.26%	0.12%	-10.15%	0.18%

华富安盈一年持有期债券 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	-1.28%	0.25%	-0.09%	0.10%	-1.19%	0.15%
过去六个月	-3.56%	0.29%	0.58%	0.11%	-4.14%	0.18%
过去一年	-5.31%	0.31%	0.17%	0.11%	-5.48%	0.20%
过去三年	4.88%	0.27%	7.67%	0.11%	-2.79%	0.16%
过去五年	-3.12%	0.30%	7.70%	0.12%	-10.82%	0.18%
自基金合同生效起至今	-4.82%	0.30%	7.26%	0.12%	-12.08%	0.18%

注：本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×6%+恒生指数收益率×4%+中证可转换债券指数收益率×5%+中债-新综合全价(1-3 年)指数收益率×80%+活期存款基准利率×5%

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、本基金建仓期为 2021 年 8 月 26 日到 2022 年 2 月 26 日，建仓期结束各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的各项约定。

2、自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%”调整为“沪深 300 指数收益率×6%+恒生指数收益率×4%+中证可转换债券指数收益率×5%+中债-新综合全价(1-3 年)指数收益率×80%+活期存款基准利率×5%”。

§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		
尤之奇	本基金基金经理，固定收益部总监助理、公司固收投资决策委员会委员、公司指数投资决策委员会委员	2026 年 7 月 1 日	-	十六年	上海财经大学经济学硕士，本科学历。历任毕马威会计师事务所审计员、华泰柏瑞基金管理有限公司事务部总监助理、兴业银行银行合作中心基金负责人。2017 年 6 月加入华富基金管理有限公司，曾任指数投资部基金经理助理、总监助理，自 2020 年 8 月 17 日起任华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月 15 日起任华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 3 月 14 日起任华富中证 5 年恒定久期国开债

					指数型证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 16 日起任华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 21 日起任华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 21 日起任华富恒享纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 9 月 24 日起任华富恒惠纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 11 月 26 日起任华富祥晖 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2025 年 5 月 20 日起任华富吉福 120 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理，自 2026 年 7 月 1 日起任华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
尹培俊	本基金基金经理	2021 年 8 月 26 日	2026 年 7 月 10 日	二十一年	兰州大学工商管理硕士，硕士研究生学历。历任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012 年 7 月加入华富基金管理有限公司，曾任固定收益部信用研究员、总监助理、副总监、公司总经理助理，固定收益部总监、债券研究部总监、公司副总经理、公司公募投资决策委员会联席主席，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、证券从业的含义遵从中国证监会《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

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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

2026 年三季度财政呈现"重发行、慢支出"特征，专项债发行明显提速、但对内需的托底作用边际减弱，社会消费品零售总额同比降至 1%以下的低位，内需修复持续承压；而出口同比维持高增，外需表现显著强于内需，经济"K 型"分化格局进一步延续。房地产投资累计降幅扩大至近 20%，居民信贷持续收缩，社融增速回落，整体经济仍处于弱复苏通道。通胀方面，三季度原油价格高位运行，受输入性因素与 AI 产业链涨价扩散共同推动，PPI 高位加速上行至 3.8%，CPI 温和回升至 0.8%，输入性通胀压力不减。通胀高企叠加经济数据维持韧性，美国加息预期升温并最终落地——美联储 9 月加息 25 个基点。人民币在强劲出口与结汇需求带动下持续升值，创近年新高。

权益市场方面，2026 年三季度权益市场风格出现较大切换，前期领涨的 AI 科技板块深度调整、红利资产接力走强，"高低切换"特征鲜明。三季度上证指数、沪深 300、中证 500、科创创业 50 指数分别录得-6.16%、-12.49%、-17.67%和-33.38%，而中证红利和恒生指数分别上涨 9.38%、7.57%，科技与红利的相对表现较二季度完全反转。三季度科技板块的调整，是前期涨幅透支、交易拥挤（TMT 成交占比一度触及 43%的历史极值）、中报"利好出尽"、海外科技回调与流动性虹吸等多重因素共振的结果，本质上是估值出清而非产业逻辑失效。

可转债方面，中证转债指数 2026 年三季度下跌约 7.0%，跟随权益回调且明显弱于纯债。市场由"配置驱动"进一步转向"交易驱动"，估值与成交同步压缩，个券跌多涨少。与二季度高、低价转债分化不同，三季度资金正股看涨预期修正、高低价转债共振回落，叠加下修与强赎等条款博弈扰动加大，投资难度进一步增加。

债券收益率 2026 年三季度总体表现牛平，超长债表现突出。7 月围绕资金面与政策预期区间震荡，8 月中上旬长端加速走强、10 年与 30 年国债双双创出年内新低，随后止盈压力带来小幅回调，9 月先围绕 1.68%关口拉锯，下旬在跨季资金呵护与交易推动下由超长债领衔突破。报告期 3 年国开、5 年国开分别下行约 2bp；同期 10 年国债下行约 5bp、30 年国债下行约 16bp。受摊余债基影响，信用债估值继续压缩，中长久期信用利差普遍收窄。

本基金在 2026 年三季度报告期保持中短久期高等级城投债、产业债、二永债配置，保持转债较低仓位，权益仓位有所降低。结构调整方面，本基金一方面保留原有 AI 相关方向。海外英伟达股价再创历史新高，全球算力需求景气仍在延续；更重要的是，AI 相关投资已成为中美经济增长的重要增量引擎，国内算力资本开支亦持续提速，产业趋势与政策支持方向较为明确。本基金据此保留 AI 核心算力及产业链中景气与估值匹配度较优的环节，同时注意内部分化，规避短期涨幅过高、交易过度拥挤的品种。另一方面增配红利资产。报告期内无风险利率持续下行，红利资产的类固收属性进一步凸显，叠加中长线资金加速入市，板块配置价值提升。本基金增配公用事业、金融、资源类等景气向上的红利细分方向，以增强组合的防御性与收益稳定性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富安盈一年持有期债券 A 份额净值为 0.9711 元，累计份额净值为 0.9711 元。报告期，华富安盈一年持有期债券 A 份额净值增长率为-1.18%，同期业绩比较基准收益率为-0.09%。截止本期末，华富安盈一年持有期债券 C 份额净值为 0.9518 元，累计份额净值为 0.9518 元。报告期，华富安盈一年持有期债券 C 份额净值增长率为-1.28%，同期业绩比较基准收益率为-0.09%。

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，本基金不存在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	29,161,806.52	15.11
	其中：股票	29,161,806.52	15.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	162,510,314.97	84.23
	其中：债券	162,510,314.97	84.23
	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	1,193,121.97	0.62
8	其他资产	77,514.39	0.04
9	合计	192,942,757.85	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 11,030,584.22 元，占期末净值比例为 6.40%。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,231,050.00	0.71
B	采矿业	573,300.00	0.33
C	制造业	12,719,750.30	7.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,420,400.00	0.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	201,802.00	0.12
J	金融业	1,277,400.00	0.74
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	707,520.00	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,131,222.30	10.52

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-

非日常生活消费品	2,137,761.93	1.24
日常消费品	1,042,980.30	0.60
能源	885,374.39	0.51
金融	3,449,666.91	2.00
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
通信服务	3,514,800.69	2.04
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	11,030,584.22	6.40

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	9,500	3,514,800.69	2.04
2	02318	中国平安	40,000	1,811,266.20	1.05
3	300502	新易盛	4,600	1,789,400.00	1.04
4	02601	中国太保	67,826	1,638,400.71	0.95
5	09988	阿里巴巴-W	16,000	1,464,121.15	0.85
6	002714	牧原股份	29,000	1,231,050.00	0.71
7	300750	宁德时代	4,200	1,222,662.00	0.71
8	600350	山东高速	120,000	1,219,200.00	0.71
9	002532	天山铝业	97,000	1,181,460.00	0.69
10	688376	美埃科技	18,990	1,062,870.30	0.62

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	10,133,706.85	5.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,151,818.90	23.87
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	39,826,353.34	23.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,398,435.88	41.41
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	162,510,314.97	94.26

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	240738	24 株国 06	100,000	10,565,496.99	6.13
2	242580053	25 渤海银行永续债 01	100,000	10,388,627.40	6.03
3	102481665	24 北控水集 MTN002	100,000	10,350,920.55	6.00
4	241162	24 津投 21	100,000	10,318,369.32	5.98
5	242812	25 甘国 K2	100,000	10,313,956.71	5.98

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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，渤海银行股份有限公司、云南省投资控股集团有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内被监

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。

5.10.2 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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,884.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	68,549.54
4	应收利息	-
5	应收申购款	79.94
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	77,514.39

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富安盈一年持有期债券 A	华富安盈一年持有期债券 C
报告期期初基金份额总额	170,113,022.01	15,993,938.79
报告期期间基金总申购份额	38,420.93	26,859.41
减:报告期期间基金总赎回份额	8,209,562.08	110,449.05
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	161,941,880.86	15,910,349.15

§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

本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§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

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

注：本基金本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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同

2、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金托管协议

3、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富安盈一年持有期债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日