

南方天天利货币市场基金 2019 年 3 季度末资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占比%

1 固定收益投资 63,106,889,673.62 52.18%

其中：国债 2,341,065,632.80 1.94%

政策性金融债 5,024,435,606.10 4.15%

商业银行金融债 0.00 0.00%

同业存单 53,280,454,469.19 44.06%

其他债券 2,460,933,965.53 2.03%

2 买入返售金融资产 4,005,260,433.06 3.31%

其中：交易对手为银行 299,970,649.96 0.25%

交易对手为其他机构 3,705,289,783.10 3.06%

3 银行存款和结算备付金 53,264,719,888.77 44.04%

4 商业银行票据 0.00 0.00%

5 其他资产 561,521,198.26 0.46%

6 合计（6=1+2+3+4+5） 120,938,391,193.71 100.00%

各项目合计数为南方天天利货币市场基金总资产。交易所回购因无法知晓对手方因此全部归入其他机构。

南方基金管理股份有限公司

2019 年 10 月 11 日