众盈沃安中短期利率债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：众盈基金管理有限公司

基金托管人：广州农村商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

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。

基金托管人广州农村商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。

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

2.1 基金基本情况

基金简称	众盈沃安中短利率债券	
基金主代码	004596	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年3月18日	
报告期末基金份额总额	11,414,747.74份	
投资目标	本基金通过重点投资中短期利率债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金主要投资中短期利率债，通过对国内外宏观经济状况、货币政策、市场资金供求情况进行综合分析，主要在剩余期限不超过三年的国债、央行票据、政策性金融债中进行配置和选择。	
业绩比较基准	中债1-3年政策性金融债指数收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，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	众盈基金管理有限公司	
基金托管人	广州农村商业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	众盈沃安中短利率债券A	众盈沃安中短利率债券C
下属分级基金的交易代码	004596	007034
报告期末下属分级基金的份额总额	9,665,731.46份	1,749,016.28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

	报告期（2026年7月1日—2026年9月30日）	
	众盈沃安中短利率债券A	众盈沃安中短利率债券C
1.本期已实现收益	54,426.85	7,435.01
2.本期利润	28,229.37	3,248.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0029	0.0017
4.期末基金资产净值	12,893,101.43	1,929,201.02
5.期末基金份额净值	1.3339	1.1030

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）本报告所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的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

众盈沃安中短利率债券A

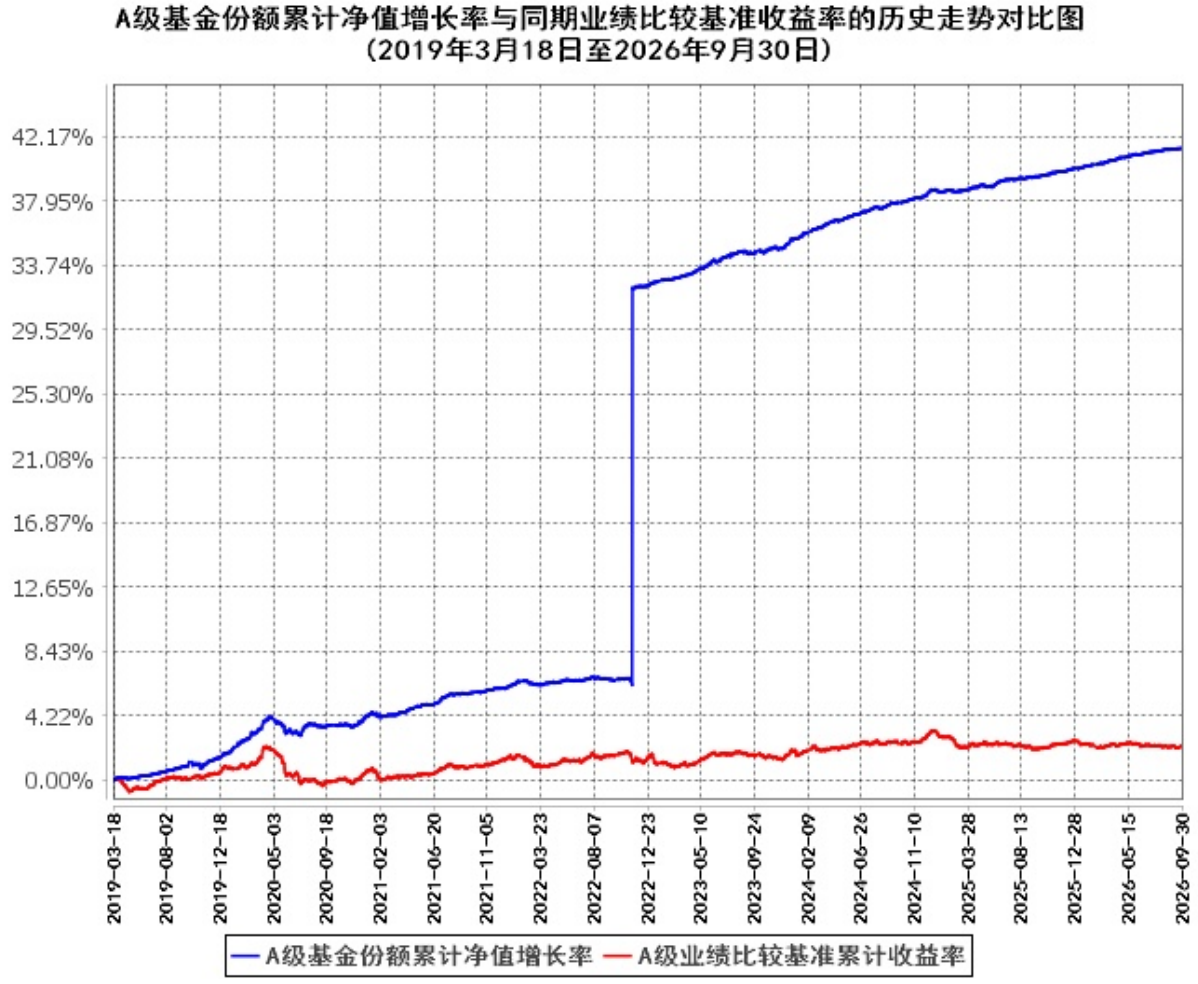
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.22%	0.01%	-0.10%	0.02%	0.32%	-0.01%
过去六个月	0.56%	0.01%	-0.10%	0.02%	0.66%	-0.01%
过去一年	1.31%	0.01%	0.13%	0.02%	1.18%	-0.01%
过去三年	5.03%	0.02%	0.57%	0.03%	4.46%	-0.01%
过去五年	33.73%	0.70%	1.29%	0.04%	32.44%	0.66%
过去七年	39.76%	0.59%	2.14%	0.04%	37.62%	0.55%
自基金合同生效起至今	41.41%	0.57%	2.21%	0.04%	39.20%	0.53%

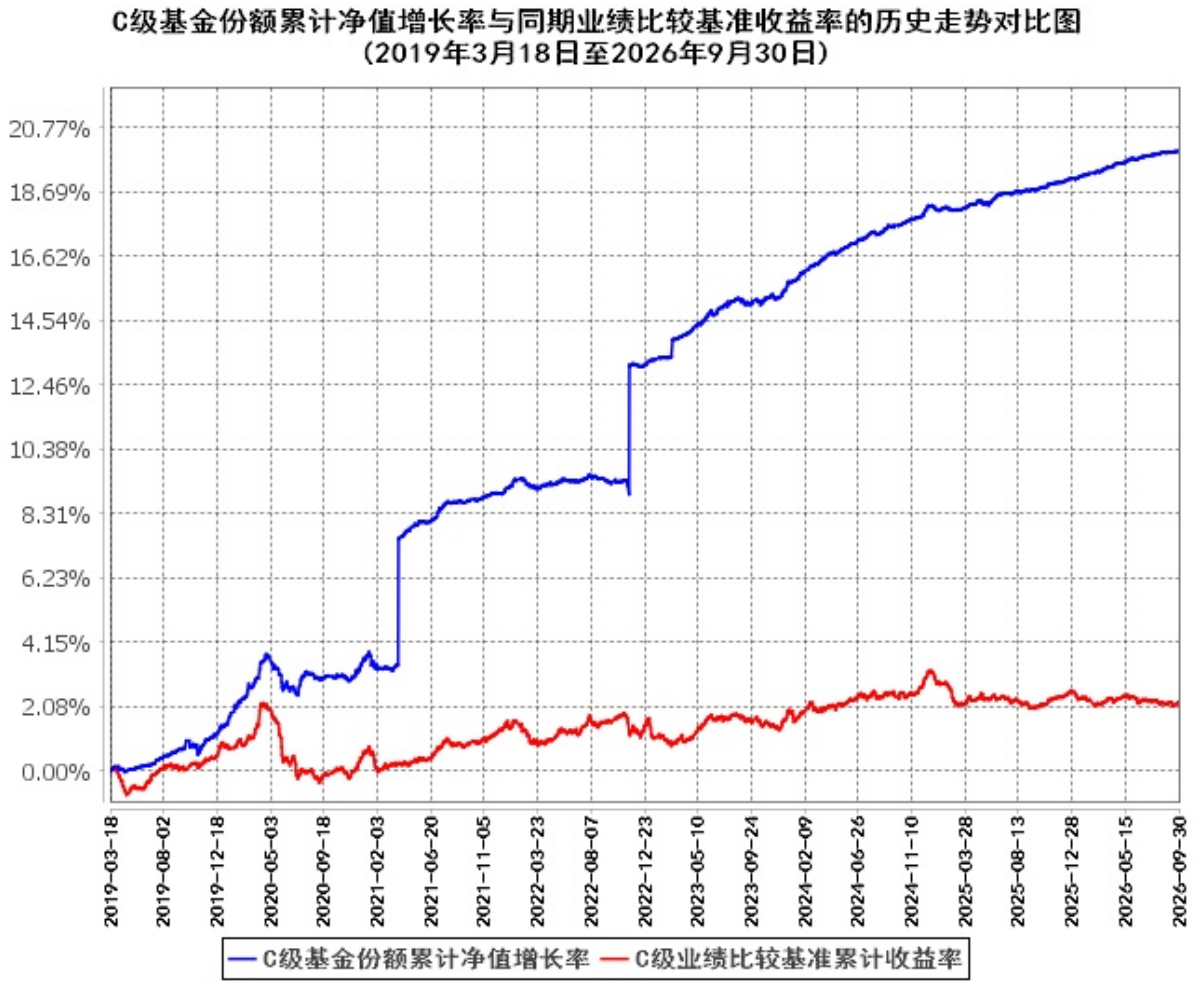
众盈沃安中短利率债券C

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	0.15%	0.01%	-0.10%	0.02%	0.25%	-0.01%
过去六个月	0.43%	0.01%	-0.10%	0.02%	0.53%	-0.01%
过去一年	1.04%	0.01%	0.13%	0.02%	0.91%	-0.01%
过去三年	4.20%	0.02%	0.57%	0.03%	3.63%	-0.01%
过去五年	10.35%	0.11%	1.29%	0.04%	9.06%	0.07%
过去七年	18.84%	0.14%	2.14%	0.04%	16.70%	0.10%

自基金合同生效起至今	20.01%	0.13%	2.21%	0.04%	17.80%	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





§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		
卢振荣	公司总经理助理、基金经理	2025 年 3 月 5 日	2026 年 8 月 6 日	17	理学硕士。曾任东莞农商银行总行公司部客户经理、资金中心债券交易岗和票据交易岗，广东省农村信用社资金调剂中心交易员，广东南粤银行金融市场部主管、金融市场部债券交易部总经理、资金运营中心债券部总经理助理，众盈基金管理有限公司总经理助理，众盈沃嘉

					灵活配置混合型证券投资基金、众盈货币市场基金、众盈沃安中短期利率债债券型证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
高晓飞	基金经理	2026年8月3日	-	9	金融管理硕士。曾任上海华瑞银行股份有限公司交易中心交易员，众盈基金管理有限公司集中交易部交易员、交易主管、部门副总经理（主持工作），现任众盈货币市场基金、众盈沃安中短期利率债债券型证券投资基金、众盈沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、众盈沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。

注：1.此处的“任职日期”、“离职日期”为公告确定的聘任日期和离任日期；

2.证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，债券市场整体走强，收益率曲线呈现“牛平”特征。资金面总体平稳，货币市场利率围绕政策利率窄幅波动。利率债方面，长端和超长端表现优于短端，收益率曲线进一步平坦化，超长端一度创下年内新低。信用债走势先弱后强，前期受供给放量、止盈压力等因素影响，信用利差一度被动走阔；随着利率中枢下行和配置需求释放，信用债在季末出现补涨，利差整体小幅收窄。政府债供给高峰期间，央行流动性呵护较为明显，供给冲击总体可控，市场对后续行情的预期有所提前。

操作上，本基金坚持稳健投资策略，以短久期配置为主，灵活运用凸点骑乘和久期调整策略，在严控久期风险的基础上把握波段交易机会，力争为持有人创造稳定回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末众盈沃安中短利率债券A的基金份额净值为1.3339元，本报告期基金份额净值增长率为0.22%；截至本报告期末众盈沃安中短利率债券C的基金份额净值为1.1030元，本报告期基金份额净值增长率为0.15%；同期业绩比较基准收益率为-0.10%。

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，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形，已向监管部门提交解决方案。

§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	-	-
3	固定收益投资	12,192,345.52	82.19
	其中：债券	12,192,345.52	82.19
	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	-552.33	0.00
	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	627,359.52	4.23
8	其他资产	2,015,572.07	13.59
9	合计	14,834,724.78	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

注：本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

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。

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	12,192,345.52	82.26
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	12,192,345.52	82.26

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	019790	25国债17	27,000	2,707,104.33	18.26
2	019771	25国债06	24,000	2,425,709.59	16.37
3	019797	25国债24	21,000	2,125,211.51	14.34
4	019840	26国债11	20,000	2,009,506.30	13.56
5	019779	25国债10	18,000	1,816,668.00	12.26

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。

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

注：本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未参与国债期货投资。

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未出现本报告期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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,319.86
2	应收证券清算款	2,000,631.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	120.98
6	其他应收款	13,500.00
7	其他	-
8	合计	2,015,572.07

5.11.3 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。

5.11.4 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。

5.11.5 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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	众盈沃安中短利率债券A	众盈沃安中短利率债券C
报告期期初基金份额总额	9,789,656.29	2,037,480.10
报告期期间基金总申购份额	947,103.79	148,884.02
减：报告期期间基金总赎回份额	1,071,028.62	437,347.84
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	9,665,731.46	1,749,016.28

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

§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. 中国证监会准予本基金募集的文件；
2. 《众盈沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《众盈沃安中短期利率债债券型证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件、营业执照；
6. 关于申请募集注册本基金的法律意见书；
7. 中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

众盈基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日