

方正富邦货币市场基金

[2017] 第一季度报告

基金管理人:方正富邦基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年04月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员不直接从事投资管理,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。
本基金的基金经理没有直接从事投资管理,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。

报告期内本基金因回购融资余额占基金资产净值比例导致报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值的比例的简单平均值;对于货币市场基金,只要其投资的市场(如银行间市场)可交易,即视为交易日。

本基金正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

报告期末,本货币市场基金正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	4.14
2	其中:买断式回购	-
3	报告期末持有的国债期货投资	76,909,706.00
4	其中:买入返售金融资产	9.04

注:报告期内因回购融资余额占基金资产净值比例导致报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值;对于货币市场基金,只要其投资的市场(如银行间市场)可交易,即视为交易日。

本基金正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

报告期末,本货币市场基金正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金报告期末投资组合平均剩余期限超过120天。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	天数
1	报告期末债券回购融资的平均剩余期限	87
2	报告期末持有的国债期货的平均剩余期限	90
3	报告期末持有的买入返售金融资产的平均剩余期限	22

本基金报告期末投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金报告期末投资组合平均剩余期限超过120天。

5.3.4 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限占基金资产净值的比例 (%)	长期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	12.34	9.24
2	30天(含)-90天	-	-
3	90天(含)-180天	14.28	-
4	180天(含)-360天	76.10	-
5	360天以上	-	-
6	60天(含)-120天	-	-
7	120天(含)-360天(含)	6.06	-
8	360天以上	-	-
9	合 计	100.00	9.24

5.4 报告期末投资组合平均剩余期限超过240天情况说明

本基金报告期末投资组合平均剩余期限超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本	占基金资产净值比例(%)
1	现金类资产	-	-
2	同业存款	-	-
3	金融债	40,314,963.11	6.06
4	其中:政策性金融债	40,314,963.11	6.06
5	企业债券	-	-
6	企业中期票据	-	-
7	企业短期融资券	306,845,963.24	48.13
8	其他	-	-
9	合计	446,660,916.35	54.19
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 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证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1117160006	17上海银行CD009	1,000,000.00	987,747.04	1.20%
2	1117120009	17北京银行CD009	1,000,000.00	987,747.04	1.20%
3	1117100074	17恒丰银行CD074	1,000,000.00	986,426.70	1.20%
4	170203	17浦发银行CD004	600,000.00	601,914,963.11	6.06
5	1116260061	16广发银行CD177	500,000.00	497,426.21	0.60%
6	1110100068	16兴业银行CD096	600,000.00	497,302.00	0.60%
7	1117120057	17民生银行CD057	500,000.00	497,281.00	0.60%
8	1117100074	17平安银行CD074	500,000.00	497,260.00	0.60%
9	1117160006	17上海银行CD006	600,000.00	497,239.00	0.60%
10	1117160006	17民生银行CD006	600,000.00	497,239.00	0.60%

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期偏离度绝对值在0.25%-1%区间内的次数	0
报告期偏离度最高值	0.0000%
报告期偏离度最低值	-0.0002%
报告期偏离度的简单平均值	0.0025%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到1%情况说明

本基金本报告期正偏离度的绝对值未达到0.50%。

5.8 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

序号	资产支持证券名称	资产支持证券的发行主体	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160001-A	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%
2	160001-B	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%
3	160001-C	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%
4	160001-D	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%
5	160001-E	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%
6	160001-F	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%
7	160001-G	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%
8	160001-H	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%
9	160001-I	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%
10	160001-J	16国开行租赁资产支持证券	341,100,797.05	5.10%

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金会计方法说明

本基金采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价或折价,在评估日将公允价值与账面价值的差额确认为公允价值变动损益。

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生偏差,从而对基金份额持有人的利益产生不利影响,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新估值,即“影子定价”。

5.9.2 报告期内,本基金运作平稳,实现了较高的投资收益,并严格控制了风险,取得了良好的投资回报。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额	占基金资产净值比例(%)
1	卖出回购证券	304,979,067.37	4.16%
2	卖出回购金融资产	652,126,589.05	0.97%
3	卖出回购基金的份额	443,079,065.04	6.05%
4	其他	616,024,966.81	8.65%
5	合计	1,349,304,384.11	100.00%

5.10 投资组合报告

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例为1.0059%,B级份额净值收益率为

1.0055%。A级份额净值收益率为0.9959%,B级份额净值收益率为

0.9955%。B级份额净值收益率与A级份额净值收益率之差为0.01%。

5.12 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例为0.9959%,B级份额净值收益率为

0.9955%。A级份额净值收益率为0.9959%,B级份额净值收益率为

0.9955%。B级份额净值收益率与A级份额净值收益率之差为0.00%。

5.13 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例为0.9959%,B级份额净值收益率为

0.9959%。A级份额净值收益率为0.9959%,B级份额净值收益率为

0.9959%。B级份额净值收益率与A级份额净值收益率之差为0.00%。

5.14 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例为0.9959%,B级份额净值收益率为

0.9959%。A级份额净值收益率为0.9959%,B级份额净值