

# 南方理财金交易型货币市场基金 2021 年第 1 季度报告

2021 年 03 月 31 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

送出日期：2021 年 4 月 22 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 2021 年 4 月 20 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 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|             |                                                         |                  |        |
|-------------|---------------------------------------------------------|------------------|--------|
| 基金简称        | 南方理财金货币 ETF                                             |                  |        |
| 场内简称        | 理财金 H（理财金货币 ETF）                                        |                  |        |
| 基金主代码       | 000816                                                  |                  |        |
| 交易代码        | 000816                                                  |                  |        |
| 基金运作方式      | 交易型开放式                                                  |                  |        |
| 基金合同生效日     | 2014 年 12 月 5 日                                         |                  |        |
| 报告期末基金份额总额  | 32,984,953,174.38 份                                     |                  |        |
| 投资目标        | 在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。                  |                  |        |
| 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 | 理财金 A                                                   | 理财金 H            | 理财金 E  |
| 下属分级基金的场内简称 | -                                                       | 理财金 H（理财金货币 ETF） |        |
| 下属分级基金的交易   | 000816                                                  | 511810           | 007522 |

|                 |                     |                 |                |
|-----------------|---------------------|-----------------|----------------|
| 代码              |                     |                 |                |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 32,931,193,456.27 份 | 50,960,368.80 份 | 2,799,349.31 份 |

注：1、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“理财金 H”或“理财金货币 ETF”。

2、本基金 A 级份额净值为 1 元，本基金 E 级份额净值为 1 元，本基金 H 级份额净值为 100 元。

### § 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（2021 年 1 月 1 日—2021 年 3 月 31 日） |                  |              |
|------------|-------------------------------------|------------------|--------------|
|            | 理财金 A                               | 理财金 H            | 理财金 E        |
| 1.本期已实现收益  | 173,470,683.77                      | 23,132,391.06    | 16,336.76    |
| 2.本期利润     | 173,470,683.77                      | 23,132,391.06    | 16,336.76    |
| 3.期末基金资产净值 | 32,931,193,456.27                   | 5,096,036,879.85 | 2,799,349.31 |

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。

自 2019 年 6 月 5 日起，本基金增加 E 类基金份额。

#### 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

理财金 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 | 0.5672% | 0.0013%   | 0.3381%    | 0.0000%       | 0.2291% | 0.0013% |
| 过去六个月 | 1.1243% | 0.0010%   | 0.6848%    | 0.0000%       | 0.4395% | 0.0010% |
| 过去一年  | 1.9946% | 0.0013%   | 1.3781%    | 0.0000%       | 0.6165% | 0.0013% |

|                    |          |         |         |         |          |         |
|--------------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去三年               | 7.7511%  | 0.0023% | 4.1955% | 0.0000% | 3.5556%  | 0.0023% |
| 过去五年               | 15.1406% | 0.0026% | 7.0872% | 0.0000% | 8.0534%  | 0.0026% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 20.3242% | 0.0033% | 9.0445% | 0.0000% | 11.2797% | 0.0033% |

理财金 H

| 阶段                 | 净值收益<br>率① | 净值收益<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③      | ②-④     |
|--------------------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|----------|---------|
| 过去三个<br>月          | 0.5673%    | 0.0013%           | 0.3381%            | 0.0000%                   | 0.2292%  | 0.0013% |
| 过去六个<br>月          | 1.1244%    | 0.0010%           | 0.6848%            | 0.0000%                   | 0.4396%  | 0.0010% |
| 过去一年               | 1.9943%    | 0.0013%           | 1.3781%            | 0.0000%                   | 0.6162%  | 0.0013% |
| 过去三年               | 7.7507%    | 0.0023%           | 4.1955%            | 0.0000%                   | 3.5552%  | 0.0023% |
| 过去五年               | 15.1396%   | 0.0026%           | 7.0872%            | 0.0000%                   | 8.0524%  | 0.0026% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 20.3266%   | 0.0033%           | 9.0445%            | 0.0000%                   | 11.2821% | 0.0033% |

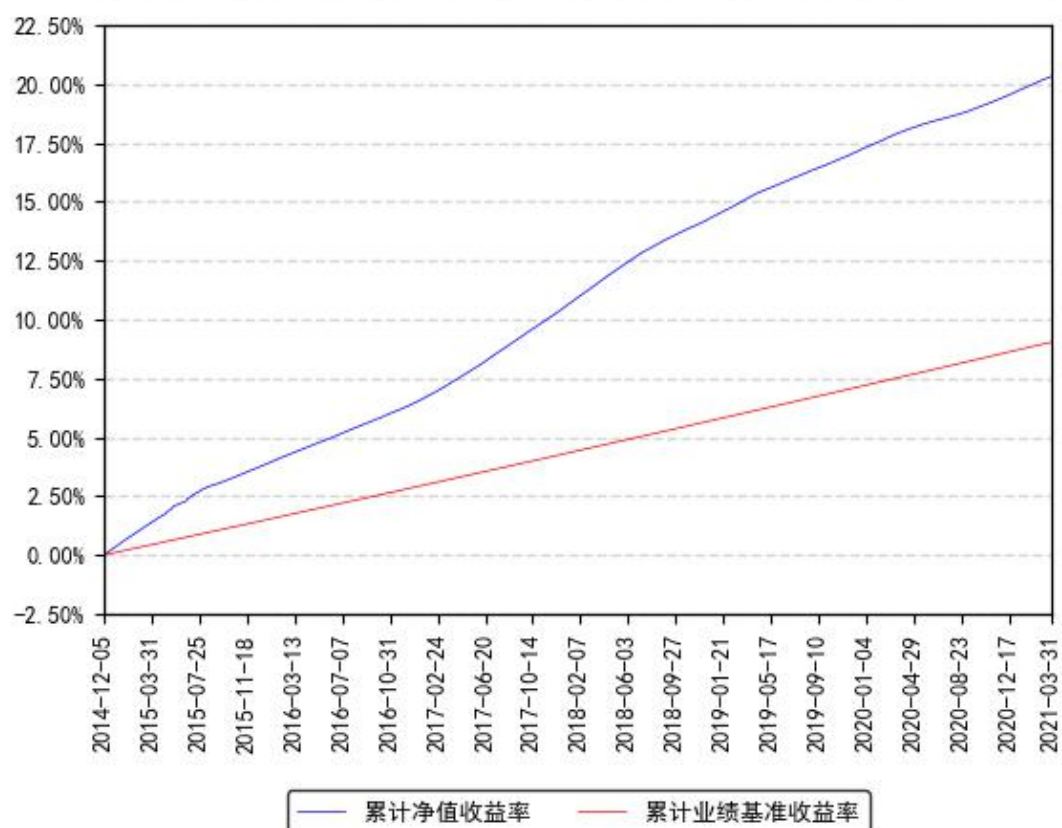
理财金 E

| 阶段                 | 净值收益<br>率① | 净值收益<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④     |
|--------------------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去三个<br>月          | 0.5645%    | 0.0013%           | 0.3381%            | 0.0000%                   | 0.2264% | 0.0013% |
| 过去六个<br>月          | 1.1191%    | 0.0010%           | 0.6848%            | 0.0000%                   | 0.4343% | 0.0010% |
| 过去一年               | 1.9859%    | 0.0013%           | 1.3781%            | 0.0000%                   | 0.6078% | 0.0013% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 4.0346%    | 0.0018%           | 2.5251%            | 0.0000%                   | 1.5095% | 0.0018% |

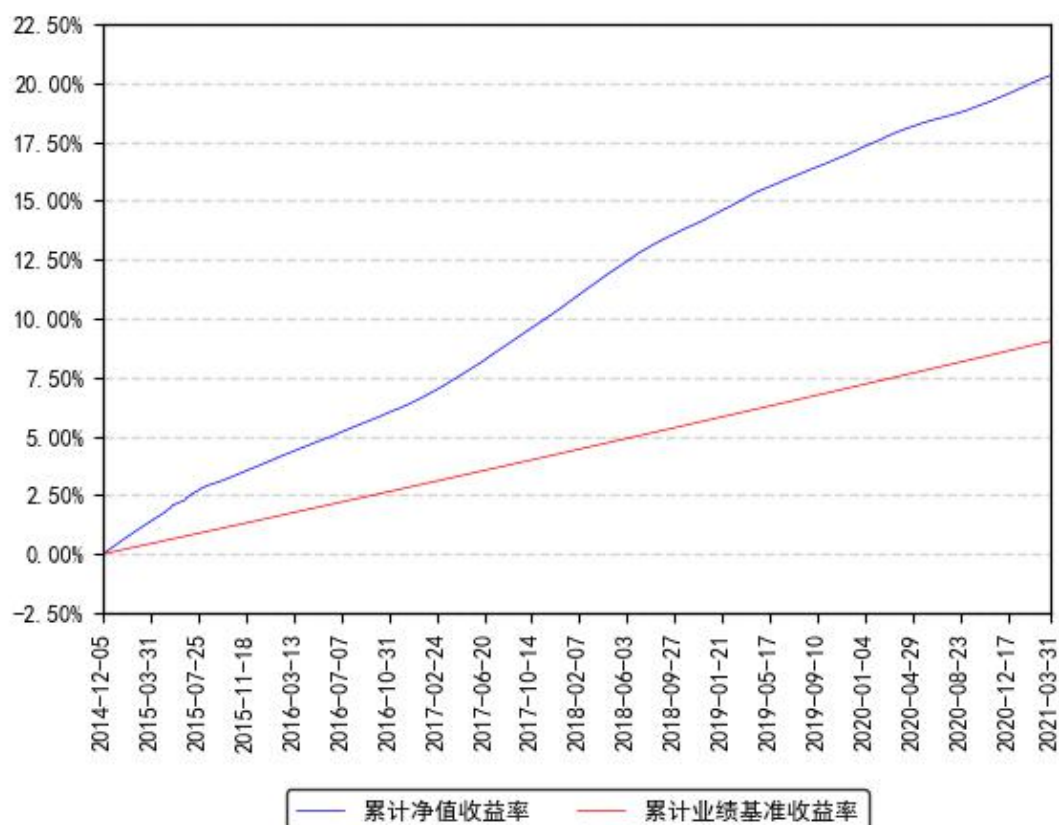
注：本基金收益分配为按日结转份额。

### 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

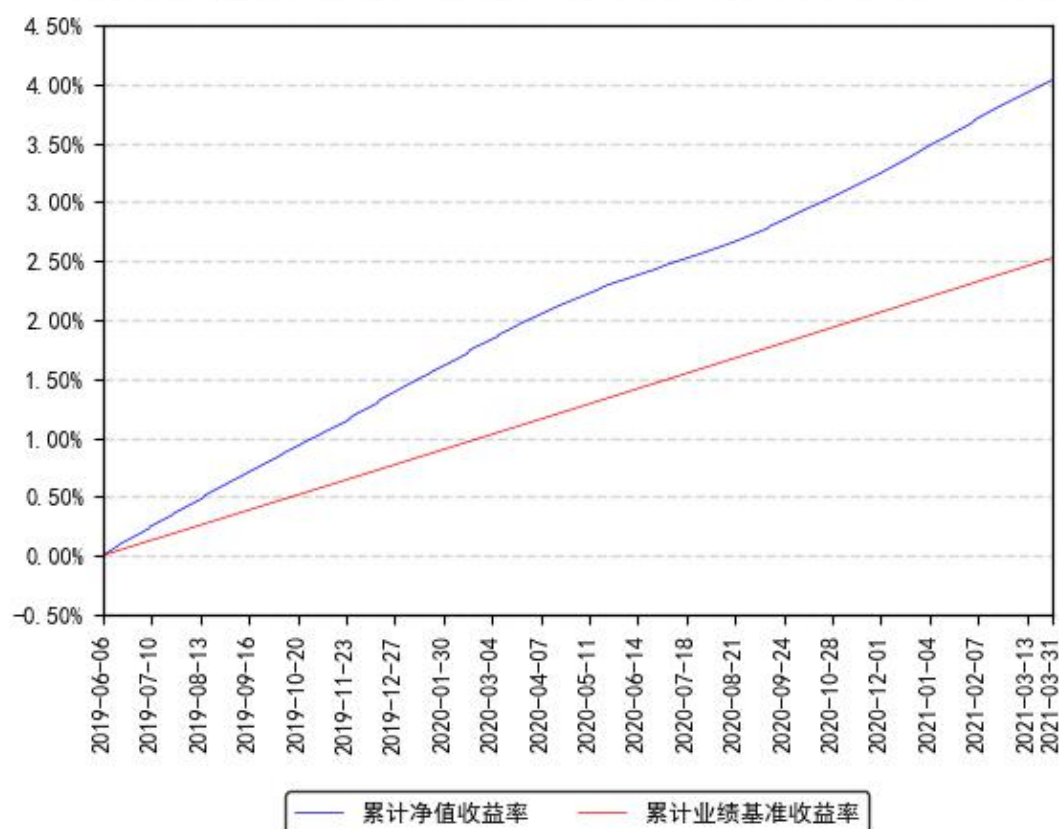
理财金A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



理财金H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



理财金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



## § 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期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----|---------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |         | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 蔡奕奕 | 本基金基金经理 | 2016 年 8 月 26 日 | -    | 15 年   | 女，中南大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于万家基金、银河基金、融通基金，历任交易员、研究员、基金经理助理；2011 年 10 月 13 日至 2015 年 3 月 14 日，任融通易支付货币基金经理；2012 年 3 月 1 日至 2015 年 3 月 14 日，任融通四季添利债券基金经理；2012 年 11 月 6 日至 2015 年 3 月 14 日，任融通岁岁添利债券基金经理；2014 年 8 月 29 日至 2015 年 3 月 14 日，任融通月月添利定开债券基金经理。2015 年 4 月加入南方基金；2016 年 8 月 26 日至 2019 年 5 月 24 日，任南方日添益基金经理；2017 年 8 月 24 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方收益宝基金经理；2016 年 8 月 26 日至今，任南方薪金宝、南方理财金基金经理；2016 年 11 月 17 日至今，任南方天天利基金经理；2019 年 5 月 24 日至今，任南方天天宝基金经理。 |

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。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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利益。本报告期内，本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，未出现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% 的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度经济继续修复。1-2 月工业增加值同比增长 35.1%；固定资产投资同比增长 35%；社会消费品零售总额同比增长 33.8%，消费修复略不及预期。1、2 月 CPI 分别同比下滑 0.3% 和 0.2%，由于对应去年基数高点，同时食品价格回落，拖累了 CPI 的上涨；1、2 月 PPI 分别同比增长 0.3% 和 1.7%，工业品价格普涨，同时基数偏低，带动 PPI 上行。2 月末 M2 同比增长 10.1%，年初以来信贷和社融增长强劲，社融结构向好。

美联储一季度维持利率不变，未推出扭曲操作。但美联储主席鲍威尔在 3 月的一次公开采访中表示，随着美国经济复苏和目标取得实质性进展，美联储将减少债券购买，释放了较强的鹰派信号。欧央行一季度维持利率不变。国内方面，央行一季度无降准降息操作。本季度美元指数上涨 3.59%，人民币对美元汇率中间价贬值 464 个基点。全季度来看，银行间隔夜、7 天回购加权利率均值为 2.05%、2.41%，分别较上月上行 35BP 和下行 9BP。

市场层面，一季度货币市场收益率震荡上行，曲线扁平化。其中，1 年国债、1 年国开收益率分别上行 10BP、20BP，3 个月 AAA 等级同业存单利率上行 28BP，6 个月国股同业存单利率上行 10BP。本基金整体采取稳健的久期策略，在收益上行的市场环境中以捕捉相对收益较高资产为主要投资目标，不断提高组合收益静态收益。

展望二季度，由于经济仍未完全恢复，央行不具备收紧的基础，预计仍将维持稳健中性的政策取向。我们认为短期流动性环境维持中性，财政政策依然比较积极，二季度关注供给放量对资金面的影响。货币市场利率在区间震荡中或仍有向上运行空间，本基金将保持适中积极的久期策略，择时利用好杠杆工具，精选投资回报和风险均衡的优质资产，积极提高组合静态收益。

## 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 0.5672%，同期业绩基准收益率为 0.3381%；本基金 H 份额净值收益率为 0.5673%，同期业绩基准收益率为 0.3381%；本基金 E 份额净值收益率为 0.5645%，同期业绩基准收益率为 0.3381%。

#### 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            | 21,294,666,718.92 | 53.41        |
|    | 其中：债券             | 21,294,666,718.92 | 53.41        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 11,134,879,960.06 | 27.93        |
|    | 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      | 7,326,368,725.38  | 18.38        |
| 4  | 其他资产              | 110,810,680.34    | 0.28         |
| 5  | 合计                | 39,866,726,084.70 | 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 | 2.82             |               |
|    | 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 | 1,784,730,674.93 | 4.69          |
|    | 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    | 76 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 88 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 55 |

### 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比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 38.72              | 4.77               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天（含）-60 天           | 24.76              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天（含）-90 天           | 10.28              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90 天（含）-120 天          | 9.51               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120 天（含）-397 天（含）      | 21.34              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
|    | 合计                     | 104.60             | 4.77               |

### 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      | 284,498,717.32   | 0.75         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,659,264,885.01 | 4.36         |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,659,264,885.01 | 4.36         |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 2,055,171,663.99 | 5.40         |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |

|    |                      |                   |       |
|----|----------------------|-------------------|-------|
| 7  | 同业存单                 | 17,295,731,452.60 | 45.48 |
| 8  | 其他                   | -                 | -     |
| 9  | 合计                   | 21,294,666,718.92 | 55.99 |
| 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  | 112104002 | 21 中国银行 CD002 | 10,000,000 | 996,864,057.42 | 2.62         |
| 2  | 112109056 | 21 浦发银行 CD056 | 10,000,000 | 996,864,057.42 | 2.62         |
| 3  | 112113028 | 21 浙商银行 CD028 | 10,000,000 | 995,836,379.21 | 2.62         |
| 4  | 112193239 | 21 徽商银行 CD005 | 10,000,000 | 995,733,558.76 | 2.62         |
| 5  | 112116029 | 21 上海银行 CD029 | 6,000,000  | 599,658,611.14 | 1.58         |
| 6  | 180208    | 18 国开 08      | 5,550,000  | 555,469,867.46 | 1.46         |
| 7  | 200206    | 20 国开 06      | 5,150,000  | 514,713,268.13 | 1.35         |
| 8  | 112118020 | 21 华夏银行 CD020 | 5,000,000  | 498,432,028.74 | 1.31         |
| 9  | 112193530 | 21 天津银行 CD058 | 5,000,000  | 493,747,207.77 | 1.30         |
| 10 | 112009454 | 20 浦发银行 CD454 | 4,700,000  | 465,624,394.16 | 1.22         |

## 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                   | 0.0921%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0206% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0370%  |

### 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 报告期末按摊余成本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 18 国开 08（证券代码 180208）、20 国开 06（证券代码 200206）、20 浦发银行 CD454（证券代码 112009454）、21 华夏银行 CD020（证券代码 112118020）、21 浦发银行 CD056（证券代码 112109056）、21 上海银行 CD029（证券代码 112116029）、21 浙商银行 CD028（证券代码 112113028）、21 中国银行 CD002（证券代码 112104002）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。

#### 1、18 国开 08（证券代码 180208）、20 国开 06（证券代码 200206）

根据中国银保监会公告，2020 年 12 月 25 日，因国家开发银行存在“为违规的政府购买服务项目提供融资”等 24 项违规情形，中国银保监会决定对其处罚款 4880 万元。

#### 2、20 浦发银行 CD454（证券代码 112009454）、21 浦发银行 CD056（证券代码 112109056）

浦发银行 2020 年 8 月 11 日公告称，2013 年至 2018 年，该行存在下列违法违规事实：未按专营部门制规定开展同业业务；同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；延迟支付同业投资资金吸收存款；为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；未按规定进行贷款资金支付管理与控制；个人消费贷款贷后管理未尽职责；通过票据转贴现业务调节信贷规模；银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职责；办理无真实贸易背景的贴现业务；委托贷款资金来源审查未尽职责；未按权限和程序办理委托贷款业务；未按权限和程序办理非融资性保函业务。中国保险监督管理委员会上海保监局对公司处以罚款 2100 万元并责令改正。

#### 3、21 华夏银行 CD020（证券代码 112118020）

2020 年 7 月 13 日，华夏银行股份有限公司因“内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则”等 4 项违规行为，被中国银保监会处罚款 110 万元。

#### 4、21 上海银行 CD029（证券代码 112116029）

上海银行 2020 年 8 月 14 日公告称，因 2014 年至 2019 年，上海银行存在违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款、并购贷款管理严重违反审慎经营规则、经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则等违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对公司责令改正，没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万元，罚没合计 1652.155092 万元。

上海银行 2020 年 11 月 25 日公告称，因 1. 2014 年至 2018 年，该行绩效考评管理严重违反审慎经营规则。2. 2018 年，该行未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬。中国银行保险监督管理委员会上海监管局对公司责令改正，并处罚款共计 80 万元

5、21 浙商银行 CD028（证券代码 112113028）

处罚时间：2020 年 7 月 13 日，处罚依据：（一）关联交易未经关联交易委员会审批（二）未严格执行关键岗位轮岗制度（三）对上海分行理财业务授权混乱等 处罚结果：罚款 10120 万元。

6、21 中国银行 CD002（证券代码 112104002）

2020 年 4 月 20 日，中国银行股份有限公司因存在理财产品数量漏报；资金交易信息漏报严重；贸易融资业务漏报；分户账明细记录应报未报；分户账账户数据应报未报；关键且应报字段漏报或填报错误的行为，被罚款合计 270 万元。

2020 年 12 月 1 日，中国银行股份有限公司因“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为，被中国银保监会处罚款 5050 万元。

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   | 42,425.08      |
| 2  | 应收证券清算款 | 24,598,047.27  |
| 3  | 应收利息    | 85,059,807.66  |
| 4  | 应收申购款   | 1,110,400.33   |
| 5  | 其他应收款   | -              |
| 6  | 待摊费用    | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 110,810,680.34 |

### 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          | 理财金 A              | 理财金 H         | 理财金 E         |
|-------------|--------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 26,501,834,328.44  | 35,386,472.31 | 1,442,486.81  |
| 报告期期间基金总申   | 157,669,500,443.01 | 15,665,445.91 | 11,975,095.69 |

|              |                    |               |               |
|--------------|--------------------|---------------|---------------|
| 购份额          |                    |               |               |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 151,240,141,315.18 | 91,549.42     | 10,618,233.19 |
| 报告期期末基金份额总额  | 32,931,193,456.27  | 50,960,368.80 | 2,799,349.31  |

## § 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<br>(份) | 交易金额<br>(元) | 适用费率 |
|----|------|-----------------|-------------|-------------|------|
| 1  | 分红   | 2021 年 1 月 4 日  | 0.04        | 0.04        | -    |
| 2  | 分红   | 2021 年 1 月 5 日  | 0.01        | 0.01        | -    |
| 3  | 分红   | 2021 年 1 月 6 日  | 0.01        | 0.01        | -    |
| 4  | 分红   | 2021 年 1 月 7 日  | 0.01        | 0.01        | -    |
| 5  | 分红   | 2021 年 1 月 8 日  | 0.01        | 0.01        | -    |
| 6  | 分红   | 2021 年 1 月 11 日 | 0.03        | 0.03        | -    |
| 7  | 分红   | 2021 年 1 月 12 日 | 0.01        | 0.01        | -    |
| 8  | 分红   | 2021 年 1 月 13 日 | 0.01        | 0.01        | -    |
| 9  | 分红   | 2021 年 1 月 14 日 | 0.01        | 0.01        | -    |
| 10 | 分红   | 2021 年 1 月 15 日 | 0.01        | 0.01        | -    |
| 11 | 分红   | 2021 年 1 月 18 日 | 0.03        | 0.03        | -    |
| 12 | 分红   | 2021 年 1 月 19 日 | 0.01        | 0.01        | -    |
| 13 | 分红   | 2021 年 1 月 20 日 | 0.01        | 0.01        | -    |
| 14 | 分红   | 2021 年 1 月 21 日 | 0.01        | 0.01        | -    |
| 15 | 分红   | 2021 年 1 月 22 日 | 0.01        | 0.01        | -    |
| 16 | 分红   | 2021 年 1 月 25 日 | 0.03        | 0.03        | -    |
| 17 | 分红   | 2021 年 1 月      | 0.01        | 0.01        | -    |

|    |    |                    |      |      |   |
|----|----|--------------------|------|------|---|
|    |    | 26 日               |      |      |   |
| 18 | 分红 | 2021 年 1 月<br>27 日 | 0.01 | 0.01 | - |
| 19 | 分红 | 2021 年 1 月<br>28 日 | 0.01 | 0.01 | - |
| 20 | 分红 | 2021 年 1 月<br>29 日 | 0.01 | 0.01 | - |
| 21 | 分红 | 2021 年 2 月 1<br>日  | 0.03 | 0.03 | - |
| 22 | 分红 | 2021 年 2 月 2<br>日  | 0.01 | 0.01 | - |
| 23 | 分红 | 2021 年 2 月 3<br>日  | 0.01 | 0.01 | - |
| 24 | 分红 | 2021 年 2 月 4<br>日  | 0.01 | 0.01 | - |
| 25 | 分红 | 2021 年 2 月 5<br>日  | 0.01 | 0.01 | - |
| 26 | 分红 | 2021 年 2 月 8<br>日  | 0.06 | 0.06 | - |
| 27 | 分红 | 2021 年 2 月 9<br>日  | 0.01 | 0.01 | - |
| 28 | 分红 | 2021 年 2 月<br>10 日 | 0.01 | 0.01 | - |
| 29 | 分红 | 2021 年 2 月<br>18 日 | 0.08 | 0.08 | - |
| 30 | 分红 | 2021 年 2 月<br>19 日 | 0.01 | 0.01 | - |
| 31 | 分红 | 2021 年 2 月<br>22 日 | 0.03 | 0.03 | - |
| 32 | 分红 | 2021 年 2 月<br>23 日 | 0.01 | 0.01 | - |
| 33 | 分红 | 2021 年 2 月<br>24 日 | 0.01 | 0.01 | - |
| 34 | 分红 | 2021 年 2 月<br>25 日 | 0.01 | 0.01 | - |
| 35 | 分红 | 2021 年 2 月<br>26 日 | 0.01 | 0.01 | - |
| 36 | 分红 | 2021 年 3 月 1<br>日  | 0.03 | 0.03 | - |
| 37 | 分红 | 2021 年 3 月 2<br>日  | 0.01 | 0.01 | - |
| 38 | 分红 | 2021 年 3 月 3<br>日  | 0.01 | 0.01 | - |

|    |    |                 |      |        |   |
|----|----|-----------------|------|--------|---|
| 39 | 分红 | 2021 年 3 月 4 日  | 0.01 | 0.01   | - |
| 40 | 分红 | 2021 年 3 月 5 日  | 0.01 | 0.01   | - |
| 41 | 分红 | 2021 年 3 月 8 日  | 0.03 | 0.03   | - |
| 42 | 分红 | 2021 年 3 月 9 日  | 0.01 | 0.01   | - |
| 43 | 分红 | 2021 年 3 月 10 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 44 | 分红 | 2021 年 3 月 11 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 45 | 分红 | 2021 年 3 月 12 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 46 | 分红 | 2021 年 3 月 15 日 | 0.03 | 0.03   | - |
| 47 | 分红 | 2021 年 3 月 16 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 48 | 分红 | 2021 年 3 月 17 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 49 | 分红 | 2021 年 3 月 18 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 50 | 分红 | 2021 年 3 月 19 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 51 | 分红 | 2021 年 3 月 22 日 | 0.03 | 0.03   | - |
| 52 | 分红 | 2021 年 3 月 23 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 53 | 分红 | 2021 年 3 月 24 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 54 | 分红 | 2021 年 3 月 25 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 55 | 分红 | 2021 年 3 月 26 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 56 | 分红 | 2021 年 3 月 29 日 | 0.03 | 0.03   | - |
| 57 | 分红 | 2021 年 3 月 30 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 58 | 分红 | 2021 年 3 月 31 日 | 0.01 | 0.01   | - |
| 59 | 分红 | 2021 年 1 月 4 日  | 8.00 | 863.62 | - |
| 60 | 分红 | 2021 年 1 月 5 日  | 8.00 | 863.65 | - |



|    |    |                 |       |          |   |
|----|----|-----------------|-------|----------|---|
| 61 | 分红 | 2021 年 1 月 6 日  | 8.00  | 848.41   | - |
| 62 | 分红 | 2021 年 1 月 7 日  | 8.00  | 820.20   | - |
| 63 | 分红 | 2021 年 1 月 8 日  | 23.00 | 2,307.03 | - |
| 64 | 分红 | 2021 年 1 月 11 日 | 7.00  | 736.33   | - |
| 65 | 分红 | 2021 年 1 月 12 日 | 7.00  | 752.70   | - |
| 66 | 分红 | 2021 年 1 月 13 日 | 7.00  | 796.49   | - |
| 67 | 分红 | 2021 年 1 月 14 日 | 8.00  | 876.08   | - |
| 68 | 分红 | 2021 年 1 月 15 日 | 22.00 | 2,235.46 | - |
| 69 | 分红 | 2021 年 1 月 18 日 | 7.00  | 765.68   | - |
| 70 | 分红 | 2021 年 1 月 19 日 | 7.00  | 784.40   | - |
| 71 | 分红 | 2021 年 1 月 20 日 | 8.00  | 862.32   | - |
| 72 | 分红 | 2021 年 1 月 21 日 | 8.00  | 816.98   | - |
| 73 | 分红 | 2021 年 1 月 22 日 | 22.00 | 2,217.81 | - |
| 74 | 分红 | 2021 年 1 月 25 日 | 7.00  | 748.63   | - |
| 75 | 分红 | 2021 年 1 月 26 日 | 7.00  | 787.77   | - |
| 76 | 分红 | 2021 年 1 月 27 日 | 8.00  | 856.24   | - |
| 77 | 分红 | 2021 年 1 月 28 日 | 8.00  | 838.58   | - |
| 78 | 分红 | 2021 年 1 月 29 日 | 24.00 | 2,400.03 | - |
| 79 | 分红 | 2021 年 2 月 1 日  | 8.00  | 814.78   | - |
| 80 | 分红 | 2021 年 2 月 2 日  | 7.00  | 785.77   | - |
| 81 | 分红 | 2021 年 2 月 3 日  | 9.00  | 948.92   | - |
| 82 | 分红 | 2021 年 2 月 4 日  | 9.00  | 930.72   | - |

|     |    |                 |       |          |   |
|-----|----|-----------------|-------|----------|---|
| 83  | 分红 | 2021 年 2 月 5 日  | 37.00 | 3,718.41 | - |
| 84  | 分红 | 2021 年 2 月 8 日  | 8.00  | 801.91   | - |
| 85  | 分红 | 2021 年 2 月 9 日  | 7.00  | 797.05   | - |
| 86  | 分红 | 2021 年 2 月 10 日 | 62.00 | 6,241.80 | - |
| 87  | 分红 | 2021 年 2 月 18 日 | 7.00  | 770.47   | - |
| 88  | 分红 | 2021 年 2 月 19 日 | 21.00 | 2,199.85 | - |
| 89  | 分红 | 2021 年 2 月 22 日 | 7.00  | 796.75   | - |
| 90  | 分红 | 2021 年 2 月 23 日 | 8.00  | 814.59   | - |
| 91  | 分红 | 2021 年 2 月 24 日 | 7.00  | 701.30   | - |
| 92  | 分红 | 2021 年 2 月 25 日 | 7.00  | 748.33   | - |
| 93  | 分红 | 2021 年 2 月 26 日 | 21.00 | 2,145.62 | - |
| 94  | 分红 | 2021 年 3 月 1 日  | 7.00  | 762.21   | - |
| 95  | 分红 | 2021 年 3 月 2 日  | 7.00  | 743.60   | - |
| 96  | 分红 | 2021 年 3 月 3 日  | 7.00  | 729.22   | - |
| 97  | 分红 | 2021 年 3 月 4 日  | 7.00  | 740.54   | - |
| 98  | 分红 | 2021 年 3 月 5 日  | 21.00 | 2,118.11 | - |
| 99  | 分红 | 2021 年 3 月 8 日  | 7.00  | 759.01   | - |
| 100 | 分红 | 2021 年 3 月 9 日  | 7.00  | 747.89   | - |
| 101 | 分红 | 2021 年 3 月 10 日 | 7.00  | 757.10   | - |
| 102 | 分红 | 2021 年 3 月 11 日 | 7.00  | 740.83   | - |
| 103 | 分红 | 2021 年 3 月 12 日 | 21.00 | 2,109.57 | - |
| 104 | 分红 | 2021 年 3 月 15 日 | 7.00  | 704.26   | - |

|     |    |                    |        |           |   |
|-----|----|--------------------|--------|-----------|---|
| 105 | 分红 | 2021 年 3 月<br>16 日 | 7.00   | 708.39    | - |
| 106 | 分红 | 2021 年 3 月<br>17 日 | 7.00   | 708.87    | - |
| 107 | 分红 | 2021 年 3 月<br>18 日 | 7.00   | 734.40    | - |
| 108 | 分红 | 2021 年 3 月<br>19 日 | 21.00  | 2,141.67  | - |
| 109 | 分红 | 2021 年 3 月<br>22 日 | 7.00   | 744.03    | - |
| 110 | 分红 | 2021 年 3 月<br>23 日 | 7.00   | 744.90    | - |
| 111 | 分红 | 2021 年 3 月<br>24 日 | 7.00   | 756.02    | - |
| 112 | 分红 | 2021 年 3 月<br>25 日 | 7.00   | 754.86    | - |
| 113 | 分红 | 2021 年 3 月<br>26 日 | 21.00  | 2,160.03  | - |
| 114 | 分红 | 2021 年 3 月<br>29 日 | 7.00   | 779.25    | - |
| 115 | 分红 | 2021 年 3 月<br>30 日 | 8.00   | 823.84    | - |
| 合计  | -  | -                  | 648.93 | 67,364.21 | - |

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、《南方理财金交易型货币市场基金基金合同》；
- 2、《南方理财金交易型货币市场基金托管协议》；

3、南方理财金交易型货币市场基金 2021 年 1 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>