

南方现金增利货币市场证券投资基金 2020 年 1 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 17,967,108,073.51 55.85%
其中：国债 329,322,186.13 1.02%
政策性金融债 1,258,180,200.65 3.91%
商业银行金融债 * -
同业存单 11,837,262,958.25 36.79%
其他债券 4,542,342,728.48 14.12%
2 买入返售金融资产 10,413,008,552.60 32.37%
其中：交易对手为银行 400,061,840.09 1.24%
交易对手为其他机构 10,012,946,712.51 31.12%
3 银行存款和结算备付金 3,402,613,589.12 10.58%
4 商业银行票据 -
5 其他资产 389,069,792.33 1.21%
6 合计（6=1+2+3+4+5） 32,171,800,007.56 100%

各项目合计数为南方现金增利总资产。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 4 月 8 日