

富国天时货币市场基金

二〇二〇年10月月报

2020年10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：2020年11月06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	12,659,719,427.54
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	6,517,652,308.34	47.94
	其中：债券	6,517,652,308.34	47.94
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	2,903,029,732.55	21.35
	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	4,050,134,663.96	29.79
4	其他资产	124,762,165.41	0.92
5	合计	13,595,578,870.26	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	558,260,686.47	4.41
2	央行票据	—	—
3	金融债券	140,079,117.65	1.11
	其中：政策性金融债	140,079,117.65	1.11
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	799,655,077.92	6.32
6	中期票据	10,031,640.04	0.08
7	同业存单	5,009,625,786.26	39.57
8	其他	—	—
9	合计	6,517,652,308.34	51.48
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	112004086	20 中国银行 CD086	5,000,000.00	496,410,065.03	3.92
2	112017266	20 光大银行 CD266	5,000,000.00	488,594,301.89	3.86
3	112015410	20 民生银行 CD410	4,000,000.00	398,843,476.46	3.15
4	209945	20 贴现国债 45	3,800,000.00	378,793,577.13	2.99
5	112004047	20 中国银行 CD047	3,000,000.00	299,869,957.69	2.37
6	112015401	20 民生银行 CD401	3,000,000.00	299,199,255.76	2.36
7	112008031	20 中信银行 CD031	3,000,000.00	299,079,708.14	2.36
8	112087621	20 宁波银行 CD173	3,000,000.00	299,043,881.30	2.36
9	112088807	20 杭州银行 CD175	3,000,000.00	298,724,014.53	2.36
10	112017273	20 光大银行 CD273	3,000,000.00	293,021,519.74	2.31

### 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11月06日