

富国天时货币市场基金二〇一八年 11 月月报

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：2018 年 12 月 07 日 1

§ 1 基金产品概况

基金简称 富国天时货币

基金主代码 100025

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2006 年 06 月 05 日

报告期末基金份额

总额

24,792,586,080.61

业绩比较基准

在充分重视本金安全的前提下，确保基金资产的高流动性，追求超越业绩比较基准的稳定收益。

§ 2 投资组合报告

2.1 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	固定收益投资	13,216,419,973.02	48.59
---	--------	-------------------	-------

其中：债券	13,215,735,956.81	48.58
-------	-------------------	-------

资产支持证券	684,016.21	0.00
--------	------------	------

2	买入返售金融资产	6,010,529,524.74	22.10
---	----------	------------------	-------

其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
-------------------	---	---

3	银行存款和结算备付金合计	7,793,240,407.74	28.65
---	--------------	------------------	-------

4	其他资产	181,140,045.83	0.67
---	------	----------------	------

5	合计	27,201,329,951.33	100.00
---	----	-------------------	--------

2.2 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	498,123,564.21	2.01
---	------	----------------	------

2	央行票据	—	—
---	------	---	---

3	金融债券	1,292,144,148.89	5.21
---	------	------------------	------

其中：政策性金融债	1,292,144,148.89	5.21
-----------	------------------	------

4	企业债券	—	—
---	------	---	---

5	企业短期融资券	1,621,201,302.80	6.54
---	---------	------------------	------

6	中期票据	—	—
---	------	---	---

7	同业存单	9,804,266,940.91	39.55
---	------	------------------	-------

8	其他	—	—
---	----	---	---

9	合计	13,215,735,956.81	53.31
---	----	-------------------	-------

10	剩余存续期超过 397 天的浮		
----	-----------------	--	--

动利率债券

— — 2

2.3 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 111814240 18 江苏银行 CD240 5,000,000.00 499,631,265.21 2.02

2 111816355 18 上海银行 CD355 5,000,000.00 499,350,272.21 2.01

3 111807134 18 招商银行 CD134 5,000,000.00 499,337,263.93 2.01

4 111808164 18 中信银行 CD164 5,000,000.00 499,337,263.93 2.01

5 111805213 18 建设银行 CD213 5,000,000.00 495,252,740.27 2.00

6 180207 18 国开 07 4,300,000.00 429,799,230.48 1.73

7 111818175 18 华夏银行 CD175 4,000,000.00 399,498,596.63 1.61

8 111808105 18 中信银行 CD105 4,000,000.00 393,614,692.78 1.59

9 140209 14 国开 09 3,300,000.00 331,715,785.87 1.34

10 180305 18 进出 05 3,000,000.00 300,426,630.95 1.21

2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1889112 18 上和 1A1 900,000 684,016.21 0.00

富国基金管理有限公司

2018年12月07日