

富国收益宝交易型货币市场基金

二〇二〇年7月月报

2020年07月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2020年08月07日

§ 1 基金产品概况

基金简称	富国收益宝交易型货币
场内简称	富国货币 ETF
基金主代码	511900
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 24 日
报告期末基金份额总额	19,439,266,354.85
业绩比较基准	活期存款利率（税后）

§ 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	9,903,499,092.89	47.94
	其中：债券	9,803,499,092.89	47.46
	资产支持证券	100,000,000.00	0.48
2	买入返售金融资产	3,972,716,363.64	19.23
	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	6,365,111,131.52	30.81
4	其他资产	416,654,174.86	2.02
5	合计	20,657,980,762.91	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	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	99,819,391.94	0.51
2	央行票据	—	—
3	金融债券	970,558,581.07	4.99
	其中：政策性金融债	970,558,581.07	4.99
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	2,510,076,575.14	12.91
6	中期票据	302,765,629.56	1.56
7	同业存单	5,920,278,915.18	30.46
8	其他	—	—
9	合计	9,803,499,092.89	50.43
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	—	—

2.3 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	112009235	20 浦发银行 CD235	5,000,000.00	498,271,067.62	2.56
2	190211	19 国开 11	3,700,000.00	370,616,483.19	1.91
3	111909275	19 浦发银行 CD275	3,000,000.00	299,891,851.55	1.54
4	112011125	20 平安银行 CD125	3,000,000.00	299,208,453.69	1.54
5	112006135	20 交通银行 CD135	3,000,000.00	298,259,270.95	1.53
6	112003007	20 农业银行 CD007	3,000,000.00	297,533,825.16	1.53
7	112003017	20 农业银行 CD017	3,000,000.00	297,359,432.53	1.53
8	112003019	20 农业银行 CD019	3,000,000.00	297,347,848.69	1.53
9	112017093	20 光大银行 CD093	3,000,000.00	297,347,848.69	1.53
10	111903099	19 农业银行 CD099	2,000,000.00	199,941,930.87	1.03

2.4 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	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	168649	信润 03A1	1,000,000	100,000,000.00	0.51

富国基金管理有限公司
2020年08月07日