

# 方正富邦货币市场基金

## 2015第三季度报告

基金管理人:方正富邦基金管理有限公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年10月26日

基金管理人的董事会及董事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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
基金托管人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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
基金管理人承诺以诚实信用、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。  
基金托管人承诺以诚实信用、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。  
基金合同当事人根据基金合同约定,选择以纸面、电子或两者结合的形式披露基金的招募说明书。  
本报告期中基金管理人未使用纸介。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

9月30日,管理人对基金的流动性、证券资产及行业走势的简要说明  
4.6.1 管理人对基金的流动性、证券资产及行业走势的简要说明  
在长期利率下降的背景下,货币市场基金受到的影响可能较为有限,而融资需求较低,货币政策持续放松对基金流动性走势的持续支撑。尽管人民币汇率的不确定性及资本外流对资金面可能带来负面影响,但央行预计通过灵活的货币政策和对冲操作,将逐步改善资金面,我们预计四季度信用供给可能三季度有所放缓,发行在货币市场总体宽松的环境下,本基金将力求在保证流动性的前提下,为投资者提供较高收益。

5.6 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

姓名	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1 固定收益投资		110,112,588.16	43.06
其中:债券		110,112,588.16	43.06
资产支持证券		—	—
2 买入返售金融资产		90,000,735.00	35.03
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		49,137,001.08	1.92
4 其他资产		1,237,166.00	0.49
5 合计		250,488,371.04	100.00

5.2 报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末持有的回购协议	856	—
其中:买断式回购		—	—

注:本基金持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.3 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末持有的回购协议	39,099,740.00	1.906

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.4 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.5 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.6 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.7 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.8 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.9 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.10 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.11 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.12 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.13 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数
1	报告期末持有的回购协议	116	—
2	报告期内持有的回购协议最高价	120	—
3	报告期内持有的回购协议最低价	47	—

注:报告期末持有的回购协议金额占基金资产净值的20%。

5.14 本报告期末持有的回购协议情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	天数




<tbl\_r cells="4" ix="4"