

南方天天利货币市场基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方天天利货币		
基金主代码	003473		
交易代码	003473		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 10 月 20 日		
报告期末基金份额总额	185,408,060,684.31 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	交通银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 E
下属分级基金的交易代码	003473	003474	005194
报告期末下属分级基金的份额总额	9,256,106,544.19 份	171,791,787,977.61 份	4,360,166,162.51 份

注:自 2017 年 9 月 13 日起增加南方天天利货币市场基金 E 类。

§ 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(2022年7月1日-2022年9月30日)		
	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 E
1.本期已实现收益	44,188,625.36	847,087,344.62	25,169,556.46
2.本期利润	44,188,625.36	847,087,344.62	25,169,556.46
3.期末基金资产净值	9,256,106,544.19	171,791,787,977.61	4,360,166,162.51

注:1、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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金按照实际利率计算账面价值,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;

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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

南方天天利货币 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	0.4434%	0.0002%	0.3456%	0.0000%	0.0978%	0.0002%
过去六个月	0.9468%	0.0004%	0.6886%	0.0000%	0.2582%	0.0004%
过去一年	2.0892%	0.0006%	1.3781%	0.0000%	0.7111%	0.0006%
过去三年	6.8493%	0.0008%	4.1955%	0.0000%	2.6538%	0.0008%
过去五年	14.5996%	0.0022%	7.0872%	0.0000%	7.5124%	0.0022%
自基金合同生效起至今	18.8636%	0.0025%	8.4857%	0.0000%	10.3779%	0.0025%

南方天天利货币 B

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	0.5042%	0.0002%	0.3456%	0.0000%	0.1586%	0.0002%
过去六个月	1.0685%	0.0004%	0.6886%	0.0000%	0.3799%	0.0004%
过去一年	2.3346%	0.0006%	1.3781%	0.0000%	0.9565%	0.0006%
过去三年	7.6211%	0.0008%	4.1955%	0.0000%	3.4256%	0.0008%
过去五年	15.9821%	0.0022%	7.0872%	0.0000%	8.8949%	0.0022%
自基金合同生效起至今	20.5682%	0.0025%	8.4857%	0.0000%	12.0825%	0.0025%

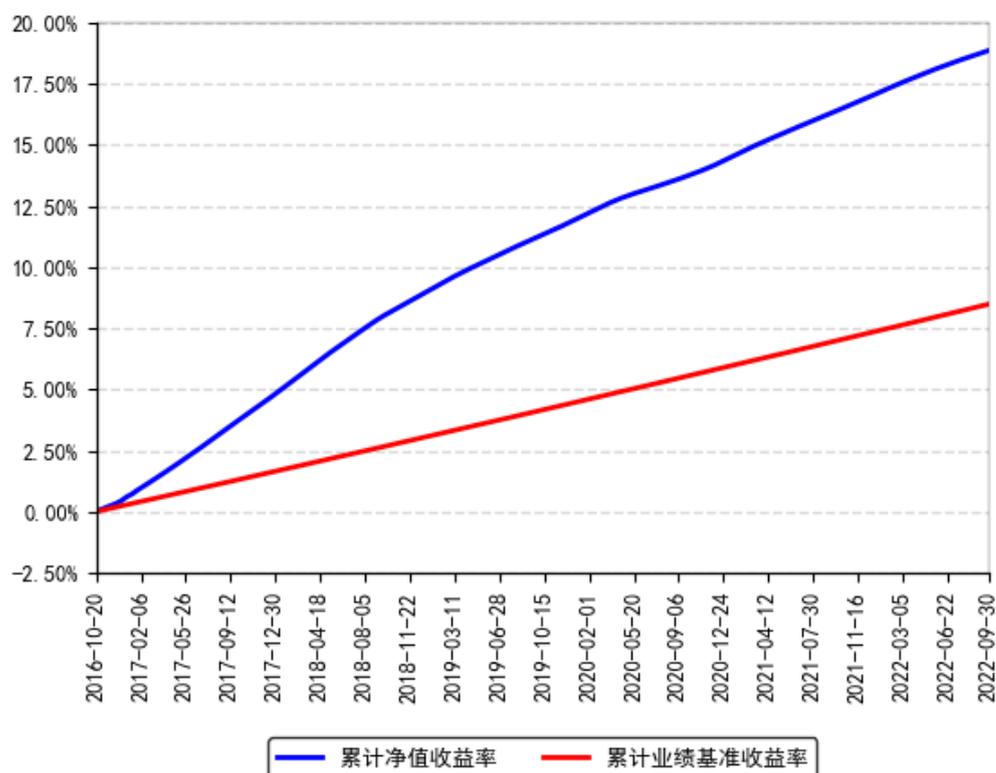
南方天天利货币 E

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	0.4814%	0.0002%	0.3456%	0.0000%	0.1358%	0.0002%
过去六个月	1.0230%	0.0004%	0.6886%	0.0000%	0.3344%	0.0004%
过去一年	2.2427%	0.0006%	1.3781%	0.0000%	0.8646%	0.0006%
过去三年	7.3308%	0.0008%	4.1955%	0.0000%	3.1353%	0.0008%
过去五年	15.4626%	0.0022%	7.0832%	0.0000%	8.3794%	0.0022%
自基金合同生效起至今	15.6997%	0.0023%	7.1555%	0.0000%	8.5442%	0.0023%

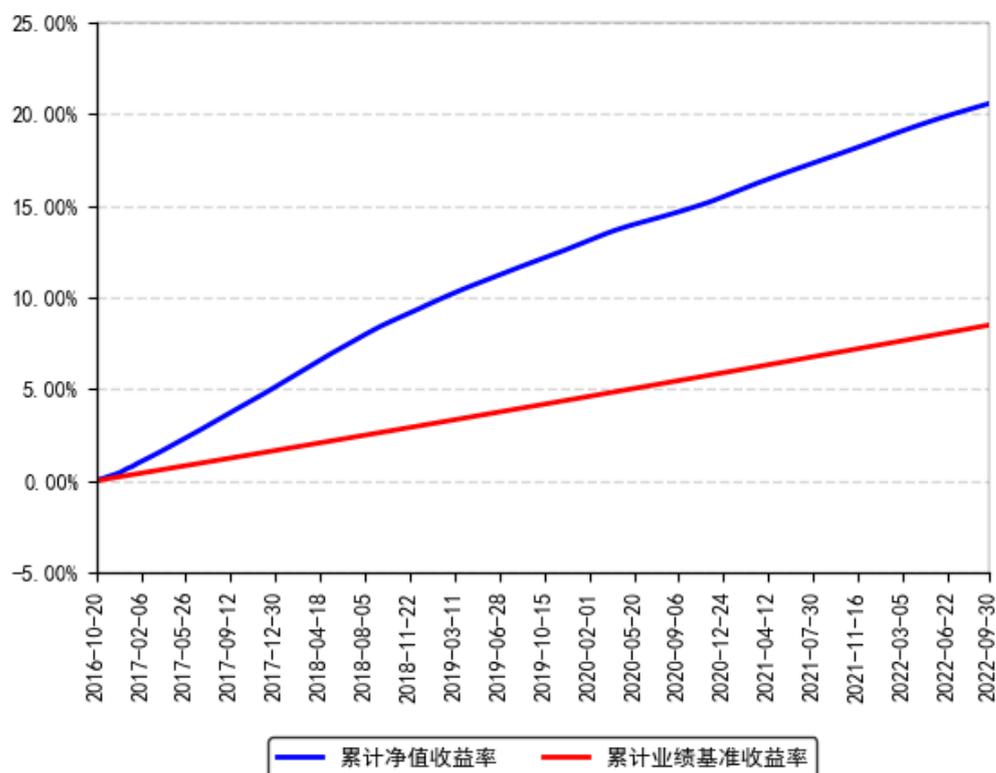
注：本基金收益分配为按日结转份额。

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

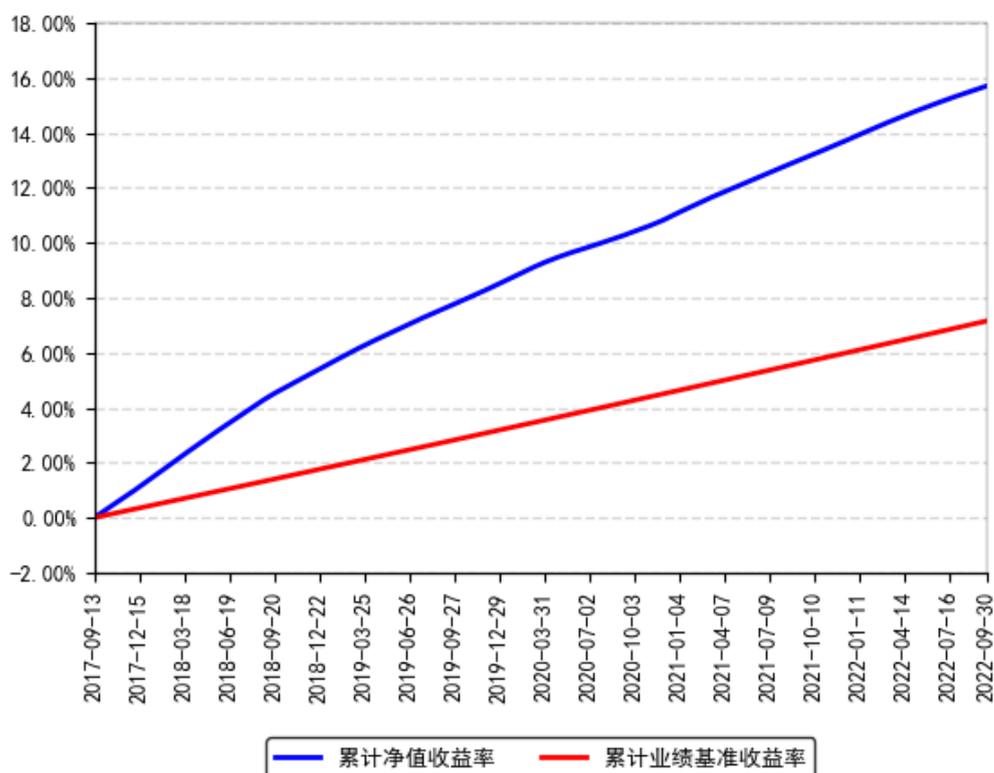
南方天天利货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方天天利货币B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



南方天天利货币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



§ 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		
夏晨曦	本基金基金经理	2016年10月20日	-	17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6月17日至2012年7月20日，任固定收益部投资经理；2013年1月22日至2014年12月15日，任南方理财30天基金经理；2012年7月20日至2015年1月13日，任南方润元基金经理；2014年7月25日至2016年11月17日，任南方薪金宝基金经理；2014年12月5日至2016年11月17日，任南方理财金基金经理；2012年10月19日至2019年10

				<p>月 15 日，任南方理财 60 天基金经理；2014 年 12 月 15 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方收益宝基金经理；2016 年 2 月 3 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方日添益货币基金经理；2017 年 8 月 9 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方天天宝基金经理；2012 年 8 月 14 日至 2020 年 6 月 16 日，任南方理财 14 天基金经理；2014 年 7 月 25 日至 2020 年 11 月 6 日，任南方现金增利基金经理；2018 年 12 月 5 日至 2020 年 11 月 6 日，任南方 3-5 年农发债基金经理 2019 年 3 月 15 日至 2020 年 11 月 6 日，任南方 7-10 年国开债基金经理；2020 年 4 月 17 日至 2022 年 1 月 14 日，任南方 1-5 年国开债基金经理 2020 年 8 月 6 日至 2022 年 1 月 14 日，任南方 0-2 年国开债基金经理 2014 年 7 月 25 日至今，任南方现金通基金经理；2016 年 10 月 20 日至今，任南方天天利基金经理 2018 年 11 月 8 日至今，任南方 1-3 年国开债基金经理；2020 年 3 月 5 日至今，任南方 0-5 年江苏城投债基金经理；2021 年 12 月 20 日至今，任南方中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金经理。</p>
蔡奕奕	本基金基金经理	2016 年 11 月 17 日	- 16 年	<p>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；2022 年 4 月 1 日至今，任南方收益</p>

					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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金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

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 2 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济有所回暖。国内方面，疫情仍有反复，但常态化管控后，生产端受影响减小，需求端仍然偏弱。海外方面，美联储加息节奏超预期，本轮加息周期预计将至少持续到明年上半年，外需后续将面临一定下行风险。政策上，央行三季度调降公开市场操作和 MLF 利率 10BP，同时，调降 1 年期 LPR 5BP，5 年期 LPR 15BP，流动性整体维持在较为充裕水平上，但受到短期人民币汇率贬值的影响，货币政策操作的空间受到一定限制。市场层面，三季度债券市场收益率震荡下行，信用债整体表现好于同期限利率债。

投资运作上，组合保持中性久期和适度杠杆，配置上偏向于哑铃型结构，并积极把握波段操作的机会。

展望未来，经济仍然受到疫情和地产等因素的影响，信用扩张节奏偏慢。海外方面，后续衰退压力较大。政策层面，房地产政策仍在放松，准财政政策持续加码。货币政策虽然受到汇率影响，但预计流动性水平边际变化不大。

策略方面，密切关注货币政策与汇率的变化，积极捕捉市场机会，提高组合收益。

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 0.4434%，同期业绩基准收益率为 0.3456%；本基金 B 份额净值收益率为 0.5042%，同期业绩基准收益率为 0.3456%；本基金 E 份额净值收益率为 0.4814%，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	67,136,158,752.39	35.55
	其中：债券	64,792,030,926.89	34.31
	资产支持证券	2,344,127,825.50	1.24
2	买入返售金融资产	44,793,561,221.65	23.72
	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	76,190,455,295.53	40.34
4	其他资产	729,653,945.92	0.39
5	合计	188,849,829,215.49	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		1.97
	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	3,304,253,994.98	1.78
	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	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	99
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	76

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	39.34	1.84
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.08	-
2	30 天（含）-60 天	11.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.09	-
3	60 天（含）-90 天	14.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.30	-
4	90 天（含）-120 天	1.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）-397 天（含）	34.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.56	1.84

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	1,572,986,754.46	0.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,664,008,095.64	3.59
	其中：政策性金融债	6,664,008,095.64	3.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,071,445,218.22	2.20
6	中期票据	-	-
7	同业存单	52,483,590,858.57	28.31
8	其他	-	-
9	合计	64,792,030,926.89	34.95
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	2,728,182,726.22	1.47

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	200202	20 国开 02	20,800,000	2,099,208,267.46	1.13
2	112206205	22 交通银行 CD205	20,000,000	1,970,920,127.40	1.06
3	112295981	22 徽商银行 CD032	17,000,000	1,678,058,261.30	0.91
4	112295745	22 徽商银行 CD027	14,000,000	1,382,559,874.70	0.75
5	112106294	21 交通银行 CD294	13,000,000	1,297,323,686.04	0.70
6	112203057	22 农业银行 CD057	13,000,000	1,286,783,426.33	0.69
7	112209026	22 浦发银行 CD026	10,000,000	991,058,769.72	0.53
8	112206155	22 交通银行 CD155	10,000,000	983,570,980.93	0.53
9	112209118	22 浦发银行 CD118	10,000,000	983,445,053.77	0.53
10	210213	21 国开 13	8,800,000	889,751,044.03	0.48

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	0.0925%
报告期内偏离度的最低值	0.0362%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0641%

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180792	工鑫 6A2	2,400,000	240,203,888.21	0.13
2	180389	G 电建 2A	1,800,000	180,697,749.05	0.10
3	183844	铁保 11A1	1,300,000	131,158,616.99	0.07
4	136928	链融 56A1	1,000,000	101,602,564.38	0.05
5	136916	恒煦 04A1	1,000,000	101,521,972.60	0.05
6	183287	明珠 03 优	1,000,000	101,488,131.51	0.05
7	135147	国链 37A1	800,000	80,659,813.70	0.04
8	183332	22 信易 1A	700,000	71,301,424.66	0.04
9	136901	天著优 12	600,000	61,119,780.82	0.03
10	136929	恒煦 05A1	600,000	60,903,004.93	0.03
10	136939	链融 57A1	600,000	60,903,004.93	0.03

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金按照实际利率计算账面价值，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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；徽商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行合肥中心支行的处罚；交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚；上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

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	-
2	应收清算款	176,665,623.85
3	应收利息	-
4	应收申购款	552,988,322.07
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	729,653,945.92

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	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 E
报告期期初基金份额总额	9,765,670,024.22	165,814,662,912.90	4,227,137,003.59
报告期期间基金总申购份额	8,799,678,483.80	53,245,429,479.95	6,182,502,823.17
报告期期间基金总赎回份额	9,309,241,963.83	47,268,304,415.24	6,049,473,664.25
报告期期末基金份额总额	9,256,106,544.19	171,791,787,977.61	4,360,166,162.51

§ 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	分红	2022年7月1日	5.69	5.69	-
2	赎回	2022年7月1日	12.34	12.34	-
3	分红	2022年7月4日	17.91	17.91	-
4	赎回	2022年7月4日	5,601.01	5,601.01	-
5	分红	2022年7月5日	5.61	5.61	-
6	申购	2022年7月5日	160,000,000.00	160,000,000.00	-
7	赎回	2022年7月5日	8.69	8.69	-

8	分红	2022 年 7 月 6 日	9,324.98	9,324.98	-
9	申购	2022 年 7 月 6 日	340,000,000. 00	340,000,000. 00	-
10	赎回	2022 年 7 月 6 日	6.56	6.56	-
11	分红	2022 年 7 月 7 日	28,752.60	28,752.60	-
12	赎回	2022 年 7 月 7 日	4.22	4.22	-
13	分红	2022 年 7 月 8 日	28,345.32	28,345.32	-
14	赎回	2022 年 7 月 8 日	8.10	8.10	-
15	分红	2022 年 7 月 11 日	84,957.28	84,957.28	-
16	赎回	2022 年 7 月 11 日	10.14	10.14	-
17	分红	2022 年 7 月 12 日	28,840.16	28,840.16	-
18	赎回	2022 年 7 月 12 日	17.70	17.70	-
19	分红	2022 年 7 月 13 日	28,107.44	28,107.44	-
20	赎回	2022 年 7 月 13 日	13.97	13.97	-
21	分红	2022 年 7 月 14 日	28,209.05	28,209.05	-
22	赎回	2022 年 7 月 14 日	160,000,004. 40	160,000,004. 40	-
23	分红	2022 年 7 月 15 日	19,192.69	19,192.69	-
24	赎回	2022 年 7 月 15 日	27.25	27.25	-
25	分红	2022 年 7 月 18 日	57,054.10	57,054.10	-
26	赎回	2022 年 7 月 18 日	12.04	12.04	-
27	分红	2022 年 7 月 19 日	19,022.26	19,022.26	-
28	赎回	2022 年 7 月 19 日	21.10	21.10	-
29	分红	2022 年 7 月 20 日	19,009.33	19,009.33	-

30	赎回	2022 年 7 月 20 日	15.54	15.54	-
31	分红	2022 年 7 月 21 日	18,921.08	18,921.08	-
32	赎回	2022 年 7 月 21 日	27.82	27.82	-
33	分红	2022 年 7 月 22 日	18,961.22	18,961.22	-
34	赎回	2022 年 7 月 22 日	10.48	10.48	-
35	分红	2022 年 7 月 25 日	56,600.87	56,600.87	-
36	赎回	2022 年 7 月 25 日	160,000,019. 06	160,000,019. 06	-
37	分红	2022 年 7 月 26 日	10,115.46	10,115.46	-
38	赎回	2022 年 7 月 26 日	18.18	18.18	-
39	分红	2022 年 7 月 27 日	10,429.17	10,429.17	-
40	赎回	2022 年 7 月 27 日	11.73	11.73	-
41	分红	2022 年 7 月 28 日	10,148.58	10,148.58	-
42	赎回	2022 年 7 月 28 日	20.86	20.86	-
43	分红	2022 年 7 月 29 日	10,079.25	10,079.25	-
44	赎回	2022 年 7 月 29 日	30,000,021.7 6	30,000,021.7 6	-
45	分红	2022 年 8 月 1 日	25,044.38	25,044.38	-
46	赎回	2022 年 8 月 1 日	21.50	21.50	-
47	分红	2022 年 8 月 2 日	8,332.54	8,332.54	-
48	申购	2022 年 8 月 2 日	190,000,000. 00	190,000,000. 00	-
49	赎回	2022 年 8 月 2 日	35,916.52	35,916.52	-
50	分红	2022 年 8 月 3 日	18,788.90	18,788.90	-
51	申购	2022 年 8 月 3 日	40,000,000.0 0	40,000,000.0 0	-

52	赎回	2022 年 8 月 3 日	2.05	2.05	-
53	分红	2022 年 8 月 4 日	20,890.09	20,890.09	-
54	申购	2022 年 8 月 4 日	320,000,000. 00	320,000,000. 00	-
55	赎回	2022 年 8 月 4 日	1.66	1.66	-
56	分红	2022 年 8 月 5 日	38,461.09	38,461.09	-
57	申购	2022 年 8 月 5 日	25,000,000.0 0	25,000,000.0 0	-
58	赎回	2022 年 8 月 5 日	0.95	0.95	-
59	分红	2022 年 8 月 8 日	119,203.61	119,203.61	-
60	申购	2022 年 8 月 8 日	10,000,000.0 0	10,000,000.0 0	-
61	赎回	2022 年 8 月 8 日	2.78	2.78	-
62	分红	2022 年 8 月 9 日	40,058.57	40,058.57	-
63	赎回	2022 年 8 月 9 日	6.58	6.58	-
64	分红	2022 年 8 月 10 日	39,884.01	39,884.01	-
65	赎回	2022 年 8 月 10 日	10.38	10.38	-
66	分红	2022 年 8 月 11 日	39,722.72	39,722.72	-
67	赎回	2022 年 8 月 11 日	9.12	9.12	-
68	分红	2022 年 8 月 12 日	39,971.07	39,971.07	-
69	赎回	2022 年 8 月 12 日	65,000,031.2 0	65,000,031.2 0	-
70	分红	2022 年 8 月 15 日	108,746.67	108,746.67	-
71	赎回	2022 年 8 月 15 日	70,000,004.8 0	70,000,004.8 0	-
72	分红	2022 年 8 月 16 日	32,427.05	32,427.05	-
73	赎回	2022 年 8 月 16 日	16.67	16.67	-

74	分红	2022 年 8 月 17 日	32,366.02	32,366.02	-
75	赎回	2022 年 8 月 17 日	65,000,022.8 5	65,000,022.8 5	-
76	分红	2022 年 8 月 18 日	28,788.90	28,788.90	-
77	赎回	2022 年 8 月 18 日	41.64	41.64	-
78	分红	2022 年 8 月 19 日	28,898.94	28,898.94	-
79	赎回	2022 年 8 月 19 日	17.38	17.38	-
80	分红	2022 年 8 月 22 日	86,487.64	86,487.64	-
81	赎回	2022 年 8 月 22 日	10.95	10.95	-
82	分红	2022 年 8 月 23 日	28,601.46	28,601.46	-
83	赎回	2022 年 8 月 23 日	25,000,032.1 6	25,000,032.1 6	-
84	分红	2022 年 8 月 24 日	27,396.71	27,396.71	-
85	赎回	2022 年 8 月 24 日	19.98	19.98	-
86	分红	2022 年 8 月 25 日	27,128.34	27,128.34	-
87	赎回	2022 年 8 月 25 日	10,000,018.6 9	10,000,018.6 9	-
88	分红	2022 年 8 月 26 日	26,642.19	26,642.19	-
89	赎回	2022 年 8 月 26 日	7.73	7.73	-
90	分红	2022 年 8 月 29 日	80,062.78	80,062.78	-
91	赎回	2022 年 8 月 29 日	41.04	41.04	-
92	分红	2022 年 8 月 30 日	26,812.71	26,812.71	-
93	赎回	2022 年 8 月 30 日	41.89	41.89	-
94	分红	2022 年 8 月 31 日	26,903.98	26,903.98	-
95	赎回	2022 年 8 月 31 日	50,000,037.6 7	50,000,037.6 7	-

96	分红	2022 年 9 月 1 日	24,186.38	24,186.38	-
97	赎回	2022 年 9 月 1 日	27.63	27.63	-
98	分红	2022 年 9 月 2 日	24,052.41	24,052.41	-
99	赎回	2022 年 9 月 2 日	34,172.93	34,172.93	-
100	分红	2022 年 9 月 5 日	71,859.82	71,859.82	-
101	赎回	2022 年 9 月 5 日	1.40	1.40	-
102	分红	2022 年 9 月 6 日	23,627.24	23,627.24	-
103	申购	2022 年 9 月 6 日	380,000,000. 00	380,000,000. 00	-
104	赎回	2022 年 9 月 6 日	2.01	2.01	-
105	分红	2022 年 9 月 7 日	43,606.40	43,606.40	-
106	申购	2022 年 9 月 7 日	20,000,000.0 0	20,000,000.0 0	-
107	赎回	2022 年 9 月 7 日	5.78	5.78	-
108	分红	2022 年 9 月 8 日	44,822.99	44,822.99	-
109	赎回	2022 年 9 月 8 日	4.46	4.46	-
110	分红	2022 年 9 月 9 日	44,721.01	44,721.01	-
111	赎回	2022 年 9 月 9 日	6.57	6.57	-
112	分红	2022 年 9 月 13 日	179,237.13	179,237.13	-
113	赎回	2022 年 9 月 13 日	24.81	24.81	-
114	分红	2022 年 9 月 14 日	44,995.93	44,995.93	-
115	申购	2022 年 9 月 14 日	30,000,000.0 0	30,000,000.0 0	-
116	赎回	2022 年 9 月 14 日	18.15	18.15	-
117	分红	2022 年 9 月 15 日	46,692.56	46,692.56	-

118	赎回	2022 年 9 月 15 日	13.20	13.20	-
119	分红	2022 年 9 月 16 日	46,495.84	46,495.84	-
120	赎回	2022 年 9 月 16 日	55,000,022.0 0	55,000,022.0 0	-
121	分红	2022 年 9 月 19 日	129,609.81	129,609.81	-
122	赎回	2022 年 9 月 19 日	50,000,005.8 0	50,000,005.8 0	-
123	分红	2022 年 9 月 20 日	40,770.85	40,770.85	-
124	赎回	2022 年 9 月 20 日	25.92	25.92	-
125	分红	2022 年 9 月 21 日	41,216.10	41,216.10	-
126	赎回	2022 年 9 月 21 日	9.12	9.12	-
127	分红	2022 年 9 月 22 日	42,401.12	42,401.12	-
128	赎回	2022 年 9 月 22 日	14.92	14.92	-
129	分红	2022 年 9 月 23 日	41,793.88	41,793.88	-
130	赎回	2022 年 9 月 23 日	20,000,022.6 4	20,000,022.6 4	-
131	分红	2022 年 9 月 26 日	122,590.99	122,590.99	-
132	赎回	2022 年 9 月 26 日	14.42	14.42	-
133	分红	2022 年 9 月 27 日	40,795.56	40,795.56	-
134	赎回	2022 年 9 月 27 日	36.62	36.62	-
135	分红	2022 年 9 月 28 日	41,396.65	41,396.65	-
136	赎回	2022 年 9 月 28 日	69.14	69.14	-
137	分红	2022 年 9 月 29 日	42,005.33	42,005.33	-
138	赎回	2022 年 9 月 29 日	45,000,018.5 7	45,000,018.5 7	-
139	分红	2022 年 9 月 30 日	39,601.33	39,601.33	-

140	赎回	2022 年 9 月 30 日	13.06	13.06	-
141	分红	2022 年 7 月 1 日	0.39	0.39	-
142	分红	2022 年 7 月 4 日	1.17	1.17	-
143	分红	2022 年 7 月 5 日	0.39	0.39	-
144	分红	2022 年 7 月 6 日	0.38	0.38	-
145	分红	2022 年 7 月 7 日	0.37	0.37	-
146	分红	2022 年 7 月 8 日	0.37	0.37	-
147	分红	2022 年 7 月 11 日	1.11	1.11	-
148	分红	2022 年 7 月 12 日	0.38	0.38	-
149	分红	2022 年 7 月 13 日	0.37	0.37	-
150	分红	2022 年 7 月 14 日	0.37	0.37	-
151	分红	2022 年 7 月 15 日	0.37	0.37	-
152	分红	2022 年 7 月 18 日	1.08	1.08	-
153	分红	2022 年 7 月 19 日	0.36	0.36	-
154	分红	2022 年 7 月 20 日	0.36	0.36	-
155	分红	2022 年 7 月 21 日	0.36	0.36	-
156	分红	2022 年 7 月 22 日	0.36	0.36	-
157	分红	2022 年 7 月 25 日	1.08	1.08	-
158	分红	2022 年 7 月 26 日	0.36	0.36	-
159	分红	2022 年 7 月 27 日	0.38	0.38	-
160	分红	2022 年 7 月 28 日	0.37	0.37	-
161	分红	2022 年 7 月 29 日	0.36	0.36	-

162	分红	2022 年 8 月 1 日	1.08	1.08	-
163	分红	2022 年 8 月 2 日	0.36	0.36	-
164	分红	2022 年 8 月 3 日	0.36	0.36	-
165	分红	2022 年 8 月 4 日	0.36	0.36	-
166	分红	2022 年 8 月 5 日	0.36	0.36	-
167	分红	2022 年 8 月 8 日	1.08	1.08	-
168	分红	2022 年 8 月 9 日	0.36	0.36	-
169	分红	2022 年 8 月 10 日	0.35	0.35	-
170	分红	2022 年 8 月 11 日	0.35	0.35	-
171	分红	2022 年 8 月 12 日	0.36	0.36	-
172	分红	2022 年 8 月 15 日	1.05	1.05	-
173	分红	2022 年 8 月 16 日	0.35	0.35	-
174	分红	2022 年 8 月 17 日	0.35	0.35	-
175	分红	2022 年 8 月 18 日	0.35	0.35	-
176	分红	2022 年 8 月 19 日	0.35	0.35	-
177	分红	2022 年 8 月 22 日	1.05	1.05	-
178	分红	2022 年 8 月 23 日	0.35	0.35	-
179	分红	2022 年 8 月 24 日	0.35	0.35	-
180	分红	2022 年 8 月 25 日	0.35	0.35	-
181	分红	2022 年 8 月 26 日	0.35	0.35	-
182	分红	2022 年 8 月 29 日	1.05	1.05	-
183	分红	2022 年 8 月 30 日	0.35	0.35	-

184	分红	2022 年 8 月 31 日	0.35	0.35	-
185	分红	2022 年 9 月 1 日	0.35	0.35	-
186	分红	2022 年 9 月 2 日	0.35	0.35	-
187	分红	2022 年 9 月 5 日	1.05	1.05	-
188	分红	2022 年 9 月 6 日	0.34	0.34	-
189	分红	2022 年 9 月 7 日	0.34	0.34	-
190	分红	2022 年 9 月 8 日	0.34	0.34	-
191	分红	2022 年 9 月 9 日	0.34	0.34	-
192	分红	2022 年 9 月 13 日	1.37	1.37	-
193	分红	2022 年 9 月 14 日	0.35	0.35	-
194	分红	2022 年 9 月 15 日	0.35	0.35	-
195	分红	2022 年 9 月 16 日	0.35	0.35	-
196	分红	2022 年 9 月 19 日	1.02	1.02	-
197	分红	2022 年 9 月 20 日	0.34	0.34	-
198	分红	2022 年 9 月 21 日	0.35	0.35	-
199	分红	2022 年 9 月 22 日	0.36	0.36	-
200	分红	2022 年 9 月 23 日	0.35	0.35	-
201	分红	2022 年 9 月 26 日	1.06	1.06	-
202	分红	2022 年 9 月 27 日	0.35	0.35	-
203	分红	2022 年 9 月 28 日	0.36	0.36	-
204	分红	2022 年 9 月 29 日	0.36	0.36	-
205	分红	2022 年 9 月 30 日	0.36	0.36	-

合计	-	-	2,322,690,970.89	2,322,690,970.89	-
----	---	---	------------------	------------------	---

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、《南方天天利货币市场基金基金合同》；
- 2、《南方天天利货币市场基金托管协议》；
- 3、南方天天利货币市场基金 2022 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>