南方理财金交易型货币市场基金 2020 年第 2 季度报告

2020 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

报告送出日期：2020 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 2020 年 7 月 17 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 2020 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	16,512,921,221.36 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	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）。		
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代码	000816	511810	007522
报告期末下属分级基金的份额总额	16,481,695,677.22 份	29,508,176.10 份	1,717,368.04 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（2020 年 4 月 1 日－2020 年 6 月 30 日）		
	理财金 A	理财金 H	理财金 E
1.本期已实现收益	65,187,761.00	13,434,286.81	13,728.52
2.本期利润	65,187,761.00	13,434,286.81	13,728.52
3.期末基金资产净值	16,481,695,677.22	2,950,817,610.31	1,717,368.04

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	0.4316%	0.0009%	0.3418%	0.0000%	0.0898%	0.0009%

过去六个月	1.0185%	0.0019%	0.6848%	0.0000%	0.3337%	0.0019%
过去一年	2.2075%	0.0020%	1.3819%	0.0000%	0.8256%	0.0020%
过去三年	9.3622%	0.0028%	4.1955%	0.0000%	5.1667%	0.0028%
过去五年	15.6732%	0.0028%	7.0913%	0.0000%	8.5819%	0.0028%
自基金合同生效起至今	18.4803%	0.0034%	7.9298%	0.0000%	10.5505%	0.0034%

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	0.4314%	0.0009%	0.3418%	0.0000%	0.0896%	0.0009%
过去六个月	1.0181%	0.0019%	0.6848%	0.0000%	0.3333%	0.0019%
过去一年	2.2063%	0.0020%	1.3819%	0.0000%	0.8244%	0.0020%
过去三年	9.3618%	0.0028%	4.1955%	0.0000%	5.1663%	0.0028%
过去五年	15.6748%	0.0028%	7.0913%	0.0000%	8.5835%	0.0028%
自基金合同生效起至今	18.4828%	0.0034%	7.9298%	0.0000%	10.5530%	0.0034%

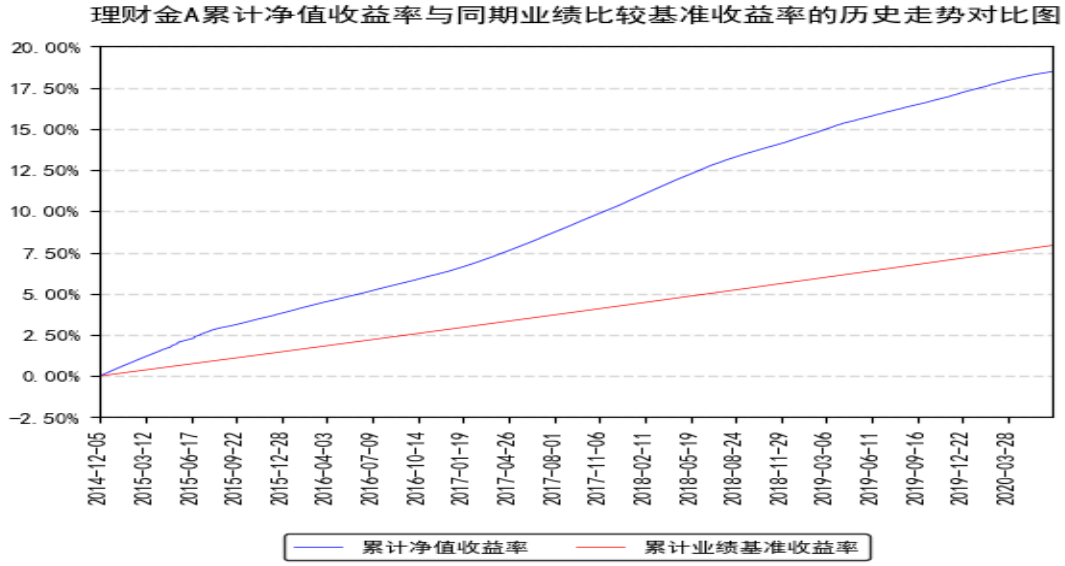
理财金E

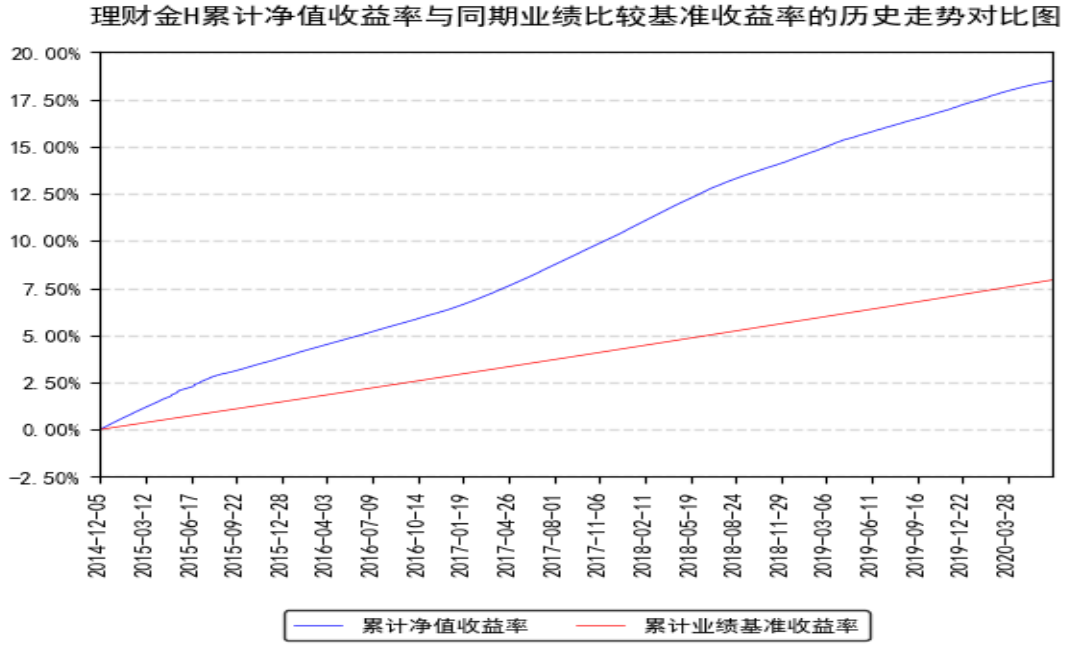
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4294%	0.0010%	0.3418%	0.0000%	0.0876%	0.0010%
过去六个	1.0156%	0.0019%	0.6848%	0.0000%	0.3308%	0.0019%

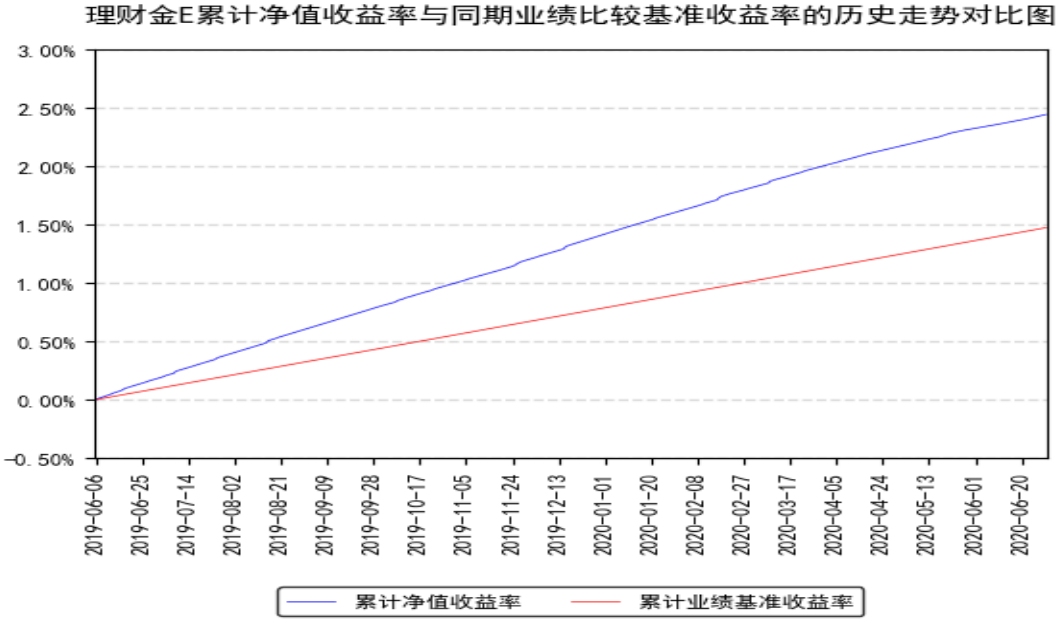
月						
过去一年	2.2656%	0.0021%	1.3819%	0.0000%	0.8837%	0.0021%
自基金合同生效起至今	2.4469%	0.0021%	1.4770%	0.0000%	0.9699%	0.0021%

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







§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	-	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。

4.2 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 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，是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度经济触底回升。1-5 月工业增加值同比下滑 2.8%，其中 4-5 月单月同比已经正增长；固定资产投资累计同比下滑 6.3%；社会消费品零售总额累计同比下滑 13.5%，消费修复相对缓慢。1-5 月 CPI 平均增长 4.1%，二季度随着供需缓解，食品价格回落，带动 CPI 下行；PPI 平均下滑 1.7%，国内需求下行，叠加原油价格暴跌，带动二季度 PPI 大幅下行。5 月末 M2 同比增长 11.1%，二季度信贷和社融增量较一季度回落。

美联储二季度无进一步降息操作，数次会议和发言主要在引导市场预期稳定，目前出现负利率可能性较低。欧央行二季度进一步加大了 PEPP 购买计划，推动疫情后的经济修复。国内央行二季度将超额存款准备金利率从 0.72%调整至 0.35%，同时于季末宣布降低再贷款、再贴现利率 0.25%。二季度美元指数下跌 1.60%，人民币对美元汇率中间价升值 56 个基点。

全季度来看，银行间隔夜、7 天回购加权利率均值为 1.38%、1.76%，分别较上季度下行 29BP 和 57BP。

市场层面，二季度利率债收益率先下后上，曲线扁平化。其中，1 年国债、1 年国开收益率分别上行 49BP、34BP，3 个月 AAA 等级同业存单利率上行 33BP，6 个月 AAA 等级同业存单利率上行 64BP。本基金久期中性积极，在绝对收益较低的市场环境中操作稳健中性，季末收益上行阶段积极配置高收益资产，增厚组合收益静态收益。

展望三季度，我们预计三季度经济仍处于修复区间，但修复斜率较二季度将明显放缓。通胀方面，预计三季度 CPI 回落到 2%左右，PPI 底部回升至-2%左右。目前，资金利率水平已经回升至政策利率附近。由于国内疫情已经基本得到控制，海外疫情的峰值也在逐渐度过，我们认为，货币政策仍将保持在中性偏宽松的水平。货币市场利率中枢回升后将窄幅震荡，本基金将保持中性久期，择时利用好杠杆工具，平衡基金的静态收益和久期风险，稳健提高基金整体收益水平。

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 0.4316%，同期业绩基准收益率为 0.3418%；本基金 H 份额净值收益率为 0.4314%，同期业绩基准收益率为 0.3418%；本基金 E 份额净值收益率为 0.4294%，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	10,291,387,582.22	49.76
	其中：债券	10,291,387,582.22	49.76
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,084,406,943.86	34.26
	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	3,266,447,857.01	15.80
4	其他资产	37,967,494.23	0.18
5	合计	20,680,209,877.32	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	1.98	
	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	649,111,355.44	3.34
	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	85
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	51

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	44.77	6.35
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）-60 天	5.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）-90 天	14.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）-120 天	6.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）-397 天（含）	34.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮	-	-

	动利率债		
	合计	106.22	6.36

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	975,606,614.69	5.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	494,563,592.75	2.54
	其中：政策性金融债	494,563,592.75	2.54
4	企业债券	50,245,250.10	0.26
5	企业短期融资券	3,138,647,504.08	16.15
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,632,324,620.60	28.98
8	其他	-	-
9	合计	10,291,387,582.22	52.95
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	019627	20 国债 01	5,630,000	565,987,012.21	2.91
2	112099765	20 徽商银行 CD039	4,000,000	397,343,825.11	2.04
3	112008009	20 中信银行 CD009	4,000,000	395,960,471.51	2.04
4	112092531	20 天津银行 CD005	3,200,000	318,749,380.40	1.64
5	072000142	20 平安证券 CP006	3,000,000	300,000,105.47	1.54
6	112081366	20 郑州银行 CD098	3,000,000	299,691,381.12	1.54
7	112014070	20 江苏银行 CD070	3,000,000	295,315,418.97	1.52
8	112008006	20 中信银行 CD006	3,000,000	294,948,144.57	1.52
9	200206	20 国开 06	2,100,000	209,322,559.07	1.08
10	112093507	20 大连银行 CD039	2,100,000	208,924,538.15	1.08

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	0.2109%
报告期内偏离度的最低值	-0.0449%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1044%

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 20 中信银行 CD006（证券代码 112008006）、20 中信银行 CD009（证券代码 112008009）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、20 中信银行 CD006（证券代码 112008006）

2019 年 7 月 3 日，中国银行保险监管管理委员会对中信银行未按规定提供报表且逾期未改正；错报、漏报银行业监管统计资料；未向监管部门报告重要信息系统运营中断事件等违规情况，予以行政处罚，没收违法所得 33.6677 万元，罚款 2190 万元，合计 2223.6677 万元。

2020 年 5 月 9 日，中国银保监会消费者权益保护局因中信银行在未经客户本人授权的情况下，向第三方提供个人银行账户交易明细，对中信银行启动立案调查程序。

2020 年 5 月 9 日，中信银行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，被中国银行保险监管管理委员会罚款 160 万元

2020 年 2 月 21 日，银保监会北京监管局因违规发放土地储备贷款等 19 项违规情形对中信银行股份有限公司处以责令改正，并给予合计 2020 万元罚款的行政处罚。

2、20 中信银行 CD009（证券代码 112008009）

2019 年 7 月 3 日，中国银行保险监管管理委员会对中信银行未按规定提供报表且逾期未改正；错报、漏报银行业监管统计资料；未向监管部门报告重要信息系统运营中断事件等违规情况，予以行政处罚，没收违法所得 33.6677 万元，罚款 2190 万元，合计 2223.6677 万元。

2020 年 5 月 9 日，中国银保监会消费者权益保护局因中信银行在未经客户本人授权的情况下，向第三方提供个人银行账户交易明细，对中信银行启动立案调查程序。

2020 年 5 月 9 日，中信银行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，被中国银行保险监管管理委员会罚款 160 万元

2020 年 2 月 21 日，银保监会北京监管局因违规发放土地储备贷款等 19 项违规情形对中信银行股份有限公司处以责令改正，并给予合计 2020 万元罚款的行政处罚。

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	4,782.81
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	34,468,071.52
4	应收申购款	3,494,639.90
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	37,967,494.23

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	13,708,470,228.45	31,898,111.40	5,021,373.42
报告期期间基金总申购份额	66,582,626,452.10	1,744,294.87	13,445,092.48
报告期期间基金总赎回份额	63,809,401,003.33	4,134,230.17	16,749,097.86

报告期期末基金份额总额	16,481,695,677.22	29,508,176.10	1,717,368.04

§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	2020 年 4 月 1 日	280.47	280.47	0.00%
2	分红	2020 年 4 月 2 日	243.55	243.55	0.00%
3	分红	2020 年 4 月 3 日	270.69	270.69	0.00%
4	分红	2020 年 4 月 7 日	974.08	974.08	0.00%
5	分红	2020 年 4 月 8 日	341.39	341.39	0.00%
6	分红	2020 年 4 月 9 日	234.88	234.88	0.00%
7	分红	2020 年 4 月 10 日	263.15	263.15	0.00%
8	分红	2020 年 4 月 13 日	716.52	716.52	0.00%
9	分红	2020 年 4 月 14 日	324.02	324.02	0.00%
10	分红	2020 年 4 月 15 日	306.59	306.59	0.00%
11	分红	2020 年 4 月 16 日	229.79	229.79	0.00%
12	分红	2020 年 4 月 17 日	258.22	258.22	0.00%
13	分红	2020 年 4 月 20 日	776.23	776.23	0.00%
14	分红	2020 年 4 月 21 日	228.50	228.50	0.00%
15	分红	2020 年 4 月 22 日	227.41	227.41	0.00%
16	分红	2020 年 4 月 23 日	234.61	234.61	0.00%
17	分红	2020 年 4 月 24 日	293.36	293.36	0.00%
18	分红	2020 年 4 月 27 日	661.15	661.15	0.00%
19	分红	2020 年 4 月 28 日	223.52	223.52	0.00%
20	分红	2020 年 4 月 29 日	219.17	219.17	0.00%
21	分红	2020 年 4 月 30 日	221.77	221.77	0.00%
22	分红	2020 年 5 月 6 日	1,345.69	1,345.69	0.00%
23	分红	2020 年 5 月 7 日	207.65	207.65	0.00%
24	分红	2020 年 5 月 8 日	279.19	279.19	0.00%
25	分红	2020 年 5 月 11 日	675.37	675.37	0.00%
26	分红	2020 年 5 月 12 日	285.30	285.30	0.00%
27	分红	2020 年 5 月 13 日	236.16	236.16	0.00%
28	分红	2020 年 5 月 14 日	216.94	216.94	0.00%
29	分红	2020 年 5 月 15 日	244.38	244.38	0.00%
30	分红	2020 年 5 月 18 日	622.07	622.07	0.00%
31	分红	2020 年 5 月 19 日	327.73	327.73	0.00%
32	分红	2020 年 5 月 20 日	359.71	359.71	0.00%
33	分红	2020 年 5 月 21 日	278.83	278.83	0.00%
34	分红	2020 年 5 月 22 日	289.65	289.65	0.00%
35	分红	2020 年 5 月 25 日	664.59	664.59	0.00%

36	分红	2020 年 5 月 26 日	238.46	238.46	0.00%
37	分红	2020 年 5 月 27 日	199.45	199.45	0.00%
38	分红	2020 年 5 月 28 日	206.40	206.40	0.00%
39	分红	2020 年 5 月 29 日	180.64	180.64	0.00%
40	分红	2020 年 6 月 1 日	515.43	515.43	0.00%
41	分红	2020 年 6 月 2 日	110.02	110.02	0.00%
42	分红	2020 年 6 月 3 日	165.24	165.24	0.00%
43	分红	2020 年 6 月 4 日	176.77	176.77	0.00%
44	分红	2020 年 6 月 5 日	201.18	201.18	0.00%
45	分红	2020 年 6 月 8 日	518.79	518.79	0.00%
46	分红	2020 年 6 月 9 日	187.70	187.70	0.00%
47	分红	2020 年 6 月 10 日	180.01	180.01	0.00%
48	分红	2020 年 6 月 11 日	177.83	177.83	0.00%
49	分红	2020 年 6 月 12 日	178.22	178.22	0.00%
50	分红	2020 年 6 月 15 日	530.01	530.01	0.00%
51	分红	2020 年 6 月 16 日	214.92	214.92	0.00%
52	分红	2020 年 6 月 17 日	168.06	168.06	0.00%
53	分红	2020 年 6 月 18 日	168.18	168.18	0.00%
54	分红	2020 年 6 月 19 日	186.62	186.62	0.00%
55	分红	2020 年 6 月 22 日	560.43	560.43	0.00%
56	赎回	2020 年 6 月 23 日	4,719,161.18	4,719,161.18	0.00%
57	分红	2020 年 6 月 23 日	194.34	194.34	0.00%
58	赎回	2020 年 6 月 24 日	560.43	560.43	0.00%
59	分红	2020 年 6 月 24 日	0.03	0.03	0.00%
60	分红	2020 年 6 月 29 日	0.05	0.05	0.00%
61	分红	2020 年 6 月 30 日	0.01	0.01	0.00%
62	分红	2020 年 4 月 1 日	7.00	700.00	0.00%
63	分红	2020 年 4 月 2 日	6.00	600.00	0.00%
64	分红	2020 年 4 月 3 日	7.00	700.00	0.00%
65	分红	2020 年 4 月 7 日	25.00	2,500.00	0.00%
66	分红	2020 年 4 月 8 日	8.00	800.00	0.00%
67	分红	2020 年 4 月 9 日	6.00	600.00	0.00%
68	分红	2020 年 4 月 10 日	7.00	700.00	0.00%
69	分红	2020 年 4 月 13 日	18.00	1,800.00	0.00%
70	分红	2020 年 4 月 14 日	8.00	800.00	0.00%
71	分红	2020 年 4 月 15 日	8.00	800.00	0.00%
72	分红	2020 年 4 月 16 日	5.00	500.00	0.00%
73	分红	2020 年 4 月 17 日	7.00	700.00	0.00%
74	分红	2020 年 4 月 20 日	19.00	1,900.00	0.00%
75	分红	2020 年 4 月 21 日	6.00	600.00	0.00%
76	分红	2020 年 4 月 22 日	6.00	600.00	0.00%
77	分红	2020 年 4 月 23 日	6.00	600.00	0.00%
78	分红	2020 年 4 月 24 日	7.00	700.00	0.00%

79	分红	2020 年 4 月 27 日	17.00	1,700.00	0.00%
80	分红	2020 年 4 月 28 日	5.00	500.00	0.00%
81	分红	2020 年 4 月 29 日	6.00	600.00	0.00%
82	分红	2020 年 4 月 30 日	5.00	500.00	0.00%
83	分红	2020 年 5 月 6 日	34.00	3,400.00	0.00%
84	分红	2020 年 5 月 7 日	5.00	500.00	0.00%
85	分红	2020 年 5 月 8 日	7.00	700.00	0.00%
86	分红	2020 年 5 月 11 日	17.00	1,700.00	0.00%
87	分红	2020 年 5 月 12 日	7.00	700.00	0.00%
88	分红	2020 年 5 月 13 日	6.00	600.00	0.00%
89	分红	2020 年 5 月 14 日	6.00	600.00	0.00%
90	分红	2020 年 5 月 15 日	6.00	600.00	0.00%
91	分红	2020 年 5 月 18 日	15.00	1,500.00	0.00%
92	分红	2020 年 5 月 19 日	9.00	900.00	0.00%
93	分红	2020 年 5 月 20 日	9.00	900.00	0.00%
94	分红	2020 年 5 月 21 日	7.00	700.00	0.00%
95	分红	2020 年 5 月 22 日	7.00	700.00	0.00%
96	分红	2020 年 5 月 25 日	17.00	1,700.00	0.00%
97	分红	2020 年 5 月 26 日	5.00	500.00	0.00%
98	分红	2020 年 5 月 27 日	5.00	500.00	0.00%
99	分红	2020 年 5 月 28 日	6.00	600.00	0.00%
100	分红	2020 年 5 月 29 日	4.00	400.00	0.00%
101	分红	2020 年 6 月 1 日	13.00	1,300.00	0.00%
102	分红	2020 年 6 月 2 日	3.00	300.00	0.00%
103	分红	2020 年 6 月 3 日	4.00	400.00	0.00%
104	分红	2020 年 6 月 4 日	4.00	400.00	0.00%
105	分红	2020 年 6 月 5 日	5.00	500.00	0.00%
106	分红	2020 年 6 月 8 日	13.00	1,300.00	0.00%
107	分红	2020 年 6 月 9 日	5.00	500.00	0.00%
108	分红	2020 年 6 月 10 日	5.00	500.00	0.00%
109	分红	2020 年 6 月 11 日	4.00	400.00	0.00%
110	分红	2020 年 6 月 12 日	5.00	500.00	0.00%
111	分红	2020 年 6 月 15 日	13.00	1,300.00	0.00%
112	分红	2020 年 6 月 16 日	5.00	500.00	0.00%
113	分红	2020 年 6 月 17 日	5.00	500.00	0.00%
114	分红	2020 年 6 月 18 日	4.00	400.00	0.00%
115	分红	2020 年 6 月 19 日	4.00	400.00	0.00%
116	分红	2020 年 6 月 22 日	14.00	1,400.00	0.00%
117	分红	2020 年 6 月 23 日	5.00	500.00	0.00%
118	分红	2020 年 6 月 24 日	6.00	600.00	0.00%
119	分红	2020 年 6 月 29 日	27.00	2,700.00	0.00%
120	分红	2020 年 6 月 30 日	5.00	500.00	0.00%
合计	-	-	4,739,052.73	4,789,542.73	-

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 2020 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