

富国天时货币市场基金

【2016】第一季度报告

基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2016年04月22日

重要提示

富国基金管理有限公司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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，基金的风险由基金持有人承担。投资者有风险，投资需谨慎。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务数据未经审计。

本报告自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况				
基金名称	富国天时货币			
基金代码	100026			
基金运作方式	契约开放式			
基金合同生效日	2009年06月05日			
报告期末基金份额总额	15,111,925,101.96			
投资目标	在充分重视本金安全的前提下，确保基金资产的高流动性，追求超越业绩比较基准的稳定收益。			
投资策略	本基金管理人借鉴外方股东加拿大蒙特利尔银行（BMO Financial Group）的投资管理经验及投技经验，结合国内市场特点，应用“富国PMF—BMMF策略（Fixed Income Portfolio System—Money Market Fund）”和“股债配置—BMMF策略（Fixed Income Portfolio System—Money Market Fund）”进行资产配置。在投资管理过程中，本基金管理人坚持“中性与适度相结合、公平与积极相结合”的原则，根据市场利率变动及时调整资产配置，采用投资组合与资产配置相结合的方式进行主动投资管理。			
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为同期银行一年期定期存款利率（税后）。			
风险收益特征	本基金属于低风险投资，收益稳定，流动性较强的证券投资基金品种，但不意味着投资本基金不承担任何风险。			
基金管理人	富国基金管理有限公司			
基金托管人	中国工商银行股份有限公司			
下属分级基金的名称	富国天时货币A 富国天时货币B 富国天时货币C 富国天时货币D			
下属分级基金的代码	100026S 100026B 100026C 100026D			
报告期末下成分基金资产净值（单位：元）	621,367,103.61 14,440,862,300.03 18,325,478.06 20,759,430.06			

§3 主要财务指标和基金净值表现				
主要财务指标	A股 (2016年01月01日至 ~2016年03月31日)	B股 (2016年01月01日至 ~2016年03月31日)	C股 (2016年01月01日至 ~2016年03月31日)	D股 (2016年01月01日至 ~2016年03月31日)
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§4 业绩比较基准				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§5 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§6 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§7 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§8 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§9 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§10 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§11 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§12 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§13 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§14 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§15 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§16 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§17 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§18 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§19 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§20 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§21 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§22 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

(MPA)，季末资金更为紧张，回购利率出现大幅上升。与此同时，央行3月11日下调，普通下调金融机构人民币存款准备金率0.5个百分点，以对冲上述资金紧张的情况。在此背景下，本基金上一季度A股回购融资的收益率从1月26%左右在1月上旬一路爬升至26%左右，在接近1月末末，达到27%左右，又由于基金申购赎回，3月回购资金比例下降。一季度回购利率一月均值较四季度末末上升约2.60个百分点，在二月末末下降约2.3%后，3月又继续回升至2.5%。

报告期内，本基金管理人秉承“稳健投资、积极稳健”的原则，根据市场利率变动及时调整资产配置，采用投资组合与资产配置相结合的方式进行主动投资管理。

基金的风险由基金持有人承担。投资者有风险，投资需谨慎。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况				
基金名称	富国天时货币			
基金代码	100026			
基金运作方式	契约开放式			
基金合同生效日	2009年06月05日			
报告期末基金份额总额	15,111,925,101.96			

§3 主要财务指标和基金净值表现				
主要财务指标	A股 (2016年01月01日至 ~2016年03月31日)	B股 (2016年01月01日至 ~2016年03月31日)	C股 (2016年01月01日至 ~2016年03月31日)	D股 (2016年01月01日至 ~2016年03月31日)
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§4 业绩比较基准				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§5 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§6 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§7 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§8 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§9 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§10 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§11 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§12 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§13 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§14 基金净值表现				
项目	A股	B股	C股	D股
1.本期已实现收益	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86
2.本期利润	4,813,490.39	122,346,097.28	130,469.21	111,669.86

§15 基金净值表现					单位:份
序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2016-01-04	427,624.42	427,624.42	--
2	申购	2016-01-06	260,000,000.00	260,000,000.00	--
3	红利再投	2016-02-01	3,406,524.79	3,406,524.79	--
4	赎回	2016-02-03	120,000,000.00	-120,000,000.00	--
5	赎回	2016-03-17	30,000,000.00	-30,000,000.00	--