

南方现金通货币市场基金 2018 年第 2 季度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 07 月 18 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 7 月 16 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，投资者在做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 2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方现金通货币
基金主代码	000493
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 01 月 21 日
报告期末基金份额总额	89,142,444,691.40 份
投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	南方现金货币 A	南方现金货币 B	南方现金货币 C	南方现金货币 E
下属分级基金的交易代码	000493	000494	000495	000719
报告期末下属分级基金的份额总额	6,267,132.17 份	22,961,383.22 份	9,903,421,568.21 份	79,209,794,607.80 份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方现金通”。

§ 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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)			
	南方现金货币 A	南方现金货币 B	南方现金货币 C	南方现金货币 E
1. 本期已实现收益	50,695.86	305,084.83	80,285,006.45	791,306,344.61
2. 本期利润	50,695.86	305,084.83	80,285,006.45	791,306,344.61
3. 期末基金资产净值	6,267,132.17	22,961,383.22	9,903,421,568.21	79,209,794,607.80

注：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

南方现金货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④

		②	收益率 ③	准差④		
过去 三个 月	1.0607%	0.0006%	0.3418%	0.0000%	0.7189%	0.0006%

南方现金货币 B

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	1.0727%	0.0005%	0.3418%	0.0000%	0.7309%	0.0005%

南方现金货币 C

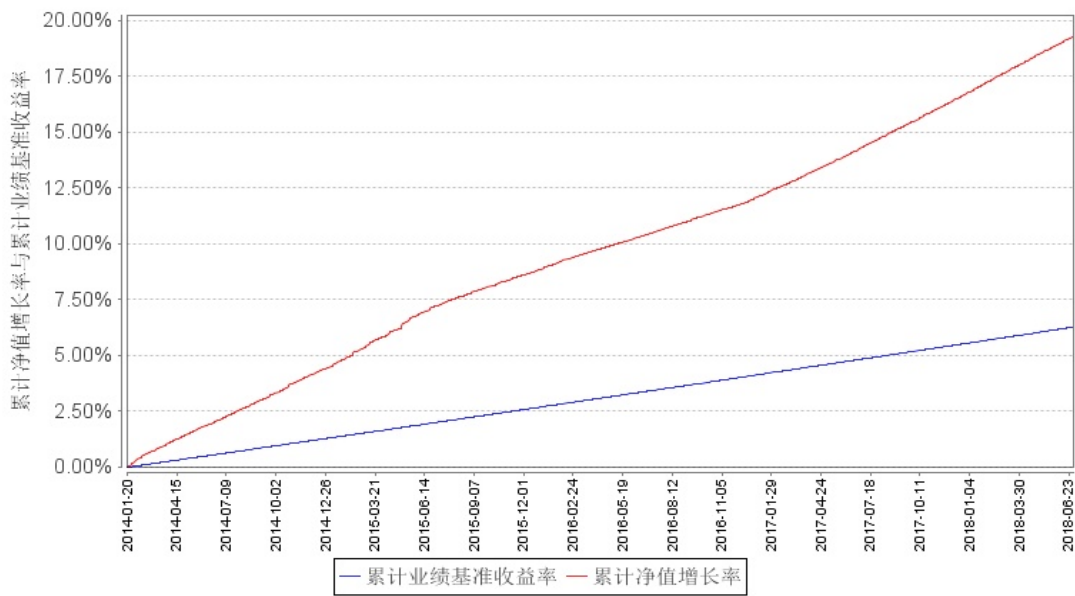
阶段	净值收 益率①	净值收益 率标准差 ②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去 三个 月	1.0898%	0.0005%	0.3418%	0.0000%	0.7480%	0.0005%

南方现金货币 E

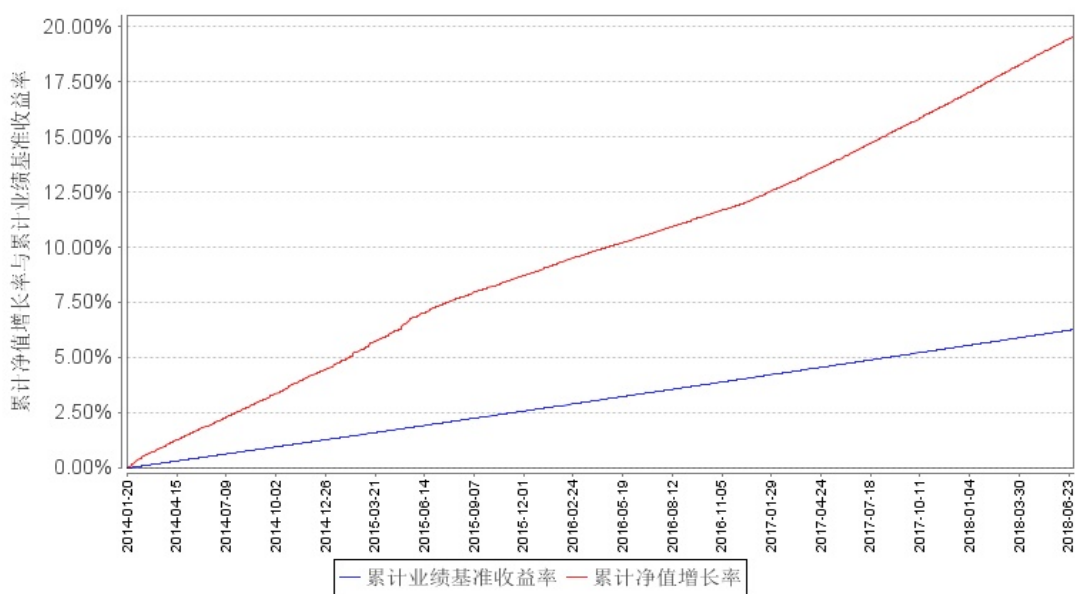
阶段	净值收 益率①	净值收益 率标准差 ②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去 三个 月	1.0443%	0.0005%	0.3418%	0.0000%	0.7025%	0.0005%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

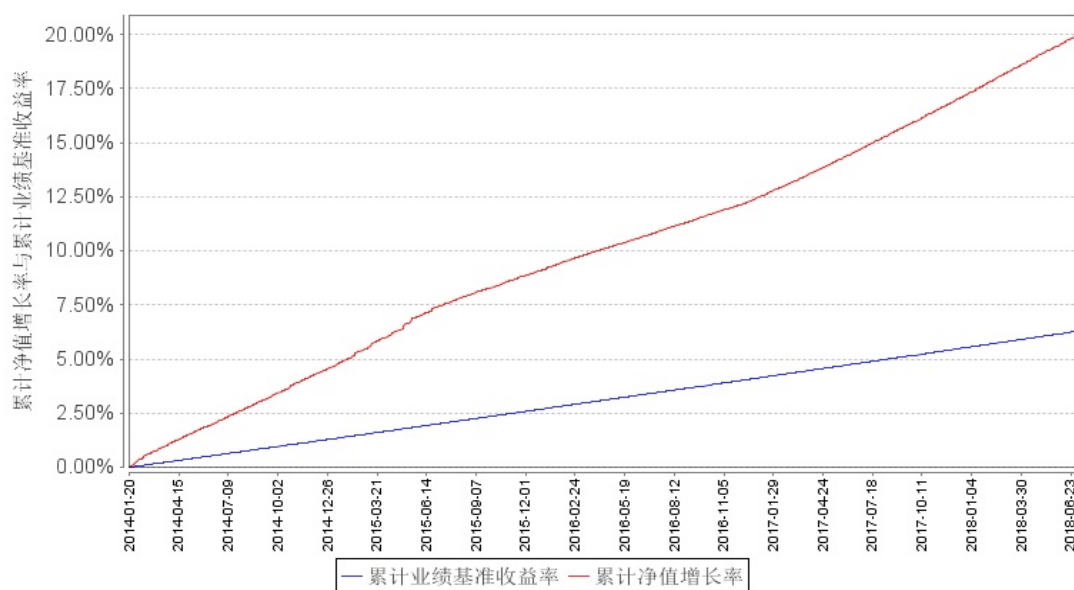
南方现金货币A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



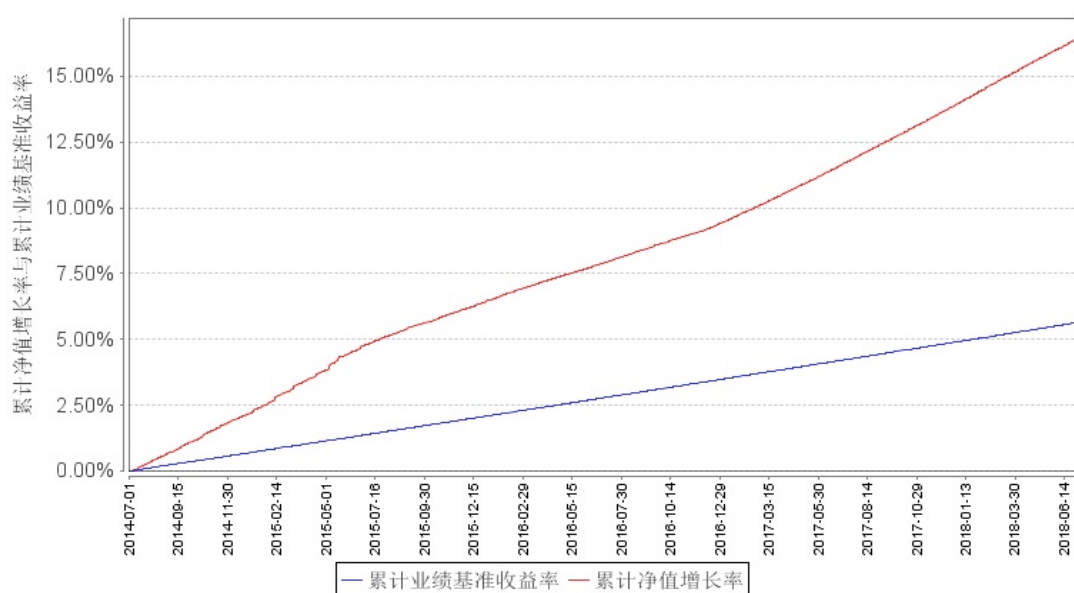
南方现金货币B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方现金通货币C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方现金通货币E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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		
董浩	本基金基金经理	2015年9月11日		8年	南开大学金融学硕士，具有基金从业资格。2010年7月加入南方基金，历任交

					<p>易管理部债券交易员、固定收益部货币理财类研究员；</p> <p>2014 年 3 月至 2015 年 9 月，任南方现金通基金经理助理；</p> <p>2015 年 9 月至 2016 年 8 月，任南方 50 债基金经理；</p> <p>2015 年 9 月至今，任南方现金通、南方中票基金经理；</p> <p>2016 年 2 月至今，任南方日添益货币基金经理；</p> <p>2016 年 8 月至今，任南方 10 年国债基金经理；</p> <p>2016 年 11 月至今，任南方理财 60 天基金经理；</p> <p>2017 年 8 月至今，任南方天天宝基金经理。</p>
夏晨曦	本基金基金经理	2014 年 7 月 25 日		13 年	<p>香港科技大学理学硕士，具有基金从业资格。</p> <p>2005 年 5 月加入南方基金，曾担任金融工程研</p>

					<p>究员、固定收益研究员、风险控制员等职务，现任现金投资部总经理、固定收益投资决策委员会副主席。</p> <p>2008 年 5 月至 2012 年 7 月，任固定收益部投资经理，负责社保、专户及年金组合的投资管理；</p> <p>2013 年 1 月至 2014 年 12 月，任南方理财 30 天基金经理；</p> <p>2012 年 7 月至 2015 年 1 月，任南方润元基金经理；</p> <p>2014 年 7 月至 2016 年 11 月，任南方薪金宝基金经理；</p> <p>2014 年 12 月至 2016 年 11 月，任南方理财金基金经理；</p> <p>2012 年 8 月至今，任南方理财 14 天基金经理；</p>
--	--	--	--	--	--

					2012 年 10 月至今，任南方理财 60 天基金经理； 2014 年 7 月至今，任南方现金增利、南方现金通基金经理； 2014 年 12 月至今，任南方收益宝基金经理； 2016 年 2 月至今，任南方日添益货币基金经理； 2016 年 10 月至今，任南方天天利基金经理； 2017 年 8 月至今，任南方天天宝基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方现金货币市场基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完

善相应制度及流程，通过系统和人工等各种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基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度经济有所回落，1-5 月工业增加值累计同比增长 6.9%；1-5 月固定资产投资累计同比增长 6.1%，其中，房地产投资累计同比增长 10.2%，基建投资累计同比增长 9.4%，制造业投资累计同比增长 5.2%，投资数据较一季度显著回落，基建投资下滑是主要拖累项，地产投资中拿地支出的滞后影响依然存在，制造业投资相对平稳；1-5 月社会消费品零售总额累计同比增长 9.5%，较一季度继续回落。通胀方面，由于食品价格低迷，4、5 月 CPI 同比增长回落至 1.8%；而 PPI 受到油价上涨和基数较低的影响，4、5 月同比增幅回升至 3.4%和 4.1%。金融数据方面，M2 增速依然偏低，4、5 月同比增速仅 8.3%，信贷较去年同期有一定增长，不过由于非标收缩导致社融整体出现明显下滑。美联储 6 月议息会议再次加息 25BP，将联邦基金利率目标上调至 1.75%-2.0%，同时上调了今年的经济增速和今明两年的通胀预测，对经济前景保持乐观。欧央行维持三大利率不变，维持每月购债规模 300 亿欧元不变，同时宣布将在 12 月底结束购债，但维持利率不变至少到 2019 年夏天。国内央行在二季度两次降准，合计净投放流动性约 1.1 万亿，且二季度美联储加息后央行并未跟随调整，货币政策转向中性偏松。二季度美元指数上涨 4.54%，人民币对美元汇率中间价贬值 3285 个基点。二季度银行间隔夜、7 天回购加权利率均值为 2.73%、3.39%，分别较上季度回升 5BP 和 18BP。市场层面，利率债收益率震荡下行。1 年国债、1 年国开收益率分别下行 16BP、33BP。10 年国债、10 年国开收益率分别下行 27BP、39BP，利率曲线平坦化下移。同业存单利率先上后下，高点仍未突破一季度水平。货币市场利率处于下行趋势中，中枢较去年已有明显下移。在操作方面，本基金主要以中高久期持仓为主，以期提高组合静态收益并获取一定的资本利得。经济层面，6 月中采制造业 PMI 从 51.9 回落至 51.5，进出口指数下滑是主要拖累项，随着贸易战的爆发，企业对生产活动前景的预期有所弱化。二季度工业生产加快有一定赶工效应的影响，近期环保力度再次加大，贸易前景的不确定性也明显提高，预计后期工业生产将承受一定压力。通胀方面，CPI 由于食品价格低迷，预计三季度将稳中有落，全年中枢在 2.0%左右；PPI 的基数效应逐渐消退，油价短期内进入震荡期，对 PPI 拉动有所放缓，预计三季度 PPI 也有所回落，全年中枢在 3.5%左右。政策方面，美联储 6 月如期加息，且对经

济和通胀前景较为乐观，年内再次加息 2 次的概率仍然较高。欧央行维持利率不变，将于年底退出 QE，不过到明年夏天前不会加息的表态略低于市场预期。国内方面，央行二季度两次降准，合计释放了上万亿的流动性，同时央行在季末例会中也调整了部分措辞，将保持流动性“合理稳定”改为“合理充裕”，基本明确了货币政策转向中性偏松。监管政策方面，资管新规虽然已经出台，但细则迟迟没有落地，商业银行流动性新规正式稿落地，相比于征求意见稿，在过渡期和部分指标的计算上有所放松。债市策略方面，二季度进入旺季后基本面表现平稳，量价指标均有明显回暖。不过，基本面的风险也逐渐显现，融资环境大幅收紧，贸易战局势反复，地产和平台的监管继续收紧，这些因素都对经济增长造成了偏长期的影响，短期内难以逆转。因此，基本面向下行的压力仍未缓解，预计下半年经济将弱于上半年。随着去杠杆带来的基本面风险提升，叠加外部局势的不稳定，货币政策已经出现了明显的转向，但资管新规细则仍未落地，债券市场配置力量依然偏弱，且主要集中在高等级和中短端。利率债方面，二季度在基本面和政策面的利好推动下，收益率继续震荡下行，不过配置力量的相对缺失导致交易情绪偏重，期限利差有明显压缩，短期行情或有反复。中长期来看，利率下行的基础依然存在，需要等待短端的进一步下行打开长端下行的空间。信用债方面，二季度信用违约事件频发，融资环境的收紧和资管新规的落地对低等级信用债造成了较大的冲击，高等级显著优于低等级，信用利差走扩的压力较大。下半年需要密切关注民营企业、城投平台等在本轮紧信用环境中受冲击最明显的领域，加强对持仓债券的跟踪和梳理，严防信用风险。操作方面，本基金将保持中高久期，重点配置高等级债券和同业存单，密切关注市场流动性和基金规模状况，确保基金平稳安全运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 级基金净值收益率为 1.0607%，同期业绩比较基准收益率为 0.3418%。B 级基金净值收益率为 1.0727%，同期业绩比较基准收益率为 0.3418%。C 级基金净值收益率为 1.0898%，同期业绩比较基准收益率为 0.3418%。E 级基金净值收益率为 1.0443%，同期业绩比较基准收益率为 0.3418%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	61,290,767,160.31	66.64
	其中：债券	61,178,767,160.31	66.52

	资产支持 证券	112,000,000.00	0.12
2	买入返售金融资 产	3,944,286,554.37	4.29
	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	26,531,774,549.80	28.85
4	其他资产	205,988,259.13	0.22
5	合计	91,972,816,523.61	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融 资余额	3.96	
	其中：买断式回购融 资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融 资余额	2,688,765,898.74	3.02
	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的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：本基金合同约定：“本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	65

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

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	各期限负债占基金资产净值的比例
----	--------	-------------	-----------------

		值的比例 (%)	(%)
1	30 天以内	8.51	3.13
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	16.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	40.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	32.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	102.94	3.13

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

注：本报告期内，本基金未发生平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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	517,921,202.65	0.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,074,346,108.95	4.57
	其中：政策性金融债	4,074,346,108.95	4.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,412,309,157.38	3.83
6	中期票据	100,261,497.90	0.11
7	同业存单	53,073,929,193.43	59.54
8	其他	-	-
9	合计	61,178,767,160.31	68.63
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序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量	摊余成本（元）	占基金资产净值
----	------	------	------	---------	---------

			(张)		比例 (%)
1	111803112	18 农业银行 CD112	35,000,000	3,474,632,218.52	3.90
2	111809172	18 浦发银行 CD172	32,000,000	3,174,323,403.40	3.56
3	111808161	18 中信银行 CD161	28,000,000	2,776,755,712.63	3.11
4	111803091	18 农业银行 CD091	23,500,000	2,338,188,522.85	2.62
5	111811118	18 平安银行 CD118	23,000,000	2,289,466,728.41	2.57
6	111807090	18 招商银行 CD090	20,000,000	1,931,497,523.79	2.17
7	111812098	18 北京银行 CD098	20,000,000	1,930,682,260.42	2.17
8	111815203	18 民生银行 CD203	18,900,000	1,881,344,057.74	2.11
9	111809148	18 浦发银行 CD148	11,400,000	1,133,051,421.80	1.27
10	111806114	18 交通银行 CD114	11,500,000	1,110,613,553.63	1.25

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	0.1210%
报告期内偏离度的最低值	0.0042%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0472%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：无。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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)	摊余成本 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	116638	万科 10A1	900,000	90,000,000.00	0.10
2	116614	万科 8A1	220,000	22,000,000.00	0.02

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

5.9.2

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（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	205,988,259.13
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	205,988,259.13

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方现金通货币 A	南方现金通货币 B	南方现金通货币 C	南方现金通货币 E
报告期 期初基 金份 额 总 额	4,936,512.37	29,372,439.64	7,119,789,865.25	68,453,545,022.54
报告期 期间基 金总 申 购份 额	3,802,917,393.77	259,757,968.29	3,800,924,498.47	151,524,842,907.91
减：报 告期 期 间基 金 总 赎 回 份 额	3,801,586,773.97	266,169,024.71	1,017,292,795.51	140,768,593,322.65
报告期 期间基 金拆 分 变 动 份 额 （份 额 减 少 以“- ”填 列）	-	-	-	-
报告期 期 末 基 金 份 额 总 额	6,267,132.17	22,961,383.22	9,903,421,568.21	79,209,794,607.80

注： 1. 本基金 A 类基金份额开放认购、申购和赎回业务，B 类和 C 类基金份额不开放申购业务，只开放赎回业务。B 类和 C 类基金份额是根据持有时间或持有数量在满足一定条件后由系统自动升级生成。上表中申购、赎回份额均包含份额升级部分。 2. 根据 2014 年 7 月 2 日刊登《关于南方现金通货币市场基金增加基金份额类别、开放申购赎回业务并修改基金合同的公告》，决定增

加南方现金通货币市场基金的 E 类份额类别、开放申购赎回业务，E 类份额自 2014 年 7 月 4 日起开放申购和赎回业务，不随持有时间或持有数量升级或降级为其他基金份额类别。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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	分红	2018-04-02	72.32	72.32	-
2	分红	2018-04-02	0.67	0.67	-
3	分红	2018-04-02	0.67	0.67	-
4	分红	2018-04-02	81.35	81.35	-
5	分红	2018-04-02	0.69	0.69	-
6	分红	2018-04-02	82.98	82.98	-
7	分红	2018-04-02	73.77	73.77	-
8	分红	2018-04-02	279.49	279.49	-
9	分红	2018-04-02	6.87	6.87	-
10	分红	2018-04-02	81.35	81.35	-
11	分红	2018-04-02	0.67	0.67	-
12	分红	2018-04-02	6.87	6.87	-
13	分红	2018-04-02	14.10	14.10	-
14	分红	2018-04-02	0.69	0.69	-
15	分红	2018-04-02	14.21	14.21	-
16	分红	2018-04-02	285.04	285.04	-
17	分红	2018-04-02	7.06	7.06	-
18	分红	2018-04-02	72.32	72.32	-
19	分红	2018-04-02	14.10	14.10	-
20	分红	2018-04-02	0.67	0.67	-
21	分红	2018-04-02	279.47	279.47	-
22	分红	2018-04-03	0.68	0.68	-
23	分红	2018-04-03	281.17	281.17	-
24	分红	2018-04-03	0.68	0.68	-
25	分红	2018-04-03	72.76	72.76	-
26	分红	2018-04-03	14.28	14.28	-
27	分红	2018-04-03	6.99	6.99	-
28	分红	2018-04-03	81.85	81.85	-
29	分红	2018-04-04	0.68	0.68	-
30	分红	2018-04-04	73.10	73.10	-
31	分红	2018-04-04	14.57	14.57	-
32	分红	2018-04-04	7.26	7.26	-
33	分红	2018-04-04	82.22	82.22	-
34	分红	2018-04-04	0.68	0.68	-
35	分红	2018-04-04	282.47	282.47	-

36	分红	2018-04-09	14.32	14.32	-
37	分红	2018-04-09	14.32	14.32	-
38	分红	2018-04-09	283.82	283.82	-
39	分红	2018-04-09	74.08	74.08	-
40	分红	2018-04-09	6.98	6.98	-
41	分红	2018-04-09	6.98	6.98	-
42	分红	2018-04-09	82.61	82.61	-
43	分红	2018-04-09	0.68	0.68	-
44	分红	2018-04-09	283.78	283.78	-
45	分红	2018-04-09	0.68	0.68	-
46	分红	2018-04-09	73.44	73.44	-
47	分红	2018-04-09	73.44	73.44	-
48	分红	2018-04-09	82.61	82.61	-
49	分红	2018-04-09	73.44	73.44	-
50	分红	2018-04-09	6.98	6.98	-
51	分红	2018-04-09	286.27	286.27	-
52	分红	2018-04-09	82.60	82.60	-
53	分红	2018-04-09	73.43	73.43	-
54	分红	2018-04-09	0.69	0.69	-
55	分红	2018-04-09	283.77	283.77	-
56	分红	2018-04-09	6.98	6.98	-
57	分红	2018-04-09	0.68	0.68	-
58	分红	2018-04-09	82.61	82.61	-
59	分红	2018-04-09	7.41	7.41	-
60	分红	2018-04-09	0.68	0.68	-
61	分红	2018-04-09	14.32	14.32	-
62	分红	2018-04-09	14.32	14.32	-
63	分红	2018-04-09	0.68	0.68	-
64	分红	2018-04-09	0.69	0.69	-
65	分红	2018-04-09	283.80	283.80	-
66	分红	2018-04-09	83.33	83.33	-
67	分红	2018-04-09	0.68	0.68	-
68	分红	2018-04-09	0.68	0.68	-
69	分红	2018-04-09	14.70	14.70	-
70	分红	2018-04-09	0.68	0.68	-
71	分红	2018-04-10	82.94	82.94	-
72	分红	2018-04-10	0.68	0.68	-
73	分红	2018-04-10	14.60	14.60	-
74	分红	2018-04-10	284.92	284.92	-
75	分红	2018-04-10	7.19	7.19	-
76	分红	2018-04-10	0.69	0.69	-
77	分红	2018-04-10	73.73	73.73	-
78	分红	2018-04-11	281.12	281.12	-

79	分红	2018-04-11	14.53	14.53	-
80	分红	2018-04-11	72.75	72.75	-
81	分红	2018-04-11	81.83	81.83	-
82	分红	2018-04-11	7.53	7.53	-
83	分红	2018-04-11	0.68	0.68	-
84	分红	2018-04-11	0.68	0.68	-
85	分红	2018-04-12	0.67	0.67	-
86	分红	2018-04-12	277.89	277.89	-
87	分红	2018-04-12	80.90	80.90	-
88	分红	2018-04-12	0.67	0.67	-
89	分红	2018-04-12	7.07	7.07	-
90	分红	2018-04-12	71.92	71.92	-
91	分红	2018-04-12	14.23	14.23	-
92	分红	2018-04-13	0.68	0.68	-
93	分红	2018-04-13	281.81	281.81	-
94	分红	2018-04-13	0.68	0.68	-
95	分红	2018-04-13	7.14	7.14	-
96	分红	2018-04-13	82.03	82.03	-
97	分红	2018-04-13	14.38	14.38	-
98	分红	2018-04-13	72.93	72.93	-
99	分红	2018-04-16	6.70	6.70	-
100	分红	2018-04-16	274.43	274.43	-
101	分红	2018-04-16	0.66	0.66	-
102	分红	2018-04-16	79.89	79.89	-
103	分红	2018-04-16	71.02	71.02	-
104	分红	2018-04-16	0.66	0.66	-
105	分红	2018-04-16	79.44	79.44	-
106	分红	2018-04-16	0.66	0.66	-
107	分红	2018-04-16	13.76	13.76	-
108	分红	2018-04-16	13.76	13.76	-
109	分红	2018-04-16	6.70	6.70	-
110	分红	2018-04-16	13.91	13.91	-
111	分红	2018-04-16	6.87	6.87	-
112	分红	2018-04-16	79.44	79.44	-
113	分红	2018-04-16	0.66	0.66	-
114	分红	2018-04-16	70.63	70.63	-
115	分红	2018-04-16	272.91	272.91	-
116	分红	2018-04-16	70.62	70.62	-
117	分红	2018-04-16	0.66	0.66	-
118	分红	2018-04-16	272.90	272.90	-
119	分红	2018-04-16	0.66	0.66	-
120	分红	2018-04-17	280.95	280.95	-
121	分红	2018-04-17	72.70	72.70	-

122	分红	2018-04-17	81.78	81.78	-
123	分红	2018-04-17	0.68	0.68	-
124	分红	2018-04-17	14.34	14.34	-
125	分红	2018-04-17	6.97	6.97	-
126	分红	2018-04-17	0.68	0.68	-
127	分红	2018-04-18	7.09	7.09	-
128	分红	2018-04-18	0.67	0.67	-
129	分红	2018-04-18	277.04	277.04	-
130	分红	2018-04-18	71.69	71.69	-
131	分红	2018-04-18	14.20	14.20	-
132	分红	2018-04-18	80.65	80.65	-
133	分红	2018-04-18	0.67	0.67	-
134	分红	2018-04-19	0.65	0.65	-
135	分红	2018-04-19	13.93	13.93	-
136	分红	2018-04-19	6.93	6.93	-
137	分红	2018-04-19	70.50	70.50	-
138	分红	2018-04-19	0.65	0.65	-
139	分红	2018-04-19	272.45	272.45	-
140	分红	2018-04-19	79.30	79.30	-
141	分红	2018-04-20	0.69	0.69	-
142	分红	2018-04-20	14.66	14.66	-
143	分红	2018-04-20	287.73	287.73	-
144	分红	2018-04-20	74.46	74.46	-
145	分红	2018-04-20	0.69	0.69	-
146	分红	2018-04-20	7.27	7.27	-
147	分红	2018-04-20	83.76	83.76	-
148	分红	2018-04-23	6.77	6.77	-
149	分红	2018-04-23	0.66	0.66	-
150	分红	2018-04-23	13.90	13.90	-
151	分红	2018-04-23	6.77	6.77	-
152	分红	2018-04-23	71.31	71.31	-
153	分红	2018-04-23	80.24	80.24	-
154	分红	2018-04-23	0.66	0.66	-
155	分红	2018-04-23	80.22	80.22	-
156	分红	2018-04-23	71.32	71.32	-
157	分红	2018-04-23	275.64	275.64	-
158	分红	2018-04-23	71.33	71.33	-
159	分红	2018-04-23	0.66	0.66	-
160	分红	2018-04-23	0.66	0.66	-
161	分红	2018-04-23	0.66	0.66	-
162	分红	2018-04-23	6.90	6.90	-
163	分红	2018-04-23	275.59	275.59	-
164	分红	2018-04-23	275.60	275.60	-

165	分红	2018-04-23	80.22	80.22	-
166	分红	2018-04-23	13.90	13.90	-
167	分红	2018-04-23	0.66	0.66	-
168	分红	2018-04-23	13.94	13.94	-
169	分红	2018-04-24	0.68	0.68	-
170	分红	2018-04-24	7.07	7.07	-
171	分红	2018-04-24	82.56	82.56	-
172	分红	2018-04-24	0.68	0.68	-
173	分红	2018-04-24	73.40	73.40	-
174	分红	2018-04-24	14.38	14.38	-
175	分红	2018-04-24	283.62	283.62	-
176	分红	2018-04-25	82.00	82.00	-
177	分红	2018-04-25	14.37	14.37	-
178	分红	2018-04-25	0.68	0.68	-
179	分红	2018-04-25	0.68	0.68	-
180	分红	2018-04-25	72.90	72.90	-
181	分红	2018-04-25	281.70	281.70	-
182	分红	2018-04-25	7.19	7.19	-
183	分红	2018-04-26	280.87	280.87	-
184	分红	2018-04-26	81.76	81.76	-
185	分红	2018-04-26	72.69	72.69	-
186	分红	2018-04-26	7.12	7.12	-
187	分红	2018-04-26	0.68	0.68	-
188	分红	2018-04-26	0.68	0.68	-
189	分红	2018-04-26	14.32	14.32	-
190	分红	2018-04-27	14.14	14.14	-
191	分红	2018-04-27	7.07	7.07	-
192	分红	2018-04-27	0.67	0.67	-
193	分红	2018-04-27	277.49	277.49	-
194	分红	2018-04-27	0.67	0.67	-
195	分红	2018-04-27	80.78	80.78	-
196	分红	2018-04-27	71.81	71.81	-
197	分红	2018-05-02	14.17	14.17	-
198	分红	2018-05-02	81.01	81.01	-
199	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
200	分红	2018-05-02	278.44	278.44	-
201	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
202	分红	2018-05-02	81.04	81.04	-
203	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
204	分红	2018-05-02	6.84	6.84	-
205	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
206	分红	2018-05-02	72.06	72.06	-
207	分红	2018-05-02	6.84	6.84	-

208	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
209	分红	2018-05-02	81.05	81.05	-
210	分红	2018-05-02	278.42	278.42	-
211	分红	2018-05-02	14.05	14.05	-
212	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
213	分红	2018-05-02	14.04	14.04	-
214	分红	2018-05-02	6.84	6.84	-
215	分红	2018-05-02	81.01	81.01	-
216	分红	2018-05-02	278.40	278.40	-
217	分红	2018-05-02	72.04	72.04	-
218	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
219	分红	2018-05-02	72.05	72.05	-
220	分红	2018-05-02	14.05	14.05	-
221	分红	2018-05-02	72.02	72.02	-
222	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
223	分红	2018-05-02	81.05	81.05	-
224	分红	2018-05-02	278.28	278.28	-
225	分红	2018-05-02	72.01	72.01	-
226	分红	2018-05-02	6.84	6.84	-
227	分红	2018-05-02	7.10	7.10	-
228	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
229	分红	2018-05-02	14.04	14.04	-
230	分红	2018-05-02	0.67	0.67	-
231	分红	2018-05-02	278.30	278.30	-
232	分红	2018-05-03	0.67	0.67	-
233	分红	2018-05-03	277.11	277.11	-
234	分红	2018-05-03	14.27	14.27	-
235	分红	2018-05-03	6.95	6.95	-
236	分红	2018-05-03	0.67	0.67	-
237	分红	2018-05-03	71.71	71.71	-
238	分红	2018-05-03	80.66	80.66	-
239	分红	2018-05-04	69.78	69.78	-
240	分红	2018-05-04	78.50	78.50	-
241	分红	2018-05-04	0.65	0.65	-
242	分红	2018-05-04	13.98	13.98	-
243	分红	2018-05-04	269.66	269.66	-
244	分红	2018-05-04	0.65	0.65	-
245	分红	2018-05-04	7.28	7.28	-
246	分红	2018-05-07	266.39	266.39	-
247	分红	2018-05-07	68.93	68.93	-
248	分红	2018-05-07	68.71	68.71	-
249	分红	2018-05-07	6.51	6.51	-
250	分红	2018-05-07	0.64	0.64	-

251	分红	2018-05-07	0.64	0.64	-
252	分红	2018-05-07	13.38	13.38	-
253	分红	2018-05-07	0.64	0.64	-
254	分红	2018-05-07	13.61	13.61	-
255	分红	2018-05-07	13.38	13.38	-
256	分红	2018-05-07	265.50	265.50	-
257	分红	2018-05-07	0.64	0.64	-
258	分红	2018-05-07	6.51	6.51	-
259	分红	2018-05-07	77.28	77.28	-
260	分红	2018-05-07	68.70	68.70	-
261	分红	2018-05-07	77.54	77.54	-
262	分红	2018-05-07	77.29	77.29	-
263	分红	2018-05-07	0.64	0.64	-
264	分红	2018-05-07	0.64	0.64	-
265	分红	2018-05-07	265.50	265.50	-
266	分红	2018-05-07	6.82	6.82	-
267	分红	2018-05-08	82.47	82.47	-
268	分红	2018-05-08	283.31	283.31	-
269	分红	2018-05-08	0.68	0.68	-
270	分红	2018-05-08	7.05	7.05	-
271	分红	2018-05-08	0.68	0.68	-
272	分红	2018-05-08	73.31	73.31	-
273	分红	2018-05-08	14.30	14.30	-
274	分红	2018-05-09	0.64	0.64	-
275	分红	2018-05-09	68.52	68.52	-
276	分红	2018-05-09	13.58	13.58	-
277	分红	2018-05-09	264.78	264.78	-
278	分红	2018-05-09	0.64	0.64	-
279	分红	2018-05-09	77.08	77.08	-
280	分红	2018-05-09	6.73	6.73	-
281	分红	2018-05-10	264.56	264.56	-
282	分红	2018-05-10	0.64	0.64	-
283	分红	2018-05-10	77.01	77.01	-
284	分红	2018-05-10	68.46	68.46	-
285	分红	2018-05-10	0.64	0.64	-
286	分红	2018-05-10	13.60	13.60	-
287	分红	2018-05-10	6.69	6.69	-
288	分红	2018-05-11	442.40	442.40	-
289	分红	2018-05-14	442.52	442.52	-
290	分红	2018-05-14	429.28	429.28	-
291	分红	2018-05-14	429.25	429.25	-
292	分红	2018-05-15	429.26	429.26	-
293	分红	2018-05-16	435.38	435.38	-

294	分红	2018-05-17	436.98	436.98	-
295	分红	2018-05-18	432.04	432.04	-
296	分红	2018-05-21	434.15	434.15	-
297	分红	2018-05-21	437.80	437.80	-
298	分红	2018-05-21	434.18	434.18	-
299	分红	2018-05-22	438.38	438.38	-
300	分红	2018-05-23	434.26	434.26	-
301	分红	2018-05-24	434.08	434.08	-
302	分红	2018-05-25	432.98	432.98	-
303	分红	2018-05-28	439.90	439.90	-
304	分红	2018-05-28	432.39	432.39	-
305	分红	2018-05-28	419.20	419.20	-
306	分红	2018-05-29	427.80	427.80	-
307	分红	2018-05-30	435.55	435.55	-
308	分红	2018-05-31	438.32	438.32	-
309	分红	2018-06-01	439.83	439.83	-
310	分红	2018-06-04	440.84	440.84	-
311	分红	2018-06-04	439.97	439.97	-
312	分红	2018-06-04	439.99	439.99	-
313	分红	2018-06-05	483.86	483.86	-
314	分红	2018-06-06	447.31	447.31	-
315	分红	2018-06-07	441.58	441.58	-
316	分红	2018-06-08	451.50	451.50	-
317	分红	2018-06-11	435.38	435.38	-
318	分红	2018-06-11	435.53	435.53	-
319	分红	2018-06-11	435.36	435.36	-
320	分红	2018-06-12	446.15	446.15	-
321	分红	2018-06-13	440.24	440.24	-
322	分红	2018-06-14	444.95	444.95	-
323	分红	2018-06-15	448.65	448.65	-
324	分红	2018-06-19	445.78	445.78	-
325	分红	2018-06-19	446.18	446.18	-
326	分红	2018-06-19	445.76	445.76	-
327	分红	2018-06-19	445.81	445.81	-
328	分红	2018-06-20	455.70	455.70	-
329	分红	2018-06-21	453.03	453.03	-
330	分红	2018-06-22	452.70	452.70	-
331	分红	2018-06-25	445.85	445.85	-
332	分红	2018-06-25	418.48	418.48	-
333	分红	2018-06-25	418.44	418.44	-
334	分红	2018-06-26	428.24	428.24	-
335	分红	2018-06-27	564.28	564.28	-
336	分红	2018-06-28	485.49	485.49	-

337	分红	2018-06-29	515.19	515.19	-
合计			40,784.43	40,784.43	

§ 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

注：报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、南方现金通货币市场基金基金合同。
- 2、南方现金通货币市场基金托管协议。
- 3、南方现金通货币市场基金 2018 年 2 季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>