

南方天利货币市场基金2018年第4季度报告

基金管理人南方基金管理股份有限公司
基金托管人中国人银行股份有限公司
重要提示
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...

4.2 管理人对报告期内基金净值波动情况的说明
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合同的规定...

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(%)

47 分红 2018年12月11日 5,012.74 5,012.74
48 分红 2018年12月12日 5,061.98 5,061.98
49 分红 2018年12月13日 5,022.89 5,022.89

3.1 主要财务指标
报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)
主要财务指标 南方天利货币A 南方天利货币B 南方天利货币E

5.2 报告期末债券投资组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)
1 固定收益投资 80,221,282,698.32 64.83

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
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 2018年10月19日 12,679,840 52,679,840 --

61 分红 2018年10月8日 76,374.81 76,374.81
62 分红 2018年10月9日 7,631.78 7,631.78
63 分红 2018年10月10日 7,267.31 7,267.31

南方天利货币A 阶段 净值收益率(%) 净收益率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④

5.3 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(%)

5.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分
5.9 开放式基金份额变动
单位:份

93 分红 2018年11月21日 7,200.96 7,200.96
94 分红 2018年11月22日 7,424.47 7,424.47
95 分红 2018年11月23日 7,322.82 7,322.82

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

5.4 管理人报告
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合同的规定...

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(%)

99 分红 2018年11月29日 7,427.23 7,427.23
100 分红 2018年11月30日 7,302.15 7,302.15
101 分红 2018年12月1日 21,791.52 21,791.52

注:1.本基金历任基金经理的任职日期为基金合同生效日,前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议的公告(生效)日期...

注:1.本基金正回购的资产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%。

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例
报告期内每个交易日债券回购融资余额占基金资产净值的简单平均值

注:本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。
8.1 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
8.2 报告期内单一投资者持有基金份额比例不在达到或超过20%的情况

基金管理人南方基金管理股份有限公司
基金托管人中国人银行股份有限公司
重要提示
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...

4.2 管理人对报告期内基金净值波动情况的说明
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合同的规定...

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(%)

5.7 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。

3.1 主要财务指标
报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)
主要财务指标 南方现金增利货币A 南方现金增利货币B 南方现金增利货币E

5.2 报告期末债券投资组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)
1 固定收益投资 29,478,512,853.77 42.88

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
序号 交易方式 交易日期 交易份额(份) 交易金额(元) 适用费率

5.8 投资组合报告附注
5.9 开放式基金份额变动
单位:份

南方现金增利货币A 阶段 净值收益率(%) 净收益率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④

5.3 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(%)

5.8 投资组合报告附注
5.9 开放式基金份额变动
单位:份

注:本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。
8.1 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
8.2 报告期内单一投资者持有基金份额比例不在达到或超过20%的情况

注:1.本基金历任基金经理的任职日期为基金合同生效日,前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议的公告(生效)日期...

注:1.本基金正回购的资产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%。

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例
报告期内每个交易日债券回购融资余额占基金资产净值的简单平均值

注:本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。
8.1 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
8.2 报告期内单一投资者持有基金份额比例不在达到或超过20%的情况