

南方日添益货币市场基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 09 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 25 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 23 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，投资者在作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 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方日添益货币		
基金主代码	002324		
交易代码	002324		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日		
报告期末基金份额总额	12,074,637,203.33 份		
投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。		
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	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）		
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	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	南方日添益货币 A	南方日添益货币 E	南方日添益货币 F
下属分级基金的交易代码	002324	002325	007521
报告期末下属分级基金的份额总额	11,078,480,341.61 份	982,460,530.01 份	13,696,331.71 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“南方日添益”。

§ 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（2019年7月1日—2019年9月30日）		
	南方日添益货币 A	南方日添益货币 E	南方日添益货币 F
1.本期已实现收益	68,309,601.24	6,035,318.27	20,236.66
2.本期利润	68,309,601.24	6,035,318.27	20,236.66
3.期末基金资产净值	11,078,480,341.61	982,460,530.01	13,696,331.71

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，所以，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增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方日添益货币 A

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	0.5955%	0.0005%	0.3456%	0.0000%	0.2499%	0.0005%

南方日添益货币 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	0.6209%	0.0005%	0.3456%	0.0000%	0.2753%	0.0005%

南方日添益货币 F

阶段	净值收益	净值收益	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个 月	0. 6563%	0. 0005%	0. 3456%	0. 0000%	0. 3107%	0. 0005%

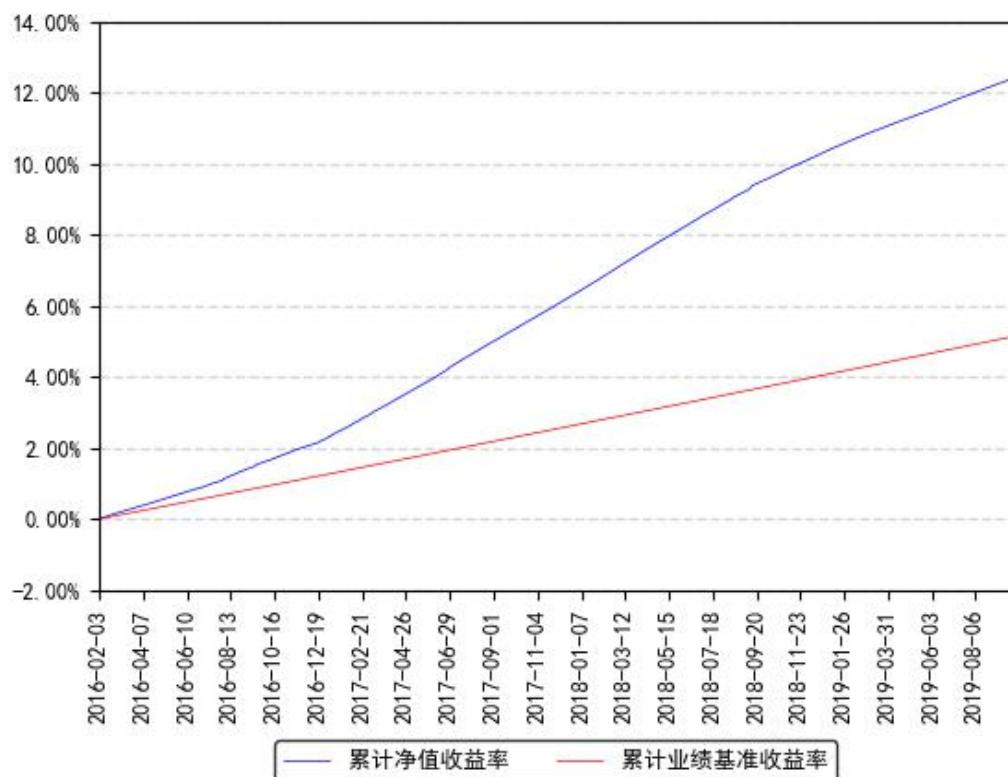
注：1. 南方日添益 E 级份额自 2016 年 6 月 28 日存续。

2. 南方日添益 F 类份额自 2019 年 6 月 6 日起存续。

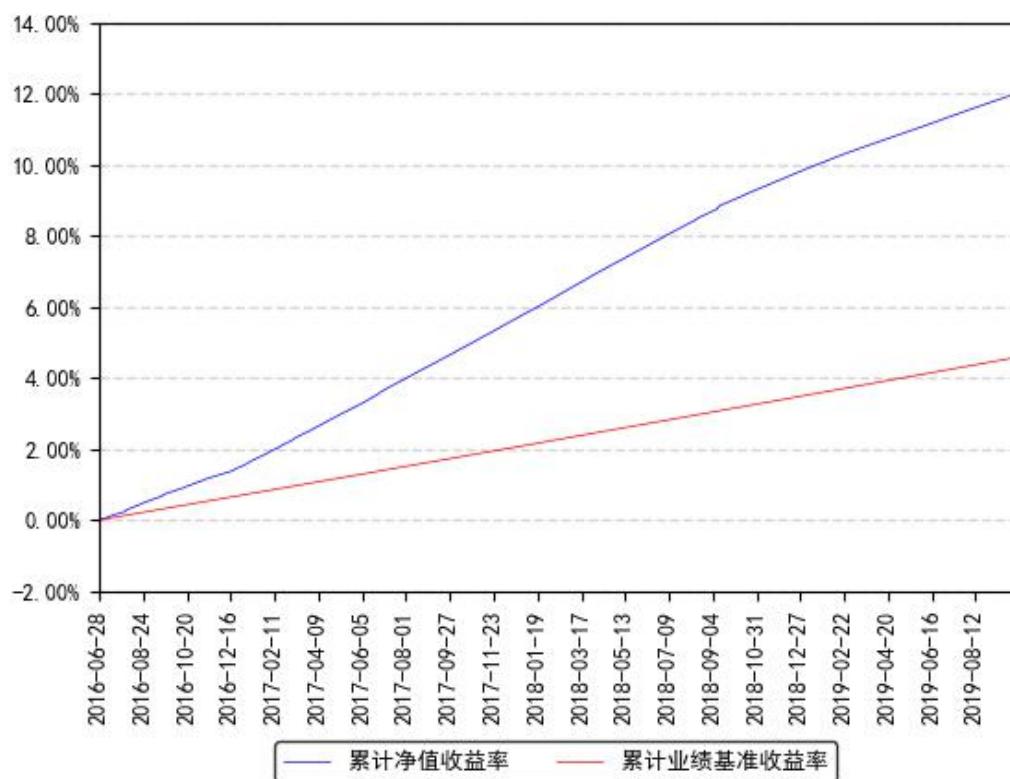
3. 本基金收益分配为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

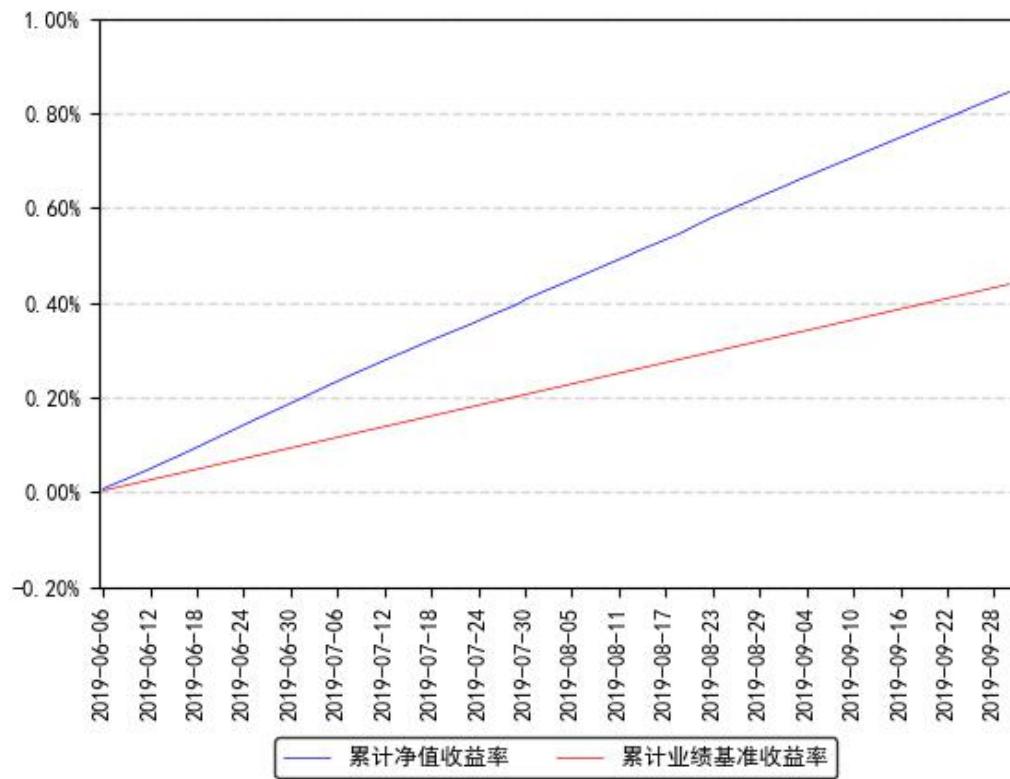
南方日添益货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方日添益货币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



南方日添益货币F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



注：1、本基金从 2019 年 6 月 5 日起新增 F 类份额，F 类份额自 2019 年 6 月 6 日起存续。

§ 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		证券从业年限	说明
		期限			
任职日期	离任日期				
夏晨曦	本基金基金经理	2016 年 2 月 3 日	-	14 年	香港科技大学理学硕士，具有基金从业资格。2005 年 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。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，任南方天天宝基金经理；2018 年 11 月至今，任南方 1-3 年国开债基金经理；2018 年 12 月至今，任南方 3-5 年农发债基金经理；2019 年 3 月至今，任南方 7-10 年国开债基金经理。
董浩	本基金基金经理	2016 年 2 月 3 日	-	9 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 2018 年 7 月，任南方中票基金经理；2015 年 9 月至今，任南方现金通基金经理；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；2018 年 11 月至今，任南方 1-3 年国开债基金经理；2018 年 12 月至今，任南方 3-5 年农发债基金经理；2019 年 3 月至今，任南方 7-10 年国开债基金经理；2019 年 5 月至今，任南方收益宝基金经理。
--	--	--	--	---

- 注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；
 2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。
 3、本基金管理人于 2019 年 10 月 16 日发布公告，原基金经理夏晨曦先生不担任本基金基金经理。

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、中国证监会和本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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合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超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 1 次，是由于投资组合的投资策略需要所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济进一步回落。1-8 月工业增加值同比增长 5.6%，较二季度明显下滑；1-8 月固定资产投资同比增长 5.5%；社会消费品零售总额同比增长 8.2%。1-8 月 CPI 累计同比增长 2.4%，猪肉价格上涨推动 CPI 中枢上移；1-8 月 PPI 累计同比增长 0.1%，较上一季度继续下行。8 月末 M2 同比增长 8.2%，三季度信贷和社融投放相对平稳。

美联储 9 月再度降息 25BP，但对年内第三次降息美联储内部出现一定分歧，鸽派程度不及市场预期。欧央行议息会议决定将存款工具的利率降低 10 个基点至 -0.50%。主要再融资操作的利率和边际贷款工具的利率将保持不变，并从 11 月 1 日起重启 QE。国内方面，央行三季度进行了全面降准和定向降准，维护了跨季资金面的稳定。报告期内，银行间隔夜、7 天回购加权利率均值为 2.40%、2.70%，分别较上季度上行 31BP 和 6BP。

市场层面，三季度利率债收益率先下后上，货币市场利率震荡上行，曲线呈现扁平化。其中，1 年国债收益率下行 9BP；1 年国开收益率基本持平；3 个月国股同业存单利率上行 38BP；6 个月国股同业存单利率上行 16BP。本基金整体保持中性偏积极久期，在季末时点择机配置绝对收益较高资产增厚组合收益。

策略方面，三季度经济数据显著下滑，货币政策取向相对鹰派，短端流动性虽然不紧，但资金成本始终保持在较高位置，财政政策的焦点主要在于四季度的专项债落地情况。我们认为随着货币基金整体收益率走低，规模变动的不确定性增加，基金将保持资产流动性充裕，采取稳健的久期策略，确保基金安全平稳运行。同时，积极把握年末出现的配置机会，合理布局风险收益比较高的优质资产，努力提高组合收益水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值收益率为 0.5955%，同期业绩基准收益率为 0.3456%；本基金 E 份额净值收益率为 0.6209%，同期业绩基准收益率为 0.3456%；本基金 F 份额净值收益率为 0.6563%，同期业绩基准收益率为 0.3456%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,957,611,337.67	44.90

	其中：债券	5,957,611,337.67	44.90
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	429,963,919.94	3.24
	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	6,812,526,056.78	51.35
4	其他资产	67,705,154.21	0.51
5	合计	13,267,806,468.60	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	10.59	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,106,010,115.98	9.16
	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。

5.2.1 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	81

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.3 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值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	20.76	9.82
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	26.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮	-	-

	动利率债		
3	60 天(含)-90 天	41.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	3.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	16.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
	合计	109.32	9.82

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

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	150,473,594.90	1.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	535,898,144.49	4.44
	其中：政策性金融债	535,898,144.49	4.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,370,022,788.32	11.35
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,901,216,809.96	32.31
8	其他	-	-
9	合计	5,957,611,337.67	49.34
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名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净 值比例(%)
1	071900104	19 海通证券 CP002	2,000,000	200,000,136.38	1.66
2	071900103	19 国信证券 CP008	2,000,000	200,000,128.41	1.66
3	111998178	19 东莞农村商业银行 CD050	2,000,000	199,141,846.67	1.65
4	111998661	19 东莞农村商业银行 CD054	2,000,000	199,044,198.48	1.65

5	111916292	19 上海银行 CD292	2,000,000	198,692,929.19	1.65
6	111980363	19 中原银行 CD175	2,000,000	198,655,283.55	1.65
7	111915032	19 民生银行 CD032	2,000,000	198,064,345.67	1.64
8	111918211	19 华夏银行 CD211	2,000,000	197,109,214.87	1.63
9	018081	农发 1901	1,900,000	189,859,863.57	1.57
10	111904089	19 中国银行 CD089	1,800,000	174,989,039.76	1.45

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	0.0727%
报告期内偏离度的最低值	0.0232%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0415%

5.7.1 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

5.7.2 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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和折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

5.9.2 声明本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内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除 19 上海银行 CD292（证券代码 111916292）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018 年 10 月 18 日，中国银行业监督管理委员会上海监管局公告，因上海银行股份存在违规向其关系人发放信用贷款、对某同业资金违规投向资本金不足的房地产项目合规性审查未尽职的行为，决定对上海银行罚款 159.2 万元人民币。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	38,459.03
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	60,877,703.86
4	应收申购款	6,788,991.32
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	67,705,154.21

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方日添益货币 A	南方日添益货币 E	南方日添益货币 F
报告期期初基金份额总额	11,216,827,672.95	941,681,206.32	193,875.31
报告期内期间基金总申购份额	35,147,567,280.59	2,854,913,207.68	19,692,294.28
报告期内期间基金总赎回份额	35,285,914,611.93	2,814,133,883.99	6,189,837.88
报告期末基金份额总额	11,078,480,341.61	982,460,530.01	13,696,331.71

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金管理明细

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	2019年7月1日	3,223.66	3,223.66	0.00%
2	分红	2019年7月2日	1,078.02	1,078.02	0.00%
3	分红	2019年7月3日	1,137.08	1,137.08	0.00%

4	分红	2019年7月4日	1,145.18	1,145.18	0.00%
5	分红	2019年7月5日	1,122.82	1,122.82	0.00%
6	分红	2019年7月8日	3,240.00	3,240.00	0.00%
7	分红	2019年7月9日	1,056.95	1,056.95	0.00%
8	分红	2019年7月10日	1,017.53	1,017.53	0.00%
9	分红	2019年7月11日	1,043.12	1,043.12	0.00%
10	分红	2019年7月12日	1,018.36	1,018.36	0.00%
11	分红	2019年7月15日	3,075.40	3,075.40	0.00%
12	分红	2019年7月16日	970.10	970.10	0.00%
13	分红	2019年7月17日	1,062.99	1,062.99	0.00%
14	分红	2019年7月18日	1,010.16	1,010.16	0.00%
15	分红	2019年7月19日	959.50	959.50	0.00%
16	分红	2019年7月22日	2,831.52	2,831.52	0.00%
17	分红	2019年7月23日	949.02	949.02	0.00%
18	分红	2019年7月24日	951.80	951.80	0.00%
19	分红	2019年7月25日	986.81	986.81	0.00%
20	分红	2019年7月26日	1,126.27	1,126.27	0.00%
21	分红	2019年7月29日	2,880.38	2,880.38	0.00%
22	分红	2019年7月30日	950.17	950.17	0.00%
23	分红	2019年7月31日	1,527.20	1,527.20	0.00%
24	分红	2019年8月1日	978.59	978.59	0.00%
25	分红	2019年8月2日	1,025.41	1,025.41	0.00%

26	分红	2019年8月5日	2,931.57	2,931.57	0.00%
27	分红	2019年8月6日	988.36	988.36	0.00%
28	分红	2019年8月7日	984.59	984.59	0.00%
29	分红	2019年8月8日	1,001.61	1,001.61	0.00%
30	分红	2019年8月9日	982.29	982.29	0.00%
31	分红	2019年8月12日	3,026.67	3,026.67	0.00%
32	分红	2019年8月13日	1,010.15	1,010.15	0.00%
33	分红	2019年8月14日	1,089.18	1,089.18	0.00%
34	分红	2019年8月15日	983.39	983.39	0.00%
35	分红	2019年8月16日	977.51	977.51	0.00%
36	申购	2019年8月19日	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00%
37	分红	2019年8月19日	2,893.71	2,893.71	0.00%
38	申购	2019年8月20日	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00%
39	分红	2019年8月20日	1,101.61	1,101.61	0.00%
40	申购	2019年8月21日	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00%
41	分红	2019年8月21日	1,382.65	1,382.65	0.00%
42	申购	2019年8月22日	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00%
43	分红	2019年8月22日	1,451.96	1,451.96	0.00%
44	申购	2019年8月23日	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00%
45	分红	2019年8月23日	1,434.49	1,434.49	0.00%
46	分红	2019年8月26日	4,123.96	4,123.96	0.00%
47	分红	2019年8月27日	1,501.26	1,501.26	0.00%

48	分红	2019年8月 28日	1,283.38	1,283.38	0.00%
49	分红	2019年8月 29日	1,279.53	1,279.53	0.00%
50	分红	2019年8月 30日	1,404.64	1,404.64	0.00%
51	分红	2019年9月2 日	3,836.54	3,836.54	0.00%
52	分红	2019年9月3 日	1,439.32	1,439.32	0.00%
53	分红	2019年9月4 日	1,333.50	1,333.50	0.00%
54	分红	2019年9月5 日	1,269.06	1,269.06	0.00%
55	分红	2019年9月6 日	1,271.07	1,271.07	0.00%
56	分红	2019年9月9 日	3,859.71	3,859.71	0.00%
57	分红	2019年9月 10日	1,267.79	1,267.79	0.00%
58	分红	2019年9月 11日	1,270.38	1,270.38	0.00%
59	分红	2019年9月 12日	1,334.67	1,334.67	0.00%
60	分红	2019年9月 16日	5,084.16	5,084.16	0.00%
61	分红	2019年9月 17日	1,278.50	1,278.50	0.00%
62	分红	2019年9月 18日	1,269.40	1,269.40	0.00%
63	分红	2019年9月 19日	1,263.71	1,263.71	0.00%
64	分红	2019年9月 20日	1,265.04	1,265.04	0.00%
65	分红	2019年9月 23日	3,840.07	3,840.07	0.00%
66	赎回	2019年9月 24日	-10,000,000.0 0	-10,000,000.0 0	0.00%
67	分红	2019年9月 24日	1,254.48	1,254.48	0.00%
68	分红	2019年9月 25日	689.77	689.77	0.00%
69	分红	2019年9月 26日	710.16	710.16	0.00%

70	分红	2019 年 9 月 27 日	665.13	665.13	0.00%
71	分红	2019 年 9 月 30 日	1,950.54	1,950.54	0.00%
合计	-	-	-4,895,646.45	-4,895,646.45	-

注：基金管理人按照本基金合同约定费率进行认购、申购和赎回。

§ 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

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《南方日添益货币市场基金基金合同》；
- 2、《南方日添益货币市场基金托管协议》；
- 3、南方日添益货币市场基金 2019 年 3 季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>