# 南方中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期 证券投资基金 2025 年第 3 季度报告

2025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: 2025年10月28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 2025 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2025年7月1日起至9月30日止。

# § 2 基金产品概况

基金简称	南方中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	014430
交易代码	014430
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月20日
报告期末基金份额总额	7,454,120,634.45 份
	本基金采用被动式指数化投资,通过严格的
投资目标	投资纪律约束和数量化的风险管理手段,以
	实现对标的指数的有效跟踪。
	本基金为被动式指数基金,采用抽样复制和
	动态最优化的方法,选取标的指数成份券和
	备选成份券中流动性较好的同业存单,构造
投资策略	与标的指数风险收益特征相似的资产组合,
	以实现对标的指数的有效跟踪。具体投资策
	略包括: 1、资产配置策略; 2、债券投资策
	略; 3、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行
业坝比权举任	人民币一年定期存款利率(税后)×5%
	本基金主要采用抽样复制和动态最优化的
	方法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、
风险收益特征	以及标的指数所代表的市场相似的风险收
	益特征。一般而言,本基金的长期平均风险
	和预期的收益率低于股票型基金和偏股混

	合型基金, 高于货币市场基金。
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

# §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(2025年7月1日-2025年9月 30日)
1.本期已实现收益	17,756,470.79
2.本期利润	17,150,466.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0033
4.期末基金资产净值	8,072,476,728.05
5.期末基金份额净值	1.0830

- 注: 1、基金业绩指标不包括持有人认(申)购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
- 2、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。

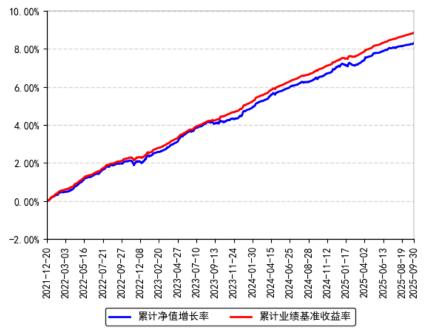
#### 3.2 基金净值表现

#### 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

阶段	净值增长 率①	净值增长 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	①-③	2-4
过去三个 月	0.31%	0.01%	0.41%	0.00%	-0.10%	0.01%
过去六个	0.85%	0.01%	0.94%	0.01%	-0.09%	0.00%
过去一年	1.74%	0.02%	1.88%	0.01%	-0.14%	0.01%
过去三年	6.21%	0.02%	6.61%	0.01%	-0.40%	0.01%
自基金合 同生效起 至今	8.30%	0.02%	8.85%	0.01%	-0.55%	0.01%

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	基金经理期限	证券从业年	说明
<b>姓右</b>		任职日期	离任日期	限	W 193
夏晨曦	本基金基金经理	2021 年 12月 20日	-	20年	香学具业年南担程定员员任券部定决副车港理有资5方任研收风等现指总收策主6月技士从6分子基金究益险职金数经益委席月技士从6分分曾工固究制现债资固资会8日7月

月20日 固定较多 2013 年 22 日 21 年 21 日 2015 年 13 日,元 经理 13 日,元 经理 13 日,元 经理 14 年 7月 至 2016 月 17 日 南方金 2014 3 月 15 2016 4 月 15 南方至 2014 3 月 15 2019 4 月 15 日 南方女 2014 3 月 15 日 南方女 2014 3 月 15 日 南方女 2014 3 月 15 日 南方女 2016 日 17 日 日 18 日 18		1	Т
固定收资经 2013 年 22 日至年 12月 任 南			至 2012 年 7
投资经 2013 年 22 日至 年12月 任南方 30 天型 月 20 2015 年 13 日, 方網理; 年7月 至 2016 月 17 日 南方金 2014 月 5 2016 月 17 日 南方型 基金全 2012 月 19 2019 4 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方建 金 2014 月 15 日 南方建 金 2014 月 15 日 南方理 表金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 百 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日			月 20 日,任
2013年 21日至 年12月 任南方 30天寿 理 2012 月 20 2015年 13日, 方理理;年7月 至 2016月 月 17日 南方 基基金 2014月 月 5 2016日 月 17日 南方理 基金全 2012月 月 19 2019月 月 15日 南方理 天基金 2014月 月 15日 南方世 五十二 五十二 五十二 五十二 五十二 五十二 五十二 五十二			固定收益部
22 日至年12月任南方30 天基理 2013月 20 2015年 13 日,方須理;年7月至 2016月 17日南方金金 2014 4月 5 2016 4月 17日南方方理 基金经 2012 4月 19日 2019 4月 15日南方理 天基金 2014 4月 15日南方理 3日至 3日			投资经理;
年12月 任南方 30 天基 理。2015 年 13 日, 方涧元 经理; 年7月 至2016 月 17日 南方 基金公 2014 月 5 2016 月 17日 南方理 基金公 2012 月 19 2019 月 15日 南方理 天基金 2014 月 15日 南方理 天基金 2014 月 15日 南方理 天基金 2014 月 15日 南方四 日 15日 南方四 日 15日 南方如 日 15日 南方四 日 15日 日			2013年1月
任南方 30 天基 理 2012 月 20 2015 年 13 日,方河元 经理;年7月 至 2016 月 17 日南方 金型 2014 4 月 5 2016 4 月 17 日南方 基金经 2012 3 月 19 2019 4 月 15 日南方理 天基金。2014 4 月 15 2019 4 月 15 日南方 地址 基金经 2016 年 3 日至			22 日至 2014
30 天基 理 2012 月 20 2015 年 13 日, 方利元 经理: 年 7 月 至 2016 月 17 日 南方 基 金 2014 月 5 2016 月 17 日 南方理 基金金 2014 月 5 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 5 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方理 天基金 2014 月 15 日 南方世 天 2016 月 15 日 南方世 日 17 日 南方世 日 17 日 南方世 日 17 日 日 18 日 日 日 日 18 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日			年12月15日,
理 2015年13日,方润元经理;年7月至2016月17日南方新基金经2014名月5日南方新基金金2012名月192019名月15日南方理天基金2014名月15日南方理天基金2014名月15日南方理			任南方理财
月 20 2015年13日,方润元经理;年7月至2016月17日南方新基金全2014。月 5 2016。月 7 日南东经2014。月 5 2019。月 15 日南方建长之2014。月 15 日南方处经2016年3日至			30 天基金经
2015年 13日,方祖子 经理; 年7月 至2016 月17日 南方蘇基 全2014 月5 2016 月17日 南方金经 2012 月19 2019 月15日 南方墨 金2014 月15日 南方继 金2014 月15日 南方 经 2014 月15日 南方 经 2016年 3日至 3日至 3日至 3日至 3日至 3日至 3日至 3日至 3日至 3日至			理, 2012年7
13 日,方润元经理;年7月至2016月17日南方新基金经2014。 月 5 2016。 月 17日南东 基金经2012。 月 17日南东 基金经2012。 月 19 2019。 月 15日南东 基金。 2014。 月 15日南东 经2014。 月 15日南东 经2016年 3日至			月 20 日至
方润元经理; 年7月至2016月17日南方新基本经2014月5日南方新基本经2016月17日南方金经2016月17日南方安经2012月19日15日南方理天基金。2014月15日南方理天基金。2014月15日南方收基金经2016年3日至			2015年1月
经理; 年7月 至2016 月17日 南方新基金金 2014 3 月 5 2016 3 月 17日 南方金经 2012 3 月 19 2019 3 月 15日 南方理 天基金。 2014 4 月 15 2019 4 月 15日 南方收基金经 2016年 3 日至			13 日, 任南
年7月至2016 月17日南方新基金经 2014 3 月5 2016 4 月17日南方理基金经 2012 3 月19 2019 3 月15日南方理 天基金。 2014 3 月15日南方理 天基金。 2014 3 月15日南方地			方润元基金
至 2016 月 17 日 南方蘇基金经 2014 月 5 2016 4 月 17 日 南方理 基金经 2012 3 月 19 2019 4 月 15 日 南方理 天基金 2014 3 月 15 日 南方收 基金经 2019 3 月 15 日 高子 2019 3 月 15 日 高子 2019 3 月 15 日 高子 2019 3 月 15 日 高子 2019 3 月 15 日 高子 2019 3 月 15 日 高子 2019 3 月 15 日 3 日 3 日 3 日 3 日 3 日 3 日 3 日 3 日 3 日 3			经理; 2014
月 17 日 南方新基金经2014 名 月 5 2016 名 月 17 日南方理基金经2012 名 月 19 2019 名 月 15 日南方理 天基金。2014 名 月 15 日南方理 天基金。2014 名 月 15 日南方收基金经2016 年 3 日至			年7月25日
南方新基金经 2014 3 月 5 2016 4 月 17 日 南方理 基金经 2012 4 月 19 2019 3 月 15 日 南方理 天基金。 2014 3 月 15 2019 4 月 15 日 南方收基金经 2016 年 3 日至			至2016年11
基金经2014 3 月 5 2016 4 月 17 日南方理基金经2012 3 月 19 2019 3 月 15 日南方理天基金: 2014 3 月 15 日南方收基金经2016 年 3 日至			月 17 日,任
2014 名 月 5 2016 名 月 17 日 南方理 基金经 2012 名 月 19 2019 名 月 15 日 南方理 天基金 2014 名 月 15 2019 名 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			南方薪金宝
月 5 2016 名 月 17 日 南方理基金经 2012 名 月 19 2019 名 月 15 日 南方理 天基金 2014 名 月 15 日 南方收基金经 2016 年 3 日至			基金经理;
2016 名 月 17 日 南方理 基金经 2012 名 月 19 2019 名 月 15 日 南方理 天基金 2014 名 月 15 2019 名 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			2014 年 12
月 17 日南方理基金经2012 名月 19 2019 名月 15 日南方理天基金: 2014 名月 15 日南方收基金经2016 年 3 日至			月 5 日至
南方理基金经 2012 名 月 19 2019 名 月 15 日 南方理 天基金: 2014 名 月 15 2019 名 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			2016 年 11
基金经2012 3月 19 2019 3月 15 日南方理 天基金3 2014 3月 15 日南方收基金经2016 年 3 日至			月 17 日,任
2012 名 月 19 2019 名 月 15 日 南方理 天基金: 2014 名 月 15 2019 名 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			南方理财金
月 19 2019 名 月 15 日 南方理 天基金: 2014 名 月 15 日 南方收			基金经理;
2019 名 月 15 日 南方理 天基金: 2014 名 月 15 2019 名 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			2012 年 10
月 15 日 南方理 天基金: 2014 名 月 15 2019 名 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			月 19 日至
南方理 天基金: 2014 <sup>4</sup> 月 15 2019 <sup>4</sup> 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			2019 年 10
天基金: 2014 名 月 15 2019 名 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			月 15 日,任
2014 名 月 15 2019 名 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			南方理财 60
月 15 2019 名 月 15 日 南方收基金经 2016 年 3 日至			天基金经理;
2019 名 月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			2014 年 12
月 15 日 南方收 基金经 2016 年 3 日至			月 15 日至
南方收基金经 2016年 3 日至			2019 年 10
基金经2016年3日至			月 15 日,任
2016年3日至			南方收益宝
3 日至			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;			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: 2020年3
		月 5 日至
		2023年6月
		19 日,任南

方 0-5 年江
苏城投债基
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;
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; 2023
年 6 月 19 日
至今,任南方
现金增利基
金经理; 2025
年7月4日至
今,任南方理
财 金 货 币
ETF 基金经
理。
女,英国约克
大学商业金
融与管理硕
士,具有基金
从业资格。曾
先后就职于
泰达宏利基
金交易部和
中国光大银
行资产管理
部,历任债券
交易员、固定
收益投资经

					理。2019年
					11 月加入南
					方基金; 2020
					年 5 月 22 日
					至 2023 年 12
					月29日,任
					南方 1-5 年
					国开债基金
					经理; 2020
					年 5 月 22 日
					至今,任南方
					1-3年国开债、
					南方 3-5 年
					农发债、南方
					7-10 年国开
					债、南方 0-5
					年江苏城投
					债基金经理;
					2020年8月
					21 日至今,
					任南方 0-2
					年国开债基
					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; 2022
					年12月21日
					至今,任南方
					中证政策性
					金融债指数
					基金经理。
<b>注.</b> 1	首任基全经理的	九年111111111111111111111111111111111111	<b>其</b>	<b>巨红其</b>	門的任职日期以

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

宏观基本面层面,经济延续温和复苏的态势,消费和出口呈现出一定韧性,较好支撑经济增速。进入三季度以后,在"反内卷"大背景下,物价数据也出现低位回升的迹象,促进经济温和向好的因素不断积累。但是,我们也需要关注到经济复苏面临的不确定性一方面,经济数据结构上仍是生产端强于需求端,需求端的可持续性尚待观察。另一方面,三季度以来中美关系缓和的叙事逻辑正发生边际变化,关税摩擦始终是对外出口面临的潜在逆风。整体而言,国内经济复苏进程仍将继续,但复苏斜率存在不确定性,债券市场大概率不具备转能的基础。

货币政策层面,央行对资金面仍呈现呵护态度,关键时点进行大量公开市场投放,熨平资金面波动。9月下旬调整 14 天期逆回购投标方式,进一步明确 7 天期逆回购利率的政策利率地位,客观上也有助于降低银行跨季融资成本。三季度虽然没有新增降准降息,但潘行长公开表示货币政策决策是基于经济数据,目前 PMI 持续低于荣枯线以下,如果中美关税摩擦升温,四季度或可期待新的降准降息落地,宽货币仍处于进行时。

市场层面,季度内资金面维持宽松,同业存单始终具备套息价值。虽然在季末受到供给压力和跨季资金价格扰动影响,同业存单收益率小幅上行,但是上行幅度符合季节性规律。报告期内,银行间隔夜回购加权利率均值为1.43%,较上季度下行约15BP,7天回购加权利率均值为1.53%,较上季度下行约16BP。3个月、9个月和12个月的AAA级同业存单收益率分别下行约8bp、上行约3bp、上行约4bp。基金运作上,报告期内,本基金密切跟踪指数,并根据成份券变更和规模的变动进行小幅的调整,有效实现了对指数的跟踪。

展望未来,同业存单在流动性合理充裕的环境下仍是较好的配置品种,我们将密切关注各项宏观经济数据的走势,留意流动性的边际变化,合理运用杠杆工具,维持组合稳健的久期策略。本基金为被动型指数基金,我们将进一步优化既有的跟踪策略,注重保持组合的流动性,有效跟踪标的指数。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 1.0830 元,报告期内,份额净值增长率为 0.31%,同期业绩基准增长率为 0.41%。

# 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

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比 例(%)
1	权益投资	-	-
	其中: 股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,482,168,932.05	93.91
	其中:债券	9,482,168,932.05	93.91
	资产支持证		
	券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的		
	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备	412 407 91	0.00
/	付金合计	413,497.81	0.00
8	其他资产	614,952,079.87	6.09
9	合计	10,097,534,509.73	100.00

# 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

# 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

# 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

- 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

无。

# 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	757,274,304.10	9.38
	其中: 政策性金融债	757,274,304.10	9.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	141,292,370.95	1.75
6	中期票据	80,147,068.49	0.99
7	可转债 (可交换债)	-	-
8	同业存单	8,503,455,188.51	105.34
9	其他	-	-
10	合计	9,482,168,932.05	117.46

# 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	112518211	25 华夏银行	4,000,000	397,647,067.	4.93
		CD211		39	
2	112504061	25 中国银行	3,000,000	295,297,275.	3.66
2	2   112304061	CD061	3,000,000	62	3.00
3	112508302	25 中信银行	3,000,000	295,270,116.	3.66
3	112308302	CD302	3,000,000	16	3.00
4	11250(220	25 交通银行	2 000 000	295,202,217.	2.66
4 112300.	112506220	CD220	3,000,000	53	3.66
5	210208	21 国开 08	2,400,000	243,222,772.	3.01

- [				
- 1			(0	
- 1			1 00	
- 1				

5.6 报告期末按公允价值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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

- 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 无。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

- 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

- 5.11 投资组合报告附注
- 5.11.1 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目前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局、中国人民银行的处罚;广发银行股份有限公司在报告编制

日前一年內曾受到国家金融监督管理总局的处罚: 华夏银行股份有限公司在报告编制日前一年內曾受到国家金融监督管理总局的处罚: 中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年內曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚: 中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年內曾受到国家金融监督管理总局的处罚: 中信银行股份有限公司在报告编制日前一年內曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。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內受到公开谴责、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。

# 5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票(如有)没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人 从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,427.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	614,949,652.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	614,952,079.87

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

# 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

# § 6 开放式基金份额变动

单位: 份

报告期期初基金份额总额	3,521,565,494.08
报告期期间基金总申购份额	9,106,207,452.65
减:报告期期间基金总赎回份额	5,173,652,312.28

报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	7,454,120,634.45

# § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末,基金管理人未持有本基金份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

# § 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、《南方中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》:
- 2、《南方中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》;
- 3、南方中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 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