方正富邦货币市场基金

2017年第四季度报告

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:2018年01月20日

§1 重要提示

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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月19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。
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。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2017年10月01日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	方正富邦货币	
基金主代码	730003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月26日	
报告期末基金份额总额	923,335,943.96份	
投资目标	在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。	
投资策略	本基金在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下,依据宏观经济、货币政策、财政政策和短期利率变动预期,综合考虑各投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。 具体而言,本基金的投资策略以自上而下为主,同时兼顾自下而上的方式。其中,自上而下是指基金管理人通过定量与定性相结合的综合分析,对利率无其是短期利率的变化趋势进行预测,在科学、合理的短期利率预测的基础上决定本基金组合的期限结构和品种结构,构建稳健的投资组合。自下而上是指要借视具体投资对象的价值分析,同时针对市场分歧及定价机制暂时失灵带来的投资机会,进行相应的套利操作,增加投资收益。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的高流动性、低风险品种。本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金	
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	
下属分级基金的基金简称	方正富邦货币A	方正富邦货币B
下属分级基金的交易代码	730003	730103
报告期末下属分级基金的份额总额	562,920,565.22份	360,415,378.74份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年10月01日 - 2017年12月31日)	
	方正富邦货币A	方正富邦货币B
1.本期已实现收益	4,464,630.78	2,980,306.01
2.本期利润	4,464,630.78	2,980,306.01
3.期末基金资产净值	562,920,565.22	360,415,378.74

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

方正富邦货币A净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0262%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.6859%	0.0019%

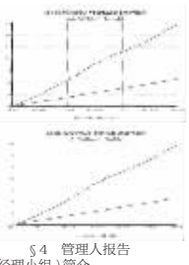
注:本基金的收益分配是按日结转份额。

方正富邦货币B净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0872%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.7469%	0.0019%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王健	基金投资部助理总监兼本基金基金经理	2015-03-18	-	8年	本科毕业于内蒙古师范大学教育技术专业,硕士毕业于内蒙古工业大学产业经济学专业。2009年3月至2014年12月于包商银行债券投资部担任执行经理助理;2015年1月至2015年3月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部担任拟任基金经理;2015年3月至今,任方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场基金、方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2015年6月至今,任方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年6月至今,任方正富邦基金管理有限公司基金投资部助理总监职务;2017年1月至2017年10月,任方正富邦鑫利宝货币市场基金的基金经理;2017年7月至今,任方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金的基金经理;2017年12月至今,任方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金的基金经理。

注:1、"任职日期"和"离任日期"分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定,通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面,本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库,确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先, 价格优先的原则严格执行所有指令,确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾四季度,基本面上,经济韧性较强但面临下行压力;政策面上,监管政策加速落地,如公募流动性新规、资管新规征求意见稿、商业银行流动性新规征求意见稿等均已发布,彰显强监管的态势;资金面上,整体紧平衡伴随时点性紧张,其中12月跨年资金利率高企,3M国有股份制存单达到年内最高5.4%,隔夜逆回购利率最高到25%,7D最高到24%。债券市场迎来年内第三波大幅上行,在11月22日前后,十年期国债收益率触及4%,十年期国开债收益率触及5%。目前投资者仍较谨慎,后续走向仍需关注市场对监管政策和货币政策的预期。

报告期内,本基金迅速适应流动性新规,结合本基金以个人客户为主的特点,优化久期及到期资金时点,并采取灵活的配置策略,在资金紧张的关键时点适度拉长久期,为投资者获得了稳定的高收益,资产配置种类包括存款、债券回购和存单。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日,本基金本报告期A级份额净值收益率为1.0262%,B级份额净值收益率为1.0872%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情况。

§5 投资组合报告

5.1 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	426,361,725.99	42.19
	其中:债券	426,361,725.99	42.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	379,626,209.44	37.57
	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	201,758,697.61	19.97
4	其他资产	2,761,602.49	0.27
5	合计	1,010,508,235.53	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	8.72
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	86,239,836.88	9.34
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取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,即可视为交易日。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2017-10-09	23.31	巨额赎回	1.00

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

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 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	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	41.31	9.34
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	7.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	49.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	10.69	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		109.14	9.34

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期投资组合平均剩余期限未超过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	摊余成本(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	59,948,215.99	6.49
	其中:政策性金融债	59,948,215.99	6.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	366,413,510.00	39.68
8	其他	-	-
9	合计	426,361,725.99	46.18
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	111709483	17浦发银行CD483	1,000,000	99,132,753.85	10.74
2	111710635	17兴业银行CD635	1,000,000	99,132,753.85	10.74
3	111781300	17南京银行CD138	1,000,000	98,695,239.34	10.69
4	111715437	17民生银行CD437	700,000	69,452,762.96	7.52
5	170204	17国开04	600,000	59,948,215.99	6.49

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
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0375%
报告期内偏离度的最低值	-0.0607%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0314%

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0.5%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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销,每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。

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重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,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评估,即"影子定价"。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

5.9.2 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,761,602.49
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	2,761,602.49

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	方正富邦货币A	方正富邦货币B
报告期期初基金份额总额	459,722,003.90	228,335,233.64
报告期期间基金总申购份额	312,908,710.17	269,592,354.07
报告期期间基金总赎回份额	209,710,148.85	137,512,208.97
报告期期末基金份额总额	562,920,565.22	360,415,378.74

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。本报告期本基金管理人持有的基金份额发生红利再投资34,731.68份。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内,不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会核准基金募集的文件;
(2)《方正富邦货币市场基金基金合同》;
(3)《方正富邦货币市场基金基金托管协议》;
(4)《方正富邦货币市场基金招募说明书》;
(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;
(6)基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司
二〇一八年一月二十日

方正富邦金小宝货币市场证券投资基金

2017年第四季度报告

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:2018年01月20日

§1 重要提示

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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月19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。
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。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2017年10月01日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	方正富邦金小宝货币	
基金主代码	000757	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年09月24日	
报告期末基金份额总额	8,426,809,371.84份	
投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资人创造稳定的收益。在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。	
投资策略	本基金在确保资产安全性和流动性的基础上,对短期货币市场利率的走势和货币政策进行预测和判断,采取积极主动的投资策略,综合利用定性分析和定量分析方法,力争获取超越比较基准的投资回报。	
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
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	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年10月01日 - 2017年12月31日)
1.本期已实现收益	151,582,753.15
2.本期利润	151,582,753.15
3.期末基金资产净值	8,426,809,371.84

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

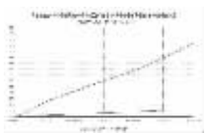
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0523%	0.0009%	0.0882%	0.0000%	0.9641%	0.0009%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王健	基金投资部助理总监兼本基金基金经理	2015-03-18	-	8年	本科毕业于内蒙古师范大学教育技术专业,硕士毕业于内蒙古工业大学产业经济学专业。2009年3月至2014年12月于包商银行债券投资部担任执行经理助理;2015年1月至2015年3月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部担任拟任基金经理;2015年3月至今,任方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场基金、方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2015年6月至今,任方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年6月至今,任方正富邦基金管理有限公司基金投资部助理总监职务;2017年1月至2017年10月,任方正富邦鑫利宝货币市场基金的基金经理;2017年7月至今,任方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金的基金经理;2017年12月至今,任方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金的基金经理。

注:1、"任职日期"和"离任日期"分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦金小宝货币市场基金基金合同》 和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定,通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面,本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库,确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先, 价格优先的原则严格执行所有指令,确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾四季度,资金面呈现出整体紧平衡,缴税及跨月时点性紧张的特点。其中12月跨年资金利率高企,3M国股存单最高到5.4%, 隔夜逆回购利率最高到25%,7D最高到24%。债券市场在10-11月开始年内第三波大幅上行。调整幅度上,利率债大于信用债、十年国开债大于十年国债,呈现出与前两波上行不同的特点。主因是在美债收益率大幅上行、部分经济数据超预期、周小川行长"GDP7.0"言论、同业监管升级及资金间歇性紧张等因素叠加影响下,引发了市场对经济基本面和通货膨胀预期的修正和对货币政策收紧、监管升级的忧虑,市场的脆弱性加剧了调整幅度。目前投资者仍较谨慎,后续走向仍需关注市场对监管政策和货币政策的预期。

本基金重点管理流动性。报告期内,本基金迅速适应流动性新规,结合客户集中度及申赎规律,优化久期和到期资金时点,在资金紧张的关键时点,相机配置超调的各类资产。总体而言,本基金在四季度紧平衡的资金环境下,合理安排了到期资金,为投资者争取了稳定收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日,本基金本报告期份额净值收益率为1.0523%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情况。

§5 投资组合报告

5.1 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	7,840,347,127.62	75.77
	其中:债券	7,840,347,127.62	75.77
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	2,502,035,566.54	24.18
4	其他资产	4,948,663.05	0.05
5	合计	10,347,331,357.21	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	7.22
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	1,914,221,320.68	22.72
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2017-12-28	26.24	巨额赎回	4

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

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	113
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 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	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	0.02	22.72
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	11.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	45.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	23.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	42.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		122.73	22.72

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期投资组合平均剩余期限未超过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	摊余成本(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	507,846,040.65	6.03
	其中:政策性金融债	507,846,040.65	6.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,945,168,376.83	82.42
8	其他	-	-
9	合计	7,840,347,127.62	93.04
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	111710600	17兴业银行CD600	10,000,000	981,601,709.39	11.65
2	111721101	17渤海银行CD101	10,000,000	976,018,961.83	11.58
3	111781300	17南京银行CD138	8,000,000	789,561,914.18	9.37
4	111715437	17民生银行CD437	5,300,000	525,856,633.94	6.24
5	111715457	17民生银行CD457	5,000,000	495,662,030.91	5.88
6	111717290	17光大银行CD290	5,000,000	490,800,854.67	5.82
7	111719199	17恒丰银行CD199	5,000,000	489,028,014.61	5.80
8	110210	11国开10	4,400,000	438,700,396.40	5.21
9	111787152	17长沙银行CD113	4,000,000	394,288,046.30	4.68
10	111787209	17郑州银行CD197	4,000,000	394,288,046.30	4.68
11	111787169	17贵阳银行CD145	4,000,000	394,288,046.30	4.68

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
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0243%
报告期内偏离度的最低值	-0.1733%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0486%

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0.5%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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销,每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。

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重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,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评估,即"影子定价"。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

5.9.2 17南京银行CD138(代码:111781300)为金小宝货币市场证券投资基金的前十大持仓证券。2017年6月22日,江苏银监局针对南京银行独立董事任职时间超过监管规定,处以人民币25万元的行政处罚。2017年11月9日,人民银行南京分行营业管理部针对南京银行的如下事由对南京银行给予警告并处罚款人民币30万元:(一)下属支行作为异地存款银行的开户银行,涉及47户银行同业账户;(二)未见存款银行经营范围批准文件,涉及48户银行同业账户;(三)未采取多种措施对开户证明文件的真实性、完整性和合规性以及存款银行开户意愿真实性进行审核,涉及48户银行同业账户;(四)对账地址(联系地址)不是存款银行经营所在地或工商注册地址, 涉及34户银行同业账户;(五) 未执行开户生效日制度,涉及1户银行同业账户;(六)未执行久悬制度,涉及6户银行同业账户。

除17南京银行CD138外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,948,663.05
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	4,948,663.05

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	11,516,749,972.90
报告期期间基金总申购份额	49,521,109,958.53
报告期期间基金总赎回份额	52,611,050,859.59
报告期期末基金份额总额	8,426,809,371.84

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额	交易金额	适用费率
1	申购	2017-11-27	20,000,000.00	20,000,000.00	0.0000
2	赎回	2017-12-15	3,000,000.00	3,000,000.00	0.0000
3	赎回	2017-12-29	2,500,000.00	2,500,000.00	0.0000
合计			25,500,000.00	25,500,000.00	

注: 本报告期本基金管理人持有的基金份额发生红利再投资 1,942,627.35份。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内,不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会核准基金募集的文件;
(2)《方正富邦金小宝货币市场基金基金合同》;
(3)《方正富邦金小宝货币市场基金基金托管协议》;
(4)《方正富邦金小宝货币市场基金招募说明书》;
(5)基金管理人业务资格批件、营业执照 ;
(6)基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司
二〇一八年一月二十日

方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金

2017年第四季度报告

基金管理人:方正富邦基金管理有限公司
基金托管人:包商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年01月20日

§1 重要提示

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。
基金托管人包商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月19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。
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。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2017年10月01日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	方正富邦睿利纯债	