

# 南方收益宝货币市场基金

## 2016年度报告摘要

\$ 8 投资组合报告

8.1 前期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	定期存款投资	13,821,999,276.07	36.00
其中:银行存款	13,801,146,263.14	35.95	
货币市场基金	32,851,016,033	8.00	
2	买入返售金融资产	4,990,096,315.23	12.93
其中:质押式买入返售金融资产	3,082,633,036	0.44	
3	其他	38,426,300,697.65	100.00
4	合计		

8.2 期末回购融资本情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内购入的债券回购融资本金额	2.40
其中:买断式回购	-	-
2	报告期末持有的买入返售金融资产	-
3	报告期净买入的买入返售金融资产	19,434,442,472.81
4	其他	303,322,633.06
5	合计	38,426,300,697.65

注:报告期内购入的债券回购融资本金额不高于货币市场基金的10%。

8.3 期末回购融资本情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内购入的债券回购融资本金额	2.40
其中:买断式回购	-	-
2	报告期末持有的买入返售金融资产	-
3	报告期净买入的买入返售金融资产	19,434,442,472.81
4	其他	303,322,633.06
5	合计	38,426,300,697.65

注:报告期内购入的债券回购融资本金额不高于货币市场基金的10%。

8.4 期末应收款项情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内购入的债券回购融资本金额	2.40
其中:买断式回购	-	-
2	报告期末持有的买入返售金融资产	-
3	报告期净买入的买入返售金融资产	19,434,442,472.81
4	其他	303,322,633.06
5	合计	38,426,300,697.65

注:报告期内购入的债券回购融资本金额不高于货币市场基金的10%。

8.5 期末投资组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	定期存款投资	13,821,999,276.07	36.00
其中:银行存款	13,801,146,263.14	35.95	
货币市场基金	32,851,016,033	8.00	
2	买入返售金融资产	4,990,096,315.23	12.93
其中:质押式买入返售金融资产	3,082,633,036	0.44	
3	其他	38,426,300,697.65	100.00

注:报告期内购入的债券回购融资本金额不高于货币市场基金的10%。

8.6 报告期内投资组合平均剩余期限分析

金额单位:人民币元

序号	项目	天数
1	报告期平均所持债券的平均剩余期限	66
2	报告期平均所持的信用等级最高的债券剩余期限	117
3	报告期平均所持长期国债的剩余期限	30

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天的情况说明

本基金会定期报告中,“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”,

本报告期末,本基金未发生超期情况。

8.7 前期末投资组合平均剩余期限分位数比例

金额单位:人民币元

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	
1	30天以内	4.42	
其中:剩余期限在30天以内(含30天)的浮动利率债	1.04	-	
2	30天(含)-90天	16.30	-
其中:剩余期限在30天(含)-90天(不含90天)的浮动利率债	16.30	-	
3	60天(含)-180天	1.40	-
其中:剩余期限在60天(含)-180天(不含180天)的浮动利率债	1.40	-	
4	90天(含)-120天	10.16	-
其中:剩余期限在90天(含)-120天(不含120天)的浮动利率债	10.16	-	
5	120天(含)-397天(含)	8.26	-
其中:剩余期限在120天(含)-397天(不含397天)的浮动利率债	8.26	-	
6	397天以上	57.07	-
其中:剩余期限在397天以上(不含397天)的浮动利率债	57.07	-	
7	合计	90.00	-

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过240天的情况说明

本基金会定期报告中,“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240天”,

本报告期末,本基金未发生超期情况。

8.8 前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	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	其他票据	-	-
3	企业债券	3,331,153,170.00	8.07
4	企业附带信用增级的债券	-	-
5	资产支持证券	28,096,900.00	0.07
6	可转换债券	4,946,944.20	0.10
7	短期融资券	9,295,100.00	0.02
8	其他	9,295,100.00	0.02
9	合计	33,601,149.20	0.07

注:报告期内按债券品种分类的债券投资组合平均剩余期限不超过240天。

8.9 前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	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	其他票据	-	-
3	企业债券	3,331,153,170.00	8.07
4	企业附带信用增级的债券	-	-
5	资产支持证券	28,096,900.00	0.07
6	可转换债券	4,946,944.20	0.10
7	短期融资券	9,295,100.00	0.02
8	其他	9,295,100.00	0.02
9	合计	33,601,149.20	0.07

注:报告期内按债券品种分类的债券投资组合平均剩余期限不超过240天。

8.10 前期末按摊余成本法计价的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	摊余成本	占基金资产净值的比例(%)
1	111601012	10年期国债	10,000,000	99.617,015,601.61
2	111601003	0-3年定期存款	10,000,000	99.426,566,663.03
3	111601022	10年期国债	8,000,000	793,000,076.00
4	111611447	16W03CD447	7,000,000	696,364,109.00
5	111601020	深市国债	6,400,000	1,018,000,000.00
6	160201020	10年期国债	6,000,000	570,012,978.30
7	160301020	10年期国债	5,000,000	409,018,000.00
8	160301020	10年期国债	5,000,000	409,018,000.00
9	160301020			