

富国天时货币市场基金

二〇二三年九月月报

2023年09月30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：2023年10月13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	7,133,669,726.04
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	4,175,615,056.49	55.80
	其中：债券	4,175,615,056.49	55.80
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	299,740,096.72	4.01
	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	2,961,593,367.70	39.58
4	其他资产	45,919,378.92	0.61
5	合计	7,482,867,899.83	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	按实际利率计算的 账面价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	260,310,342.06	3.65
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	734,764,460.23	10.30
6	中期票据	51,276,716.93	0.72
7	同业存单	3,129,263,537.27	43.87
8	其他	—	—
9	合计	4,175,615,056.49	58.53
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

**2.3 报告期末按实际利率计算的账面价值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)	按实际利率计算的 账面价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112316111	23 上海银行 CD111	4,000,000.00	398,032,907.03	5.58
2	112387782	23 徽商银行 CD149	4,000,000.00	395,264,486.62	5.54
3	112313132	23 浙商银行 CD132	2,500,000.00	247,027,163.55	3.46
4	112386937	23 杭州银行 CD221	2,000,000.00	199,062,277.70	2.79
5	112386940	23 南京银行 CD131	2,000,000.00	199,062,277.70	2.79
6	112387336	23 北京农商银行 CD191	2,000,000.00	198,965,539.55	2.79
7	112305084	23 建设银行 CD084	2,000,000.00	197,244,890.51	2.76
8	012382196	23 中船集 SCP001	1,600,000.00	160,762,836.83	2.25
9	112380427	23 昆仑银行 CD018	1,500,000.00	148,470,566.47	2.08
10	112382521	23 南京银行 CD089	1,500,000.00	148,216,298.10	2.08

**2.4 报告期末按实际利率计算的账面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  
2023年10月13日