

南方天天利货币市场基金 2017 年半年度 报告

2017-06-30

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017-08-28

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
注：无。	23
§ 7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 债券回购融资情况	30
7.3 基金投资组合平均剩余期限	30
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	31
7.6 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	31

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	32
7.8 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.....	32
7.9 投资组合报告附注.....	32
§ 8 基金份额持有人信息.....	32
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	32
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	33
8.3 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的情况.....	33
§ 9 开放式基金份额变动.....	33
§ 10 重大事件揭示.....	34
10.1 基金份额持有人大会决议.....	34
10.2 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.....	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	34
10.4 基金投资策略的改变.....	34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	34
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	34
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	35
10.9 其他重大事件.....	35
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	36
11.1 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.....	36
§ 12 备查文件目录.....	37
12.1 备查文件目录.....	37
12.2 存放地点.....	37
12.3 查阅方式.....	37

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方天天利货币市场基金	
基金简称	南方天天利货币	
基金主代码	003473	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月20日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	41,181,128,904.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B
下属分级基金的交易代码	003473	003474
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,060,200,262.59份	40,120,928,642.33份

注：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“南方天天利”。

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，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。
业绩比较基准	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。

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	南方基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95559
传真	0755-82763889	021-62701216
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路	上海市浦东新区银城中路

	六号免税商务大厦 31-33 层	188 号
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路 六号免税商务大厦 31-33 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	518048	200120
法定代表人	张海波	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日
	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B
本期已实现收益	11,581,118.02	384,482,535.83
本期利润	11,581,118.02	384,482,535.83
本期净值收益率	2.0118%	2.1320%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）	报告期末（2017 年 06 月 30 日）
期末基金资产净值	1,060,200,262.59	40,120,928,642.33
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）	报告期末（2017 年 06 月 30 日）
累计净值收益率	2.6038%	2.7730%

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,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. 所述基金业绩指标不包括持有人认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。

3. 本基金收益分配为按日结转份额。

4. 本基金合同生效日为 2016 年 10 月 20 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未
满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

南方天天利货币 A

阶段	净值收益率 ① (%)	净值收益率 标准差 ② (%)	业绩比较基 准收益率 ③ (%)	业绩比较基 准收益率标 准差 ④ (%)	①— ③ (%)	②— ④ (%)
过去一个月	0.3504	0.0006	0.1126	0.0000	0.2378	0.0006
过去三个月	1.0384	0.0004	0.3418	0.0000	0.6966	0.0004
过去六个月	2.0118	0.0019	0.6810	0.0000	1.3308	0.0019
自基金合同生效 起至今	2.6038	0.0024	0.9570	0.0000	1.6468	0.0024

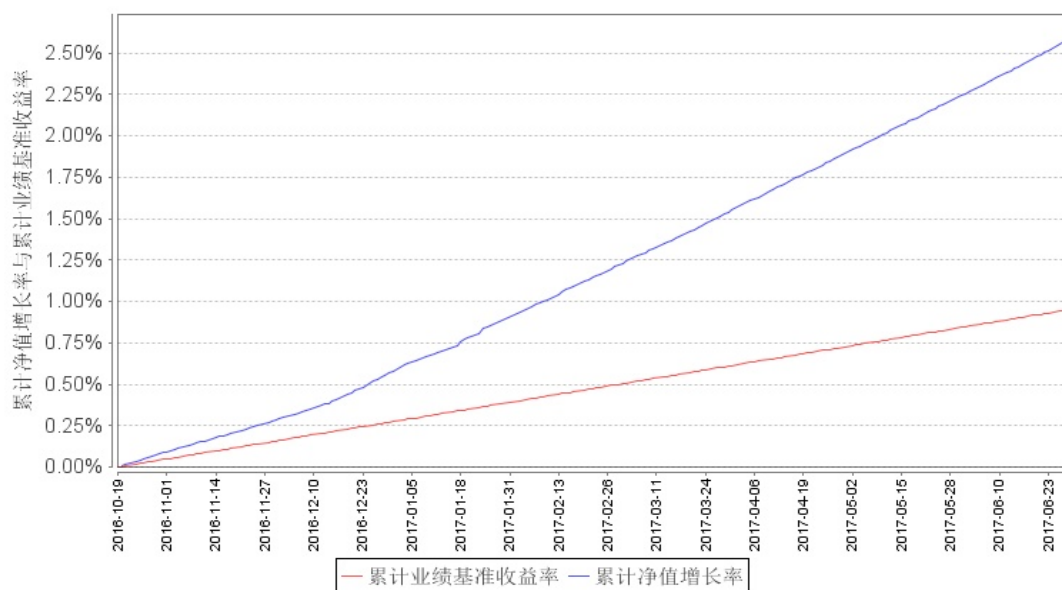
南方天天利货币 B

阶段	净值收益 率 ① (%)	净值收益率 标准差 ② (%)	业绩比较基 准收益率 ③ (%)	业绩比较基 准收益率标 准差 ④ (%)	①— ③ (%)	②— ④ (%)
过去一个月	0.3702	0.0006	0.1126	0.0000	0.2576	0.0006
过去三个月	1.0983	0.0004	0.3418	0.0000	0.7565	0.0004
过去六个月	2.1320	0.0019	0.6810	0.0000	1.4510	0.0019
自基金合同生效 起至今	2.7730	0.0024	0.9570	0.0000	1.8160	0.0024

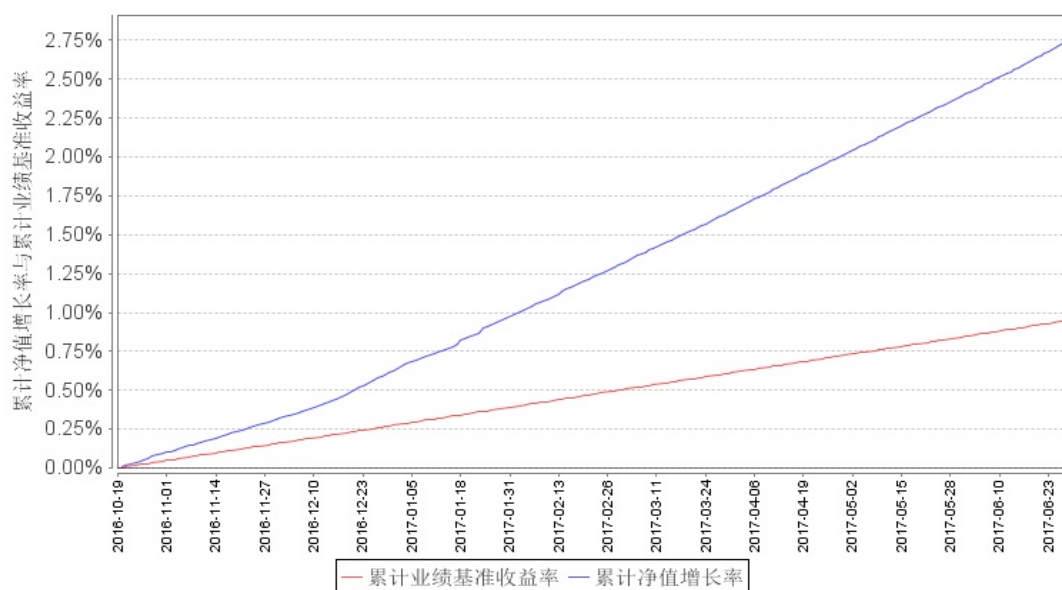
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收

益率变动的比较

南方天天利货币A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方天天利货币B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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。

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司

(45%)；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，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，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 6,500 亿元，旗下管理 134 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

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 11 月 17 日		11	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 月至 2015 年 3 月，任融通易支付货币基金经理；2012 年 3 月至 2015 年 3 月，任融通四季添利债券基金经理；2012 年 11 月至 2015 年 3 月，任融通岁岁添利债券基金经理；2014 年 8 月至 2015 年 3 月，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 月至今，任南方薪金宝、南方理财金、南方日添益基金经理；2016 年 11 月至今，任南方天天利基金经理。
夏晨曦	本基金基金经理	2016 年 10 月 20 日		12	香港科技大学理学硕士，具有基金从业资格。2005 年 5 月加入南方基金，曾担任金融工程研究员、固定收益研究员、风险控制员等职务，现任固定收益部副总监、社保理事会委托产品投资决策委员会委员、固定收益投资决策委员会委员。2008 年 5 月至 2012 年 7 月，任固定收益部投资经理，负责社保、专户及年金组合的投资管理；2012 年 7 月至 2015 年 1 月，任南方润元基金经理；2014 年 7 月至 2016 年 11 月，任南方薪金宝基金经理；2014 年 12 月至 2016 年 11 月，任南方理财金基金经理；2012 年 8 月至今，任南方理财 14 天基金经理；2012 年 10 月至今，任南方理财 60 天基金经理；2013 年 1 月至今，任南方收益宝基金经理；2014 年 7 月至今，任南方现金增利、南方现金通基金经理；2016 年 2 月至今，任南方日添益货币基金经理；2016 年 10 月至今，任南方天天利基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决

定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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《南方天天利货币市场基金基金合同》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，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。公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，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、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

上半年经济数据整体稳中有升，GDP同比增速回升至6.9%，好于市场预期水平。工业增加值累计同比增长6.9%；固定资产投资累计同比增长8.6%，其中房地产投资累计同比增长8.5%，基建投资累计同比增长16.9%，制造业投资累计同比增长5.5%；社会消费品零售总额累计同比增长10.4%。房地产销售面积累计同比增长16%，新开工面积累计同比增长11%，土地购置面积累计同比增长9%。上半年金融数据出现分化，其中5月M2同比增速9.6%，历史首次跌破10%。上半年通胀水平有所下降，其中6月CPI同比增长1.5%，缓步回升；6月PPI同比增长5.5%，较一季度出现明显回落。

美国6月会议加息，且声明偏鹰派，表明近期通胀走弱未动摇联储的信心，对经济、通胀的看法

仍然乐观，预期年内继续加息一次，并开启缩表。欧央行转向鹰派，德拉吉表示欧洲的通缩因素已被再通胀因素取代。日本方面，市场开始预期日本的经济和通胀将要走出持续的低谷。上半年美元大跌，人民币兑美元汇率中间价明显升值。央行无降息降准操作，但一季度多次上调 MLF、SLF 和公开市场政策利率。上半年来看，市场资金利率水平抬升，波动加大。

市场层面，上半年 10 年国开、10 年国债收益率分别上行 52BP、上行 56BP，国开国债短端收益率上行幅度大于长端，利率曲线平坦化。货币市场利率波动较大，但高点仍未超过去年年末，3 个月股份制银行 AAA 存单利率最高达到 5%。利率中枢整体保持稳定，保持在 4.5% 左右。在操作方面，本基金主要以低久期持仓为主，在二季度末期逐步增加了久期，以期提高组合静态收益和获取资本利得。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 级基金净值收益率为 2.0118%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%；B 级基金净值收益率为 2.1320%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。

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，6 月经济数据显著超预期，PMI 及中观数据也显示经济有所反弹，并未出现明显的快速下行。综合来看，经济整体仍处于高位震荡阶段，下行速度不快。通胀方面，预计下半年 CPI 同比增速缓慢回升，难以突破 2.0%；PPI 同比增速至年中保持缓慢回落，年末将加速回落。政策层面，美联储将缩表提上议事日程，或从 9 月/12 月正式实施，平均每月 100 亿，每 3 个月提高 100 亿，并最终达到 500 亿/月的水平。当前美元指数大幅下跌，人民币贬值压力明显缓解。当前央行货币政策从收紧转向中性，金融监管预计也将协调统一平稳进行，以防止出现新的金融风险。

短期内金融去杠杆、监管影响逐步消退，基本面重新主导债市。4-5 月经济数据明显走弱，显示经济增长和通胀水平已经走过年内高点。但 6 月 PMI 显示经济仍然平稳甚至温和反弹，并未出现明显的快速下行。综合来看，经济短期繁荣顶点已经出现，整体经济处于高位回落阶段，但下行的速度并不快。中期来看，地产调控措施不断出台，地产销量受到持续的负面影响。另一方面通胀预期走弱，PPI 掉头向下。此外，金融去杠杆必将导致实体去杠杆，对中长期债市仍然看好。随着融资需求逐步回落，货币市场利率的波动中枢也有望出现下行，因此当前水平具备较好的配置价值。但在紧信用的背景下，企业融资环境恶化，需要严防信用风险，加强对于持仓债券的跟踪和梳理。

4.6 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新准则、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。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、权益研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。其中，超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金合同约定，本基金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

§ 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

2017上半年度，托管人在南方天天利货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017上半年度，南方基金管理有限公司在南方天天利货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。个别工作日，托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：11,581,118.02元，向B级份额持有人分配利润：384,482,535.83元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017上半年度，由南方基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关南方天天利货币市场基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组

合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方天天利货币市场基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,533,813,743.16	886,131,421.67
结算备付金		11,178,209.39	484,090.91
存出保证金		523.76	-
交易性金融资产	6.4.7.2	23,728,872,126.11	1,271,459,650.03
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		23,728,872,126.11	1,271,459,650.03
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,222,503,786.75	977,711,466.59
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	70,612,045.27	6,115,933.40
应收股利		-	-
应收申购款		86,621,828.86	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		42,653,602,263.30	3,141,902,562.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,405,518,121.71	-
应付证券清算款		60,241,860.36	-
应付赎回款		6,000.00	-
应付管理人报酬		4,209,731.89	81,222.67
应付托管费		1,403,243.97	27,074.24
应付销售服务费		494,578.08	13,621.39
应付交易费用	6.4.7.7	115,816.79	13,874.34

应交税费		-	-
应付利息		89,914.55	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	394,091.03	80,000.00
负债合计		1,472,473,358.38	215,792.64
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	41,181,128,904.92	3,141,686,769.96
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		41,181,128,904.92	3,141,686,769.96
负债和所有者权益总计		42,653,602,263.30	3,141,902,562.60

注：1. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

41,181,128,904.92 份，其中 A 级基金份额总额 1,060,200,262.59 份，B 级基金份额总额 40,120,928,642.33 份。

2. 本财务报表上年度的实际编制期间为 2016 年 10 月 20 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：南方天天利货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		424,713,422.94
1. 利息收入		422,677,599.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	198,495,626.59
债券利息收入		207,099,304.12
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		17,082,668.84
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,035,823.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	2,035,823.39
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.18	-

”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)	6. 4. 7. 19	-
减: 二、费用		28,649,769.09
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	13,554,749.18
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	4,518,249.72
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	1,576,721.74
4. 交易费用	6. 4. 7. 20	-
5. 利息支出		8,715,806.69
其中: 卖出回购金融资产支出		8,715,806.69
6. 其他费用	6. 4. 7. 21	284,241.76
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		396,063,653.85
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		396,063,653.85

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 南方天天利货币市场基金

本报告期: 2017年1月1日至2017年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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)	3,141,686,769.96	-	3,141,686,769.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	396,063,653.85	396,063,653.85
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)	38,039,442,134.96	-	38,039,442,134.96

其中：1. 基金申购款	50,442,844,123.01	-	50,442,844,123.01
2. 基金赎回款	-12,403,401,988.05	-	-12,403,401,988.05
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）	-	-396,063,653.85	-396,063,653.85
五、期末所有者权益（基金净值）	41,181,128,904.92	-	41,181,128,904.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.1.1 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.1.2 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	1,813,743.16
定期存款	16,532,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	4,900,000,000.00
存款期限1个月以内	-
存款期限3个月以上	11,632,000,000.00
其他存款	-
合计：	16,533,813,743.16

注：1. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2. 本基金报告期内未提前支取部分定期存款，根据约定，原定期存款利率不变，提前支取未造成利息损失。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	1,205,981,123.01	1,205,856,155.00	-124,968.01	-0.0003
	银行间市场	22,522,891,003.10	22,548,235,000.00	25,343,996.90	0.0615
	合计	23,728,872,126.11	23,754,091,155.00	25,219,028.89	0.0612

注：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

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 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 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	2,222,503,786.75	-
合计	2,222,503,786.75	-

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	39,085.11
应收定期存款利息	56,150,260.54
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,030.20
应收债券利息	9,996,125.61
应收买入返售证券利息	4,421,543.61
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.20
合计	70,612,045.27

6.4.3.6 其他资产

注：无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	115,816.79
合计	115,816.79

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	202,396.69
其他	191,694.34
合计	394,091.03

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方天天利货币 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	143,632,716.41	143,632,716.41
本期申购	2,545,393,658.08	2,545,393,658.08
本期赎回(以“-”号填列)	-1,628,826,111.90	-1,628,826,111.90
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,060,200,262.59	1,060,200,262.59
南方天天利货币 B		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,998,054,053.55	2,998,054,053.55
本期申购	47,897,450,464.93	47,897,450,464.93
本期赎回(以“-”号填列)	-10,774,575,876.15	-10,774,575,876.15
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	40,120,928,642.33	40,120,928,642.33

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

南方天天利货币 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	11,581,118.02	-	11,581,118.02
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	-11,581,118.02	-	-11,581,118.02
本期末	-	-	-
南方天天利货币 B			
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	384,482,535.83	-	384,482,535.83
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	-384,482,535.83	-	-384,482,535.83
本期末	-	-	-

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
活期存款利息收入	225,743.39	
定期存款利息收入	197,965,430.88	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	51,977.42	
其他	252,474.90	
合计	198,495,626.59	

6.4.3.12 股票投资收益

无。

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	25,158,784,561.66	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	25,087,797,144.22	
减：应收利息总额	68,951,594.05	
买卖债券差价收入	2,035,823.39	

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.3.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.3.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.3.16 股利收益

注：无。

6.4.3.17 公允价值变动收益

注：无。

6.4.3.18 其他收入

注：无。

6.4.3.19 交易费用

注：无。

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
上交所账户维护费	9,000.00
中债账户维护费	9,000.00
账户维护费	3,400.00
银行费用	62,445.07
其他	7,000.00
合计	284,241.76

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

注：无。

6.4.6.1.2 债券交易

注：无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.6.1.4 权证交易

注：无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,554,749.18
其中：支付销售机构的客户维护费	81,802.65

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0.15%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.15%/当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,518,249.72

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

6.4.6.2.3 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		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	合计
南方基金	224,966.61	640,459.57	865,426.18
交通银行	52,381.55	816.09	53,197.64
华泰证券	15,374.39	1,833.55	17,207.94
兴业证券	7,542.09	786.88	8,328.97
合计	300,264.64	643,896.09	944,160.73

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日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 级基金份额和 B 级基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。销售服务费的计算公式为：日销售服务费 = 前一日 A/B 级基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.6.4.2 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

注：无。

6.4.6.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	2,401,813,743.16	25,584,929.47

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2017年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——货币市场基金

单位：人民币元

南方天天利货币 A				
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
11,581,118.02	-	-	11,581,118.02	-
南方天天利货币 B				
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
384,482,535.83	-	-	384,482,535.83	-

6.4.8 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

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
111709250	17 浦发银行 CD250	2017-07-07	98.94	1,130,000	111,805,275.34
140220	14 国开 20	2017-07-05	100.11	204,000	20,422,797.19
150207	15 国开 07	2017-07-06	100.43	900,000	90,390,929.07

170203	17 国开 03	2017-07-06	99.75	270,000	26,931,567.65
170204	17 国开 04	2017-07-05	99.47	4,050,000	402,850,949.57
170204	17 国开 04	2017-07-06	99.47	850,000	84,548,964.72
170306	17 进出 06	2017-07-05	99.69	1,300,000	129,594,418.39
170401	17 农发 01	2017-07-06	99.73	500,000	49,863,117.08
合计				90,240,000	916,408,019.01

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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 500,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 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。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。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。

6.4.9.2 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。本基金的活期及部分定期银行存款存放在本基金的托管行交通银行；其余定期存款存放在具有基金托管资格的中国光大银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司，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；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。

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 2017 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 52.67%。

6.4.9.3 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券的比例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。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占基金资产净值的比例不得超过20%。

于2017年6月30日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30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	12,510,813,743.16	4,023,000,000.00	-	-	16,533,813,743.16
结算备付金	11,178,209.39	-	-	-	11,178,209.39
存出保证金	523.76	-	-	-	523.76
交易性金融资产	22,802,291,813.83	926,580,312.28	-	-	23,728,872,126.11
买入返售金融资产	2,222,503,786.75	-	-	-	2,222,503,786.75
应收利息	-	-	-	70,612,045.27	70,612,045.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	132,207,642.	-	-	-	86,621,828.86

	30			45,585,813.44	
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,678,995,719.19	4,949,580,312.28		25,026,231.83	42,653,602,263.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,000.00	6,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	4,209,731.89	4,209,731.89
应付托管费	-	-	-	1,403,243.97	1,403,243.97
应付证券清算款	-	-	-	60,241,860.36	60,241,860.36
卖出回购金融资产款	1,405,518,121.71			-	1,405,518,121.71
应付销售服务费	-	-	-	494,578.08	494,578.08
应付交易费用	-	-	-	115,816.79	115,816.79
应付利息	-	-	-	89,914.55	89,914.55
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	394,091.03	394,091.03
负债总计	1,405,518,121.71			66,955,236.67	1,472,473,358.38
利率敏感度缺口	36,273,477,549.48	4,949,580,312.28		-41,929,004.84	41,181,128,904.92
上年度末 2016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	886,131,421.67			-	886,131,421.67
结算备付金	484,090.91			-	484,090.91
交易性金融资产	1,271,459,650.03			-	1,271,459,650.03
买入返售金融资产	977,711,466.59			-	977,711,466.59
应收利息	-	-	-	6,115,933.40	6,115,933.40
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,135,786,629.20			6,115,933.40	3,141,902,562.60
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	81,222.67	81,222.67
应付托管费	-	-	-	27,074.24	27,074.24
应付销售服务费	-	-	-	13,621.39	13,621.39
应付交易费用	-	-	-	13,874.34	13,874.34
其他负债	-	-	-	80,000.00	80,000.00

负债总计	-	-	-	215,792.64	215,792.64
利率敏感度缺口	3,135,786.62	-	-	5,900,140.76	3,141,686,769.96
	9.20				

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。

6.4.9.4.1.2 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		
	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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	28,340,000.00	690000
	2. 市场利率上升 25 个基点	-28,290,000.00	-690000

6.4.9.4.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益权益投资	23,728,872,126.11	55.63
	其中：债券	23,728,872,126.11	55.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,222,503,786.75	5.21
	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	16,544,991,952.55	38.79
4	其他各项资产	157,234,397.89	0.37
5	合计	42,653,602,263.30	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	4.01	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,405,518,121.71	3.41
	其中：买断式回购融资	-	-

7.2.1 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

7.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.3 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	12.96	3.56
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	20.16	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	33.07	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	1.08	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	35.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.19	3.56

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,106,531,123.01	2.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	956,613,837.56	2.32
	其中：政策性金融债	956,613,837.56	2.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	21,665,727,165.54	52.61
8	其他	-	-
	合计	23,728,872,126.11	57.62
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 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

金额单位：

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111715192	17民生银行CD192	20,000,000	1,955,978,211.63	4.75
2	111780365	17盛京银行CD135	13,000,000	1,295,498,265.99	3.15
3	111709250	17浦发银行CD250	10,000,000	989,427,215.44	2.40
4	111799843	17宁波银行CD106	10,000,000	989,390,624.66	2.40

5	111799929	17 宁波银行 CD109	10,000,000	989,382,824 .47	2.40
6	111715207	17 民生银行 CD207	10,000,000	977,928,830 .02	2.37
7	111799888	17 广州农村 商业银行 CD118	10,000,000	977,800,243 .22	2.37
8	111709229	17 浦发银行 CD229	6,000,000	593,987,978 .48	1.44
9	111715205	17 民生银行 CD205	6,000,000	593,524,577 .82	1.44
10	170204	17 国开 04	5,000,000	497,346,851 .32	1.21

7.7 “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	0.0621
报告期内偏离度的最低值	-0.0234
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0159

7.7.1 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

7.7.2 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

7.8 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	523.76
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	70,612,045.27

4	应收申购款	86,621,828.86
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	157,234,397.89

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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(%)
南方天天利货币 A	24,924	42,537.32	283,402,566.28	26.73	776,797,696.31	73.27
南方天天利货币 B	396	101,315,476.37	39,639,966,853.13	98.80	480,961,789.20	1.20
合计	25,320	1,626,426.89	39,923,369,419.41	96.95	1,257,759,485.51	3.05

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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。

8.2 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	南方天天利货币 A	11,758,290.01	1.1091
	南方天天利货币 B	-	-
	合计	11,758,290.01	0.0286

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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）。

8.3 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的情况

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	南方天天利货币 A	-
	南方天天利货币 B	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方天天利货币 A	南方天天利货币 A
	南方天天利货币 B	>100
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B
基金合同生效日（2016年10月20日）基金份额总额	55,962,277.47	200,027,317.39
本报告期期初基金份额总额	143,632,716.41	2,998,054,053.55
本报告期基金总申购份额	2,545,393,658.08	47,897,450,464.93
减：本报告期基金总赎回份额	1,628,826,111.90	10,774,575,876.15
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,060,200,262.59	40,120,928,642.33

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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

南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议已于2017年1月23日审议通过了《公司关于聘任公司副总经理、督察长和财务负责人的议案》，秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 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，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 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、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
申万宏源	2	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
申万宏源	2,582,922.27	100.00	15,530,500,000.00	100.00	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。

10.9 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增加蚂蚁基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年5月22日
2	南方天天利货币市场基金 2017 年端午节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年5月18日
3	南方天天利货币市场基金 2017 年五一前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年4月20日
4	南方基金关于旗下部分基金增加富滇银行、杭州联合农村商业银行作为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年4月12日
5	南方基金关于旗下部分基金增加苏宁基金、大泰金石为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年4月10日
6	南方基金关于旗下部分基金增加大河财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年4月6日
7	南方天天利货币市场基金 2017 年清明节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月23日
8	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月15日
9	南方基金关于旗下部分基金增加萧山农商银行作为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月6日
10	南方基金关于临时调整实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年1月24日
11	南方天天利货币市场基金 2017 年春节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年1月18日
12	南方基金关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年1月11日
13	南方基金关于旗下部分基金增加富滇银行、南海农商银行、晋商银行、和谐销售为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年1月11日
14	南方天天利货币市场基金限制大额申购和定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年1月6日
15	南方基金关于旗下部分基金增加金斧子为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年1月6日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20170524-20170630	4,002,017,831.82	6,861,252,339.65	-	10,863,270,171.47	26.38
机构	2	20170101-20170627	2,000,708,855.48	8,163,916,648.24	2,037,578,800.00	8,127,046,703.72	19.74
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方天天利货币市场基金的文件。
- 2、南方天天利货币市场基金基金合同。
- 3、南方天天利货币市场基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>