南方天天利货币市场基金 2021 年年度报告

2021 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2021 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.....4
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.....12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....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.....17
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.....18
§5 托管人报告.....18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....18
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.....18
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.....18
§6 审计报告.....19
6.1 审计报告基本信息.....19
6.2 审计报告的基本内容.....19
§7 年度财务报表.....21
7.1 资产负债表.....21
7.2 利润表.....22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....24
7.4 报表附注.....25
§8 投资组合报告.....50
8.1 期末基金资产组合情况.....50
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.....51
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.....52

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 52
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 52
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 53
8.9 投资组合报告附注 53
§9 基金份额持有人信息 54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 55
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 55
9.4 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 56
§10 开放式基金份额变动 56
§11 重大事件揭示 56
11.1 基金份额持有人大会决议 56
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 56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 57
11.4 基金投资策略的改变 57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 57
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 57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 57
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 58
11.9 其他重大事件 58
§12 影响投资者决策的其他重要信息 60
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 60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 60
§13 备查文件目录 60
13.1 备查文件目录 60
13.2 存放地点 60
13.3 查阅方式 61

§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		
交易代码	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	南方基金管理股份有限公司		
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	146,576,086,498.80 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	南方天天利货币 E
下属分级基金的交易代码	003473	003474	005194
报告期末下属分级基金的份额总额	9,168,966,934.61 份	135,109,289,990.78 份	2,297,829,573.41 份

注:1.本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方天天利”。

2.自 2017 年 9 月 13 日起增加南方天天利货币市场基金 E 类。

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	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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	陆志俊
	联系电话	0755-82763888	95559

	电子邮箱	manager@southernfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-889-8899	95559
传真		0755-82763889	021-62701216
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		518017	200336
法定代表人		杨小松（代为履行法定代表人职责）	任德奇

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（包括代为履行公司法定代表人职责以及法定、公司章程和制度规定的公司董事长其他各项职责）。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	南方基金管理股份有限公司	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、南方天天利货币 A

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	253,369,221.26	183,696,679.90	197,650,874.74
本期利润	253,369,221.26	183,696,679.90	197,650,874.74
本期净值收益率	2.3411%	2.1894%	2.7342%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末基金资产净值	9,168,966,934.61	10,341,398,460.56	6,515,731,732.66
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
累计净值收益率	17.0968%	14.4182%	11.9667%

2、南方天天利货币 B

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	2,805,678,243.86	2,472,578,675.51	3,290,959,824.03
本期利润	2,805,678,243.86	2,472,578,675.51	3,290,959,824.03
本期净值收益率	2.5872%	2.4346%	2.9812%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末基金资产净值	135,109,289,990.78	79,538,960,562.95	110,895,206,386.47
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
累计净值收益率	18.5631%	15.5730%	12.8261%

3、南方天天利货币 E

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	58,260,783.75	70,869,097.10	129,165,813.07
本期利润	58,260,783.75	70,869,097.10	129,165,813.07
本期净值收益率	2.4948%	2.3424%	2.8885%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末基金资产净值	2,297,829,573.41	2,291,519,573.65	3,564,037,530.35
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
累计净值收益率	13.8520%	11.0808%	8.5384%

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。

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

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
过去三个月	0.5718%	0.0002%	0.3456%	0.0000%	0.2262%	0.0002%
过去六个月	1.1305%	0.0002%	0.6924%	0.0000%	0.4381%	0.0002%
过去一年	2.3411%	0.0004%	1.3781%	0.0000%	0.9630%	0.0004%
过去三年	7.4413%	0.0010%	4.1955%	0.0000%	3.2458%	0.0010%
过去五年	16.4213%	0.0025%	7.0872%	0.0000%	9.3341%	0.0025%
自基金合同生效起至今	17.0968%	0.0025%	7.3808%	0.0000%	9.7160%	0.0025%

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
过去三个月	0.6327%	0.0002%	0.3456%	0.0000%	0.2871%	0.0002%
过去六个月	1.2531%	0.0002%	0.6924%	0.0000%	0.5607%	0.0002%
过去一年	2.5872%	0.0004%	1.3781%	0.0000%	1.2091%	0.0004%
过去三年	8.2176%	0.0010%	4.1955%	0.0000%	4.0221%	0.0010%
过去五年	17.8236%	0.0025%	7.0872%	0.0000%	10.7364%	0.0025%
自基金合同生效起至今	18.5631%	0.0025%	7.3808%	0.0000%	11.1823%	0.0025%

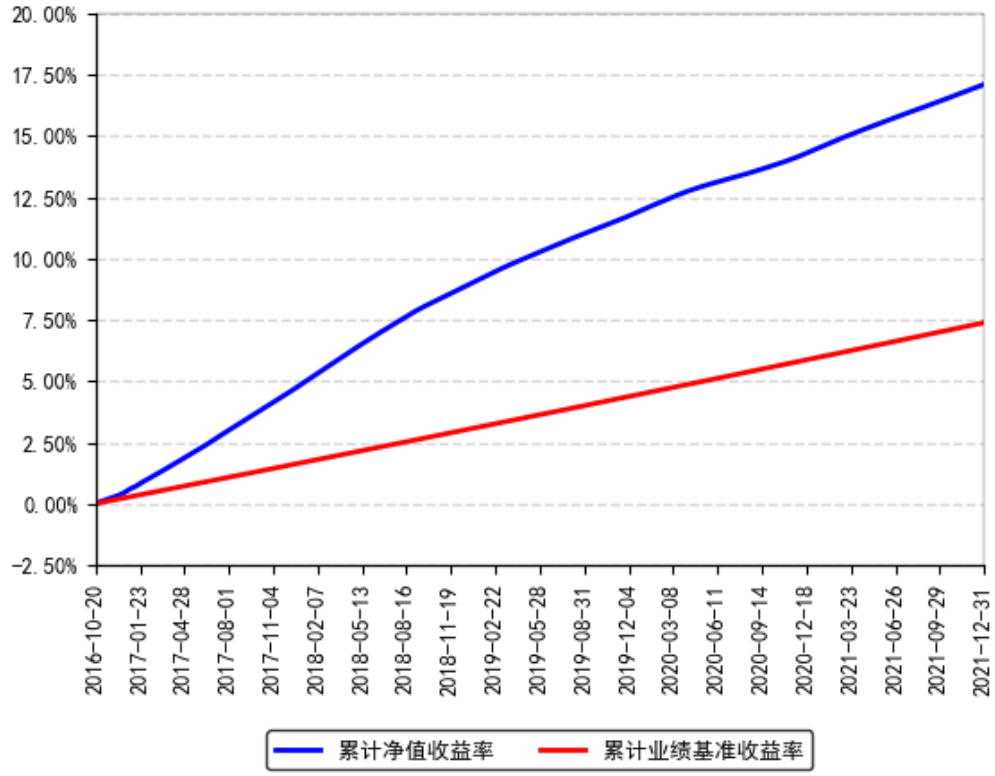
南方天天利货币 E

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	0.6099%	0.0002%	0.3456%	0.0000%	0.2643%	0.0002%
过去六个月	1.2072%	0.0002%	0.6924%	0.0000%	0.5148%	0.0002%
过去一年	2.4948%	0.0004%	1.3781%	0.0000%	1.1167%	0.0004%
过去三年	7.9255%	0.0010%	4.1955%	0.0000%	3.7300%	0.0010%
自基金合同生效起至今	13.8520%	0.0023%	6.0641%	0.0000%	7.7879%	0.0023%

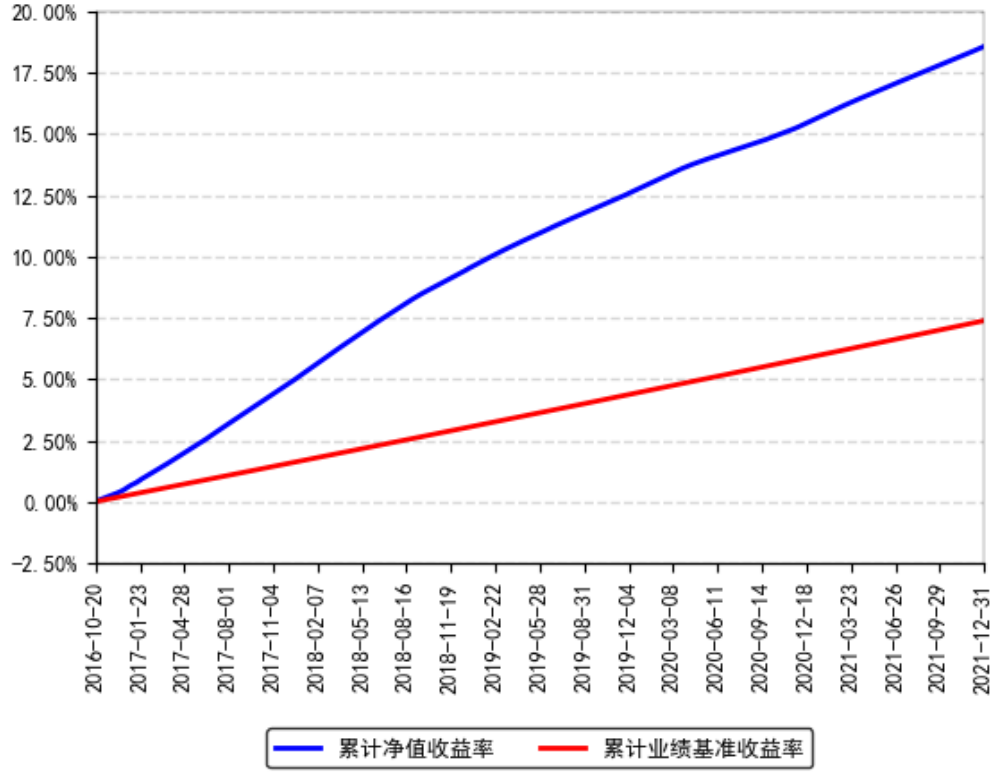
注：本基金收益分配为按日结转份额。

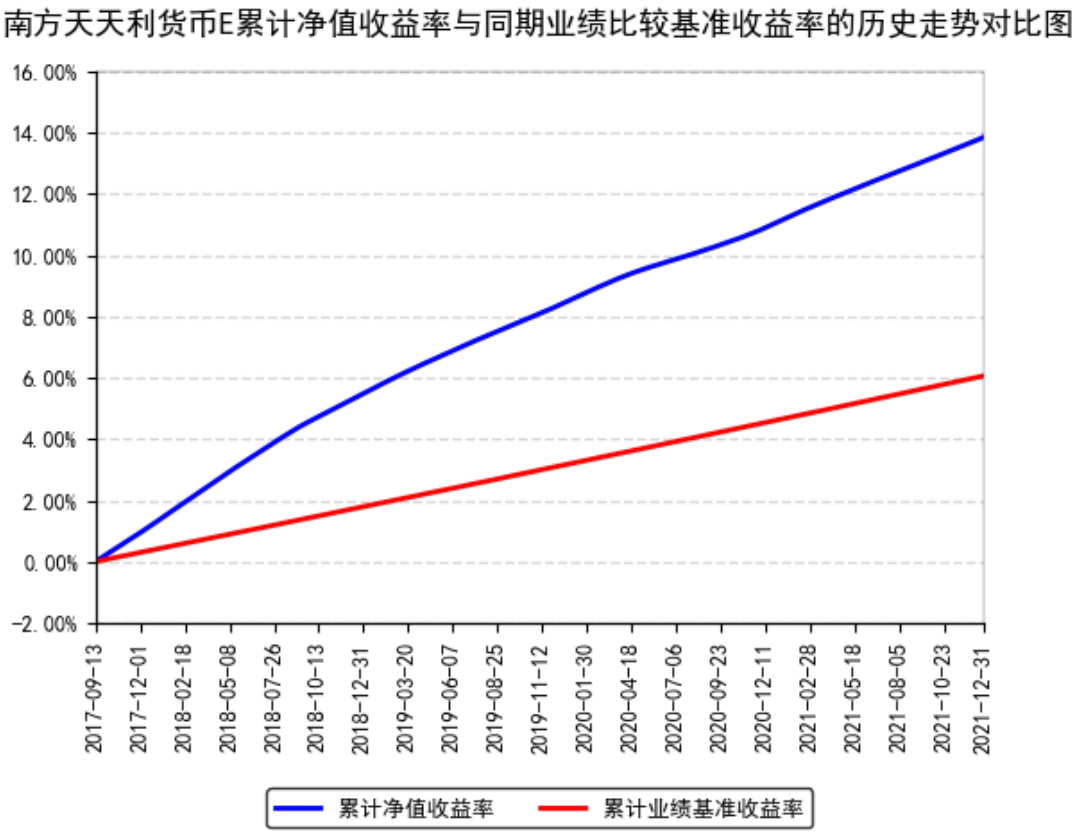
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方天天利货币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

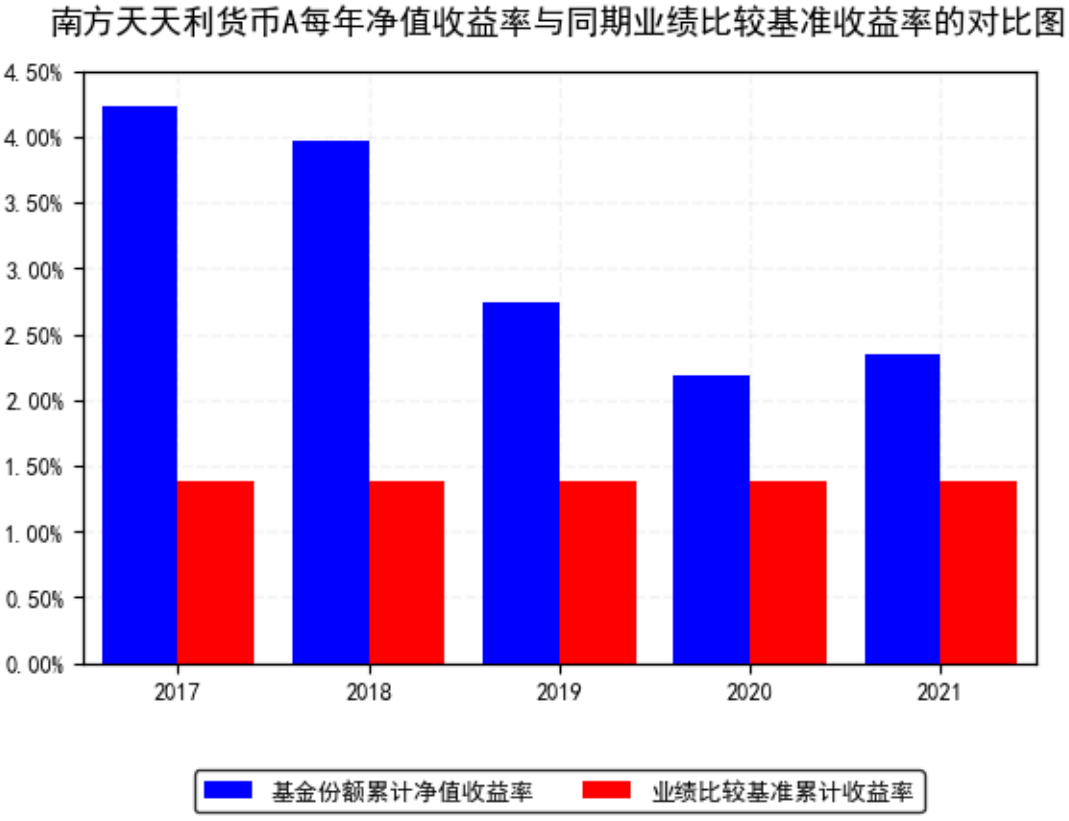


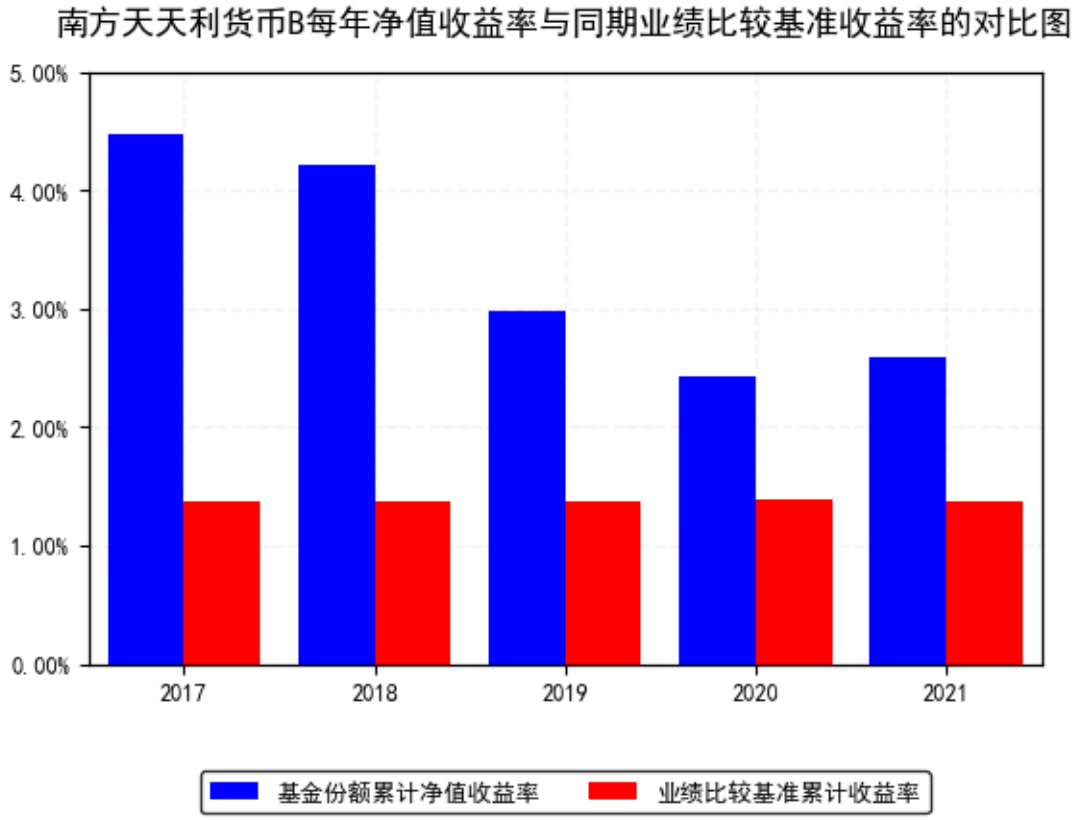
南方天天利货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

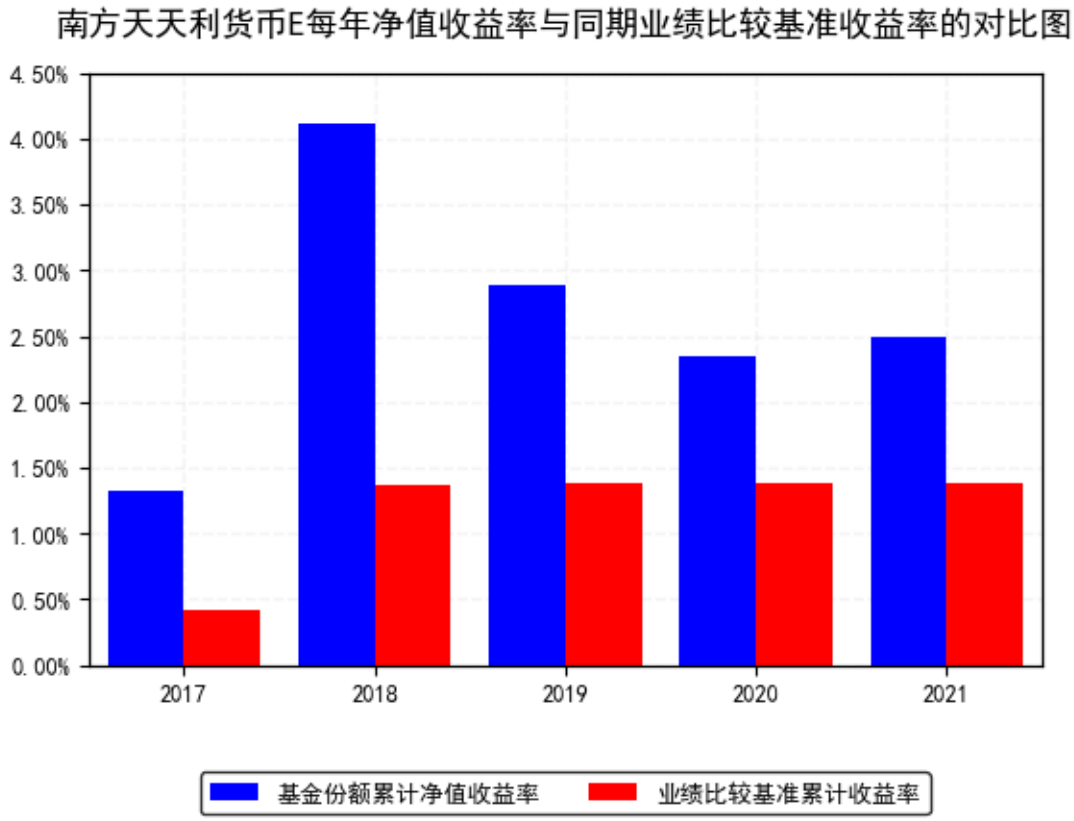




3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较







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

南方天天利货币 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
2021 年	253,369,221.26	-	-	253,369,221.26	-
2020 年	183,696,679.90	-	-	183,696,679.90	-
2019 年	197,650,874.74	-	-	197,650,874.74	-
合计	634,716,775.90	-	-	634,716,775.90	-

南方天天利货币 B

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
2021 年	2,805,678,243.86	-	-	2,805,678,243.86	-
2020 年	2,472,578,675.51	-	-	2,472,578,675.51	-
2019 年	3,290,959,824.03	-	-	3,290,959,824.03	-
合计	8,569,216,743.40	-	-	8,569,216,743.40	-

南方天天利货币 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
2021 年	58,260,783.75	-	-	58,260,783.75	-
2020 年	70,869,097.10	-	-	70,869,097.10	-
2019 年	129,165,813.07	-	-	129,165,813.07	-
合计	258,295,693.92	-	-	258,295,693.92	-

§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) 1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。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。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.5 万亿元，旗下管理 274 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		
夏晨曦	本基金基金经理	2016 年 10 月 20 日	-	16 年	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，现任现金投资部总经理、固定收益投资决策委员会副主席。2008 年 6 月 17 日至 2012 年 7 月 20 日，任固定收益部投资经理；2013 年 1 月 22 日至 2014 年 12 月 15 日，任南方理财 30 天基金经理；2012 年 7 月 20 日至 2015 年 1 月 13 日，任南方润元基金经理；2014 年 7 月 25 日至 2016 年 11 月 17 日，任

					南方薪金宝基金经理；2014 年 12 月 5 日至 2016 年 11 月 17 日，任南方理财金基金经理；2012 年 10 月 19 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方理财 60 天基金经理；2014 年 12 月 15 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方收益宝基金经理；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；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；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；2020 年 3 月 5 日至今，任南方 0-5 年江苏城投债基金经理；2020 年 4 月 17 日至今，任南方 1-5 年国开债基金经理；2020 年 8 月 6 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。
蔡奕奕	本基金基金经理	2016 年 11 月 17 日	-	15 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，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。

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，并且交易占优比也没有明显异常，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，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 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

全年经济逐季回落，下半年弱于上半年。1-12 月工业增加值同比增长 9.6%；固定资产投资累计同比增长 4.9%；社会消费品零售总额累计同比增长 12.5%，消费依然较弱；1-12 月 CPI 平均增长 0.9%，食品价格低迷拖累 CPI；PPI 平均增长 8.1%，工业品价格开始回落。12 月末 M2 同比增长 9.0%，目前社融增速基本触底反弹，但信用扩张进程较为缓慢。

美联储全年维持利率不变，但缩减 QE 进程提速，预计 2022 年 3 月结束，同时点阵图显示 22 年加息 3 次。欧央行全年维持利率不变。国内方面，央行年内两度降低存款准备金率，同时年末下调了 1 年期的 LPR 至 3.80%。全年来看，美元指数上涨 6.68%，人民币兑美元中间价升值 1492 个基点。银行间隔夜、7 天回购加权利率均值为 2.03%、2.33%，较上季度分别上行 37bp 和 10bp。

市场层面，全年货币市场收益率一季度整体上行，此后三个季度收益率震荡下行，曲线逐渐平坦化。其中，各类资产收益率较年初表现为：1 年国债、1 年国开收益率分别下行 25BP、24BP。3 个月 AAA 等级同业存单利率下行 5BP；6 个月 AAA 等级同业存单利率下行 20BP，1 年 AAA 等级同业存单利率下行 26BP。在基金运作上，全年基金总体上维持了稳健积极的投

资基调，采取了积极的久期策略，灵活运用杠杆工具，充分把握季末、年末和税期等关键时点的投资机会，努力提高组合静态收益，为增厚组合总体收益水平提供了有力保障。

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 2.3411%，同期业绩基准收益率为 1.3781%；本基金 B 份额净值收益率为 2.5872%，同期业绩基准收益率为 1.3781%；本基金 E 份额净值收益率为 2.4948%，同期业绩基准收益率为 1.3781%。

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，预计上半年经济在稳增长政策的作用下逐步企稳，下半年随着内外需的回落，会再次面临一定下行风险。通胀方面，预计 2022 年全年 CPI 中枢在 2.5%左右，PPI 中枢在 3.0%左右。

政策方面，美联储对通胀看法有所转变，紧缩节奏加快。国内央行稳健中性的取向没有改变，但也强调了将主动有为、做好加法。预计货币政策环境整体将较为友好。预计流动性环境维持稳定。

策略方面，经济依然存在下行风险。内需的压力主要体现在地产投资下行压力较大，基建受到财政可持续性的影响发力有一定限制；外需预计将逐渐见顶；信贷社融增长乏力，信用重新扩张尚需时间。通胀方面，能源紧缺逐步缓解，通胀风险有所降低，需要关注食品价格的变化。下一阶段的主要关注点在于政策的变化，目前政策端表态较为中性，需要关注地产、财政、货币等政策方面是否可能出现超预期的调整。投资配置方面，关注宏观经济数据表现，关注货币政策边际变化，预判货币市场发展趋势，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 2021 年度发布的《关于依法从严打击证券违法活动的意见》《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》和《个人信息保护法》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份额持有人利益出发，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，通过有效过程管控，将合规管理全面深度嵌入流程与业

务，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》《制度管理办法》《廉洁从业内部控制制度》《内控稽核工作操作指引》《“洗钱和恐怖融资风险”自评估制度》和《反洗钱内部控制制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，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以及包括网络直播脚本在内的其他宣传材料合规性，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，开展洗钱风险自评估工作，参考同业先进经验，按照风险为本的工作思路，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，持续全面推进合规数字化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，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

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本报告期内应分配收益 3,117,308,248.87 元,实际分配收益 3,117,308,248.87 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

2021 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

2021 年度，南方基金管理股份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。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：253,369,221.26 元，向 B 级份额持有人分配利润：2,805,678,243.86 元，向 E 级份额持有人分配利润：58,260,783.75 元。

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

2021 年度，由南方基金管理股份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 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(2022)第 22141 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	南方天天利货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了南方天天利货币市场基金(以下简称“南方天天利货币基金”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 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。 (二)我们的意见 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，公允反映了南方天天利货币基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方天天利货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
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	南方天天利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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南方天天利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计划清算南方天天利货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督南方天天利货币基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。(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。 (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。 (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，就可能导致对南方天天利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天天利货币基金不能持续经营。 (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。 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。
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	2022 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	87,068,761,747.48	25,823,841,412.71
结算备付金		43,081,012.93	203,750,074.13
存出保证金		23,433.09	133,297.79
交易性金融资产	7.4.7.2	58,876,199,147.45	55,940,353,303.66
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		58,876,199,147.45	55,829,353,303.66
资产支持证券投资		-	111,000,000.00
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	4,860,809,777.42	12,902,569,608.79
应收证券清算款		-	198,137,889.04
应收利息	7.4.7.5	532,255,246.85	279,303,923.71
应收股利		-	-
应收申购款		139,101,454.82	9,729,883.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		151,520,231,820.04	95,357,819,393.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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		3,913,212,146.18	2,430,166,359.74
应付证券清算款		78,901.88	736,688,965.72
应付赎回款		1,000,002,736.76	93,749.45
应付管理人报酬		19,138,026.73	11,179,815.76
应付托管费		6,379,342.23	3,726,605.26
应付销售服务费		3,418,800.50	2,852,540.30
应付交易费用	7.4.7.7	508,401.18	556,843.72
应交税费		18,095.30	107,618.63
应付利息		1,109,570.25	288,079.55
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	279,300.23	280,218.00
负债合计		4,944,145,321.24	3,185,940,796.13
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	146,576,086,498.80	92,171,878,597.16
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		146,576,086,498.80	92,171,878,597.16
负债和所有者权益总计		151,520,231,820.04	95,357,819,393.29

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，南方天天利货币 A 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 9,168,966,934.61 份；南方天天利货币 B 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 135,109,289,990.78 份；南方天天利货币 E 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,297,829,573.41 份；总份额合计 146,576,086,498.80 份。

7.2 利润表

会计主体：南方天天利货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		3,437,564,681.40	3,096,731,256.13
1.利息收入		3,431,585,065.59	3,109,690,916.32
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,348,235,499.95	1,050,998,270.99
债券利息收入		1,672,478,122.85	1,682,828,132.27
资产支持证券利息收入		639,432.61	1,970,625.16
买入返售金融资产收入		410,232,010.18	373,893,887.90
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,979,615.81	-12,960,361.35
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	5,970,072.91	-12,960,361.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	9,542.90	-
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	-	701.16
减：二、费用		320,256,432.53	369,586,803.62
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	185,497,867.27	172,683,192.09
2.托管费	7.4.10.2.2	61,832,622.34	57,561,064.04
3.销售服务费	7.4.10.2.3	40,739,042.18	34,969,372.86
4.交易费用	7.4.7.15	-	-
5.利息支出		31,640,323.88	103,650,854.90
其中：卖出回购金融资产支出		31,640,323.88	103,650,854.90
6.税金及附加		72,108.51	250,599.32
7.其他费用	7.4.7.16	474,468.35	471,720.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,117,308,248.87	2,727,144,452.51
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,117,308,248.87	2,727,144,452.51

7.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	92,171,878,597.16	-	92,171,878,597.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,117,308,248.87	3,117,308,248.87
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）	54,404,207,901.64	-	54,404,207,901.64
其中：1.基金申购款	282,333,950,455.25	-	282,333,950,455.25
2.基金赎回款	-227,929,742,553.61	-	-227,929,742,553.61
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）	-	-3,117,308,248.87	-3,117,308,248.87
五、期末所有者权益（基金净值）	146,576,086,498.80	-	146,576,086,498.80
项目	上年度可比期间 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）	120,974,975,649.48	-	120,974,975,649.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,727,144,452.51	2,727,144,452.51
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）	-28,803,097,052.32	-	-28,803,097,052.32
其中：1.基金申购款	251,284,651,129.96	-	251,284,651,129.96
2.基金赎回款	-280,087,748,182.28	-	-280,087,748,182.28
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）	-	-2,727,144,452.51	-2,727,144,452.51
五、期末所有者权益（基	92,171,878,597.16	-	92,171,878,597.16

金净值）			

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

南方天天利货币市场基金(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[2016]2020 号《关于准予南方天天利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《南方天天利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，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 255,955,646.96 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(2016)第 1292 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方天天利货币市场基金基金合同》于 2016 年 10 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 255,968,143.51 份基金份额，其中认购资金利息折合 12,496.55 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《关于南方天天利货币市场基金增加 E 类基金份额并修改基金合同及更新招募说明书的公告》以及更新的《南方天天利货币市场基金招募说明书》，自 2017 年 9 月 13 日起，本基金增加 E 类基金份额。E 类基金份额与原有的 A、B 类基金份额适用相同的管理费率和托管费率，按照不同的费率计提销售服务费用。本基金设 A 类、B 类和 E 类三级基金份额，各类基金份额单独设置基金代码，并分别公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方天天利货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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 2022 年 3 月 28 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》、《南方天天利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 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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。每份基金份额面值为 1.00 元。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一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。本基金以份额面值 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应付收益科目，且每日以红利再投资方式集中支付累计收益。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	13,005,761,747.48	459,341,412.71
定期存款	74,063,000,000.00	25,364,500,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	390,000,000.00	-
存款期限 1-3 个月	1,730,000,000.00	4,300,000,000.00
存款期限 3 个月以上	71,943,000,000.00	21,064,500,000.00
其他存款	-	-
合计	87,068,761,747.48	25,823,841,412.71

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 2021 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	1,229,236,227.74	1,229,556,802.80	320,575.06	0.0002
	银行间市场	57,646,962,919.71	57,689,020,000.00	42,057,080.29	0.0287
	合计	58,876,199,147.45	58,918,576,802.80	42,377,655.35	0.0289
资产支持证券		-	-	-	-
合计		58,876,199,147.45	58,918,576,802.80	42,377,655.35	0.0289
项目		上年度末 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	1,718,393,445.49	1,720,335,231.50	1,941,786.01	0.0021
	银行间市场	54,110,959,858.17	54,166,029,829.03	55,069,970.86	0.0597
	合计	55,829,353,303.66	55,886,365,060.53	57,011,756.87	0.0619
资产支持证券		111,000,000.00	111,052,400.00	52,400.00	0.0001
合计		55,940,353,303.66	55,997,417,460.53	57,064,156.87	0.0619

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 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	902,516,000.00	-
银行间市场	3,958,293,777.42	-
合计	4,860,809,777.42	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,173,375,000.00	-
银行间市场	4,729,194,608.79	-
合计	12,902,569,608.79	-

注：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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,961,882.88	335,110.55
应收定期存款利息	449,241,912.36	139,900,211.77
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	21,325.04	100,856.36
应收债券利息	72,889,423.87	130,859,385.64
应收资产支持证券利息	-	278,312.33
应收买入返售证券利息	6,140,691.04	7,829,981.06
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	11.66	66.00
合计	532,255,246.85	279,303,923.71

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	508,401.18	556,843.72
合计	508,401.18	556,843.72

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.23	918.00
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	279,300.00	279,300.00
其他	-	-
合计	279,300.23	280,218.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方天天利货币 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,341,398,460.56	10,341,398,460.56
本期申购	47,581,405,448.74	47,581,405,448.74
本期赎回（以“-”号填列）	-48,753,836,974.69	-48,753,836,974.69

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	9,168,966,934.61	9,168,966,934.61

南方天天利货币 B		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	79,538,960,562.95	79,538,960,562.95
本期申购	219,779,155,972.38	219,779,155,972.38
本期赎回（以“-”号填列）	-164,208,826,544.55	-164,208,826,544.55
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	135,109,289,990.78	135,109,289,990.78

南方天天利货币 E		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,291,519,573.65	2,291,519,573.65
本期申购	14,973,389,034.13	14,973,389,034.13
本期赎回（以“-”号填列）	-14,967,079,034.37	-14,967,079,034.37
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	2,297,829,573.41	2,297,829,573.41

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	253,369,221.26	-	253,369,221.26
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	-253,369,221.26	-	-253,369,221.26
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	2,805,678,243.86	-	2,805,678,243.86
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	-2,805,678,243.86	-	-2,805,678,243.86
本期末	-	-	-

南方天天利货币 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	58,260,783.75	-	58,260,783.75
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	-58,260,783.75	-	-58,260,783.75
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,224,571.73	19,276,445.73
定期存款利息收入	1,339,625,190.91	1,028,852,589.32
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,384,118.43	2,868,321.33
其他	1,618.88	914.61
合计	1,348,235,499.95	1,050,998,270.99

7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	171,215,778,148.72	180,544,476,169.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	170,875,338,773.57	180,127,817,008.90
减：应收利息总额	334,469,302.24	429,619,522.20

买卖债券差价收入	5,970,072.91	-12,960,361.35

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出资产支持证券成交总额	111,946,470.14	192,583,827.22
减：卖出资产支持证券成本总额	111,000,000.00	191,000,000.00
减：应收利息总额	936,927.24	1,583,827.22
资产支持证券投资收益	9,542.90	-

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	701.16
合计	-	701.16

7.4.7.15 交易费用

无。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	150,000.00	150,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	35,877.57	37,500.00
银行费用	168,048.28	163,970.41
其他	542.50	250.00
合计	474,468.35	471,720.41

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
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
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) (“厦门合泽吉”)	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) (“厦门合泽祥”)	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) (“厦门合泽益”)	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) (“厦门合泽盈”)	基金管理人的股东
华泰创新投资有限公司(“华泰创新”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
华泰紫金投资有限责任公司(“华泰紫金”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南京致远股权投资合伙企业(有限合伙) (“南京致远股权”)	基金管理人的股东华泰证券控制的合伙企业
伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业(有限合伙) (“伊犁华泰瑞达股权”)	基金管理人的股东华泰证券控制的合伙企业
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
深圳南方股权投资基金管理有限公司(“南方股权")	基金管理人的孙公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	185,497,867.27	172,683,192.09
其中：支付销售机构的客户维护费	21,539,175.43	24,880,030.10

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 × 0.15%/ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	61,832,622.34	57,561,064.04

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 × 0.05%/ 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	南方天天利货币 E	合计
华泰证券	21,855.59	218,881.26	1,031,300.62	1,272,037.47
交通银行	102,112.54	26,007.60	-	128,120.14
南方基金	295,975.14	8,772,513.15	323,458.63	9,391,946.92
兴业证券	7,822.39	3,737.47	-	11,559.86
合计	427,765.66	9,021,139.48	1,354,759.25	10,803,664.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 E	合计
华泰证券	46,931.57	125,754.96	574,075.16	746,761.69
交通银行	141,779.36	40,453.72	-	182,233.08
南方基金	1,336,494.49	7,755,103.81	519,371.72	9,610,970.02
兴业证券	10,650.88	8,211.30	-	18,862.18

合计	1,535,856.30	7,929,523.79	1,093,446.88	10,558,826.97

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额的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 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%和 0.10%。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 A/B/E 类基金份额的基金资产净值 X 约定年费率/ 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
交通银行	1,032,742,368.22	1,151,679,155.21	-	-	5,696,045,000.00	438,841.93

上年度可比期间 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
交通银行	-	-	-	-	-	-

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	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 E
报告期初持有的基金份额	0.17	355,177,040.82	-
报告期间申购/买入总份额	-	2,729,420,857.77	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	2,712,300,009.45	-
报告期末持有的基金份额	0.17	372,297,889.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.25%	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 E
报告期初持有的基金份额	466,167.52	870,438,110.19	-
报告期间申购/买入总份额	7,037,180.74	1,432,238,930.63	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	7,503,348.09	1,947,500,000.00	-
报告期末持有的基金份额	0.17	355,177,040.82	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.39%	-

注：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。

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	南方天天利货币 B	
	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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
华泰创新投资有限公司	31,607,708.76	0.02%	-	-
华泰证券股份有限公司	1,023,210,057.48	0.70%	-	-
华泰紫金投资有限责任公司	1,385,243,949.29	0.95%	320,749,220.38	0.35%
交通银行股份有限公司	1,711,906,269.32	1.17%	674,402,616.11	0.73%
南方资本管理有限公司	90,281,022.29	0.06%	145,630,246.75	0.16%
南京致远股权投资合伙企业(有限合伙)	32,757,869.51	0.02%	-	-
深圳南方股权投资基金管理有限公司	24,496,108.72	0.02%	-	-
深圳市投资控股有限公司	18,192.18	0.00%	1,028,754,801.81	1.12%
深圳市投资控股有限公司结算中心	1,093,247,381.90	0.75%	1,065,675,077.47	1.16%
厦门国际信托有限公司	-	-	100,107,421.34	0.11%
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	163,863.03	0.00%	-	-
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	194,966.42	0.00%	-	-
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	174,923.83	0.00%	-	-
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	215,180.84	0.00%	-	-
伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业(有限合伙)	38,011,768.44	0.03%	-	-

关联方名称	南方天天利货币 E			
	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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
南方资本管理有限公司	1,742,251.41	0.00%	-	-
-	-	-	-	-

注：交通银行、华泰紫金、深圳投资控股、华泰证券、南方资本、伊犁华泰瑞达股权、南京致远股权、华泰创新、南方股权、厦门合泽盈、厦门合泽祥、厦门合泽益、厦门合泽吉和厦门国际信托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。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
交通银行	13,005,761,747.48	8,849,571.73	459,341,412.71	67,279,223.04

注：本基金由基金托管人交通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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
交通银行股份有限公司	112106077	21 交通银行 CD077	报价发行	19,000,000	1,887,534,100.00
交通银行股份有限公司	112106059	21 交通银行 CD059	报价发行	15,000,000	1,454,334,000.00
交通银行股份有限公司	112106294	21 交通银行 CD294	报价发行	12,000,000	1,167,315,600.00
交通银行股份有限公司	112106282	21 交通银行 CD282	报价发行	10,000,000	973,236,000.00
交通银行股份有限公司	112106012	21 交通银行 CD012	报价发行	8,500,000	843,862,150.00
交通银行股份有限公司	112106215	21 交通银行 CD215	报价发行	5,000,000	496,993,500.00
交通银行股份有限公司	112106123	21 交通银行 CD123	报价发行	3,000,000	298,089,900.00
交通银行股份有限公司	112106171	21 交通银行 CD171	报价发行	2,500,000	243,119,750.00
交通银行股份有限公司	112106209	21 交通银行 CD209	报价发行	1,000,000	97,323,600.00

上年度可比期间 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
华泰证券	179200	华元 02A1	网上申购	1,000,000	100,000,000.00
交通银行	112006020	20 交通银行 CD020	报价发行	2,000,000	194,443,200.00
交通银行	112006040	20 交通银行	报价发行	7,500,000	732,422,250.

		CD040			00
交通银行	112006064	20 交通银行 CD064	报价发行	3,000,000	295,014,300.00
交通银行	112006065	20 交通银行 CD065	报价发行	6,000,000	589,970,400.00
交通银行	112006122	20 交通银行 CD122	报价发行	10,000,000	993,987,000.00
交通银行	112006159	20 交通银行 CD159	报价发行	3,000,000	298,054,200.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 12 月 31 日，基金持有关联方交通银行发行的同业存单，账面价值为人民币 3,108,781,123.37 元，占基金资产净值的比例为 2.12%(2020 年 12 月 31 日：账面价值为人民币 875,958,099.75 元，占基金资产净值的比例为 0.95%)。

7.4.11 利润分配情况

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
253,369,221.26	-	-	253,369,221.26	-

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
2,805,678,243.86	-	-	2,805,678,243.86	-

南方天天利货币 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
58,260,783.75	-	-	58,260,783.75	-

7.4.12 期末（2021 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 2021 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 3,013,212,146.18 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
112103030	21 农业银行 CD030	2022 年 1 月 4 日	99.38	5,435,000	540,149,686.09
112106059	21 交通银行 CD059	2022 年 1 月 5 日	99.48	5,748,000	571,789,257.10
112106294	21 交通银行 CD294	2022 年 1 月 5 日	97.76	5,748,000	561,901,081.11
112170391	21 广州农村商业银行 CD111	2022 年 1 月 4 日	99.34	7,700,000	764,914,410.41
112170472	21 郑州银行 CD266	2022 年 1 月 4 日	99.33	1,867,000	185,452,483.27
112171517	21 贵州银行 CD081	2022 年 1 月 4 日	99.17	581,000	57,619,560.22
112172927	21 成都农商银行 CD233	2022 年 1 月 4 日	99.07	2,291,000	226,961,162.98
112189907	21 郑州银行 CD255	2022 年 1 月 4 日	99.40	3,848,000	382,488,382.19
112197000	21 贵州银行 CD021	2022 年 1 月 4 日	99.17	110,000	10,909,245.31
合计	-	-	-	33,328,000	3,302,185,268.68

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 900,000,000.00 元，截至 2022 年 1 月 6 日先后到期。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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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交通银行；定期存款存放在具有基金托管资格的广发银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司以及商业银行创兴银行有限公司、富滇银行股份有限公司、江苏江南农村商业银行股份有限公司和盛京银行股份有限公司，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 2021 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 37.42%(2020 年 12 月 31 日：52.66%)。

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 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 3,913,212,146.18 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约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 个交易日内到期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 个交易日内到期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 2021 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 17.74%，本基金投资组合的平均剩余期限为 106 天，平均剩余存续期为 106 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发行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 2021 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 0.55%。

同时，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逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，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 2021 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	74,868,761,747.48	12,200,000,000.00	-	-	87,068,761,747.48
结算备付金	43,081,012.93	-	-	-	43,081,012.93
存出保证金	23,433.09	-	-	-	23,433.09
交易性金融资产	48,847,472,284.66	10,028,726,862.79	-	-	58,876,199,147.45
买入返售金融资产	4,860,809,777.42	-	-	-	4,860,809,777.42
应收利息	-	-	-	532,255,246.85	532,255,246.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	139,101,454.82	139,101,454.82
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	128,620,148,255.58	22,228,726,862.79	-	671,356,701.67	151,520,231,820.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,000,002,736.76	1,000,002,736.76
应付管理人报酬	-	-	-	19,138,026.73	19,138,026.73
应付托管费	-	-	-	6,379,342.23	6,379,342.23
应付证券清算款	-	-	-	78,901.88	78,901.88
卖出回购金融资产款	3,913,212,146.18	-	-	-	3,913,212,146.18
应付销售服务费	-	-	-	3,418,800.50	3,418,800.50
应付交易费用	-	-	-	508,401.18	508,401.18
应付利息	-	-	-	1,109,570.25	1,109,570.25
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	18,095.30	18,095.30
其他负债	-	-	-	279,300.23	279,300.23
负债总计	3,913,212,146.18	-	-	1,030,933,175.06	4,944,145,321.24
利率敏感度缺口	124,706,936,109.40	22,228,726,862.79	-	-359,576,473.39	146,576,086,498.80
上年度末 2020 年 12 月	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计

31 日					
资产					
银行存款	25,823,841,412.71	-	-	-	25,823,841,412.71
结算备付金	203,750,074.13	-	-	-	203,750,074.13
存出保证金	133,297.79	-	-	-	133,297.79
交易性金融资产	51,718,675,772.17	4,221,677,531.49	-	-	55,940,353,303.66
买入返售金融资产	12,902,569,608.79	-	-	-	12,902,569,608.79
应收利息	-	-	-	279,303,923.71	279,303,923.71
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,729,883.46	9,729,883.46
应收证券清算款	-	-	-	198,137,889.04	198,137,889.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	90,648,970,165.59	4,221,677,531.49	-	487,171,696.21	95,357,819,393.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	93,749.45	93,749.45
应付管理人报酬	-	-	-	11,179,815.76	11,179,815.76
应付托管费	-	-	-	3,726,605.26	3,726,605.26
应付证券清算款	-	-	-	736,688,965.72	736,688,965.72
卖出回购金融资产款	2,430,166,359.74	-	-	-	2,430,166,359.74
应付销售服务费	-	-	-	2,852,540.30	2,852,540.30
应付交易费用	-	-	-	556,843.72	556,843.72
应付利息	-	-	-	288,079.55	288,079.55
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	107,618.63	107,618.63
其他负债	-	-	-	280,218.00	280,218.00
负债总计	2,430,166,359.74	-	-	755,774,436.39	3,185,940,796.13
利率敏感度缺口	88,218,803,805.85	4,221,677,531.49	-	-268,602,740.18	92,171,878,597.16

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（ 2021 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-50,039,804.19	-34,536,277.02
	2.市场利率平行下降 25 个基点	50,225,118.62	34,648,355.58

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 2021 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 58,876,199,147.45 元，无属于第一或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第二层次 55,940,353,303.66 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 2021 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(2020 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号－金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号－金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号－套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，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	58,876,199,147.45	38.86
	其中：债券	58,876,199,147.45	38.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,860,809,777.42	3.21
	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	87,111,842,760.41	57.49
4	其他资产	671,380,134.76	0.44

5	合计	151,520,231,820.04	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	1.36	
	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	3,913,212,146.18	2.67
	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	104
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

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	15.88	2.67
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.10	-
2	30 天（含）-60 天	12.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）-90 天	25.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.07	-
4	90 天（含）-120 天	21.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天（含）-397 天（含）	27.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	102.92	2.67

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	1,730,021,739.94	1.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,290,988,580.98	1.56
	其中：政策性金融债	2,290,988,580.98	1.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	719,947,200.16	0.49
6	中期票据	-	-
7	同业存单	54,135,241,626.37	36.93
8	其他	-	-
9	合计	58,876,199,147.45	40.17
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	249,404,927.78	0.17

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	112106059	21 交通银行 CD059	15,000,000	1,492,143,155.27	1.02
2	112170370	21 徽商银行 CD128	15,000,000	1,490,090,621.40	1.02
3	112115321	21 民生银行 CD321	15,000,000	1,486,396,921.56	1.01
4	112115080	21 民生银行 CD080	14,000,000	1,391,252,444.95	0.95
5	112120299	21 广发银行 CD299	13,000,000	1,283,278,875.57	0.88
6	112106294	21 交通银行 CD294	13,000,000	1,270,827,079.76	0.87
7	019649	21 国债 01	10,707,740	1,070,690,480.60	0.73
8	210206	21 国开 06	10,300,000	1,030,172,751.90	0.70
9	112103030	21 农业银行 CD030	10,000,000	993,835,668.97	0.68
10	112171908	21 宁波银行 CD291	10,000,000	991,505,498.87	0.68

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	0.0809%
报告期内偏离度的最低值	-0.0302%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0281%

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 21 交通银行 CD059（证券代码 112106059）、21 交通银行 CD294（证券代码 112106294）、21 民生银行 CD080（证券代码 112115080）、21 民生银行 CD321（证券代码 112115321）、21 宁波银行 CD291（证券代码 112171908）、21 农业银行 CD030（证券代码 112103030）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、21 交通银行 CD059（证券代码 112106059）、21 交通银行 CD294（证券代码 112106294）

交通银行 2021 年 6 月 18 日公告称，因未按监管要求监测贷款资金用途，贷款资金回流部分转作银行承兑汇票保证金，中国银行保险监督管理委员会临沂监管分局对公司处以罚款 20 万元的处分。交通银行 2021 年 7 月 16 日公告称，因理财业务和同业业务制度不健全、理财业务数据与事实不符等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司处以罚款 4100 万元。交通银行 2021 年 8 月 20 日公告称，因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，中国人民银行对公司处以罚款 62 万元的处分。

2、21 民生银行 CD080（证券代码 112115080）、21 民生银行 CD321（证券代码 112115321）

民生银行 2021 年 7 月 16 日公告称，因监管发现问题屡查屡犯、检查发现问题整改不到位等原因，中国银行保险监督管理委员会对中国民生银行股份有限公司罚款 11450 万元。

3、21 宁波银行 CD291（证券代码 112171908）

宁波银行 2021 年 6 月 11 日公告称，因代理销售保险不规范，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

宁波银行 2021 年 7 月 21 日公告称，因违规为存款人多头开立银行结算账户等原因，中国人民银行宁波市中心支行对公司给予警告，并处罚款 286.2 万元。

宁波银行 2021 年 8 月 6 日公告称，因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储等原因，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

宁波银行 2021 年 12 月 31 日公告称，因信用卡业务管理不到位，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司罚款人民币 30 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

4、21 农业银行 CD030（证券代码 112103030）

处罚时间：2021 年 12 月 8 日 处罚原因：一、农业银行制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权；二、农业银行河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求，违法行为情节较为严重 处罚结果：罚款 150 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	23,433.09
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	532,255,246.85
4	应收申购款	139,101,454.82
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	671,380,134.76

§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
南方天天利货币 A	3,663,517	2,502.78	251,639,694.00	2.74%	8,917,327,240.61	97.26%
南方天天利货币 B	1,859,460	72,660.50	112,589,626,413.25	83.33%	22,519,663,577.53	16.67%
南方天天利货币 E	348,769	6,588.40	845,627,452.26	36.80%	1,452,202,121.15	63.20%
合计	5,871,746	24,962.95	113,686,893,559.51	77.56%	32,889,192,939.29	22.44%

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	银行类机构	3,716,204,950.69	2.54%
2	其他机构	2,862,850,665.53	1.95%
3	银行类机构	2,834,264,232.75	1.93%
4	银行类机构	2,743,758,244.16	1.87%
5	其他机构	2,716,715,903.41	1.85%
6	银行类机构	2,574,490,007.00	1.76%
7	银行类机构	2,533,659,924.87	1.73%
8	银行类机构	2,020,494,535.63	1.38%
9	银行类机构	2,005,838,617.26	1.37%
10	银行类机构	2,000,604,595.52	1.36%

9.3 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	1,494,806.47	0.0163%
	南方天天利货币 B	108,098,034.29	0.0800%
	南方天天利货币 E	2,683,804.48	0.1168%
	合计	112,276,645.24	0.0766%

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）。

9.4 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	南方天天利货币 A	10~50
	南方天天利货币 B	>100
	南方天天利货币 E	50~100
	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	0
	南方天天利货币 B	>100
	南方天天利货币 E	0
	合计	>100

§10 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	南方天天利货币 E
基金合同生效日(2016 年 10 月 20 日)基金份额总额	55,957,587.96	200,010,555.55	-
本报告期期初基金份额总额	10,341,398,460.56	79,538,960,562.95	2,291,519,573.65
本报告期期间基金总申购份额	47,581,405,448.74	219,779,155,972.38	14,973,389,034.13
减:本报告期基金总赎回份额	48,753,836,974.69	164,208,826,544.55	14,967,079,034.37
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	9,168,966,934.61	135,109,289,990.78	2,297,829,573.41

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长张海波先生病逝缺位，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。

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川先生兼任首席信息官。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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 150,000.00 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	
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。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

退租交易单元：

无

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
申万宏源	1,457,134,728.42	100.00%	333,811,347,000.00	100.00%	-	-

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	南方基金管理股份有限公司关于北京恒宇天泽基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基	证券时报、基金管理人网站、中国证监会	2021-01-07

	金的公告	基金电子披露网站	
2	南方天天利货币市场基金 2021 年春节暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
3	南方天天利货币市场基金 2021 年清明节暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-25
4	南方基金关于旗下部分基金增加中国建设银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-26
5	关于《南方天天利货币市场基金 2021 年清明节暂停申购及转换转入业务的公告》的补充公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
6	南方基金关于旗下部分基金增加坤元基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-01
7	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
8	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
9	南方基金关于旗下部分基金在中信银行机构投资平台进行销售的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-19
10	南方天天利货币市场基金 2021 年五一劳动节暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
11	南方天天利货币市场基金 2021 年端午节暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-03
12	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下南方天天利货币市场基金 E 类份额申购和定投业务金额限制的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-08
13	南方基金关于旗下部分基金增加江海证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-08
14	南方基金管理股份有限公司关于大河财富基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18
15	南方基金关于旗下部分基金增加首创证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-29
16	南方基金关于旗下部分基金增加招商银行为销	证券时报、基金管理	2021-07-21

	售机构及开通相关业务的公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
17	南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-08
18	南方天天利货币市场基金 2021 年中秋节暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-09
19	南方天天利货币市场基金 2021 年国庆节暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-22
20	南方天天利货币市场基金 2022 年元旦节暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-12-23
21	南方基金管理股份有限公司关于国开证券股份有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-12-31

§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、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、《南方天天利货币市场基金 2021 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