

富国天时货币市场基金

二〇一八年一月月报

2018年01月31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：2018年2月6日

§ 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	26,100,240,527.76
业绩比较基准	当期银行个人活期存款利率（税前）。

§ 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	13,182,928,715.57	44.25
	其中：债券	13,182,928,715.57	44.25
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	4,623,123,654.68	15.52
	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	11,846,392,968.53	39.77
4	其他资产	136,958,252.76	0.46
5	合计	29,789,403,591.54	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	368,700,561.54	1.41
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,666,193,552.35	6.38
	其中：政策性金融债	1,666,193,552.35	6.38
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	1,650,175,589.51	6.32
6	中期票据	—	—
7	同业存单	9,497,859,012.17	36.39
8	其他	—	—
9	合计	13,182,928,715.57	50.51
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

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	111709493	17 浦发银行 CD493	7,500,000.00	745,954,079.48	2.86
2	111817003	18 光大银行 CD003	5,500,000.00	545,302,505.09	2.09
3	111719391	17 恒丰银行 CD391	5,000,000.00	497,273,601.54	1.91
4	111806033	18 交通银行 CD033	5,000,000.00	494,492,688.93	1.89
5	170410	17 农发 10	4,400,000.00	438,614,076.92	1.68
6	130415	13 农发 15	4,000,000.00	399,098,248.92	1.53
7	111711527	17 平安银行 CD527	4,000,000.00	397,824,393.48	1.52
8	011800007	18 中电投 SCP001	3,000,000.00	300,004,906.68	1.15
9	111709483	17 浦发银行 CD483	3,000,000.00	298,642,449.12	1.14
10	111770633	17 杭州银行 CD247	3,000,000.00	298,568,151.98	1.14

富国基金管理有限公司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。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基金合同、招募说明书及其更新等法律文件。

本报告财务资料未经审计，报告内容未经托管人复核。

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

2018年2月6日