

# 南方天天利货币市场基金 2019 年 4 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 76,460,166,778.60 59.06%

其中：国债 2,085,328,834.01 1.61%

政策性金融债 4,614,421,246.84 3.56%

商业银行金融债 0.00 0.00%

同业存单 66,920,837,770.23 51.69%

其他债券 2,839,578,927.52 2.19%

2 买入返售金融资产 5,635,693,693.53 4.35%

其中：交易对手为银行 200,070,500.11 0.15%

交易对手为其他机构 5,435,623,193.42 4.20%

3 银行存款和结算备付金 46,579,006,131.54 35.98%

4 商业银行票据 0.00 0.00%

5 其他资产 779,664,566.20 0.60%

6 合计（6=1+2+3+4+5） 129,454,531,169.87 100.00%

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

2020 年 1 月 8 日