

南方天天利货币市场基金 2019 年 2 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

83,070,545,812.31 62.59%

其中：国债

5,242,033,466.17 3.95%

政策性金融债

5,687,113,029.57 4.28%

商业银行金融债

0.00 0.00%

同业存单

72,141,399,316.57 54.35%

其他债券

0.00 0.00%

2

买入返售金融资产

14,765,208,411.83 11.12%

其中：交易对手为银行

1,405,802,548.70 1.06%

交易对手为其他机构

13,359,405,863.13 10.07%

3

银行存款和结算备付金

34,266,578,060.35 25.82%

4

商业银行票据

0.00 0.00%

5

其他资产

627,442,553.71 0.47%

6

合计（6=1+2+3+4+5）

132,729,774,838.20 100.00%

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 7 月 8 日