

富国收益宝交易型货币市场基金二〇二〇年1月月报(收益宝货币ETF)

§1 基金产品概况

基金简称	富国收益宝交易型货币
场内简称	富国货币
基金主代码	511900
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月24日
报告期末基金份额总额	21,331,337,942.85
业绩比较基准	活期存款利率（税后）

§2 投资组合报告

2.1 报告期末基金资产组合情况

号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
	固定收益投资	12,232,539,737.11	53.15
	其中：债券	12,232,539,737.11	53.15
	资产支持证券	—	—
	买入返售金融资产	991,000,000.00	4.31
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
	银行存款和结算备付金合计	7,610,806,080.42	33.07
	其他资产	2,178,836,348.25	9.47
	合计	23,013,182,165.78	100.00

2.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

号	债券品种	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
	国债	—	—
	央行票据	—	—
	金融债券	1,191,063,112.31	5.58
	其中：政策性金融债	1,191,063,112.31	5.58
	企业债券	—	—
	企业短期融资券	2,099,421,530.94	9.84
	中期票据	110,961,171.71	0.52

	业存单	8,831,093,92 2.15	4 1.40
	他	—	—
	计	12,232,539,7 37.11	5 7.35
0	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	111903206	19 农业银行 CD206	5,000,00 0.00	498,577,60 7.16	2.34
2	111915608	19 民生银行 CD608	5,000,00 0.00	498,046,44 3.44	2.33
3	111915611	19 民生银行 CD611	5,000,00 0.00	498,011,57 8.46	2.33
4	111917110	19 光大银行 CD110	5,000,00 0.00	497,895,05 3.51	2.33
5	111911286	19 平安银行 CD286	5,000,00 0.00	497,895,05 3.51	2.33
6	11190	19 农业银行	5,000,00	495,098,38	2.32

	3199	CD199	0.00	9.71	
7	11190	19 农业银行	5,000,00	494,857,70	2.32
	3202	CD202	0.00	9.34	
8	11190	19 农业银行	5,000,00	494,526,15	2.32
	3210	CD210	0.00	0.31	
9	11190	19 农业银行	5,000,00	494,336,32	2.32
	3215	CD215	0.00	1.25	
10	11190	19 交通银行	5,000,00	494,313,32	2.32
	6284	CD284	0.00	5.74	

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

富国基金管理有限公司

2020年02月07日