

南方理财金交易型货币市场基金 2022 年第 2 季度报告

2022 年 06 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 7 月 21 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 2022 年 7 月 19 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 4 月 1 日起至 6 月 30 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	45,259,954,266.45 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 E	南方理财金货币 ETF
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	007522	511810

代码			
报告期末下属分级基金的份额总额	45,231,668,900.76 份	2,028,781.28 份	26,256,584.41 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、理财金 A 份额净值为 1 元，理财金 E 份额净值为 1 元，理财金 H（理财金货币 ETF）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（2022 年 4 月 1 日—2022 年 6 月 30 日）		
	理财金 A	理财金 E	南方理财金货币 ETF
1.本期已实现收益	188,353,109.83	9,294.51	12,138,446.20
2.本期利润	188,353,109.83	9,294.51	12,138,446.20
3.期末基金资产净值	45,231,668,900.76	2,028,781.28	2,625,658,440.54

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	0.4239%	0.0008%	0.3418%	0.0000%	0.0821%	0.0008%
过去六个月	0.9114%	0.0009%	0.6810%	0.0000%	0.2304%	0.0009%
过去一年	1.9352%	0.0010%	1.3781%	0.0000%	0.5571%	0.0010%
过去三年	6.3713%	0.0015%	4.1955%	0.0000%	2.1758%	0.0015%
过去五年	13.8175%	0.0026%	7.0872%	0.0000%	6.7303%	0.0026%
自基金合	23.3071%	0.0032%	10.9252%	0.0000%	12.3819%	0.0032%

同生效起至今						
--------	--	--	--	--	--	--

理财金 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	0.4238%	0.0008%	0.3418%	0.0000%	0.0820%	0.0008%
过去六个月	0.9110%	0.0009%	0.6810%	0.0000%	0.2300%	0.0009%
过去一年	1.9337%	0.0010%	1.3781%	0.0000%	0.5556%	0.0010%
过去三年	6.4239%	0.0016%	4.1955%	0.0000%	2.2284%	0.0016%
自基金合同生效起至今	6.6125%	0.0016%	4.2933%	0.0000%	2.3192%	0.0016%

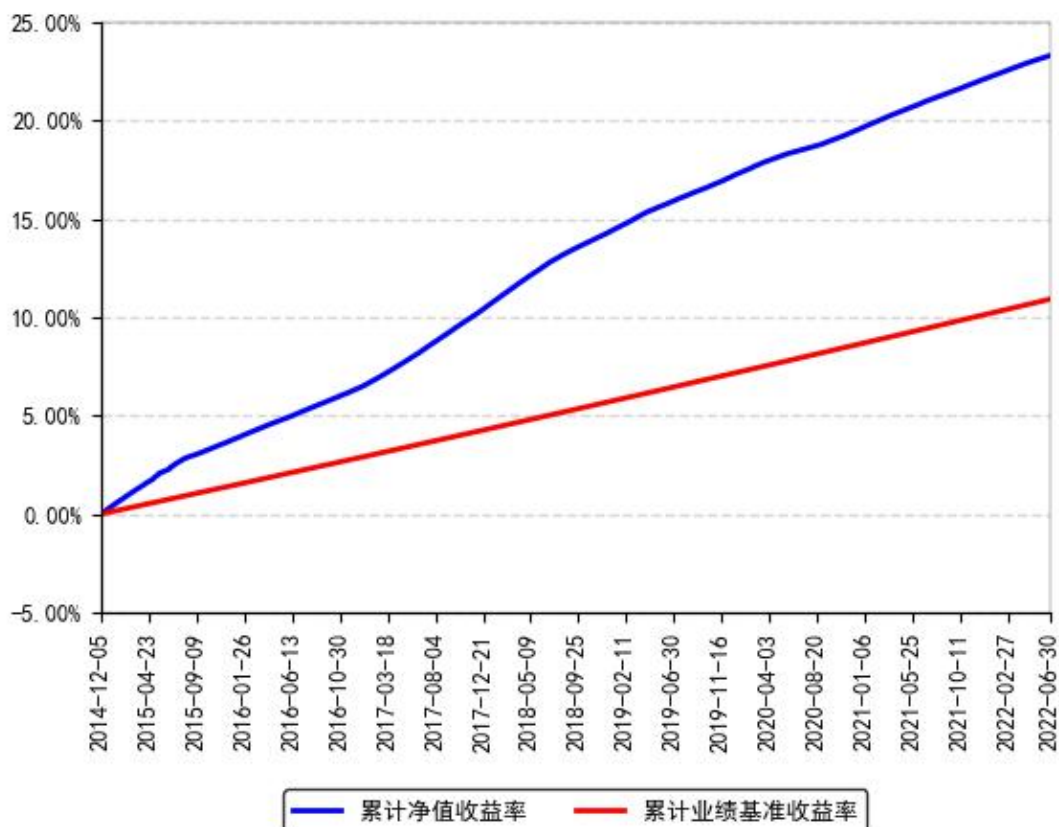
南方理财金货币 ETF

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	0.4238%	0.0008%	0.3418%	0.0000%	0.0820%	0.0008%
过去六个月	0.9112%	0.0009%	0.6810%	0.0000%	0.2302%	0.0009%
过去一年	1.9347%	0.0010%	1.3781%	0.0000%	0.5566%	0.0010%
过去三年	6.3694%	0.0015%	4.1955%	0.0000%	2.1739%	0.0015%
过去五年	13.8163%	0.0026%	7.0872%	0.0000%	6.7291%	0.0026%
自基金合同生效起至今	23.3088%	0.0032%	10.9252%	0.0000%	12.3836%	0.0032%

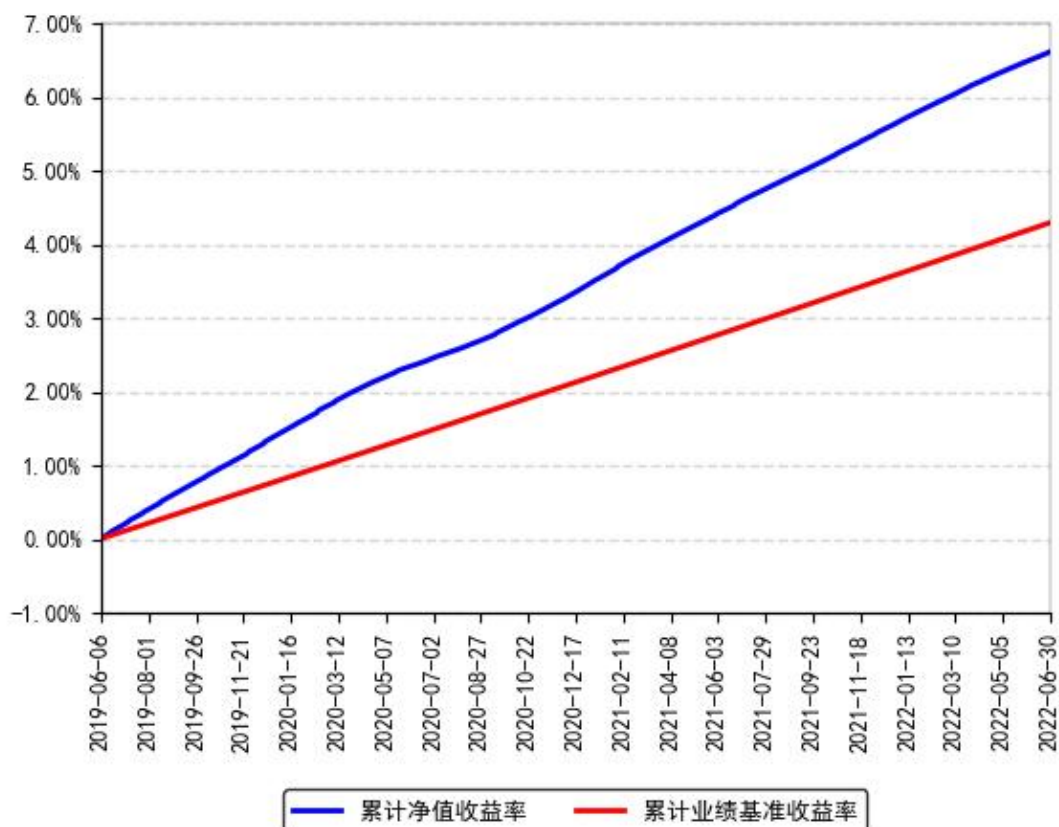
注：本基金收益分配为按日结转份额。

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

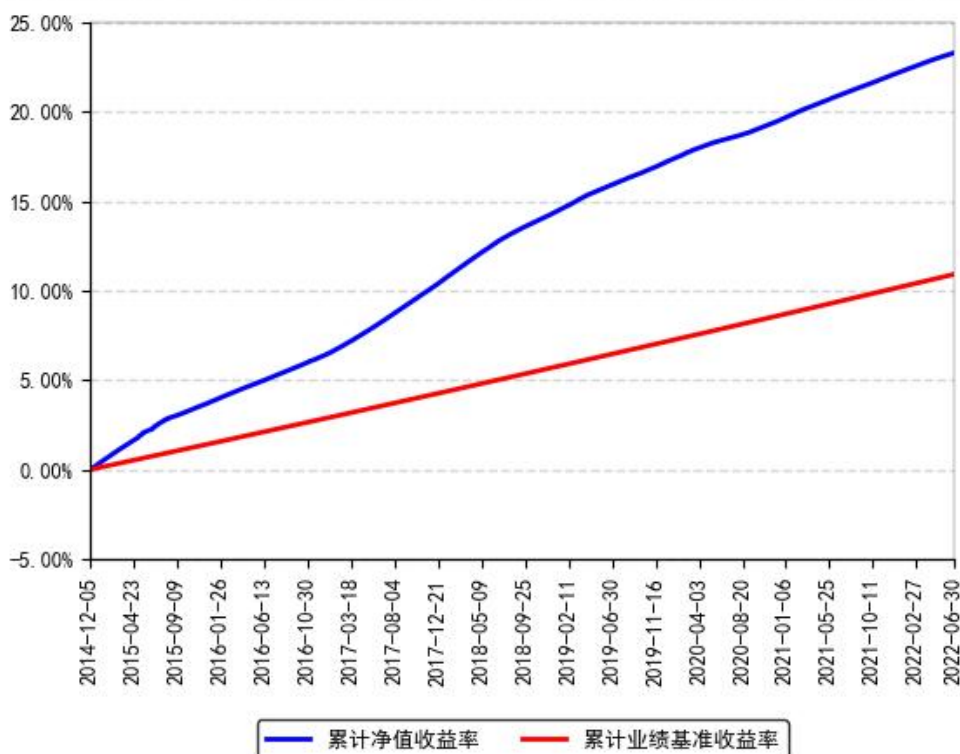
理财金A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



南方理财金货币ETF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	-	16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；2022 年 4 月 1 日至今，任南方收益宝基金经理。
董浩	本基金基金经理	2022 年 4 月 1 日	-	11 年	南开大学金融学硕士，具有基金从业资格。2010 年 7 月加入南方基金，历任交易管理部债券交易员、固定收益部货币理财类研究员；2014 年 3 月 31 日至 2015 年 9 月 11 日，任南方现金通基金经理助理；2015 年 9 月 11 日至 2016 年 8 月 17 日，任南方 50 债基金经理；2015 年 9 月 11 日至 2018 年 7 月 4 日，任南方中票基金经理；2017 年 8 月 9 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方天天宝基金经理；2018 年 12 月 5 日至 2020 年 5 月 22 日，任南方 3-5 年农发债基金经理；2019 年 3 月 15 日至 2020 年 5 月 22 日，任南方 7-10 年国开债基金经理；2016 年 11 月 17 日至 2020 年 12 月 15 日，任南方理财 60 天基金经理；2016 年 8 月 17 日至 2021 年 5 月 26 日，任南方 10 年国债基金经理；2015 年 9 月 11 日至今，任南方现金通基金经理；2016 年 2 月 3 日至今，任南方日添益货币基金经理；2018 年 11 月 8 日至今，任南方 1-3 年国开债基金经理；2019 年 5 月 24 日至今，任南方收益宝基金经理；2020 年 3 月 5 日至今，任南方 0-5 年江苏城投债基金经理；2020 年 4 月 17 日至今，任南方 1-5 年国开债基金经理；2022 年 4 月 1 日至今，任南方理财金基金经理。

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

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

上半年经济受疫情影响出现一定波动。房地产投资同比下滑 4.0%，制造业投资同比增长 10.6%，基建投资同比增长 8.2%，基建和制造业景气度较好，房地产产业链表现低迷；社会消费品零售总额同比下滑 1.5%，消费受疫情冲击较大。

美联储上半年加息 3 次，合计加息 1.50%，预计下半年加息幅度仍然较大。欧央行预计下半年也将开启加息周期。国内方面，央行上半年降低 OMO 和 MLF 操作利率 10BP，人民币对美元汇率中间价贬值 3632 个基点。

市场层面，全季度来看银行间隔夜、7 天回购加权利率均值为 1.51%、1.85%，分别较上季度下行 49BP 和 44BP。二季度债券收益率震荡为主，短端下行幅度较大。其中，3 个月国股存单和 1 年期国股存单分别较上季度下行 55BP 和 28BP，1 年国债、1 年国开收益率分别下行 18BP、27BP，10 年国债、10 年国开收益率分别上行 3BP、1BP。投资上，基金总体保持了中性久期，结构上以逆回购和同业存单资产为主，灵活运用杠杆工具，以持有到期获取票息策略为主，并通过波段操作增厚组合收益。

展望未来，经济正在逐步走出疫情的影响，房地产销售出现了底部企稳的迹象，但楼市整体偏冷，回暖尚需时间。海外方面，通胀压力维持高位，需求出现放缓迹象。后续关注点主要在疫情后的经济修复节奏以及稳增长政策的实施效果。在市场利率可能出现缓慢回升的预期下，基金将继续维持适中久期，以持有期收益为主，精选优质品种和个券，做好流动性管理和信用风险把控，积极提高组合的收益表现。

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 0.4239%，同期业绩基准收益率为 0.3418%；本基金 E 份额净值收益率为 0.4238%，同期业绩基准收益率为 0.3418%；本基金 H 份额净值收益率为 0.4238%，同期业绩基准收益率为 0.3418%。

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	22,646,149,096.15	45.86
	其中：债券	22,646,149,096.15	45.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	15,829,369,053.48	32.05
	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	10,909,449,541.26	22.09
4	其他资产	1,204,503.56	0.00
5	合计	49,386,172,194.45	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	7.84	
	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	1,500,098,630.14	3.13
	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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	76
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

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	51.36	3.13
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.10	-
2	30 天（含）-60 天	11.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）-90 天	11.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.21	-
4	90 天（含）-120 天	15.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）-397 天（含）	13.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.19	3.13

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	2,390,717,004.62	5.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	848,954,130.29	1.77
	其中：政策性金融债	210,900,866.26	0.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,186,961,613.88	4.57
6	中期票据	71,994,711.74	0.15

7	同业存单	17,147,521,635.62	35.83
8	其他	-	-
9	合计	22,646,149,096.15	47.32
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	149,726,760.43	0.31

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	229915	22 贴现国债 15	12,000,000	1,198,931,661.02	2.51
2	229914	22 贴现国债 14	10,200,000	1,019,460,699.82	2.13
3	112184716	21 长沙银行 CD130	5,000,000	499,517,412.05	1.04
4	112212046	22 北京银行 CD046	5,000,000	499,304,044.33	1.04
5	112117133	21 光大银行 CD133	5,000,000	498,849,517.32	1.04
6	112291078	22 汇丰银行 CD019	5,000,000	495,024,882.93	1.03
7	112205093	22 建设银行 CD093	5,000,000	488,853,286.94	1.02
8	112296968	22 郑州银行 CD107	4,000,000	396,213,655.11	0.83
9	112280851	22 浙江泰隆商行 CD041	3,000,000	298,789,022.27	0.62
10	112282346	22 威海商行 CD059	3,000,000	298,548,610.27	0.62

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	0.1027%
报告期内偏离度的最低值	0.0454%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0755%

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京银保监局的处罚；长沙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湖南监管局的处罚；中国建设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；浙江泰隆商业银行在报告编制日前一年内曾受到台州银保监局的处罚；中国光大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	34,332.38
2	应收证券清算款	497,671.19
3	应收利息	-
4	应收申购款	672,499.99
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,204,503.56

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 E	南方理财金货币 ETF
报告期期初基金份额总额	44,242,863,470.51	2,562,937.85	30,602,794.85

报告期期间基金总申购份额	198,352,018,570.66	29,397.54	1,162,640.46
报告期期间基金总赎回份额	197,363,213,140.41	563,554.11	5,508,850.90
报告期期末基金份额总额	45,231,668,900.76	2,028,781.28	26,256,584.41

§ 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4月6日	0.05	0.05	-
2	分红	2022年4月7日	0.01	0.01	-
3	分红	2022年4月11日	0.03	0.03	-
4	申购	2022年4月11日	50,000,000.00	50,000,000.00	-
5	分红	2022年4月12日	2,571.58	2,571.58	-
6	分红	2022年4月13日	3,789.79	3,789.79	-
7	分红	2022年4月14日	2,771.14	2,771.14	-
8	分红	2022年4月15日	2,612.11	2,612.11	-
9	分红	2022年4月18日	6,064.55	6,064.55	-
10	分红	2022年4月19日	2,544.04	2,544.04	-
11	分红	2022年4月20日	3,137.66	3,137.66	-
12	分红	2022年4月21日	2,636.53	2,636.53	-
13	分红	2022年4月22日	2,466.50	2,466.50	-
14	分红	2022年4月25日	7,273.05	7,273.05	-
15	分红	2022年4月26日	1,849.95	1,849.95	-
16	分红	2022年4月27日	2,340.75	2,340.75	-

17	分红	2022 年 4 月 28 日	2,491.17	2,491.17	-
18	分红	2022 年 4 月 29 日	2,425.95	2,425.95	-
19	分红	2022 年 5 月 5 日	13,939.49	13,939.49	-
20	分红	2022 年 5 月 6 日	2,473.65	2,473.65	-
21	分红	2022 年 5 月 9 日	6,901.11	6,901.11	-
22	分红	2022 年 5 月 10 日	1,946.97	1,946.97	-
23	分红	2022 年 5 月 11 日	2,631.92	2,631.92	-
24	分红	2022 年 5 月 12 日	2,442.21	2,442.21	-
25	分红	2022 年 5 月 13 日	2,330.68	2,330.68	-
26	分红	2022 年 5 月 16 日	6,604.06	6,604.06	-
27	分红	2022 年 5 月 17 日	1,891.02	1,891.02	-
28	分红	2022 年 5 月 18 日	2,702.89	2,702.89	-
29	分红	2022 年 5 月 19 日	2,313.56	2,313.56	-
30	分红	2022 年 5 月 20 日	2,265.30	2,265.30	-
31	分红	2022 年 5 月 23 日	6,680.48	6,680.48	-
32	分红	2022 年 5 月 24 日	2,314.11	2,314.11	-
33	分红	2022 年 5 月 25 日	2,678.34	2,678.34	-
34	分红	2022 年 5 月 26 日	2,384.30	2,384.30	-
35	分红	2022 年 5 月 27 日	2,232.18	2,232.18	-
36	分红	2022 年 5 月 30 日	6,397.72	6,397.72	-
37	赎回	2022 年 5 月 30 日	50,000,000.00	50,000,000.00	-
38	分红	2022 年 5 月 31 日	5.77	5.77	-

39	分红	2022年6月1日	5.75	5.75	-
40	分红	2022年6月2日	5.53	5.53	-
41	分红	2022年6月6日	19.57	19.57	-
42	分红	2022年6月7日	5.73	5.73	-
43	分红	2022年6月8日	5.53	5.53	-
44	分红	2022年6月9日	5.56	5.56	-
45	分红	2022年6月10日	3.13	3.13	-
46	分红	2022年6月13日	15.15	15.15	-
47	分红	2022年6月14日	6.18	6.18	-
48	分红	2022年6月15日	5.19	5.19	-
49	分红	2022年6月16日	5.67	5.67	-
50	分红	2022年6月17日	2.95	2.95	-
51	分红	2022年6月20日	14.82	14.82	-
52	分红	2022年6月21日	5.20	5.20	-
53	分红	2022年6月22日	6.28	6.28	-
54	分红	2022年6月23日	6.09	6.09	-
55	分红	2022年6月24日	5.46	5.46	-
56	分红	2022年6月27日	14.00	14.00	-
57	分红	2022年6月28日	5.42	5.42	-
58	分红	2022年6月29日	6.39	6.39	-
59	分红	2022年6月30日	6.03	6.03	-
合计	-	-	100,116,266.25	100,116,266.25	-

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 2022 年 2 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>