

# 南方现金通货币市场基金 2018 年半年度 报告摘要

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

送出日期：2018 年 08 月 27 日

## 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                     |                    |                       |                        |
|---------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|
| 基金简称                | 南方现金货币              |                    |                       |                        |
| 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 1 月 21 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        |                    |                       |                        |
| 报告期末基金份额总额          | 89,142,444,691.40 份 |                    |                       |                        |
| 基金合同存续期             | 不定期                 |                    |                       |                        |
| 下属分级基金的基金简称         | 南方现金通货<br>币 A       | 南方现金通货<br>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<br>份额总额 | 6,267,132.17<br>份   | 22,961,383.22<br>份 | 9,903,421,568.21<br>份 | 79,209,794,607.80<br>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”。

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 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。            |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          | 基金管理人         | 基金托管人                    |
|-------------|---------------|--------------------------|
| 名称          | 南方基金管理股份有限公司  | 中国工商银行股份有限公司             |
| 信息披露负<br>责人 | 姓名            | 常克川                      |
|             | 联系电话          | 0755-82763888            |
|             | 电子邮箱          | manager@southernfund.com |
| 客户服务电话      | 400-889-8899  | 95588                    |
| 传真          | 0755-82763889 | 010-66105799             |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.nffund.com |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公地址      |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1<br>期间数<br>据和指<br>标 | 报告期(2018年01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         |                   |
| 本期已<br>实现收<br>益          | 127,104.18                   | 720,666.46   | 158,248,878.10 | 1,367,278,740.75 |                   |
| 本期利<br>润                 | 127,104.18                   | 720,666.46   | 158,248,878.10 | 1,367,278,740.75 |                   |
| 本期净<br>值收益<br>率          | 2.1702%                      | 2.1948%      | 2.2282%        | 2.1378%          |                   |
| 3.1.2<br>期末数<br>据和指<br>标 | 报告期末(2018年06月30日)            |              |                |                  |                   |
|                          | 期末基<br>金资产<br>净值             | 6,267,132.17 | 22,961,383.22  | 9,903,421,568.21 | 79,209,794,607.80 |
|                          | 期末基<br>金份额<br>净值             | 1.0000       | 1.0000         | 1.0000           | 1.0000            |

注：1. 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。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 本基金收益分配为按日结转份额。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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     | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|--------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月  | 0.3490%      | 0.0009%             | 0.1126%        | 0.0000%               | 0.2364%  | 0.0009% |
| 过去三个月  | 1.0607%      | 0.0006%             | 0.3418%        | 0.0000%               | 0.7189%  | 0.0006% |
| 过去六个月  | 2.1702%      | 0.0007%             | 0.6810%        | 0.0000%               | 1.4892%  | 0.0007% |
| 过去一年   | 4.3799%      | 0.0007%             | 1.3781%        | 0.0000%               | 3.0018%  | 0.0007% |
| 过去三年   | 11.2753%     | 0.0037%             | 4.1955%        | 0.0000%               | 7.0798%  | 0.0037% |
| 自基金合同生 | 19.2713%     | 0.0069%             | 6.2712%        | 0.0000%               | 13.0001% | 0.0069% |

南方现金货币 B

| 阶段     | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|--------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月  | 0.3531%      | 0.0008%             | 0.1126%        | 0.0000%               | 0.2405%  | 0.0008% |
| 过去三个月  | 1.0727%      | 0.0005%             | 0.3418%        | 0.0000%               | 0.7309%  | 0.0005% |
| 过去六个月  | 2.1948%      | 0.0006%             | 0.6810%        | 0.0000%               | 1.5138%  | 0.0006% |
| 过去一年   | 4.4312%      | 0.0007%             | 1.3781%        | 0.0000%               | 3.0531%  | 0.0007% |
| 过去三年   | 11.4423%     | 0.0036%             | 4.1955%        | 0.0000%               | 7.2468%  | 0.0036% |
| 自基金合同生 | 19.5452%     | 0.0068%             | 6.2712%        | 0.0000%               | 13.2740% | 0.0068% |

南方现金货币 C

| 阶段    | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④     |
|-------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.3590%      | 0.0008%             | 0.1126%        | 0.0000%               | 0.2464% | 0.0008% |
| 过去三个月 | 1.0898%      | 0.0005%             | 0.3418%        | 0.0000%               | 0.7480% | 0.0005% |

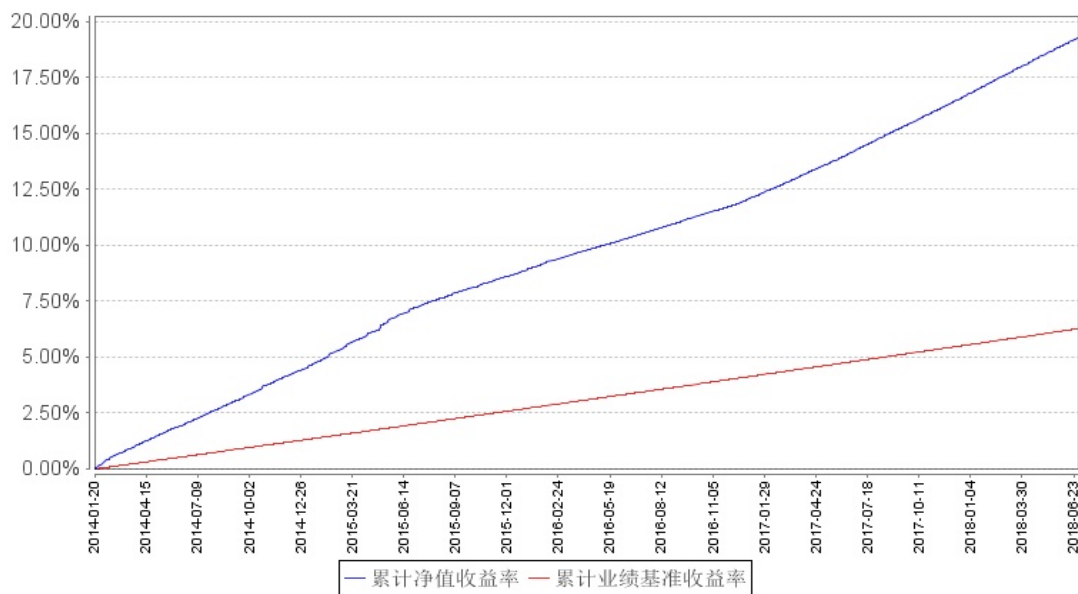
|        |          |         |         |         |          |         |
|--------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去六个月  | 2.2282%  | 0.0006% | 0.6810% | 0.0000% | 1.5472%  | 0.0006% |
| 过去一年   | 4.5006%  | 0.0007% | 1.3781% | 0.0000% | 3.1225%  | 0.0007% |
| 过去三年   | 11.6615% | 0.0036% | 4.1955% | 0.0000% | 7.4660%  | 0.0036% |
| 自基金合同生 | 19.8972% | 0.0068% | 6.2712% | 0.0000% | 13.6260% | 0.0068% |

南方现金货币 E

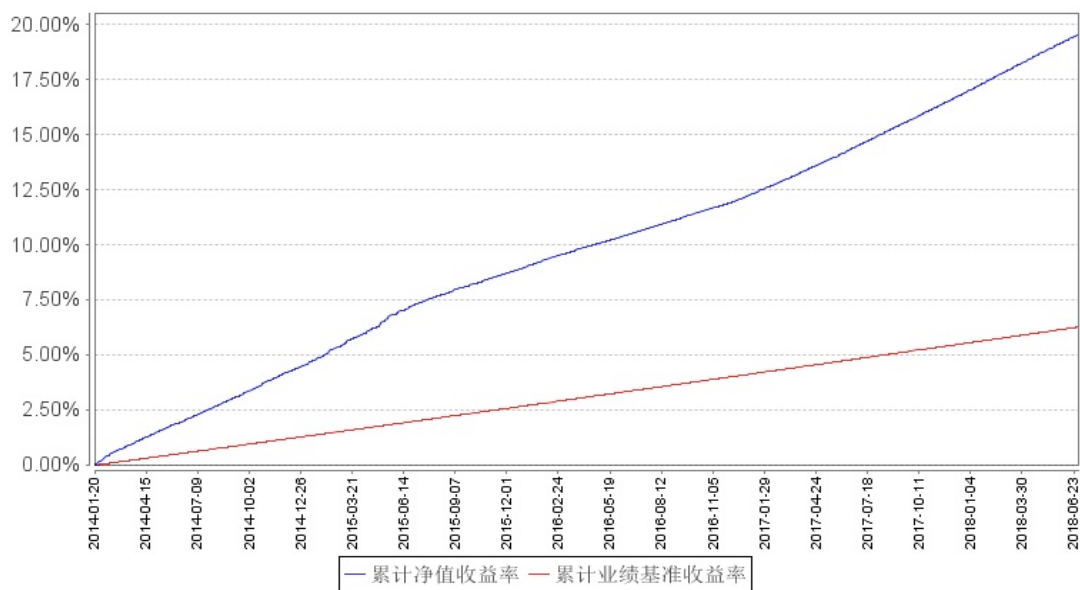
| 阶段     | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|--------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月  | 0.3439%      | 0.0008%             | 0.1126%        | 0.0000%               | 0.2313%  | 0.0008% |
| 过去三个月  | 1.0443%      | 0.0005%             | 0.3418%        | 0.0000%               | 0.7025%  | 0.0005% |
| 过去六个月  | 2.1378%      | 0.0006%             | 0.6810%        | 0.0000%               | 1.4568%  | 0.0006% |
| 过去一年   | 4.3180%      | 0.0007%             | 1.3781%        | 0.0000%               | 2.9399%  | 0.0007% |
| 过去三年   | 11.0718%     | 0.0036%             | 4.1955%        | 0.0000%               | 6.8763%  | 0.0036% |
| 自基金合同生 | 16.3899%     | 0.0070%             | 5.6275%        | 0.0000%               | 10.7624% | 0.0070% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

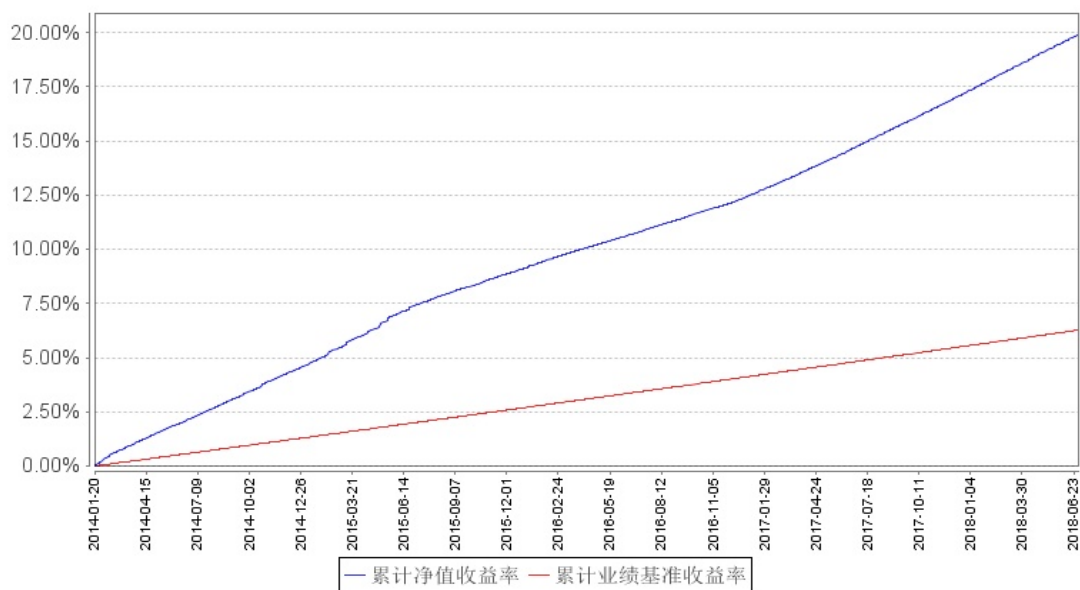
南方现金货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



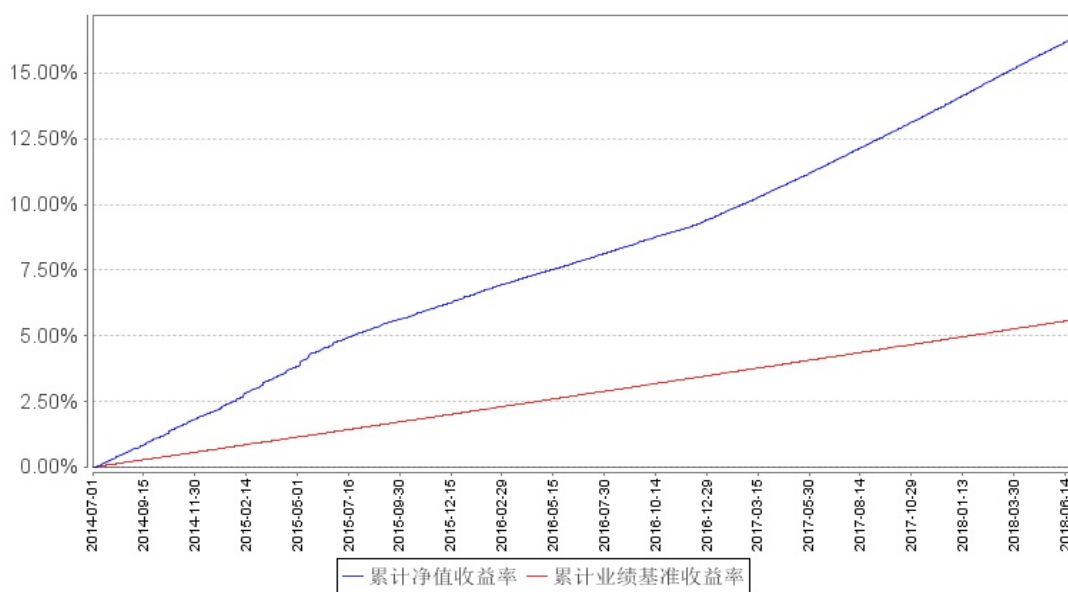
南方现金货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方现金货币C累计净值收益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E累计净值收益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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模近7,800亿元，旗下管理167只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务      | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                        |
|-----|---------|-----------------|------|--------|---------------------------|
|     |         | 任职日期            | 离任日期 |        |                           |
| 夏晨曦 | 本基金基金经理 | 2014年7月25日      | -    | 13     | 香港科技大学理学硕士，具有基金从业资格。2005年 |



|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>5月加入南方基金，曾担任金融工程研究员、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；2013年1月至2014年12月，任南方理财30天基金经理；2012年7月至2015年1月，任南方润元基金经理；2014年7月至2016年11月，任南方薪金宝基金经理；2014年12月至2016年11月，任南方理财金基金经理；2012年8月至今，任南方理财14天基金经理；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</p> |
|--|--|--|--|---|

|    |         |                 |   |   |   |
|----|---------|-----------------|---|---|---|
|    |         |                 |   |   | 天天宝基金经理。  |
| 董浩 | 本基金基金经理 | 2015 年 9 月 11 日 | - | 7 | 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，历任交易管理部债券交易员、固定收益部货币理财类研究员；2014 年 3 月至 2015 年 9 月，任南方现金通基金经理助理；2015 年 9 月至 2016 年 8 月，任南方 50 债基金经理；2015 年 9 月至今，任南方现金通、南方中票基金经理；2016 年 2 月至今，任南方日添益货币基金经理；2016 年 8 月至今，任南方 10 年国债基金经理；2016 年 11 月至今，任南方理财 60 天基金经理；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 管理人对报告期内本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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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。公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年经济基本保持稳定，较去年有所回落。一季度和二季度 GDP 同比增速分别为 6.8%和 6.7%。投资方面，地方政府融资渠道逐步收紧，带动基建投资同比增速明显下滑。而在三四线城市棚改支撑下，房地产投资同比增速较去年出现一定回升，一定程度上对冲了固定资产投资完成额同比增速的快速下降。消费方面也较去年出现了显著下降，社会消费品零售总额同比增速回落至两位数以内。进出口方面，受中美贸易战影响较大，明显拖累经济增速。CPI 一季度短暂冲高后回落，PPI 上半年先下后上。从金融数据上看，M2 和社会融资规模同比增速持续回落，实体经济信用收缩明显。海外看，美国经济持续向好，今年以来美联储已加息两次，经济前景预期较好，带动 10 年期国债利率一度突破 3.0%关口，收益率曲线持续平坦化，期限利差降至 08 年金融危机以来的历史低位。人民币汇率受美元指数上升影响，在二季度出现一定贬值压力，但央行货币政策逐步与美联储脱钩，6 月份并未跟随美联储加息而调整公开市场操作利率，政策关注点逐步转向国内。年初以来，央行通过两次定向降准释放了较多流动性，意在降低社会融资成本。但受银行资本金约束，表内信贷扩张无法有效对冲表外的信用收缩，企业层面融资压力持续增大。市场层面，上半年利率债收益率大幅下行。1 年国债、1 年国开收益率分别下行 63BP、100BP。以 3 个月国有股份制银行同业存单为代表的货币市场利率也出现了显著下降，从 4.8%逐步下降至 3.6%左右，下行超过 100bp。在操作方面，本基金主要以中等久期持仓为主，以期在提高组合静态收益和保持资产高流动性之间取得较好的平衡。

#### 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 2.1702%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。B 级基金

净值收益率为 2.1948%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。C 级基金净值收益率为 2.2282%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。E 级基金净值收益率为 2.1378%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济仍然面临较大的不确定性。一方面，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，加上贸易战持续发酵，预计下半年工业生产将承压。信用紧缩，加上棚改货币化收紧，地产投资将逐步走弱。通胀方面，CPI 预计将稳中有落，全年中枢在 2.0%左右。PPI 基数效应消退，油价短期内进入震荡期，对 PPI 拉动有所放缓，预计下半年也有所回落，全年中枢在 3.5%左右。政策方面，美联储目前对经济和通胀前景依然较为乐观，年内再加息两次的概率仍然较高。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，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。资管新规虽然已经出台，但细则迟迟没有落地，后续影响仍需观察。策略方面，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。货币政策已经出现了明显的转向，但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，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，上半年信用违约事件频发，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。对货币市场而言，预计整体收益率水平仍然会继续下行。本基金将保持中性偏高的久期，并提高基金持有高信用等级和流动性较好的债券品种。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各

类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；本基金每日进行收益计算并分配时，收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零，则增加基金份额持有人基金份额；若当日净收益等于零时，则保持基金份额持有人基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日基金净收益小于零时，不为基金份额持有人缩减相应的基金份额，基金管理人有权通过销售机构或自行向基金份额持有人追索，基金份额持有人应予支付；当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方现金货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，

不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，南方现金货币市场基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方现金货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方现金货币市场基金 2018 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方现金货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |                        |                          |
| 银行存款       | 26,382,023,063.02      | 26,971,396,084.56        |
| 结算备付金      | 149,751,486.78         | 30,186,730.72            |
| 存出保证金      | -                      | 4,218.80                 |
| 交易性金融资产    | 61,290,767,160.31      | -                        |
| 其中：股票投资    | -                      | -                        |
| 基金投资       | -                      | -                        |
| 债券投资       | 61,178,767,160.31      | 21,359,317,376.70        |
| 资产支持证券投资   | 112,000,000.00         | 112,000,000.00           |
| 贵金属投资      | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 3,944,286,554.37       | -                        |
| 应收证券清算款    | -                      | -                        |
| 应收利息       | 205,988,259.13         | 159,167,844.77           |
| 应收股利       | -                      | -                        |
| 应收申购款      | -                      | -                        |
| 递延所得税资产    | -                      | -                        |
| 其他资产       | -                      | 7,500.00                 |

|                 |  |                   |                    |
|-----------------|--|-------------------|--------------------|
| 资产总计            |  | 91,972,816,523.61 | -                  |
| <b>负债和所有者权益</b> |  | <b>本期末</b>        | <b>上年度末</b>        |
|                 |  | <b>2018年6月30日</b> | <b>2017年12月31日</b> |
| <b>负债:</b>      |  |                   |                    |
| 短期借款            |  | -                 | -                  |
| 交易性金融负债         |  | -                 | -                  |
| 衍生金融负债          |  | -                 | -                  |
| 卖出回购金融资产款       |  | 2,688,765,898.74  | 4,346,962,519.54   |
| 应付证券清算款         |  | 102,562,449.32    | -                  |
| 应付赎回款           |  | -                 | -                  |
| 应付管理人报酬         |  | 17,116,742.93     | 8,504,383.66       |
| 应付托管费           |  | 3,527,038.78      | 1,774,870.47       |
| 应付销售服务费         |  | 16,986,938.65     | 7,221,167.91       |
| 应付交易费用          |  | 271,647.88        | 162,745.69         |
| 应交税费            |  | 208,335.58        | -                  |
| 应付利息            |  | 689,224.24        | 5,261,005.98       |
| 应付利润            |  | -                 | -                  |
| 递延所得税负债         |  | -                 | -                  |
| 其他负债            |  | 243,556.09        | 482,000.00         |
| 负债合计            |  | -                 | -                  |
| <b>所有者权益:</b>   |  |                   |                    |
| 实收基金            |  | 89,142,444,691.40 | 44,261,711,062.30  |
| 未分配利润           |  | -                 | -                  |
| 所有者权益合计         |  | 89,142,444,691.40 | 44,261,711,062.30  |
| 负债和所有者权益总计      |  | 91,972,816,523.61 | 48,632,079,755.55  |

注: 1. 报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.0000 元, 基金份额总额 89,142,444,691.40 份, 其中 A 级基金份额总额 6,267,132.17 份, B 级基金份额总额 22,961,383.22 份, C 级基金份额总额 9,903,421,568.21 份, E 级基金份额总额 79,209,794,607.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 南方现金货币市场基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目         | 本期<br>2018年1月1日至<br>2018年6月30日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至<br>2017年6月30日 |
|------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入       | 1,764,106,779.97               | 446,941,800.97                      |
| 1. 利息收入    | 1,752,270,717.85               | 443,143,226.41                      |
| 其中: 存款利息收入 | 857,499,764.80                 | 252,306,363.36                      |
| 债券利息收入     | 776,722,674.19                 | 150,338,606.75                      |

|                        |  |                  |                |
|------------------------|--|------------------|----------------|
| 资产支持证券利息收入             |  | 2,286,294.44     | 201,442.88     |
| 买入返售金融资产收入             |  | 115,761,984.42   | 40,296,813.42  |
| 其他利息收入                 |  | -                | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |  | 11,836,062.12    | 3,798,574.56   |
| 其中：股票投资收益              |  | -                | -              |
| 基金投资收益                 |  | -                | -              |
| 债券投资收益                 |  | 11,836,062.12    | 3,740,141.69   |
| 资产支持证券投资收益             |  | -                | 58,432.87      |
| 贵金属投资收益                |  | -                | -              |
| 衍生工具收益                 |  | -                | -              |
| 股利收益                   |  | -                | -              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |  | -                | -              |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |  | -                | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     |  | -                | -              |
| 减：二、费用                 |  | 237,731,390.48   | 64,253,702.23  |
| 1. 管理人报酬               |  | 86,359,641.97    | 21,176,448.50  |
| 2. 托管费                 |  | 17,841,990.46    | 4,769,058.21   |
| 3. 销售服务费               |  | 85,645,637.26    | 20,506,585.78  |
| 4. 交易费用                |  | 225.00           | -              |
| 5. 利息支出                |  | 47,479,485.17    | 17,519,867.46  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |  | 47,479,485.17    | 17,519,867.46  |
| 6. 税金及附加               |  | 90,818.99        | -              |
| 7. 其他费用                |  | 313,591.63       | 281,742.28     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |  | 1,526,375,389.49 | 382,688,098.74 |
| 减：所得税费用                |  | -                | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |  | 1,526,375,389.49 | 382,688,098.74 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方现金货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                              |
|----|---------------------------------|
|    | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|    |                                 |



|  | 实收基金                            | 未分配利润             | 所有者权益合计             |
|--|---------------------------------|-------------------|---------------------|
| 一、期初所有者权益<br>(基金净值)                    | 44,261,711,062.30               | -                 | 44,261,711,062.30   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 1,526,375,389.49  | 1,526,375,389.49    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 44,880,733,629.10               | -                 | 44,880,733,629.10   |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 317,110,184,016.30              | -                 | 317,110,184,016.30  |
| 2. 基金赎回款                               | -272,229,450,387.20             | -                 | -272,229,450,387.20 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                               | -1,526,375,389.49 | -1,526,375,389.49   |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                    | 89,142,444,691.40               | -                 | 89,142,444,691.40   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                   |                     |
|  | 实收基金                            | 未分配利润             | 所有者权益合计             |
| 一、期初所有者权益<br>(基金净值)                    | 9,441,846,922.56                | -                 | 9,441,846,922.56    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 382,688,098.74    | 382,688,098.74      |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 11,751,359,639.81               | -                 | 11,751,359,639.81   |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 79,200,682,682.71               | -                 | 79,200,682,682.71   |
| 2. 基金赎回款                               | -67,449,323,042.90              | -                 | -67,449,323,042.90  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                               | -382,688,098.74   | -382,688,098.74     |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                    | 21,193,206,562.37               | -                 | 21,193,206,562.37   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(d) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 6.4.4 关联方关系

#### 6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 南方基金管理股份有限公司(“南方基金”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)   | 基金管理人的股东、基金销售机构     |

注:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

#### 6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.5.1.1 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |                           | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日 |                           |
|-------|--|---------------------------|---|---------------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额  | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 华泰证券  | 1,000,000,000.00                       | 1.19                      | -   | -                         |

##### 6.4.5.2 关联方报酬

##### 6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日 至<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 86,359,641.97                             | 21,176,448.50                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -   | -  |

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额约定的年管理费率为 0.27%、0.22%、0.17%和 0.25%。其计算公式为： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)的基金资产净值} \times \text{该类基金份额年管理费费率} / \text{当年天数}$ 。

## 6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日 至<br>2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 17,841,990.46                             | 4,769,058.21                                   |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

## 6.4.5.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日      |               |              |              |               |
|----------------|---|---------------|--------------|--------------|---------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |               |              |              |               |
|                | 南方现金通<br>货币 A                               | 南方现金通<br>货币 B | 南方现金通货币<br>C | 南方现金通货币 E    | 合计            |
| 南方基金           | 7,273.48                                    | 31,936.15     | 5,323,937.54 | 6,855,859.51 | 12,219,006.68 |
| 华泰证券           | -   | -             | -            | 18,325.58    | 18,325.58     |
| 工商银行           | -   | -             | -            | 34,943.99    | 34,943.99     |
| 合计             | 7,273.48                                    | 31,936.15     | 5,323,937.54 | 6,909,129.08 | 12,272,276.25 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日 |               |              |              |               |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |               |              |              |               |
|                | 南方现金通<br>货币 A                               | 南方现金通<br>货币 B | 南方现金通货币<br>C | 南方现金通货币 E    | 合计            |
| 南方基金           | 14,242.32                                   | 61,735.44     | 4,966,461.42 | 2,387,317.39 | 7,429,756.57  |
| 华泰证券           | -   | -             | -            | 926.45       | 926.45        |
| 合计             | 14,242.32                                   | 61,735.44     | 4,966,461.42 | 2,388,243.84 | 7,430,683.02  |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)的基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金,再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额、B类基金份额、C类基金份额和E类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%、0.20%、0.15%和0.25%。根据《南方基金关于旗下南方现金货币市场基金E类销售服务费优惠的公告》及《南方基金关于停止旗下南方现金货币市场基金E类销售服务费优惠的公告》,E类基金份额自2017年12月4日起至12月10日止期间及2017年12月15日起至12月17日止期间销售服务费年费率为0.125%。销售服务费的计算公式为:日销售服务费=前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

#### 6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

| 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日      |        |                    |       |          |       |      |
|---------------------------------|--------|--------------------|-------|----------|-------|------|
| 银行间市场<br>交易的<br>各关联方名<br>称      | 债券交易金额 |                    | 基金逆回购 |          | 基金正回购 |      |
|                                 | 基金买入   | 基金卖出               | 交易金额  | 利息收<br>入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国工商银<br>行                      | -      | 494,346,0<br>00.00 | -     | -        | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |        |                    |       |          |       |      |
| 银行间市场<br>交易的<br>各关联方名<br>称      | 债券交易金额 |                    | 基金逆回购 |          | 基金正回购 |      |
|                                 | 基金买入   | 基金卖出               | 交易金额  | 利息收<br>入 | 交易金额  | 利息支出 |
| -                               | -      | -                  | -     | -        | -     | -    |

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目                              | 本期<br>2018年1月1日至2018年6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 |
| 基金合同生效日<br>(2014年1月<br>21日)持有的基 | -                          | -       | -       | -       |

|                                 |  |            |              |          |
|---------------------------------|--|------------|--------------|----------|
| 金份额                             |  |            |              |          |
| 期初持有的基金份额                       | 58,370.98                                  | 116,982.07 | 3,522,883.35 | -        |
| 期间申购/买入总份额                      | 1,267.43                                   | 2,568.93   | 78,542.68    | -        |
| 期间因拆分变动份额                       | -  | -          | -            | -        |
| 减：期间赎回/卖出总份额                    | -  | -          | -            | -        |
| 期末持有的基金份额                       | 59,638.41                                  | 119,551.00 | 3,601,426.03 | -        |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例               | 0.0001%                                    | 0.0001%    | 0.0040%      | -        |
| 项目                              | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 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 |
| 基金合同生效日（2014 年 1 月 21 日）持有的基金份额 | -  | -          | -            | -        |
| 期初持有的基金份额                       | 56,025.30                                  | 112,226.92 | 3,377,489.79 | -        |
| 期间申购/买入总份额                      | 1,116.83                                   | 2,263.91   | 69,221.85    | -        |
| 期间因拆分变动份额                       | -  | -          | -            | -        |
| 减：期间赎回/卖出总份额                    | -  | -          | -            | -        |
| 期末持有的基金份额                       | 57,142.13                                  | 114,490.83 | 3,446,711.64 | -        |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例               | 0.64%                                      | 0.21%      | 0.07%        | -        |

注：期间申购/买入总份额含红利再投、级别调整入份额，期间赎回/卖出总份额含级别调整出份额。

#### 6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

## 南方现金货币 C

| 关联方名称 | 本期末<br>2018年6月30日 |                              | 上年度末<br>2017年12月31日 |                              |
|-------|-------------------|------------------------------|---------------------|------------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额       | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 (%) | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 (%) |
| 南方资本  | 209,461,041.70    | 0.24                         | 244,732,303.40      | 3.81                         |
| 南方股权  | 9,323,329.96      | 0.01                         | 11,284,469.05       | 0.18                         |

## 6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |           |
|--------------|----------------------------|------------|---------------------------------|-----------|
|              | 期末余额                       | 当期利息收入     | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 33,023,063.02              | 167,047.37 | 314,952.14                      | 59,664.27 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 6.4.6 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

## 6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

## 6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,688,765,898.74元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称   | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量(张)     | 期末估值总额         |
|-----------|--------|------------|--------|-----------|----------------|
| 111803112 | 18 农业银 | 2018-07-05 | 99.28  | 6,500,000 | 645,288,840.58 |

|           |               |            |        |            |                  |
|-----------|---------------|------------|--------|------------|------------------|
|           | 行 CD112       |            |        |            |                  |
| 111809172 | 18 浦发银行 CD172 | 2018-07-02 | 99.20  | 1,000,000  | 99,197,606.36    |
| 150418    | 15 农发 18      | 2018-07-05 | 99.99  | 3,000,000  | 299,969,341.80   |
| 160208    | 16 国开 08      | 2018-07-02 | 99.15  | 2,270,000  | 225,061,180.47   |
| 160415    | 16 农发 15      | 2018-07-06 | 99.34  | 3,200,000  | 317,876,886.78   |
| 180404    | 18 农发 04      | 2018-07-06 | 100.18 | 7,500,000  | 751,348,469.68   |
| 180407    | 18 农发 07      | 2018-07-06 | 99.92  | 3,000,000  | 299,773,788.86   |
| 187703    | 18 贴现国开 03    | 2018-07-05 | 99.67  | 2,340,000  | 233,230,266.73   |
| 合计        |               |            |        | 28,810,000 | 2,871,746,381.26 |

#### 6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购形成的卖出回购证券款余额。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 固定收益权益投资          | 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  | 其他各项资产            | 205,988,259.13    | 0.22          |
| 5  | 合计                | 91,972,816,523.61 | 100.00        |

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%)   |                |
|----|--------------|------------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 4.67             |                |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                |                |
| 序号 | 项目           | 金额               | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 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。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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 | 60  |

#### 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。

#### 7.3.2 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                  | 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                |

#### 7.4 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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本 | 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 | -                 | -          |

### 7.6 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

金额单位：元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量（张）    | 摊余成本             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|------------|------------------|---------------|
| 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          |

### 7.7 “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% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0368% |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%情况

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

### 7.8 期末按摊余成本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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）   | 公允价值          | 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         |

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

#### 7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

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。

#### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 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  | 待摊费用    | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 205,988,259.13 |

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别            | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构            |                |                   |                   |
|-----------------|--------------|---------------|------------------|----------------|-------------------|-------------------|
|                 |              |               | 机构投资者            |                | 个人投资者             |                   |
|                 |              |               | 持有份额             | 占总份额<br>比例 (%) | 持有份额              | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 南方<br>现金<br>通 A | 658          | 9,524.52      | 165,708.44       | 2.64           | 6,101,423.73      | 97.36             |
| 南方<br>现金<br>通 B | 867          | 26,483.72     | 552,807.44       | 2.41           | 22,408,575.78     | 97.59             |
| 南方<br>现金<br>通 C | 97,730       | 101,334.51    | 8,653,899,135.38 | 87.38          | 1,249,522,432.83  | 12.62             |
| 南方<br>现金<br>通 E | 20,459,183   | 3,871.60      | 1,154,164,823.30 | 1.46           | 78,055,629,784.50 | 98.54             |
| 合计              | 20,558,438   | 4,336.05      | 9,808,782,474.56 | 11.00          | 79,333,662,216.84 | 89.00             |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）          | 占上市总份额比例（%） |
|----|-------|------------------|-------------|
| 1  | 银行类机构 | 2,021,833,292.22 | 2.27        |
| 2  | 信托类机构 | 1,014,088,063.23 | 1.14        |
| 3  | 银行类机构 | 1,001,822,251.52 | 1.12        |
| 4  | 银行类机构 | 1,000,000,000.00 | 1.12        |
| 5  | 其他机构  | 817,241,364.45   | 0.92        |
| 6  | 银行类机构 | 515,073,624.66   | 0.58        |
| 7  | 其他机构  | 500,434,063.26   | 0.56        |
| 8  | 银行类机构 | 307,878,249.15   | 0.35        |
| 9  | 基金类机构 | 209,437,122.82   | 0.23        |
| 10 | 券商类机构 | 209,147,781.93   | 0.23        |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                       | 份额级别     | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|--------------------------|----------|-----------|-------------|
| 基金管<br>理人所<br>有从业<br>人员持 | 南方现金货币 A | -         | -           |
|                          | 南方现金货币 B | -         | -           |
|                          | 南方现金货币 C | -         | -           |

|   |          |               |        |
|---|----------|---------------|--------|
| 金 | 南方现金货币 E | 51,869,414.66 | 0.0655 |
|   | 合计       | 51,869,414.66 | 0.0582 |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 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 | >100              |
|                                | 合计       | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 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 | -                 |
|                                | 合计       | -                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 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           |
|--------------------------------|------------------|----------------|------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2014 年 1 月 21 日）基金份额总额 | 212,363,225.89   | 12,083,651.25  | 190,758,832.36   | -                  |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 7,446,220.75     | 30,188,938.67  | 6,430,198,246.24 | 37,793,877,656.64  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 7,651,423,378.86 | 601,084,151.00 | 7,626,604,194.12 | 301,231,072,292.32 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 7,652,602,467.44 | 608,311,706.45 | 4,153,380,872.15 | 259,815,155,341.16 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -                | -              | -                | -                  |

|                 |              |               |                  |                   |
|-----------------|--------------|---------------|------------------|-------------------|
| 本报告期末<br>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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 银河证券 | 1      | -    | -            | -         | -          |    |

|      |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华泰证券 | -    | -            | 1,000,000,000.00  | 1.19%          | -    | -            |
| 银河证券 | -    | -            | 83,381,800,000.00 | 98.81%         | -    | -            |

注：1、本期无租用证券公司交易单元的变更情况。 2、交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序： A：选择标准 a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好； b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告； c、公司内部

管理规范，能满足基金操作的保密要求； d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。 B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元： a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座； b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确； c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

#### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

#### 11.1 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：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。