

南方理财金交易型货币市场基金 2020 年年度报告

2020 年 12 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 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由总经理（代为履行董事长职务）签发。

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 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告.....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	19
§5 托管人报告.....	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 审计报告.....	19
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表.....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 债券回购融资情况.....	51
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	52
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53

8.6	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	53
8.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	53
8.8	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 ..	54
8.9	投资组合报告附注	54
§9	基金份额持有人信息	55
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2	期末上市基金前十名持有人	56
9.3	期末货币市场基金前十名份额持有人情况	56
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
9.5	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§10	开放式基金份额变动	57
§11	重大事件揭示	58
11.1	基金份额持有人大会决议	58
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4	基金投资策略的改变	58
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	59
11.9	其他重大事件	60
§12	影响投资者决策的其他重要信息	61
12.1	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	61
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
§13	备查文件目录	61
13.1	备查文件目录	61
13.2	存放地点	61
13.3	查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方理财金交易型货币市场基金		
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		
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		
报告期末基金份额总额	26,538,663,287.56 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2014 年 12 月 5 日		
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代码	000816	511810	007522
报告期末下属分级基金的份额总额	26,501,834,328.44 份	35,386,472.31 份	1,442,486.81 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。

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	贺倩
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518017	100031
法定代表人		张海波	周慕冰

注：1、因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2、中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司（H 级） 南方基金管理股份有限公司（A 级、E 级）	北京市西城区太平桥大街 17 号 深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1、理财金 A

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	356,755,904.21	130,256,812.00	118,037,606.96
本期利润	356,755,904.21	130,256,812.00	118,037,606.96
本期净值收益率	2.0120%	2.5196%	3.5032%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末基金资产净值	26,501,834,328.44	10,941,157,032.84	2,863,391,495.21
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
累计净值收益率	19.6456%	17.2858%	14.4033%

2、理财金 H

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	63,744,026.27	167,761,248.88	325,929,351.27
本期利润	63,744,026.27	167,761,248.88	325,929,351.27
本期净值收益率	2.0114%	2.5197%	3.5035%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末基金资产净值	3,538,647,231.17	3,710,688,123.27	9,376,677,095.41
期末基金份额净值	100.0000	100.0000	100.0000
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
累计净值收益率	19.6478%	17.2887%	14.4059%

3、理财金 E

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年 6 月 6 日-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	51,278.28	285,796.31
本期利润	51,278.28	285,796.31
本期净值收益率	2.0053%	1.4169%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末

期末基金资产净值	1,442,486.81	3,605,564.57
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末
累计净值收益率	3.4506%	1.4169%

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，由于本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；

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用；

3、本基金收益分配为按日结转份额。

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 基金份额净值收益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	0.5539%	0.0006%	0.3456%	0.0000%	0.2083%	0.0006%
过去六个月	0.9835%	0.0012%	0.6924%	0.0000%	0.2911%	0.0012%
过去一年	2.0120%	0.0016%	1.3819%	0.0000%	0.6301%	0.0016%
过去三年	8.2460%	0.0027%	4.1955%	0.0000%	4.0505%	0.0027%
过去五年	15.2293%	0.0026%	7.0913%	0.0000%	8.1380%	0.0026%
自基金合同生效起至今	19.6456%	0.0034%	8.6771%	0.0000%	10.9685%	0.0034%

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	0.5515%	0.0006%	0.3456%	0.0000%	0.2059%	0.0006%
过去六个月	0.9797%	0.0012%	0.6924%	0.0000%	0.2873%	0.0012%
过去一年	2.0053%	0.0016%	1.3819%	0.0000%	0.6234%	0.0016%
自基金合同	3.4506%	0.0019%	2.1796%	0.0000%	1.2710%	0.0019%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

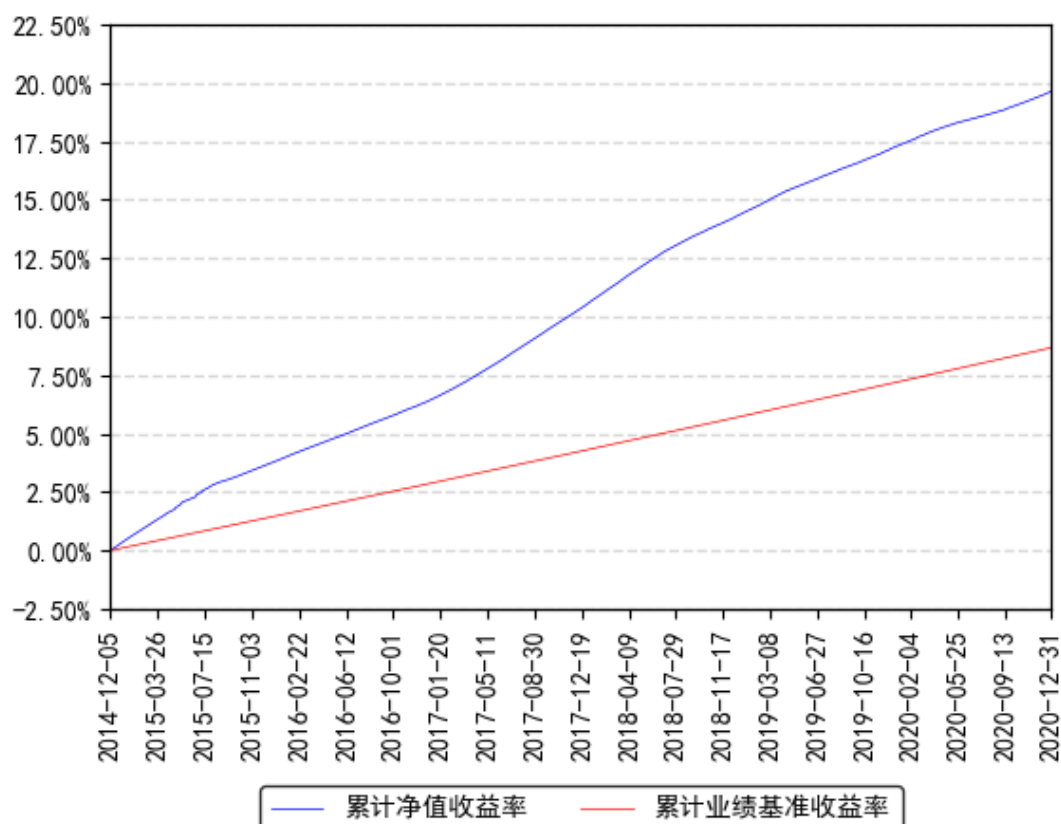
理财金 H

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	0.5539%	0.0006%	0.3456%	0.0000%	0.2083%	0.0006%
过去六个月	0.9833%	0.0012%	0.6924%	0.0000%	0.2909%	0.0012%
过去一年	2.0114%	0.0016%	1.3819%	0.0000%	0.6295%	0.0016%
过去三年	8.2458%	0.0027%	4.1955%	0.0000%	4.0503%	0.0027%
过去五年	15.2284%	0.0026%	7.0913%	0.0000%	8.1371%	0.0026%
自基金合同生效起至今	19.6478%	0.0034%	8.6771%	0.0000%	10.9707%	0.0034%

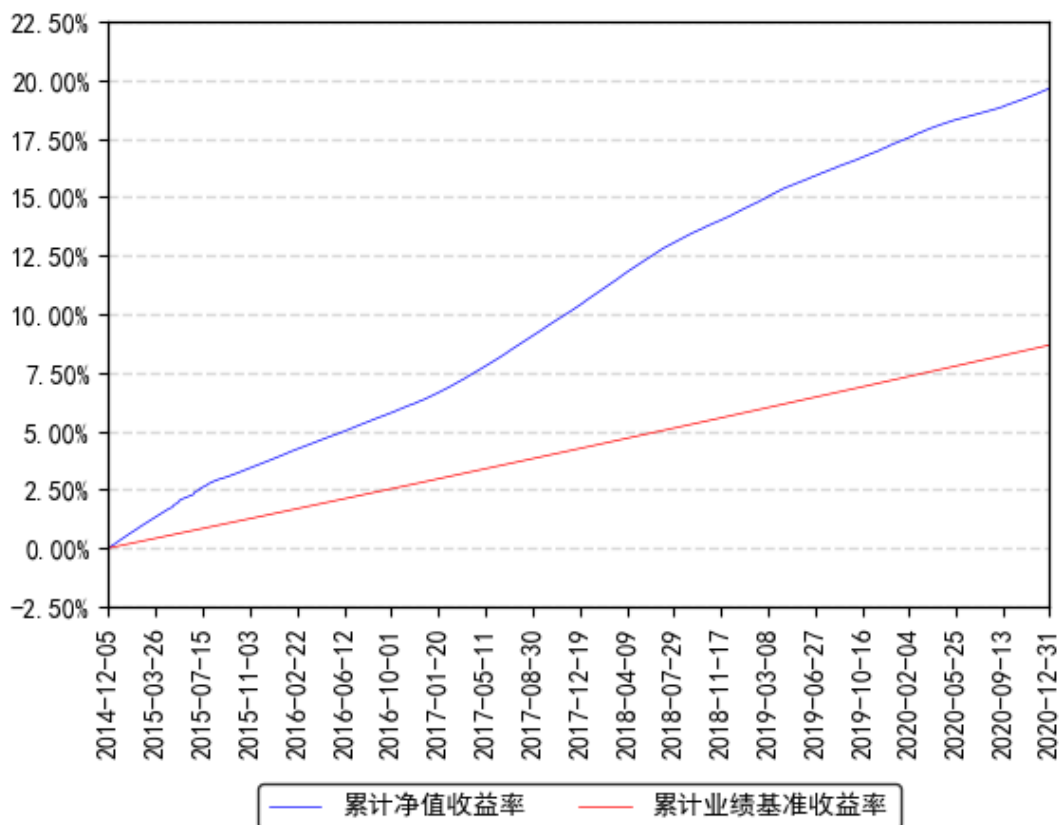
注：本基金收益分配为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

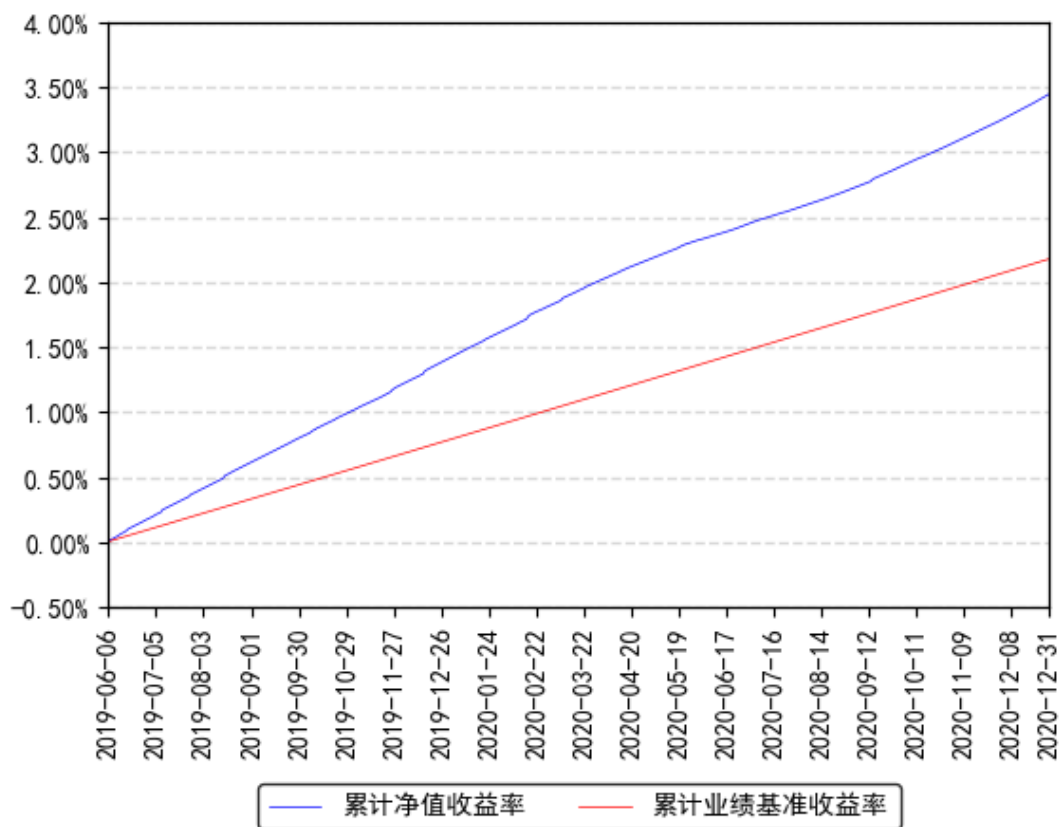
理财金A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

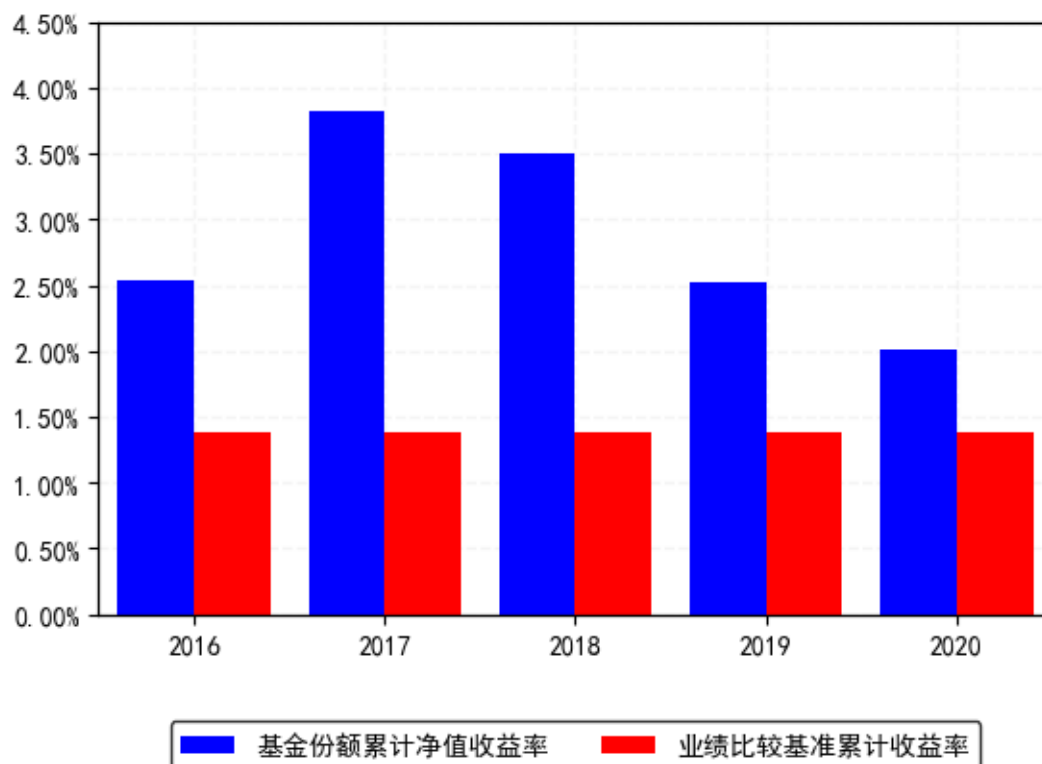


理财金E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

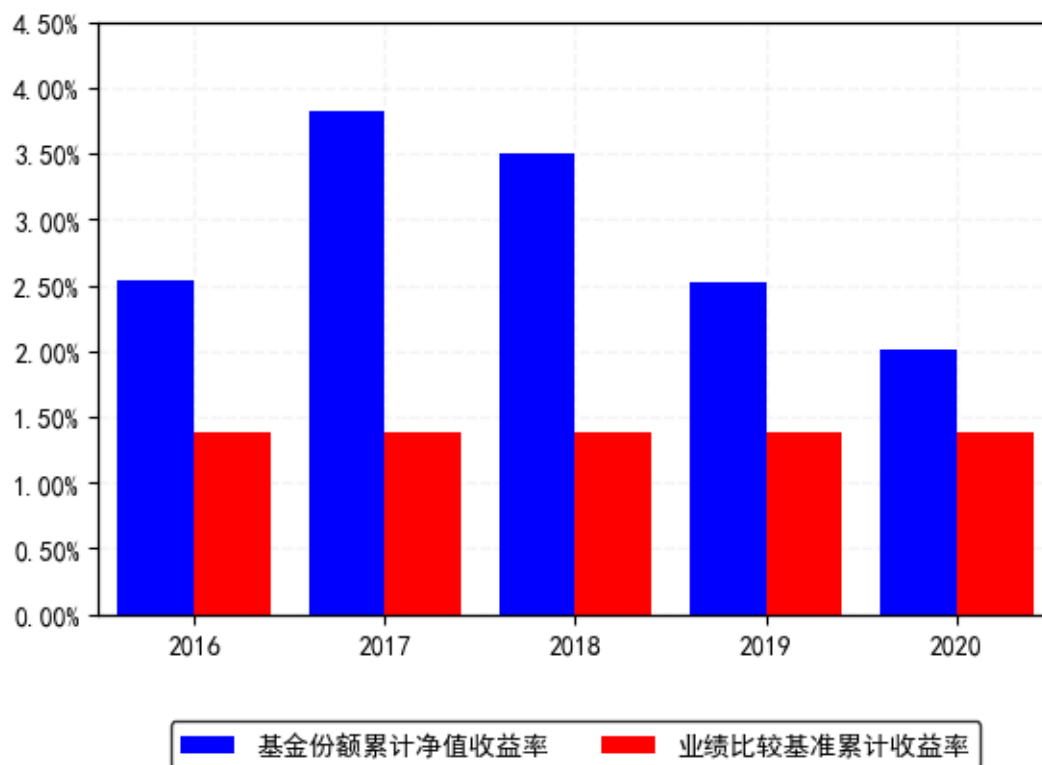


3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

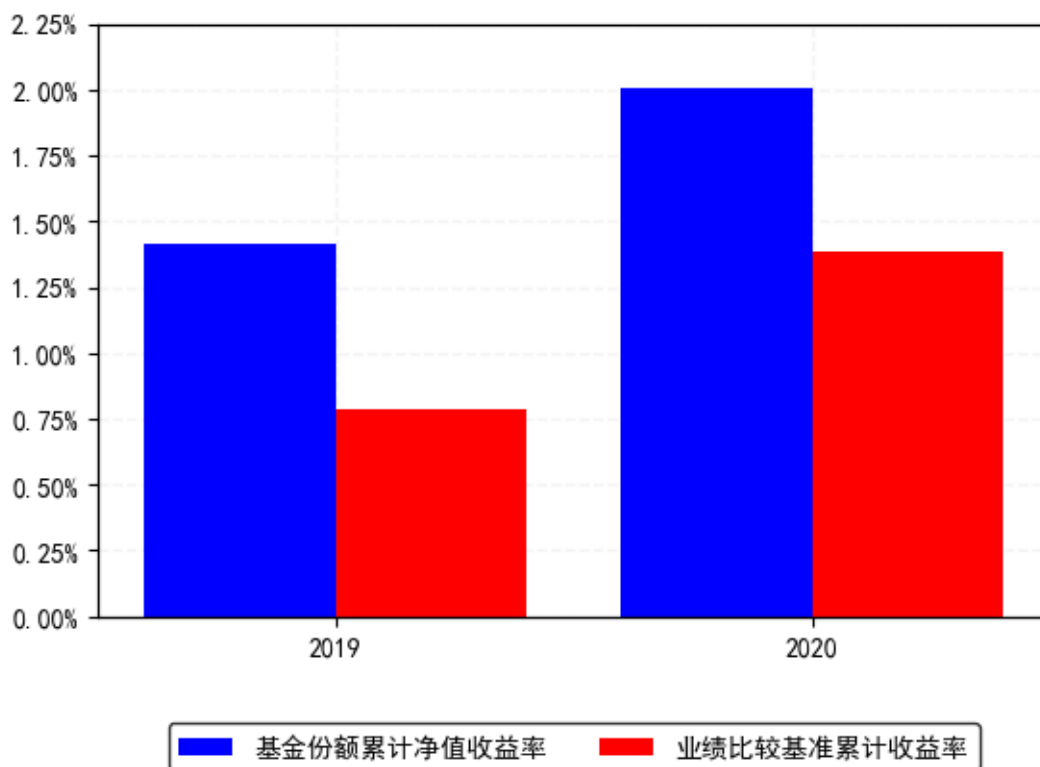
理财金A每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



理财金H每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



理财金E每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

理财金 A

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应 付赎回款转 出金额	应付利润本 年变动	年度利润分配合计	备注
2020 年	356,755,904.21	-	-	356,755,904.21	-
2019 年	130,256,812.00	-	-	130,256,812.00	-
2018 年	118,037,606.96	-	-	118,037,606.96	-
合计	605,050,323.17	-	-	605,050,323.17	-

理财金 H

年度	已按再投资形式	直接通过应	应付利润本	年度利润分配合计	备注

	转实收基金	付赎回款转出金额	年变动		
2020年	63,744,026.27	-	-	63,744,026.27	-
2019年	167,761,248.88	-	-	167,761,248.88	-
2018年	325,929,351.27	-	-	325,929,351.27	-
合计	557,434,626.42	-	-	557,434,626.42	-

理财金 E

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2020年	51,278.28	-	-	51,278.28	-
2019年	285,796.31	-	-	285,796.31	-
合计	337,074.59	-	-	337,074.59	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模近 12000 亿元，旗下管理 233 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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	-	14 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。

4.1.3 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等部分构成。工资由基金经理的 MD 职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，按超出基础创收以上部分的一定比例计提激励奖金，并依据管理产品的实际业绩贡献实施分配。

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最大利益。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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 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3次，是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内方面，2020年受到疫情影响，经济先下后上。前三季度GDP同比增速分别为-6.8%、3.2%、4.9%。1-11月工业增加值同比增长2.3%，在年初触底后逐步回升；固定资产投资累计同比增长2.6%；社会消费品零售总额累计同比下滑4.8%，消费修复滞后于生产。1-11月CPI平均增长2.7%，在食品价格的影响下，全年CPI呈现不断走低的态势；PPI平均下滑2.0%，疫情冲击下，工业品价格低迷，但下半年逐渐筑底回升。11月末M2同比增长10.7%，全年信贷和社融高增长，社融增速上行至近几年的高点，不过目前已经基本见顶。

海外方面，2020年美联储大幅放松货币政策，下调联邦基金利率至0%，同时取消了资产购买上限，推出了一系列政策工具维稳市场。欧央行也推出了较大规模的资产购买计划助力经济修复。国内方面，央行上半年下调公开市场操作利率30BP，下调超额存款准备金利率至0.35%，同时进行降准、再贷款等一系列操作；下半年随着疫情得到控制，政策整体转向中性。全年美元指数下跌6.73%，人民币对美元汇率中间价升值4513个基点。全年银行间隔夜、7天回购加权利率均值为1.66%、2.23%，分别较上年下行58BP和44BP。

市场层面，全年利率债收益率先下后上，收益率曲线变平。其中，1 年国债、1 年国开收益率分别上行 11BP、6BP。3 个月 AAA 等级同业存单利率下行 38BP；6 个月 AAA 等级同业存单利率下行 24BP，1 年 AAA 等级同业存单利率下行 12BP。在基金运作上，上半年市场收益快速下行时期，组合投资中性稳健，采取了适中久期策略，配置上跟随市场以配置中短久期资产为主；下半年货币市场利率曲线逐渐陡峭，货币市场利率中枢逐步上移，投资操作转向积极，在 11 月开始主动增加了中长久期资产配置，为增厚组合收益提供了有力保障。

4.4.2 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 2.0120%，同期业绩基准收益率为 1.3819%；本基金 E 份额净值收益率为 2.0053%，同期业绩基准收益率为 1.3819%；本基金 H 份额净值收益率为 2.0114%，同期业绩基准收益率为 1.3819%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济层面，2021 年将是疫情后全面修复的一年，上半年在国内外需求复苏的带动下，预计经济和通胀将同步走强；下半年受到刺激政策的逐步退出以及信用扩张回落的影响，经济复苏的动能可能会有所减弱。整体来看，国内外经济将较 2020 年出现显著修复。通胀方面，上半年 CPI 仍有回落压力，预计下半年将有所修复；工业品价格筑底回升，预计将带动全年 PPI 中枢出现显著抬升。预计 2021 年全年 CPI 中枢在 1.0%左右，PPI 中枢在 3.0%左右。

政策方面，2020 年受到疫情冲击的影响，全球央行均采取了超常规的宽松政策，推动经济的复苏和维护市场的稳定。随着疫情逐渐得到控制，预计 2021 年全球央行边际上不会进一步放松，但退出进程也将较为审慎。国内方面，中央经济工作会议定调政策“不急转弯”，意味着全年央行的货币政策仍将以稳为主，在信用风险抬升或经济下行压力加大时，不排除再次有所放松的可能。

策略方面，未来半年国内外共振复苏是一致预期，但国内社融增速基本已经见顶，信用扩张将明显放缓。未来全年核心矛盾是复苏的持续性，以及信用扩张见顶对基本面的影响。政策方面，预计货币政策短期内将保持中性偏松，但中长期重心仍将回归基本面；财政政策预计将有所收敛，但依然会比较积极，不会“急转弯”。投资配置方面，关注经济数据变化，预判货币市场利率发展趋势，及时调整组合资产结构，加强持仓债券的跟踪和梳理，严防信用风险；合理运用杠杆工具，保持组合中性久期策略。在保持组合良好流动性的基础上，努力提高静态收益，为广大投资者提供持续稳定的投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵循包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2020 年度发布的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册》、《防控内幕信息及交易管理制度》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理办法（试行）》、《内控稽核工作操作指引》、《异常交易管理制度》、《员工证券投资管理办法》、《离任审计及审查制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在遵循和完善制度机制建设的基础上，本基金管理人积极开展形式丰富的合规培训与考试，加强员工行为规范检查、严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，通过研究监管形势，参考同业先进经验，按照风险为本的工作方法，积极主动的采取有效措施防控洗钱风险。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，强化信息技术在监察稽核及合规管理工作中的运用，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；每日分配收益：本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；本基金场外份额根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零，则增加基金份额持有人基金份额；若当日净收益等于零时，则保持基金份额持有人基金份额不变；若当日基金净收益小于零时，缩减基金份额持有人基金份额；本基金场内份额根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，计入投资人收益账户，投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；当日买入的基金份额自买入当日起享有基金的收益分配权益；当日卖出的基金份额自卖出当日起，不享有基金的收益分配权益；在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益

无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期内应分配收益 420,551,208.76 元，实际分配收益 420,551,208.76 元。

4.9 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 24373 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方理财金交易型货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方理财金交易型货币市场基金(以下简称“南方理财金货币基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方理财金货币基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方理财金货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方理财金货币基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方理财金货币基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层</p>

	<p>计划清算南方理财金货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方理财金货币基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南方理财金货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方理财金货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波 曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方理财金交易型货币市场基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,919,905,592.98	2,840,721,447.28
结算备付金		40,870,178.04	9,739,850.00
存出保证金		47,472.12	7,843.49
交易性金融资产	7.4.7.2	19,362,388,616.88	10,792,867,211.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		19,362,388,616.88	10,612,888,317.31
资产支持证券投资		-	179,978,893.89
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	5,947,991,978.02	1,930,699,816.04
应收证券清算款		-	110,300,000.00
应收利息	7.4.7.5	79,488,389.45	48,106,943.45
应收股利		-	-
应收申购款		1,582,093.17	4,199,660.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		30,352,274,320.66	15,736,642,772.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		290,031,579.95	1,072,444,036.78
应付证券清算款		3,591,631.68	-
应付赎回款		129,916.05	230,526.37
应付管理人报酬		7,415,711.04	3,550,578.68
应付托管费		2,471,903.69	1,183,526.22
应付销售服务费		6,179,759.26	2,958,815.57
应付交易费用	7.4.7.7	171,060.74	134,567.67
应交税费		92,719.34	115,887.22
应付利息		1,692.49	292,113.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	264,300.00	282,000.00
负债合计		310,350,274.24	1,081,192,051.75
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	30,041,924,046.42	14,655,450,720.68
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		30,041,924,046.42	14,655,450,720.68
负债和所有者权益总计		30,352,274,320.66	15,736,642,772.43

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，理财金 A 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 26,501,834,328.44 份；理财金 E 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,442,486.81 份；理财金 H 份额净值 100.0000 元，基金份额总额 35,386,472.31 份；总份额合计 26,538,663,287.56 份。

7.2 利润表

会计主体：南方理财金交易型货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		568,814,155.16	392,995,968.26
1. 利息收入		561,920,189.27	366,024,855.82

其中：存款利息收入	7.4.7.11	132,440,370.28	113,300,299.74
债券利息收入		312,506,938.27	204,184,710.88
资产支持证券利息收入		1,081,737.26	706,530.75
买入返售金融资产收入		115,891,143.46	47,833,314.45
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,893,965.89	26,971,112.44
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	6,893,965.89	26,971,112.44
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-	-
减：二、费用		148,262,946.40	94,692,111.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	63,207,663.62	36,466,839.74
2. 托管费	7.4.10.2.2	21,069,221.28	12,155,613.20
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	52,673,053.06	30,365,701.46
4. 交易费用	7.4.7.15	-	-
5. 利息支出		10,729,134.58	14,992,794.58
其中：卖出回购金融资产支出		10,729,134.58	14,992,794.58
6. 税金及附加		107,123.03	163,749.15

7. 其他费用	7. 4. 7. 16	476, 750. 83	547, 412. 94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		420, 551, 208. 76	298, 303, 857. 19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		420, 551, 208. 76	298, 303, 857. 19

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方理财金交易型货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	14, 655, 450, 720. 68	-	14, 655, 450, 720. 68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	420, 551, 208. 76	420, 551, 208. 76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	15, 386, 473, 325. 74	-	15, 386, 473, 325. 74
其中：1. 基金申购款	373, 934, 857, 537. 76	-	373, 934, 857, 537. 76
2. 基金赎回款	-358, 548, 384, 212. 02	-	-358, 548, 384, 212. 02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-420, 551, 208. 76	-420, 551, 208. 76
五、期末所有者权益(基金净值)	30, 041, 924, 046. 42	-	30, 041, 924, 046. 42
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	12,240,068,590.62	-	12,240,068,590.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	298,303,857.19	298,303,857.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	2,415,382,130.06	-	2,415,382,130.06
其中：1. 基金申购款	102,285,593,434.73	-	102,285,593,434.73
2. 基金赎回款	-99,870,211,304.67	-	-99,870,211,304.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-298,303,857.19	-298,303,857.19
五、期末所有者权益(基金净值)	14,655,450,720.68	-	14,655,450,720.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 杨小松 _____ 徐超 _____ 徐超 _____
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方理财金交易型货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]915号《关于准予南方理财金交易型货币市场基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于2018年1月4日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方理财金交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,555,346,776.51元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第753号验资报告予以验证。

经向中国证监会备案,《南方理财金交易型货币市场基金基金合同》于 2014 年 12 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,556,143,171.44 份基金份额,其中认购资金利息折合 796,394.93 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《南方理财金交易型货币市场基金基金合同》和《南方理财金交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司确定基金合同生效日,即 2014 年 12 月 5 日为本基金 H 类基金份额的份额折算日。当日折算前本基金 H 类基金份额总额为 1,005,131,000.00 份,本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司按照 100:1 的比例对 H 类基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由 H 类基金份额的登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2014 年 12 月 5 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2014]703 号审核同意,本基金 H 类份额 10,051,310 份基金份额于 2015 年 1 月 5 日在上交所挂牌交易。

根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2019 年 6 月 5 日发布的《关于南方理财金交易型货币市场基金新增 E 类基金份额并修改基金合同的公告》以及更新的《南方理财金交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,自 2019 年 6 月 5 日起,本基金增加 E 类基金份额,E 类基金份额通过基金管理人指定的电子交易平台办理申购、赎回等业务。本基金设 A 类、E 类和 H 类三类基金份额,A 类与 E 类为场外基金份额,H 类为场内基金份额。A 类与 E 类基金份额的登记业务由南方基金管理股份有限公司办理;H 类基金份额的登记业务由中国证券登记结算有限责任公司办理。三类基金份额单独设置基金代码,并分别公布每万份基金净收益、7 日年化收益率和运作期年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方理财金交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方

理财金交易型货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券

起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。买入的基金份额享有买入当日的分红权益，而卖出的基金不享有卖出当日的分红权益。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至投资人基金账户。本基金 H 类基金份额以份额面值 100.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至投资人收益账户，投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金

份额一起参加当日的收益分配。收益账户高于 100 元以上的整百元收益于每个工作日转为基金份额支付到投资人的证券账户。投资人赎回基金份额时，其对应比例的累计未付收益立即结清，以现金支付给投资人；若累计未付收益为负值，则从投资人赎回基金款中按比例扣除。投资人卖出部分基金份额时，不支付对应的累计未付收益；但投资人份额全部卖出时，以现金方式将全部累计未付收益结清。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	7,705,592.98	721,447.28
定期存款	4,912,200,000.00	2,840,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	990,000,000.00	970,000,000.00
存款期限 3 个月以上	3,922,200,000.00	1,870,000,000.00

其他存款	-	-
合计	4,919,905,592.98	2,840,721,447.28

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	343,258,785.64	343,405,679.10	146,893.46	0.0005
	银行间市场	19,019,129,831.24	19,040,836,500.00	21,706,668.76	0.0723
	合计	19,362,388,616.88	19,384,242,179.10	21,853,562.22	0.0727
资产支持证券		-	-	-	-
合计		19,362,388,616.88	19,384,242,179.10	21,853,562.22	0.0727
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	169,992,401.07	170,102,000.00	109,598.93	0.0007
	银行间市场	10,442,895,916.24	10,450,898,000.00	8,002,083.76	0.0546
	合计	10,612,888,317.31	10,621,000,000.00	8,111,682.69	0.0553
资产支持证券		179,978,893.89	179,946,000.00	-32,893.89	-0.0002
合计		10,792,867,211.20	10,800,946,000.00	8,078,788.80	0.0551

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,173,487,000.00	-
银行间市场	2,774,504,978.02	-
合计	5,947,991,978.02	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,930,699,816.04	-
合计	1,930,699,816.04	-

交易所买入返售证券余额中包含的交易所固收平台质押式协议回购的余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	60,631.77	6,684.13
应收定期存款利息	31,616,012.13	13,790,666.29
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	18,618.19	4,382.94
应收债券利息	43,597,850.17	30,995,192.35
应收资产支持证券利息	-	1,002,476.72
应收买入返售证券利息	4,195,255.79	2,307,537.52
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	21.40	3.50
合计	79,488,389.45	48,106,943.45

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-3,942.86	-2,083.32
银行间市场应付交易费用	175,003.60	136,650.99
合计	171,060.74	134,567.67

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
信息披露费用	-	-
预提费用	264,300.00	282,000.00
其他	-	-
账户维护费	-	-
审计费	-	-
合计	264,300.00	282,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

理财金 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,941,157,032.84	10,941,157,032.84
本期申购	372,226,494,432.02	372,226,494,432.02
本期赎回（以“-”号填列）	-356,665,817,136.42	-356,665,817,136.42
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	26,501,834,328.44	26,501,834,328.44

理财金 E		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,605,564.57	3,605,564.57
本期申购	38,212,979.47	38,212,979.47
本期赎回（以“-”号填列）	-40,376,057.23	-40,376,057.23
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,442,486.81	1,442,486.81

理财金 H		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,106,881.23	3,710,688,123.27
本期申购	16,701,501.26	1,670,150,126.27
本期赎回（以“-”号填列）	-18,421,910.18	-1,842,191,018.37
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	35,386,472.31	3,538,647,231.17

注：

1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至 2020 年 12 月 31 日止，本基金 H 类基金份额于上交所上市的基金份额为 35,386,472.31 份(2019 年 12 月 31 日：37,106,881.23 份)，无托管在场外未上市交易的 H 类基金份额(2019 年 12 月 31 日：同)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基

基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额全部为场外基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

理财金 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	356,755,904.21	-	356,755,904.21
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-356,755,904.21	-	-356,755,904.21
本期末	-	-	-

理财金 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	51,278.28	-	51,278.28
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-51,278.28	-	-51,278.28
本期末	-	-	-

理财金 H			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	63,744,026.27	-	63,744,026.27
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-63,744,026.27	-	-63,744,026.27
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	3,281,434.49	144,734.61

定期存款利息收入	125,702,018.09	112,017,151.20
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	3,456,626.13	1,137,829.84
其他	291.57	584.09
合计	132,440,370.28	113,300,299.74

7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	35,128,309,160.69	33,175,053,700.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	34,981,844,548.12	32,989,192,470.13
减：应收利息总额	139,570,646.68	158,890,117.98
买卖债券差价收入	6,893,965.89	26,971,112.44

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出资产支持证券成交总额	182,095,560.00	12,256,153.42
减：卖出资产支持证券成本总额	180,000,000.00	12,200,000.00
减：应收利息总额	2,095,560.00	56,153.42
资产支持证券投资收益	-	-

7.4.7.14 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.15 交易费用

本基金本报告期内及上年度可比期间无交易费用。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	135,000.00	153,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,500.00	37,200.00
银行费用	139,050.83	152,087.94
其他	45,200.00	25,125.00

上市费	-	60,000.00
合计	476,750.83	547,412.94

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司(“厦门国际信托”)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司(“深圳投资控股”)	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司(“南方资本”)	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司(“南方东英”)	基金管理人的子公司

注：

1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理股份有限公司关于公司股东及股东出资比例变更的公告》，经南方基金管理股份有限公司(以下简称“南方基金”)股东大会决议，并经中国证监会证监许可[2019]1361号《关于核准南方基金管理股份有限公司变更股权的批复》核准，新增厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)和厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)为南方基金的股东，并于2019年7月31日完成了工商变更登记手续。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-953.62	51.28%	-2,705.16	68.61%
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-889.70	77.98%	-1,751.54	84.07%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	63,207,663.62	36,466,839.74
其中：支付销售机构的客户维护费	29,830,948.91	7,674,450.86

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	21,069,221.28	12,155,613.20

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	理财金 A	理财金 H	理财金 E	合计
华泰证券	9,087.26	-	-	9,087.26
南方基金	523,585.50	-	6,690.78	530,276.28
农业银行	99,217.87	-	-	99,217.87
合计	631,890.63	-	6,690.78	638,581.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	理财金 A	理财金 H	理财金 E	合计
华泰证券	43,709.55	3,961,432.75	-	4,005,142.30
南方基金	1,917,956.81	9,701,255.84	5,396.78	11,624,609.43
中国农业银行	142,262.98	-	-	142,262.98
合计	2,103,929.34	13,662,688.59	5,396.78	15,772,014.71

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类、E 类和 H 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A 类、E 类和 H 类基金份额约定的销售服务费年费率均为 0.25%。此外，根据《南方基金关于旗下南方理财金 E、南方日添益 F 类份额销售服务费优惠的公告》，自 2019 年 6 月 5 日起至 2019 年 9 月 30 日，E 类基金份额销售服务费率调整为 0.01%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 A/E/H 类基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	248,976,093.27	298,207,553.55	-	-	11,713,692,000.00	886,680.38

上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

各关联方名称						
中国农业银行	-	314,031,246.47	-	-	3,776,811,000.00	709,777.61

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	理财金 A	理财金 E	理财金 H
基金合同生效日 (2014 年 12 月 5 日) 持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	1,676,637.74	-	117,280.00
报告期间申购/买入 总份额	3,043,280.19	-	2,359.00
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖 出总份额	4,719,721.61	-	-
报告期末持有的基金 份额	196.32	-	119,639.00
报告期末持有的基金 份额占基金总份额比 例	0.00%	-	0.34%

项目	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
----	----------------------------------

	理财金 A	理财金 E	理财金 H
基金合同生效日 (2014 年 12 月 5 日) 持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	29,265,995.20	-	114,368.00
报告期间申购/买入 总份额	32,410,642.54	-	2,912.00
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖 出总份额	60,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金 份额	1,676,637.74	-	117,280.00
报告期末持有的基金 份额占基金总份额比 例	0.02%	-	0.32%

1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 基金管理人南方基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

3. 报告期末基金份额占比为持有该类别基金份额数占该类别基金份额总额的比例。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位: 份

关联方名称	理财金 E			
	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份 额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的基金份 额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-
厦门国际信托有限公司	-	-	-	-

关联方名称	理财金 H			
	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份 额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的基金份 额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
华泰证券股份有限公司	9,343.00	0.03%	37,525.00	0.10%
厦门国际信托有限公司	74,890.00	0.21%	692,092.00	1.87%
-	-	-	-	-

注:

1. 华泰证券和厦门国际信托投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定支付。

2. 报告期末基金份额占比为持有该类别基金份额数占该类别基金份额总额的比例。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	7,705,592.98	3,281,434.49	721,447.28	27,027,484.06

注：本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中国农业银行	112003177	20 农业银行 CD177	报价发行	2,000,000	197,246,200.00

上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中国农业银行	111903027	19 农业银行 CD027	报价发行	5,000,000	498,775,000.00
中国农业银行	111903210	19 农业银行 CD210	报价发行	1,000,000	98,473,700.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有关联方中国农业银行发行的债券，账面价值为人民币 445,433,411.44 元，占基金资产净值的比例为 1.48% (2019 年 12 月 31 日：本基金持有关联方中国农业银行发行的债券，账面价值为人民币 592,169,529.68 元，占基金资产净值的比例为 4.04%)。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

理财金 A

已按再投资形式转	直接通过应付赎	应付利润本年变	本期利润分配合计	备注

实收基金	回款转出金额	动		
356,755,904.21	-	-	356,755,904.21	-

理财金 E

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润本年变 动	本期利润分配合计	备注
51,278.28	-	-	51,278.28	-

理财金 H

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润本年变 动	本期利润分配合计	备注
63,744,026.27	-	-	63,744,026.27	-

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 200,031,579.95 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总额
200010	20 付息国 债 10	2021 年 1 月 7 日	99.66	2,128,000	212,072,400.17
合计	-	-	-	2,128,000	212,072,400.17

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 90,000,000.00 元，截至 2021 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，投资于各类货币市场工具，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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行；定期存款存放在具有基金托管资格的中信银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司以及股份制商业银行江苏江南农村商业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 55.80%(2019 年 12 月 31 日：67.77%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2020 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 290,031,579.95 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的

20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 1.79%，本基金投资组合的平均剩余期限为 67 天，平均剩余存续期为 67 天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.67%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本

基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	4,919,905,59 2.98	-	-	-	4,919,905,59 2.98
结算备付金	40,870,178.0 4	-	-	-	40,870,178.0 4
存出保证金	47,472.12	-	-	-	47,472.12
交易性金融 资产	17,980,610,5 21.24	1,381,778,09 5.64	-	-	19,362,388,6 16.88
买入返售金 融资产	5,947,991,97 8.02	-	-	-	5,947,991,97 8.02
应收利息	-	-	-	79,488,389.4 5	79,488,389.4 5
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,582,093.17	1,582,093.17
应收证券清 算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	28,889,425,7 42.40	1,381,778,09 5.64	-	81,070,482.6 2	30,352,274,3 20.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	129,916.05	129,916.05
应付管理人 报酬	-	-	-	7,415,711.04	7,415,711.04
应付托管费	-	-	-	2,471,903.69	2,471,903.69
应付证券清 算款	-	-	-	3,591,631.68	3,591,631.68
卖出回购金 融资产款	290,031,579. 95	-	-	-	290,031,579. 95
应付销售服 务费	-	-	-	6,179,759.26	6,179,759.26
应付交易费 用	-	-	-	171,060.74	171,060.74
应付利息	-	-	-	1,692.49	1,692.49
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	92,719.34	92,719.34
其他负债	-	-	-	264,300.00	264,300.00

负债总计	290,031,579.95	-	-	20,318,694.29	310,350,274.24
利率敏感度缺口	28,599,394,162.45	1,381,778,095.64	-	60,751,788.33	30,041,924,046.42
上年度末 2019年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	2,840,721,447.28	-	-	-	2,840,721,447.28
结算备付金	9,739,850.00	-	-	-	9,739,850.00
存出保证金	7,843.49	-	-	-	7,843.49
交易性金融资产	10,673,724,840.26	119,142,370.94	-	-	10,792,867,211.20
买入返售金融资产	1,930,699,816.04	-	-	-	1,930,699,816.04
应收利息	-	-	-	48,106,943.45	48,106,943.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,199,660.97	4,199,660.97
应收证券清算款	-	-	-	110,300,000.00	110,300,000.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,454,893,797.07	119,142,370.94	-	162,606,604.42	15,736,642,772.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	230,526.37	230,526.37
应付管理人报酬	-	-	-	3,550,578.68	3,550,578.68
应付托管费	-	-	-	1,183,526.22	1,183,526.22
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,072,444,036.78	-	-	-	1,072,444,036.78
应付销售服务费	-	-	-	2,958,815.57	2,958,815.57
应付交易费用	-	-	-	134,567.67	134,567.67
应付利息	-	-	-	292,113.24	292,113.24
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	115,887.22	115,887.22
其他负债	-	-	-	282,000.00	282,000.00
负债总计	1,072,444,036.78	-	-	8,748,014.97	1,081,192,051.75

	6.78			1.75
利率敏感度	14,382,449.7	119,142,370.9	-	153,858,589.
缺口	60.29	4		45
				14,655,450.7
				20.68

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-11,341,994.93	-5,541,770.64
	2.市场利率平行下降25个基点	11,379,016.02	5,559,368.25

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于定期存款和于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险敞口。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 19,362,388,616.88 元，无属于第一或第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日：第二层次 10,792,867,211.20 元，无第一或第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2019 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	19,362,388,616.88	63.79
	其中：债券	19,362,388,616.88	63.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,947,991,978.02	19.60
	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	4,960,775,771.02	16.34
4	其他资产	81,117,954.74	0.27
5	合计	30,352,274,320.66	100.00

8.2 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	3.05

	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	290,031,579.95	0.97
	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。

8.2.1 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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

8.3.2 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。

8.3.3 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	33.66	0.98
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）-60 天	22.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）-90 天	17.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）-120 天	7.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）-397 天（含）	19.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.76	0.98

8.4 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。

8.5 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	741,891,116.79	2.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,857,813,760.45	6.18
	其中：政策性金融债	1,857,813,760.45	6.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,328,741,108.10	7.75
6	中期票据	-	-
7	同业存单	14,433,942,631.54	48.05
8	其他	-	-
9	合计	19,362,388,616.88	64.45
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	200206	20 国开 06	6,150,000	612,738,191.48	2.04
2	180208	18 国开 08	5,550,000	557,088,908.04	1.85
3	112004081	20 中国银行 CD081	5,000,000	498,994,798.10	1.66
4	112071698	20 台州银行 CD043	5,000,000	498,300,210.99	1.66
5	112011299	20 平安银行 CD299	5,000,000	497,941,244.69	1.66
6	112009454	20 浦发银行 CD454	4,700,000	462,257,610.56	1.54
7	200010	20 附息国债 10	4,000,000	398,632,331.15	1.33
8	112073349	20 重庆农村商行 CD271	4,000,000	397,939,682.46	1.32
9	112015571	20 民生银行 CD571	4,000,000	394,640,911.41	1.31
10	112021479	20 渤海银行 CD479	4,000,000	394,565,494.87	1.31

8.7 “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	0.2109%
报告期内偏离度的最低值	-0.0580%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0633%

8.7.1 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。

8.7.2 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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 民生银行 CD571（证券代码 112015571）、20 平安银行 CD299（证券代码 112011299）、20 中国银行 CD081（证券代码 112004081）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 民生银行 CD571（证券代码 112015571）

民生银行 2020 年 2 月 14 日公告称，因：1、未按规定履行客户身份识别义务；2、未按规定保存客户身份资料和交易记录；3、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4、与身份不明的客户进行交易。被中国人民银行处以罚款 2360 万元。民生银行 2020 年 9 月 4 日公告称，因违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资、为“四证”不全的房地产项目提供融资、违规为土地储备中心提供融资等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司处以没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元。

3、20 平安银行 CD299（证券代码 112011299）

平安银行 2020 年 2 月 3 日公告称，因汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员、汽车消费贷款风险分类结果不能反映真

实风险水平等行为，中国银行业监督管理委员会深圳监管局对公司处以罚款 720 万元的处分。平安银行 2020 年 10 月 16 日公告称，因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司合计罚款人民币 100 万元

4、20 中国银行 CD081（证券代码 112004081）

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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	47,472.12
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	79,488,389.45
4	应收申购款	1,582,093.17
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	81,117,954.74

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
理财金 A	5,408,162	4,900.34	9,062,038.17	0.03%	26,492,772,290.27	99.97%
理财金 H	3,616	9,786.08	28,758,237.09	81.27%	6,628,235.22	18.73%
理财金 E	55	26,227.03	1,100,540.1	76.29%	341,946.71	23.71%

			0			
合计	5,411,833	4,903.82	38,920,815.36	0.15%	26,499,742,472.20	99.85%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海汽车集团股权投资有限公司-上汽投资-顾瑞 1 号	1,046,660.00	2.97%
2	致诚卓远(珠海)投资管理合伙企业(有限合伙)-致远稳健三十九号私募证券投资基金	700,000.00	1.98%
3	安徽国海投资发展有限公司	545,084.00	1.55%
4	长江金色晚晴(集合型)企业年金计划稳健配置组合-浦发银行	540,822.00	1.53%
5	民生加银基金-招商银行-民生加银基金融新 1 号集合资产管理计划	465,750.00	1.32%
6	招商证券资管-广发证券-招商资管鑫融 2 号集合资产管理计划	418,827.00	1.19%
7	上海稳博投资管理有限公司-稳博红樱桃 14 号私募基金	413,343.00	1.17%
8	招商证券资管-广发证券-招商资管鑫融 1 号集合资产管理计划	398,168.00	1.13%
9	东方汇智资管-中信证券-东方汇智-汇锋 2 号集合资产管理计划	394,997.00	1.12%
10	景顺长城基金-兴业银行-景顺长城基金顺利 1 号集合资产管理计划	374,338.00	1.06%

理财金 H 级份额净值为 100 元。

9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	其他机构	104,666,000.00	0.35%
2	基金类机构	70,000,000.00	0.23%
3	其他机构	59,922,800.00	0.20%
4	其他机构	54,508,600.00	0.18%
5	基金类机构	46,575,000.00	0.16%
6	券商类机构	41,882,700.00	0.14%
7	基金类机构	41,334,300.00	0.14%

8	券商类机构	39,816,800.00	0.13%
9	券商类机构	39,499,700.00	0.13%
10	基金类机构	37,433,800.00	0.12%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	理财金 A	5,292,068.69	0.0200%
	理财金 E	111.07	0.0077%
	理财金 H	2,030.39	0.0057%
	合计	5,294,210.15	0.0199%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	理财金 A	0
	理财金 E	0
	理财金 H	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	理财金 A	0~10
	理财金 E	0
	理财金 H	0
	合计	0~10

§ 10 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
基金合同生效日 (2014 年 12 月 5 日) 基金份额总额	2,551,012,171.44	10,051,310.00	-
本报告期期初基金份额总额	10,941,157,032.84	37,106,881.23	3,605,564.57
本报告期期间基金总申购份额	372,226,494,432.02	16,701,501.26	38,212,979.47
减:本报告期基金总赎回份额	356,665,817,136.42	18,421,910.18	40,376,057.23
本报告期基金拆分变	-	-	-

动份额（份额减少以“-”填列）			
本报告期末基金份额总额	26,501,834,328.44	35,386,472.31	1,442,486.81

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

2020 年 8 月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 6 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 135,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-953.62	51.28%	-
中泰证券	1	-	-	-905.92	48.72%	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	75,585,612.00	7.79%	13,545,849,000.00	16.41%	-	-
中泰证券	894,223,992.70	92.21%	69,022,200,000.00	83.59%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金在江苏银行直销银行平台进行代销的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-08
2	南方基金关于旗下部分基金增加中国人寿为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-10
3	南方理财金交易型货币市场基金 2020 年春节暂停申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-15
4	南方基金管理股份有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同信息披露有关条款的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-16
5	南方基金关于与江苏银行合作在直销银行开通南方理财金 A 基金 T+0 快速赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-17
6	南方基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
7	南方基金关于旗下部分基金增加攀赢基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-02-13
8	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分基金新增扩位证券简称的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-16
9	南方理财金交易型货币市场基金 2020 年清明节暂停申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-26
10	南方理财金交易型货币市场基金 2020 年五一劳动节暂停申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-22
11	南方基金管理股份有限公司关于长春农村商业银行股份有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-05
12	南方基金管理股份有限公司关于成都万华源基金销售有限责任公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-15
13	南方理财金交易型货币市场基金 2020 年端午节暂停申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-16
14	南方基金管理股份有限公司关于深圳宜投基金	上海证券报、基金管	2020-07-23

	销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
15	南方理财金交易型货币市场基金 2020 年中秋节、国庆节暂停申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-22
16	南方基金管理股份有限公司关于中国国际期货股份有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-29
17	南方基金管理股份有限公司关于和谐保险销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
18	南方基金管理股份有限公司关于上海攀赢基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-12-07
19	南方理财金交易型货币市场基金 2021 年元旦暂停申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-12-23

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方理财金交易型货币市场基金的文件；
- 2、《南方理财金交易型货币市场基金基金合同》；
- 3、《南方理财金交易型货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方理财金交易型货币市场基金 2020 年年度报告》原文。

13.2 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。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>