南方现金通货币市场基金2022年年度报告

2022年12月31日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023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，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2022 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.....12
§4 管理人报告.....14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....14
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....16
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.....17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....20
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....20
§5 托管人报告.....20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....20
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20
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.....20
§6 审计报告.....20
6.1 审计报告基本信息.....21
6.2 审计报告的基本内容.....21
§7 年度财务报表.....23
7.1 资产负债表.....23
7.2 利润表.....24
7.3 净资产（基金净值）变动表.....25
7.4 报表附注.....27
§8 投资组合报告.....58
8.1 期末基金资产组合情况.....58
8.2 债券回购融资情况.....58
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....58
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.....59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....59
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明

细.....59
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....60
8.8 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...60
8.9 投资组合报告附注.....61
§9 基金份额持有人信息.....61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....61
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....62
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.....63
§10 开放式基金份额变动.....63
§11 重大事件揭示.....64
11.1 基金份额持有人大会决议.....64
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.....64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....64
11.4 基金投资策略的改变.....64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....64
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.....64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....65
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....66
11.9 其他重大事件.....66
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....67
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.....67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....67
§13 备查文件目录.....67
13.1 备查文件目录.....67
13.2 存放地点.....67
13.3 查阅方式.....67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方现金通货币市场基金			
基金简称	南方现金通货币			
基金主代码	000493			
交易代码	000493			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2014 年 1 月 21 日			
基金管理人	南方基金管理股份有限公司			
基金托管人	中国工商银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	165,195,356,390.51 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	南方现金通货币 A	南方现金通货币 B	南方现金通货币 C	南方现金通货币 E
下属分级基金的交易代码	000493	000494	000495	000719
报告期末下属分级基金的份额总额	365,848.41 份	785,234.26 份	1,255,010,596.62 份	163,939,194,711.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588

传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	周易	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	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、南方现金通货币 A

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	5,145.91	10,968.32	27,769.66
本期利润	5,145.91	10,968.32	27,769.66
本期净值收益率	1.7621%	2.1699%	2.1431%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末基金资产净值	365,848.41	396,980.11	787,951.99
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
累计净值收益率	32.3712%	30.0790%	27.3164%

2、南方现金通货币 B

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	20,573.53	49,706.66	116,129.29
本期利润	20,573.53	49,706.66	116,129.29
本期净值收益率	1.8351%	2.2344%	2.1997%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末基金资产净值	785,234.26	1,993,209.71	2,622,267.59
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
累计净值收益率	33.0331%	30.6358%	27.7807%

3、南方现金通货币 C

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	26,983,756.45	172,418,772.01	221,249,222.71
本期利润	26,983,756.45	172,418,772.01	221,249,222.71
本期净值收益率	1.9044%	2.3007%	2.2664%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末基金资产净值	1,255,010,596.62	2,263,303,969.24	11,733,514,421.24
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
累计净值收益率	33.8186%	31.3178%	28.3645%

4、南方现金通货币 E

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	2,564,266,902.82	3,032,812,814.48	2,186,205,948.51
本期利润	2,564,266,902.82	3,032,812,814.48	2,186,205,948.51
本期净值收益率	1.7232%	2.1186%	2.0829%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末

期末基金资产净值	163,939,194,711.22	145,533,883,401.40	127,782,892,682.32
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
累计净值收益率	28.8611%	26.6781%	24.0499%

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，由于货币市场基金按照实际利率计算账面价值，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

南方现金通货币 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	0.4195%	0.0007%	0.3456%	0.0000%	0.0739%	0.0007%
过去六个月	0.8059%	0.0010%	0.6924%	0.0000%	0.1135%	0.0010%
过去一年	1.7621%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	0.3840%	0.0011%
过去三年	6.1985%	0.0011%	4.1955%	0.0000%	2.0030%	0.0011%
过去五年	13.3918%	0.0023%	7.0872%	0.0000%	6.3046%	0.0023%
自基金合同生效起至今	32.3712%	0.0055%	13.0331%	0.0000%	19.3381%	0.0055%

南方现金通货币 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	0.4385%	0.0006%	0.3456%	0.0000%	0.0929%	0.0006%
过去六个月	0.8422%	0.0010%	0.6924%	0.0000%	0.1498%	0.0010%
过去一年	1.8351%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	0.4570%	0.0011%
过去三年	6.4006%	0.0011%	4.1955%	0.0000%	2.2051%	0.0011%
过去五年	13.7251%	0.0023%	7.0872%	0.0000%	6.6379%	0.0023%
自基金合同生效起至今	33.0331%	0.0055%	13.0331%	0.0000%	20.0000%	0.0055%

南方现金通货币 C

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

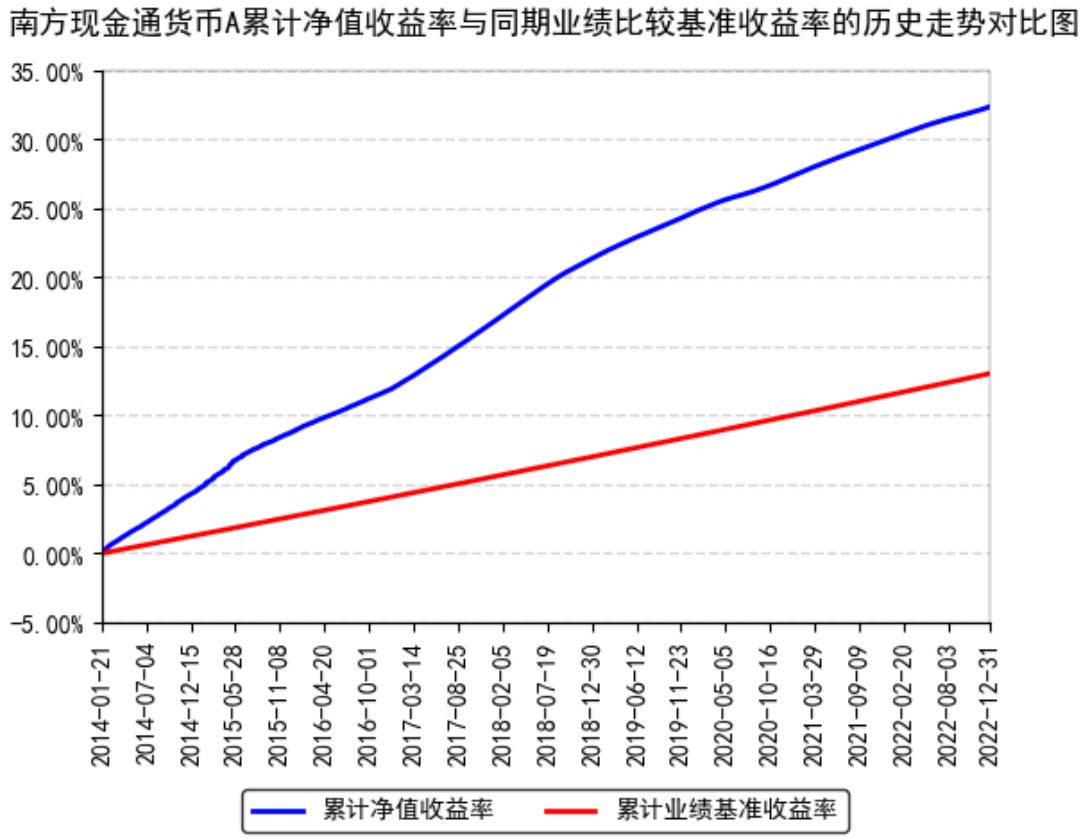
过去三个月	0.4558%	0.0006%	0.3456%	0.0000%	0.1102%	0.0006%
过去六个月	0.8780%	0.0010%	0.6924%	0.0000%	0.1856%	0.0010%
过去一年	1.9044%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	0.5263%	0.0011%
过去三年	6.6117%	0.0011%	4.1955%	0.0000%	2.4162%	0.0011%
过去五年	14.0981%	0.0023%	7.0872%	0.0000%	7.0109%	0.0023%
自基金合同生效起至今	33.8186%	0.0055%	13.0331%	0.0000%	20.7855%	0.0055%

南方现金通货币 E

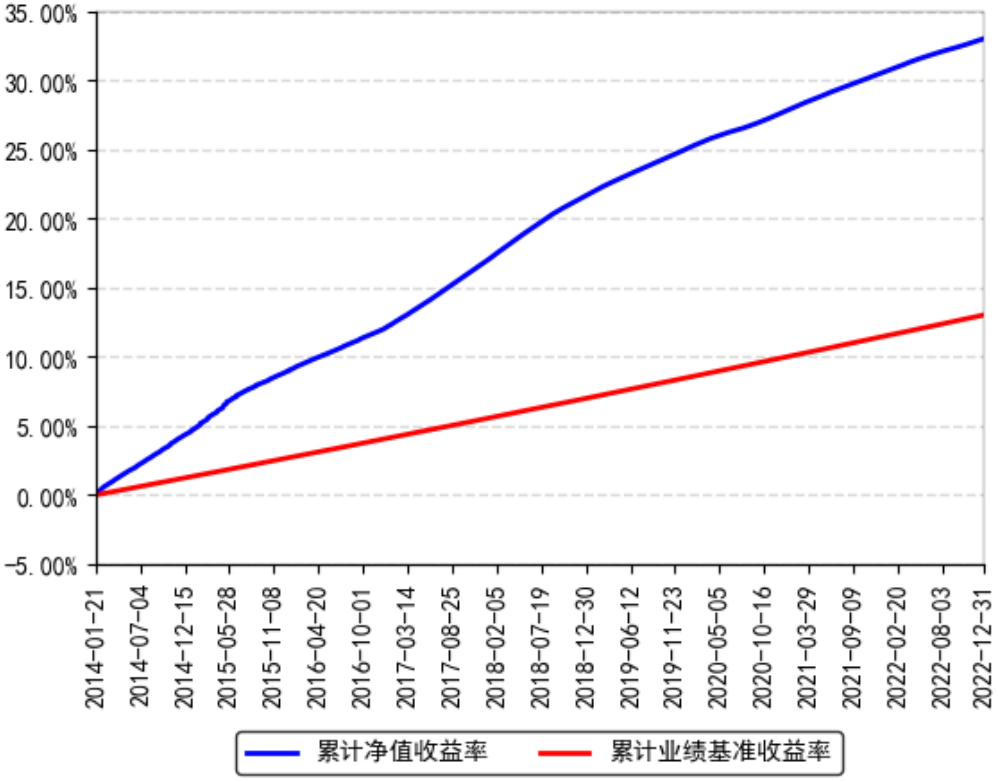
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4105%	0.0006%	0.3456%	0.0000%	0.0649%	0.0006%
过去六个月	0.7869%	0.0010%	0.6924%	0.0000%	0.0945%	0.0010%
过去一年	1.7232%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	0.3451%	0.0011%
过去三年	6.0421%	0.0011%	4.1955%	0.0000%	1.8466%	0.0011%
过去五年	13.0818%	0.0023%	7.0872%	0.0000%	5.9946%	0.0023%
自基金合同生效起至今	28.8611%	0.0054%	12.3485%	0.0000%	16.5126%	0.0054%

注：本基金收益分配为按日结转份额。

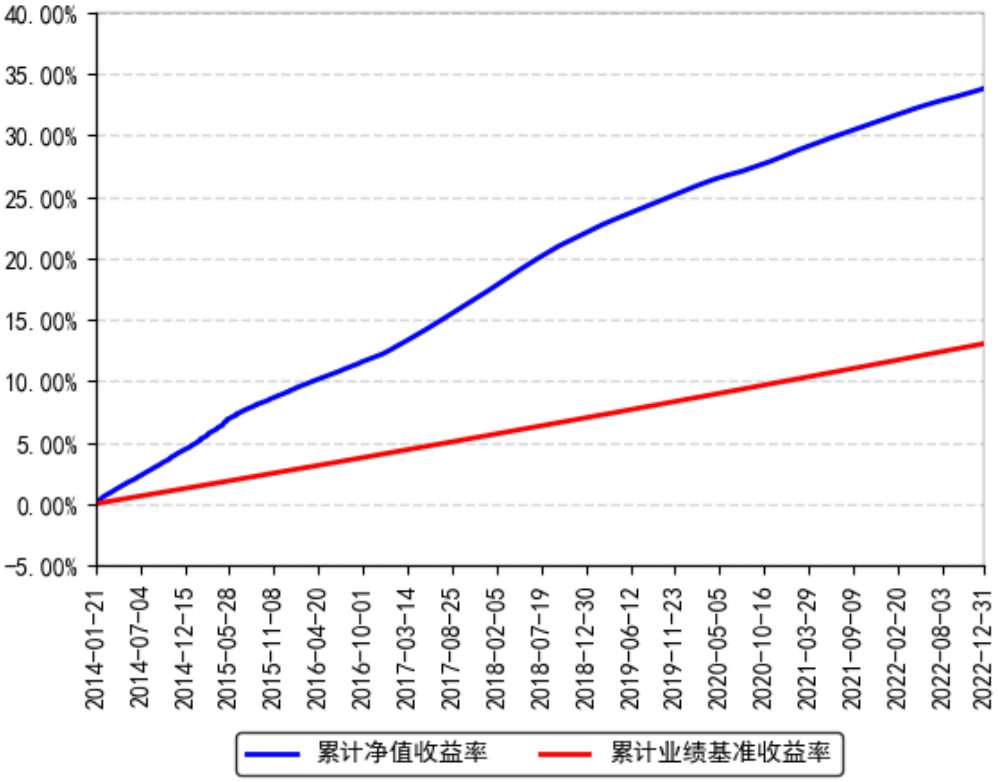
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

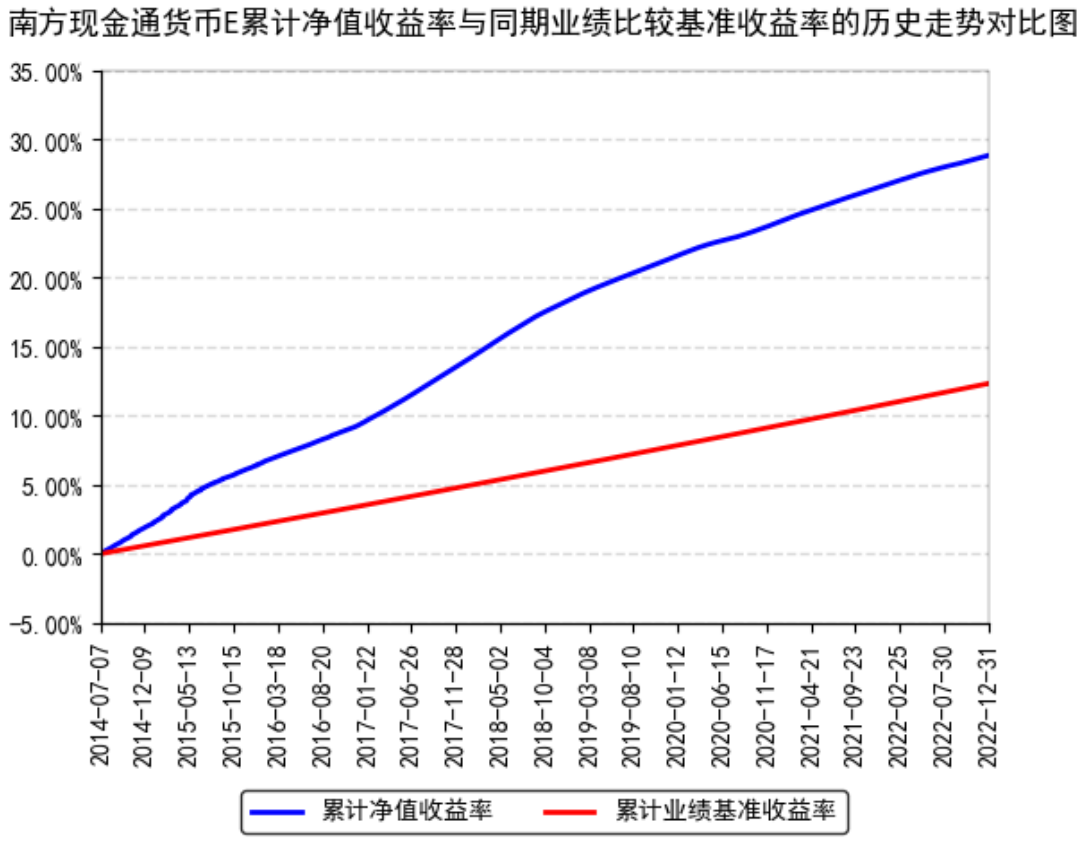


南方现金通货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

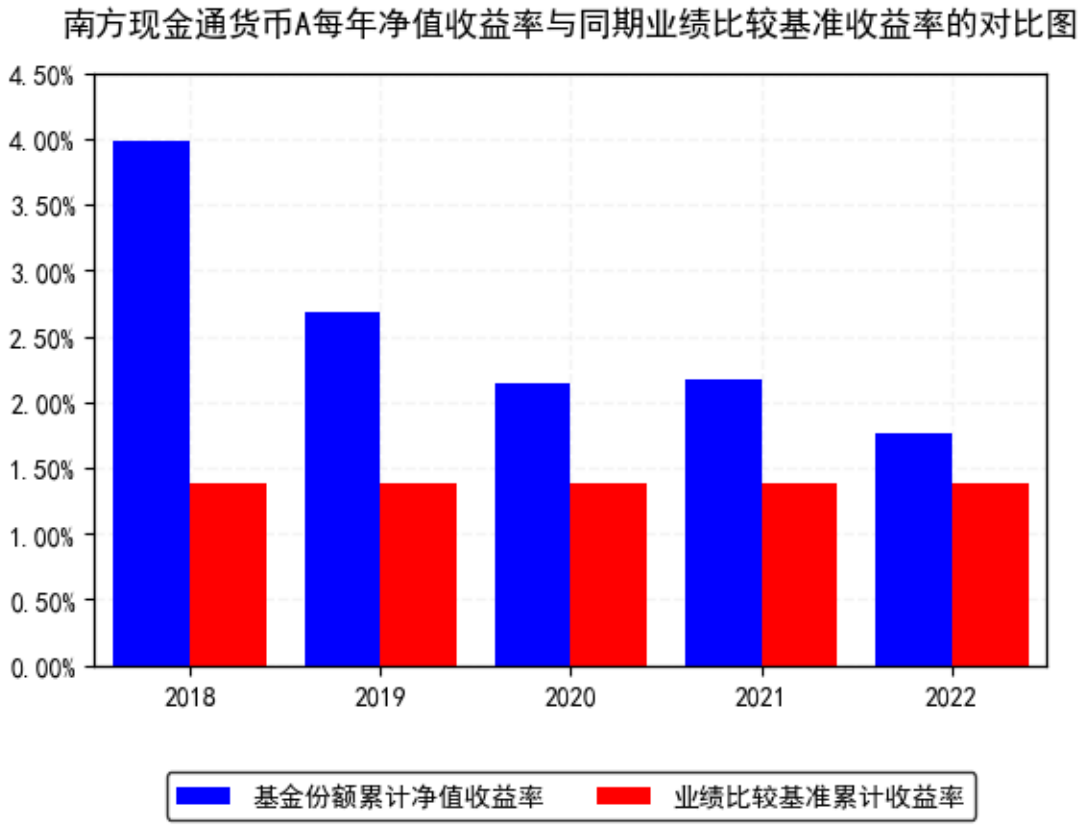


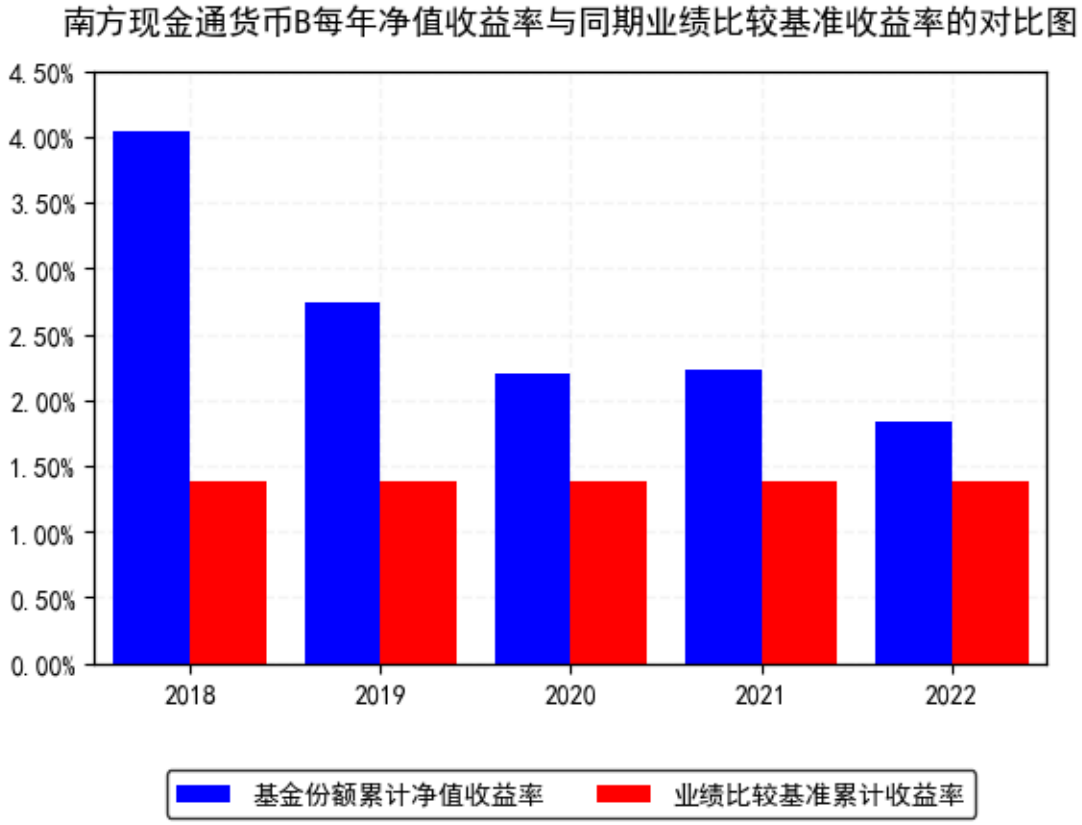
南方现金通货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

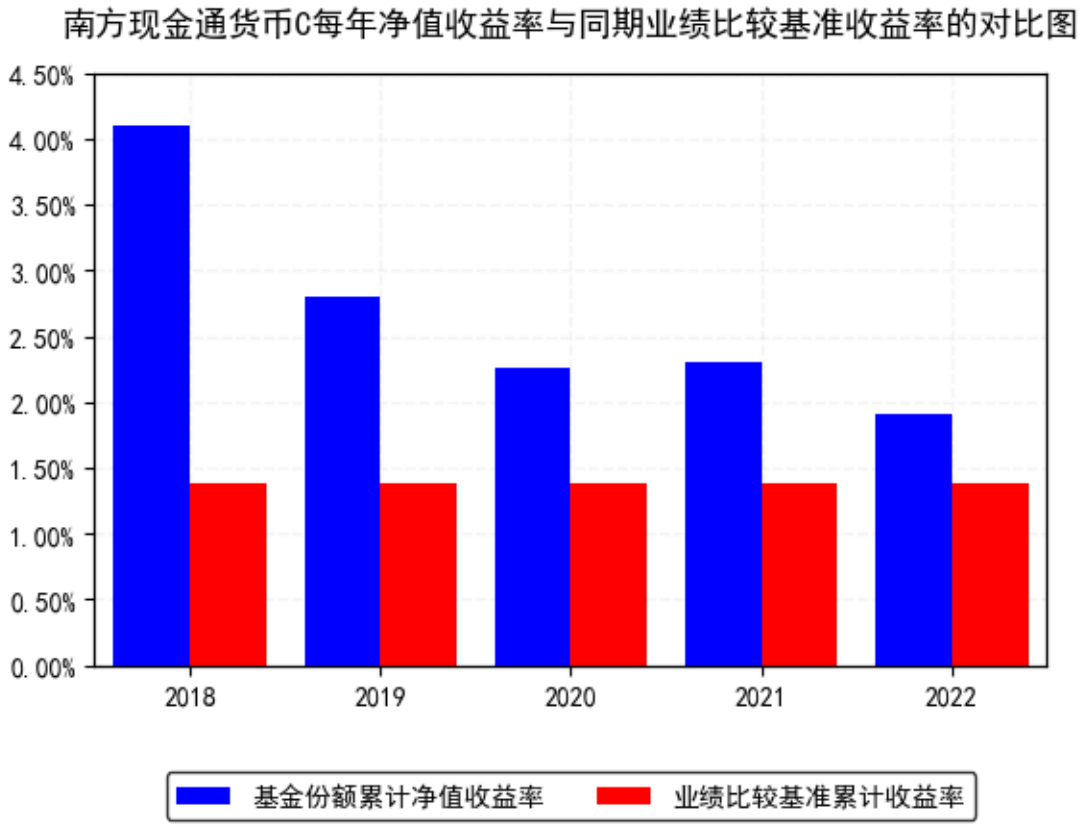


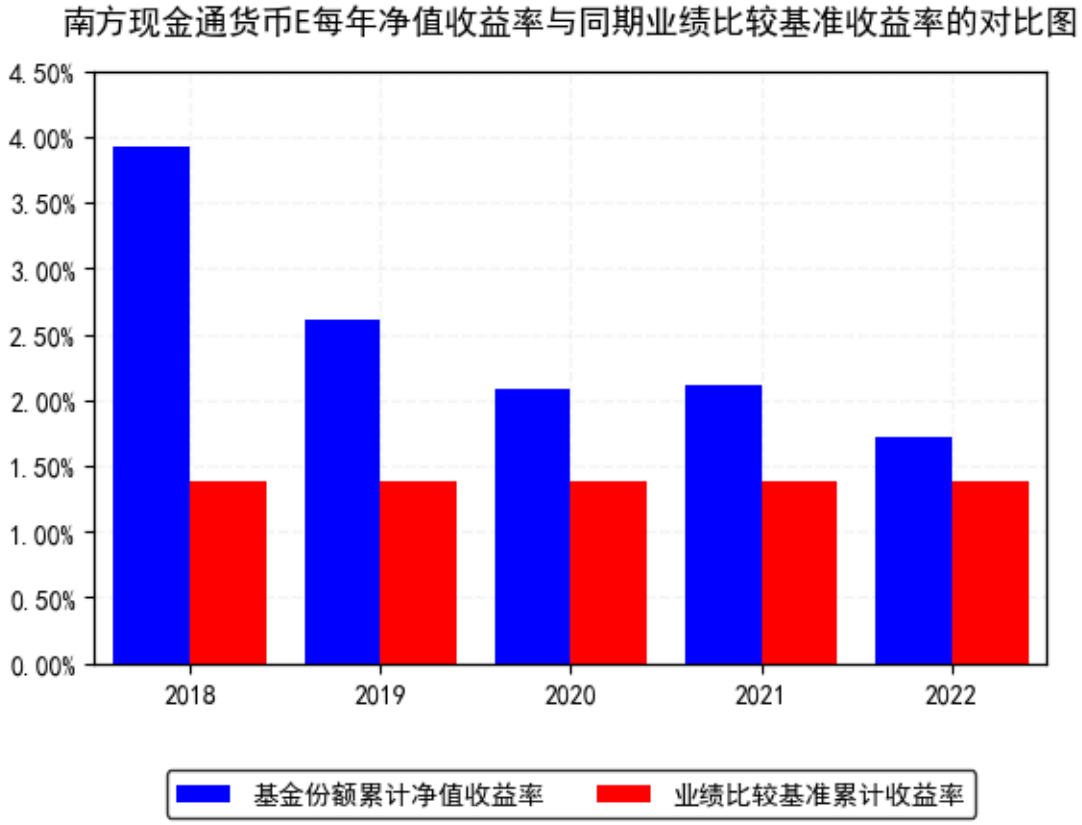


3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较


南方现金通货币A每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图
4.50%
4.00%
3.50%
3.00%
2.50%
2.00%
1.50%
1.00%
0.50%
0.00%
2018
2019
2020
2021
2022
基金份额累计净值收益率
业绩比较基准累计收益率


南方现金通货币B每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图
4.50%
4.00%
3.50%
3.00%
2.50%
2.00%
1.50%
1.00%
0.50%
0.00%
2018
2019
2020
2021
2022
基金份额累计净值收益率
业绩比较基准累计收益率





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

南方现金通货币 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
2022 年	5,145.91	-	-	5,145.91	-
2021 年	10,968.32	-	-	10,968.32	-
2020 年	27,769.66	-	-	27,769.66	-
合计	43,883.89	-	-	43,883.89	-

南方现金通货币 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
2022 年	20,573.53	-	-	20,573.53	-
2021 年	49,706.66	-	-	49,706.66	-
2020 年	116,129.29	-	-	116,129.29	-
合计	186,409.48	-	-	186,409.48	-

南方现金通货币 C

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
2022 年	26,983,756.45	-	-	26,983,756.45	-
2021 年	172,418,772.01	-	-	172,418,772.01	-
2020 年	221,249,222.71	-	-	221,249,222.71	-
合计	420,651,751.17	-	-	420,651,751.17	-

南方现金通货币 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
2022 年	2,564,266,902.82	-	-	2,564,266,902.82	-
2021 年	3,032,812,814.48	-	-	3,032,812,814.48	-

2020年	2,186,205,948.51	-	-	2,186,205,948.51	-
合计	7,783,285,665.81	-	-	7,783,285,665.81	-

§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 1.72 万亿元，旗下管理 317 只公募基金，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	2014 年 7 月 25 日	-	17 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，现任现金及债券指数投资部总经理、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；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；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；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。
董浩	本基金基金经理	2015 年 9 月 11 日	-	12 年	南开大学金融学硕士，具有基金从业资格。2010 年 7 月加入南方基金，历任交易管理部债券交易员、固定收益部货币理财类研究员；2014 年 3 月 31 日至 2015 年 9 月 11 日，任南方现金通基金经理助理；2015 年 9 月 11 日至 2016 年 8 月 17 日，任南方 50 债基金经理；2015 年 9 月 11 日至 2018 年 7 月 4 日，任南方中票基金经理；2017 年 8 月 9 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方天天宝基金经理；2018 年 12 月 5 日至 2020 年 5 月 22 日，任南方 3-5 年农发债基金经理；2019 年 3 月 15 日至 2020 年 5 月 22 日，任南方 7-10 年国开债基金经理；2016 年 11 月 17 日至 2020 年 12 月 15 日，任南方理财 60 天基金经理；2016 年 8 月 17 日至 2021 年 5 月 26 日，任南方 10 年国债基金经理；2015 年 9 月 11 日至今，任南方现金

					通基金经理；2016 年 2 月 3 日至今，任南方日添益货币基金经理；2018 年 11 月 8 日至今，任南方 1-3 年国开债基金经理；2019 年 5 月 24 日至今，任南方收益宝基金经理；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；2022 年 4 月 1 日至今，任南方理财金基金经理。

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。

4.1.3 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，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投资经理的基金经理，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，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。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放；同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

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 12 次，是由于投资组合的投资策略导致。

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

2022 年，疫情因素是全年经济基本面的主要影响因素。一季度疫情整体控制较好，社融和信贷数据波动较大，二三季度疫情影响逐渐扩大，对经济造成了较大冲击，收益率水平呈现单边下行趋势。四季度防控政策变化较快，基本面预期迅速扭转，收益率重新回到年初水平。海外看，美联储加息节奏的变化对国内市场整体影响较小。我国央行全年降息两次，合计下调公开市场操作利率 20BP，降准两次，合计下调存款准备金率 0.5%，为经济复苏维持了较宽松的货币环境。全年利率债震荡为主，1 年国债和 1 年国开收益率分别下行 15BP 和 8BP，3 个月国股存单和 1 年期国股存单收益率分别下行 25BP 和 18BP。基金整体保持了中性久期，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，四季度考虑到疫情政策的变化较大，组合久期先降后升，有效控制了风险，提高了静态收益。

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 1.7621%，同期业绩基准收益率为 1.3781%；本基金 B 份额净值收益率为 1.8351%，同期业绩基准收益率为 1.3781%；本基金 C 份额净值收益率为 1.9044%，同期业绩基准收益率为 1.3781%；本基金 E 份额净值收益率为 1.7232%，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

跨过 2022 年末疫情防控调整节点，市场对 2023 年经济复苏的预期较为强烈，春节期间亮眼的消费数据也阶段性支撑了这一预期。随着疫情高峰结束，预计 2023 年国内稳增长动力较强，各方政策助力下，国内经济有望逐步企稳回升。海外方面，衰退压力仍然较大，紧缩周期尚未结束，短期内对国内货币政策放松仍有一定制约。预计 23 年流动性水平依然保持合理充裕，当前短端利率水平较为合理，已经具备了一定配置价值。投资上，将密切关注宏观经济数据表现和货币政策边际变化，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 2022 年度发布的《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《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》和《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金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，严守底线，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》《防控内幕信息及交易管理制度》《合规绩效管理制度》《责任追究管理办法》《洗钱及制裁风险名单管理规定》和《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理规则》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，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，提升合规文化建设效果，着力增强合规培训实效性，提升合规宣导影响力；根据《基金从业人员管理规则》等监管办法要求，认真梳理并优化了员工行为检查工作方案，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，通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决，促进公司业务合规运作、稳健经营；结合内部风控系统大数据分析结果对各类合规指标采取差异化管控措施，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，不断强化销售合规风险管控，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；开展各类监管组织的投教活动，提升投教质效；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，贯彻风险为本，自评估驱动，反洗钱重点问题解决方案实现落地推进。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智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、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、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 2,591,276,378.71 元,实际分配收益 2,591,276,378.71 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

本报告期内，本基金托管人在对南方现金通货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方现金通货币市场基金基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方现金通货币市场基金 2022 年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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(2023)第 27729 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	南方现金通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 我们审计了南方现金通货币市场基金(以下简称“南方现金通货币基金”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(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，公允反映了南方现金通货币基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。
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，我们独立于南方现金通货币基金，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	南方现金通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现金通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现金通货币基金、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现金通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，就可能导致对南方现金通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现金通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　　陈薇瑶
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	2023 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方现金通货币市场基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	15,736,493,625.19	39,962,125,924.27
结算备付金		60,554,550.94	530,808,800.00
存出保证金		7,832.67	-
交易性金融资产	7.4.7.2	116,038,220,372.32	85,186,424,786.30
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		114,954,610,510.50	85,109,424,786.30
资产支持证券投资		1,083,609,861.82	77,000,000.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	41,202,495,342.10	28,790,666,706.88
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		393,792,568.96	903,660,890.17
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	492,629,620.69
资产总计		173,431,564,292.18	155,866,316,728.31
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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		7,765,707,898.71	7,990,203,625.34
应付清算款		392,595,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		34,207,907.72	31,891,660.46
应付托管费		6,858,750.27	6,414,482.28

应付销售服务费		34,186,438.84	31,846,460.02
应付投资顾问费		-	-
应交税费		784,882.25	611,683.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,867,023.88	5,771,256.43
负债合计		8,236,207,901.67	8,066,739,167.85
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	165,195,356,390.51	147,799,577,560.46
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-	-
净资产合计		165,195,356,390.51	147,799,577,560.46
负债和净资产总计		173,431,564,292.18	155,866,316,728.31

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，南方现金通货币 A 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 365,848.41 份；南方现金通货币 B 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 785,234.26 份；南方现金通货币 C 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,255,010,596.62 份；南方现金通货币 E 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 163,939,194,711.22 份；总份额合计 165,195,356,390.51 份。

7.2 利润表

会计主体：南方现金通货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		3,486,399,082.57	4,070,499,053.21
1.利息收入		1,421,685,487.28	4,049,745,034.24
其中：存款利息收入	7.4.7.9	495,496,412.21	1,355,086,835.39
债券利息收入		-	1,685,119,277.88
资产支持证券利息收入		-	2,763,442.81
买入返售金融资产收入		926,189,075.07	1,006,775,478.16
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,064,704,933.07	20,754,018.97
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.10	2,049,435,661.07	20,698,225.99
资产支持证券投资收益	7.4.7.11	15,269,272.00	55,792.98
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
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）	7.4.7.12	8,662.22	-
减：二、营业总支出		895,122,703.86	865,206,791.74
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	378,139,172.17	375,237,601.11
2.托管费	7.4.10.2.2	75,856,697.07	76,246,105.54
3.销售服务费	7.4.10.2.3	377,852,975.37	373,739,152.44
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		61,921,562.90	39,187,634.04
其中：卖出回购金融资产支出		61,921,562.90	39,187,634.04
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		898,942.59	347,136.50
8.其他费用	7.4.7.13	453,353.76	449,162.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,591,276,378.71	3,205,292,261.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,591,276,378.71	3,205,292,261.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,591,276,378.71	3,205,292,261.47

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方现金通货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	147,799,577,560.46	-	-	147,799,577,560.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	147,799,577,560.46	-	-	147,799,577,560.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,395,778,830.05	-	-	17,395,778,830.05
（一）、综合收益总额	-	-	2,591,276,378.71	2,591,276,378.71
（二）、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）	17,395,778,830.05	-	-	17,395,778,830.05
其中：1.基金申购款	2,917,824,975,943.35	-	-	2,917,824,975,943.35
2.基金赎回款	-2,900,429,197,113.30	-	-	-2,900,429,197,113.30
（三）、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）	-	-	-2,591,276,378.71	-2,591,276,378.71
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	165,195,356,390.51	-	-	165,195,356,390.51
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	139,519,817,323.14	-	-	139,519,817,323.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	139,519,817,323.	-	-	139,519,817,323.

资产（基金净值）	14			14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,279,760,237.32	-	-	8,279,760,237.32
（一）、综合收益总额	-	-	3,205,292,261.47	3,205,292,261.47
（二）、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）	8,279,760,237.32	-	-	8,279,760,237.32
其中：1.基金申购款	2,883,048,860,443.66	-	-	2,883,048,860,443.66
2.基金赎回款	-2,874,769,100,206.34	-	-	-2,874,769,100,206.34
（三）、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）	-	-	-3,205,292,261.47	-3,205,292,261.47
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	147,799,577,560.46	-	-	147,799,577,560.46

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

南方现金通货币市场基金(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[2013]第 1571 号《关于核准南方现金通货币市场基金募集的批复》核准，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《南方现金通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 212,283,005.55 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 046 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方现

金通货币市场基金基金合同》于 2014 年 1 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 212,316,611.19 份基金份额，其中认购资金利息折合 33,605.64 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《南方现金通货币市场基金基金合同》，本基金根据投资人持有基金份额的时间或数量，分别设置 A 类、B 类、C 类和 E 类四类基金份额，每类基金份额按照不同的费率计提管理费和销售服务费用。本基金 A 类基金份额开放认购、申购和赎回业务，B 类和 C 类不开放认购和申购业务，只开放赎回业务，B 类和 C 类基金份额根据持有时间或持有数量在满足一定条件后由系统自动升级生成。投资人在进行本基金 A 类、B 类或 C 类份额认购、申购和赎回时使用同一个基金代码，但是上述三类基金份额在信息披露等场合可以使用不同的代码和简称。根据《关于南方现金通货币市场基金增加基金份额类别、开放申购赎回业务并修改基金合同的公告》和《南方现金通货币市场基金招募说明书》，自 2014 年 7 月 2 日起本基金增加 E 类基金份额，收取固定的管理费和销售服务费，不随持有时间或持有数量升级或降级成其他基金份额类别。E 类基金份额通过本基金管理人指定的电子交易平台办理申购、赎回等业务并单独设置基金代码和简称。各类基金份额分别公布基金份额的每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方现金通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七天通知存款税后利率。

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 2023 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《南方现金通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 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指，从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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在初始确认时，以公允价值计量。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投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。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(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每日计提应计利息，同时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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。上述申购包括因类别调整而引起的 A、B、C 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

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投资收益。

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。

以摊余成本计量的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，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 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表时，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 39,962,125,924.27 元、530,808,800.00 元、28,790,666,706.88 元、492,629,620.69 元和 903,660,890.17 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 40,248,929,741.04 元、531,047,663.90 元、28,809,111,976.00 元、0.00 元和 903,660,890.17 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 85,186,424,786.30 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 85,373,566,457.20 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息，金额分别为 7,990,203,625.34

元、31,891,660.46 元、6,414,482.28 元、31,846,460.02 元、894,925.29 元和 4,597,031.14 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为 7,994,800,656.48 元、31,891,660.46 元、6,414,482.28 元、31,846,460.02 元、894,925.29 元和 0.00 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》 根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	595,306.51	625,924.27
等于：本金	515,407.96	625,924.27
加：应计利息	79,898.55	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	15,735,898,318.68	39,961,500,000.00
等于：本金	15,622,000,000.00	39,961,500,000.00
加：应计利息	113,898,318.68	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	230,000,000.00
存款期限 1-3 个月	2,205,317,333.08	2,172,000,000.00
存款期限 3 个月以上	13,530,580,985.60	37,559,500,000.00
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	15,736,493,625.19	39,962,125,924.27

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 2022 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	200,400,841.64	200,360,841.64	-40,000.00	0.0000
	银行间市场	114,754,209,668.86	114,816,830,502.67	62,620,833.81	0.0379

	合计	114,954,610,510.50	115,017,191,344.31	62,580,833.81	0.0379
资产支持证券		1,083,609,861.82	1,081,283,561.82	-2,326,300.00	-0.0014
合计		116,038,220,372.32	116,098,474,906.13	60,254,533.81	0.0365
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	85,109,424,786.30	85,196,161,549.54	86,736,763.24	0.0587
	合计	85,109,424,786.30	85,196,161,549.54	86,736,763.24	0.0587
资产支持证券		77,000,000.00	77,000,000.00	0.00	0.0000
合计		85,186,424,786.30	85,273,161,549.54	86,736,763.24	0.0587

1. 偏离金额＝影子定价－按实际利率计算的账面价值；
2. 偏离度＝偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,875,351,715.52	-
银行间市场	28,327,143,626.58	-
合计	41,202,495,342.10	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,079,400,000.00	-
银行间市场	14,711,266,706.88	-
合计	28,790,666,706.88	-

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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

应收利息	-	492,629,620.69
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	492,629,620.69

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,695,723.88	894,925.29
其中：交易所市场	-18,587.03	-18,587.03
银行间市场	1,714,310.91	913,512.32
应付利息	-	4,597,031.14
预提费用	171,300.00	279,300.00
其他	-	-
合计	1,867,023.88	5,771,256.43

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方现金通货币 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	396,980.11	396,980.11
本期申购	2,447,662,844.15	2,447,662,844.15
本期赎回（以“-”号填列）	-2,447,693,975.85	-2,447,693,975.85
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	365,848.41	365,848.41

南方现金通货币 B		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,993,209.71	1,993,209.71
本期申购	36,263,529.49	36,263,529.49
本期赎回（以“-”号填列）	-37,471,504.94	-37,471,504.94
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	785,234.26	785,234.26

南方现金通货币 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,263,303,969.24	2,263,303,969.24
本期申购	2,466,168,509.74	2,466,168,509.74
本期赎回（以“-”号填列）	-3,474,461,882.36	-3,474,461,882.36
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,255,010,596.62	1,255,010,596.62

南方现金通货币 E		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	145,533,883,401.40	145,533,883,401.40
本期申购	2,912,874,881,059.97	2,912,874,881,059.97
本期赎回（以“-”号填列）	-2,894,469,569,750.15	-2,894,469,569,750.15
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	163,939,194,711.22	163,939,194,711.22

注：

1. 申购含红利再投及 A、B 和 C 类基金份额之间的级别调整入份额；赎回含 A、B 和 C 类基金份额之间的级别调整出份额。

2.本基金 A 类和 E 类基金份额开放申购和赎回业务，B 类和 C 类基金份额不开放申购业务，只开放赎回业务。B 类和 C 类基金份额是根据持有时间或持有数量在满足一定条件后由系统自动升级生成。上表中申购、赎回份额均包含份额升级部分。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

南方现金通货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	5,145.91	-	5,145.91
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	-5,145.91	-	-5,145.91
本期末	-	-	-

南方现金通货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	20,573.53	-	20,573.53
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	-20,573.53	-	-20,573.53
本期末	-	-	-

南方现金通货币 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	26,983,756.45	-	26,983,756.45
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	-26,983,756.45	-	-26,983,756.45
本期末	-	-	-

南方现金通货币 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	2,564,266,902.82	-	2,564,266,902.82
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	-2,564,266,902.82	-	-2,564,266,902.82
本期末	-	-	-

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	635,922.06	469,000.14
定期存款利息收入	487,577,249.63	1,347,866,185.11

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	7,283,150.89	6,751,087.93
其他	89.63	562.21
合计	495,496,412.21	1,355,086,835.39

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	2,262,825,537.11	-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-213,389,876.04	20,698,225.99
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,049,435,661.07	20,698,225.99

7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	387,982,829,286.61	271,807,410,905.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	387,348,380,299.96	271,304,076,666.28
减：应计利息总额	847,838,862.69	482,636,013.59
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-213,389,876.04	20,698,225.99

7.4.7.11 资产支持证券投资收益

7.4.7.11.1 资产支持证券投资收益项目构成

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
资产支持证券投资收益——利息收入	15,269,272.00	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	55,792.98
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-

资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	15,269,272.00	55,792.98

7.4.7.11.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出资产支持证券成交总额	84,210,139.70	373,933,167.77
减：卖出资产支持证券成本总额	81,804,800.00	370,000,000.00
减：应计利息总额	2,405,339.70	3,877,374.79
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	55,792.98

7.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	8,662.22	-
合计	8,662.22	-

7.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	162,000.00	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	21,825.28	27,860.00
银行费用	149,228.48	150,102.11
其他	300.00	1,200.00
合计	453,353.76	449,162.11

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	4,364,267,000.00	0.42%	3,221,926,000.00	0.32%

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-	-	-18,587.03	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

华泰证券	-	-	-18,587.03	100.00%

注：

1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	378,139,172.17	375,237,601.11
其中：支付销售机构的客户维护费	186,482,355.47	178,618,992.98

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)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。A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额约定的年管理费率为 0.27%、0.22%、0.17%和 0.25%。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)的基金资产净值 X 该类基金份额年管理费率/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	75,856,697.07	76,246,105.54

注：支付基金托管人中国工商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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	南方现金通货币 A	南方现金通货币 B	南方现金通货币 C	南方现金通货币 E	合计
南方基金	465.29	1,818.69	2,138,584.96	2,634,128.46	4,774,997.40

工商银行	-	-	-	262,747.61	262,747.61
华泰证券	-	-	-	1,361,429.42	1,361,429.42
合计	465.29	1,818.69	2,138,584.96	4,258,305.49	6,399,174.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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				
	南方现金通货币 A	南方现金通货币 B	南方现金通货币 C	南方现金通货币 E	合计
工商银行	-	-	-	301,455.95	301,455.95
华泰证券	-	-	-	367,464.96	367,464.96
南方基金	929.66	3,943.58	11,226,056.73	4,579,796.85	15,810,726.82
合计	929.66	3,943.58	11,226,056.73	5,248,717.76	16,479,647.73

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)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、C 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%、0.20%、0.15%和 0.25%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费＝前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	1,063,754,174.51	-	-	-	192,279,105,000.00	17,367,623.81

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日						
银行间市	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

场交易的各关联方名称						
中国工商银行股份有限公司	-	-	6,447,869,000.00	3,866,614.69	22,419,715,000.00	3,820,714.95

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	南方现金通货币 A	南方现金通货币 B	南方现金通货币 C	南方现金通货币 E
报告期初持有的基金份额	65,045.53	130,649.04	3,944,688.45	-
报告期间申购/买入总份额	1,141.95	2,388.21	100,355,427.77	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00	100,270,000.00	-
报告期末持	66,187.48	133,037.25	4,030,116.22	-

有的基金份额				
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%	0.00%	-

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	南方现金通货币 A	南方现金通货币 B	南方现金通货币 C	南方现金通货币 E
报告期初持有的基金份额	63,663.15	127,791.08	3,855,904.42	-
报告期间申购/买入总份额	1,382.38	2,857.96	88,784.03	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	65,045.53	130,649.04	3,944,688.45	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%	0.00%	-

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	南方现金通货币 A			
	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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
深圳市投资控股有限公司	1.24	-	153,462,206.75	0.10%
深圳市投资控股有限公	-	-	-	-

司结算中心				

关联方名称	南方现金通货币 E			
	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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
-	-	-	-	-

注：深圳投资控股投资本基金相关的费用按本基金招募说明书的有关规定执行。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	595,306.51	635,922.06	625,924.27	469,000.14

注：本基金由基金托管人中国工商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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
工商银行	112202007	22 工商银行 CD007	报价发行	22,500,000	2,236,214,250.00
工商银行	112202008	22 工商银行 CD008	报价发行	2,000,000	194,742,000.00

上年度可比期间 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
工商银行	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本年度末，基金持有关联方工商银行发行的同业存单，账面价值为人民币 2,725,259,949.98 元，占基金资产净值的比例为 1.65%(上年度末：无)。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

单位：人民币元

南方现金通货币 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
5,145.91	-	-	5,145.91	-

南方现金通货币 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
20,573.53	-	-	20,573.53	-

南方现金通货币 C

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
26,983,756.45	-	-	26,983,756.45	-

南方现金通货币 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
2,564,266,902.82	-	-	2,564,266,902.82	-

7.4.12 期末（2022 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	0	-	0.00	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
135714	起航 2 号 2	2022 年 12 月 7 日	1-6 个月（含）	资产支持证券未上市	100.00	100.17	300,000	30,000,000.00	30,050,498.63	-
135738	起航 2 号 3	2022 年 12 月 22 日	1-6 个月（含）	资产支持证券未上市	100.00	100.07	560,000	56,000,000.00	56,038,663.02	-
112428	铁保 14A1	2022 年 11 月 29 日	1-6 个月（含）	资产支持证券未上市	100.00	100.22	190,000	19,000,000.00	19,042,601.64	-
135744	起航 3 号 2	2022 年 12 月 28 日	1-6 个月（含）	资产支持证券未上市	100.00	100.02	450,000	45,000,000.00	45,010,356.17	-
135739	起航 3 号	2022	1-6 个	资产支	100.0	100.0	940,000	94,000,000.	94,029,667.	-

	1	年 12 月 27 日	月（含）	持证券未上市	0	3		00	94	

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 2022 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 7,765,707,898.71 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
220014	22 附息国债 14	2023 年 1 月 4 日	100.68	10,639,000	1,071,096,558.02
229971	22 贴现国债 71	2023 年 1 月 5 日	99.04	9,500,000	940,871,772.98
112202007	22 工商银行 CD007	2023 年 1 月 3 日	99.47	8,989,000	894,124,826.84
229934	22 贴现国债 34	2023 年 1 月 5 日	99.90	7,461,000	745,328,594.81
220201	22 国开 01	2023 年 1 月 4 日	102.01	6,988,000	712,835,211.83
220214	22 国开 14	2023 年 1 月 4 日	99.38	7,000,000	695,680,246.52
229968	22 贴现国债 68	2023 年 1 月 4 日	99.17	5,000,000	495,858,438.68
112206251	22 交通银行 CD251	2023 年 1 月 3 日	98.99	2,818,000	278,947,443.17
229966	22 贴现国债 66	2023 年 1 月 4 日	99.75	2,500,000	249,384,077.78
229969	22 贴现国债 69	2023 年 1 月 6 日	99.69	2,423,000	241,546,161.06
210214	21 国开 14	2023 年 1 月 6 日	100.22	2,361,000	236,627,413.55
220306	22 进出 06	2023 年 1 月 6 日	100.66	2,310,000	232,535,797.98
229945	22 贴现国债 45	2023 年 1 月 4 日	99.75	2,076,000	207,075,154.97
229934	22 贴现国债 34	2023 年 1 月 6 日	99.90	1,839,000	183,709,862.73
09220200	22 国开清	2023 年 1 月	100.09	1,500,000	150,127,720.45

1	发 01	6 日			
200313	20 进出 13	2023 年 1 月 6 日	102.00	1,200,000	122,399,728.81
229961	22 贴现国债 61	2023 年 1 月 6 日	99.85	1,200,000	119,814,824.46
180211	18 国开 11	2023 年 1 月 6 日	102.55	1,100,000	112,806,118.47
229937	22 贴现国债 37	2023 年 1 月 6 日	99.84	1,120,000	111,818,224.77
229972	22 贴现国债 72	2023 年 1 月 6 日	99.60	1,117,000	111,258,140.61
220014	22 附息国债 14	2023 年 1 月 6 日	100.68	1,064,000	107,119,723.44
092103107	21 进出清发 107	2023 年 1 月 6 日	100.54	1,000,000	100,538,792.26
210409	21 农发 09	2023 年 1 月 4 日	100.38	1,000,000	100,377,403.35
229962	22 贴现国债 62	2023 年 1 月 6 日	99.79	1,000,000	99,794,364.64
229937	22 贴现国债 37	2023 年 1 月 4 日	99.84	880,000	87,857,176.60
220201	22 国开 01	2023 年 1 月 6 日	102.01	459,000	46,821,889.27
220206	22 国开 06	2023 年 1 月 6 日	101.00	177,000	17,876,750.68
210214	21 国开 14	2023 年 1 月 4 日	100.22	139,000	13,931,050.61
合计	-	-	-	84,860,000	8,488,163,469.34

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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中国工商银行；定期存款存放在具有基金托管资格的中国民生银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司以及商业银行创兴银行有限公司、大连银行股份有限公司、厦门国际银行股份有限公司、哈尔滨银行股份有限公司、富滇银行股份有限公司、盛京银行股份有限公司和吉林银行股份有限公司，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 AAA 级以下的企业债券，主体信用等级在 AA+以下的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。

于本年度末，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 64.11%(上年度末：52.32%)。

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%。

于本年度末，除卖出回购金融资产款余额中有 7,765,707,898.71 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(净资产)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%。于本年度末，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 0.74%，本基金投资组合的平均剩余期限为 85 天，平均剩余存续期为 92 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%。于本年度末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 3.98%。

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本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，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 2022 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	15,375,711,625.19	360,782,000.00	-	-	15,736,493,625.19
结算备付金	60,554,550.94	-	-	-	60,554,550.94
存出保证金	7,832.67	-	-	-	7,832.67

交易性金融资产	98,241,988,934.85	17,796,231,437.47	-	-	116,038,220,372.32
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	41,202,495,342.10	-	-	-	41,202,495,342.10
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	393,792,568.96	393,792,568.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	154,880,758,285.75	18,157,013,437.47	-	393,792,568.96	173,431,564,292.18
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	7,765,707,898.71	-	-	-	7,765,707,898.71
应付清算款	-	-	-	392,595,000.00	392,595,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	34,207,907.72	34,207,907.72
应付托管费	-	-	-	6,858,750.27	6,858,750.27
应付销售服务费	-	-	-	34,186,438.84	34,186,438.84
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	784,882.25	784,882.25
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,867,023.88	1,867,023.88

负债总计	7,765,707,898.71	-	-	470,500,002.96	8,236,207,901.67
利率敏感度缺口	147,115,050,387.04	18,157,013,437.47	-	-76,707,434.00	165,195,356,390.51
上年度末 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	35,942,625,924.27	4,019,500,000.00	-	-	39,962,125,924.27
结算备付金	530,808,800.00	-	-	-	530,808,800.00
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	75,817,735,458.25	9,368,689,328.05	-	-	85,186,424,786.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	28,790,666,706.88	-	-	-	28,790,666,706.88
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	903,660,890.17	903,660,890.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	492,629,620.69	492,629,620.69
资产总计	141,081,836,889.40	13,388,189,328.05	-	1,396,290,510.86	155,866,316,728.31
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	7,990,203,625.34	-	-	-	7,990,203,625.34
应付清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	31,891,660.46	31,891,660.46
应付托管费	-	-	-	6,414,482.28	6,414,482.28
应付销售服务费	-	-	-	31,846,460.02	31,846,460.02
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	611,683.32	611,683.32
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,771,256.43	5,771,256.43
负债总计	7,990,203,625.34	-	-	76,535,542.51	8,066,739,167.85
利率敏感度缺口	133,091,633,264.06	13,388,189,328.05	-	1,319,754,968.35	147,799,577,560.46

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（ 2022 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2021 年 12 月 31 日 ）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-94,267,589.98	-66,820,900.75
	2.市场利率平行下降 25 个基点	94,624,318.72	67,070,992.11

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 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	116,038,220,372.32	85,186,424,786.30
第三层次	-	-
合计	116,038,220,372.32	85,186,424,786.30

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本年度末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	116,038,220,372.32	66.91
	其中：债券	114,954,610,510.50	66.28
	资产支持证券	1,083,609,861.82	0.62
2	买入返售金融资产	41,202,495,342.10	23.76
	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	15,797,048,176.13	9.11
4	其他资产	393,800,401.63	0.23
5	合计	173,431,564,292.18	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	2.04	
	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	7,765,707,898.71	4.70
	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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

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	25.95	4.94
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.27	-

2	30 天（含）-60 天	18.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.15	-
3	60 天（含）-90 天	28.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.68	-
4	90 天（含）-120 天	3.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）-397 天（含）	27.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.99	4.94

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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,451,522,666.20	3.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,880,035,723.58	2.35
	其中：政策性金融债	3,679,634,881.94	2.23
4	企业债券	61,929,164.08	0.04
5	企业短期融资券	14,182,053,548.84	8.59
6	中期票据	754,589,643.91	0.46
7	同业存单	89,624,479,763.89	54.25
8	其他	-	-
9	合计	114,954,610,510.50	69.59
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	1,814,138,542.05	1.10

8.6 期末按实际利率计算账面价值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）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112206251	22 交通银行 CD251	39,500,000	3,910,015,615.83	2.37
2	112214227	22 江苏银行 CD227	27,000,000	2,685,114,862.87	1.63
3	112203093	22 农业银行 CD093	26,000,000	2,586,439,625.60	1.57

4	112203107	22 农业银行 CD107	25,000,000	2,491,299,348.40	1.51
5	112202007	22 工商银行 CD007	22,500,000	2,238,047,458.44	1.35
6	112215502	22 民生银行 CD502	22,000,000	2,192,657,787.19	1.33
7	112204048	22 中国银行 CD048	22,000,000	2,177,556,680.14	1.32
8	112212194	22 北京银行 CD194	20,000,000	1,988,975,387.54	1.20
9	112206244	22 交通银行 CD244	19,000,000	1,866,080,746.97	1.13
10	220014	22 附息国债 14	16,800,000	1,691,364,054.39	1.02

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.1504%
报告期内偏离度的最低值	-0.0523%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0862%

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	183287	明珠 03 优	1,000,000	102,044,668.49	0.06
2	135739	起航 3 号 1	940,000	94,029,667.94	0.06
3	135738	起航 2 号 3	560,000	56,038,663.02	0.03
4	136946	惠和 14A	500,000	51,068,778.08	0.03
5	136981	22 元顺 1A	500,000	51,045,479.45	0.03
6	136926	天著优 13	450,000	46,048,043.84	0.03
7	135744	起航 3 号 2	450,000	45,010,356.17	0.03
8	135248	恒煦 08A1	420,000	42,500,087.67	0.03
9	136969	22 融惠 1A	380,000	38,802,310.14	0.02
10	136961	鹏睿 01A	350,000	35,718,226.85	0.02

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金按照实际利率计算账面价值，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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京外汇管理部的处罚；交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚；中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。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内受到公开谴责、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。

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	7,832.67
2	应收清算款	393,792,568.96
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	393,800,401.63

§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

南方现金通货币 A	27	13,549.94	66,195.77	18.09%	299,652.64	81.91%
南方现金通货币 B	40	19,630.86	141,895.56	18.07%	643,338.70	81.93%
南方现金通货币 C	86,659	14,482.17	1,123,019,386.16	89.48%	131,991,210.46	10.52%
南方现金通货币 E	23,007,292	7,125.53	64,946,387.52	0.04%	163,874,248,323.70	99.96%
合计	23,094,018	7,153.17	1,188,173,865.01	0.72%	164,007,182,525.50	99.28%

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	1,111,648,684.97	0.67%
2	基金类机构	28,294,592.04	0.02%
3	个人	20,062,952.89	0.01%
4	个人	11,102,904.31	0.01%
5	基金类机构	10,740,973.96	0.01%
6	个人	10,028,690.46	0.01%
7	其他机构	10,005,663.37	0.01%
8	个人	9,601,548.42	0.01%
9	个人	9,568,539.87	0.01%
10	个人	9,449,914.99	0.01%

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	南方现金通货币 A	-	-
	南方现金通货币 B	-	-
	南方现金通货币 C	1,205,396.87	0.0960%
	南方现金通货币 E	5,593,420.89	0.0034%
	合计	6,798,817.76	0.0041%

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	南方现金通货币 A	0
	南方现金通货币 B	0
	南方现金通货币 C	0~10
	南方现金通货币 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方现金通货币 A	0
	南方现金通货币 B	0
	南方现金通货币 C	0
	南方现金通货币 E	0~10
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方现金通货币 A	南方现金通货币 B	南方现金通货币 C	南方现金通货币 E
基金合同生效日(2014 年 1 月 21 日)基金份额总额	9,520,742.28	12,083,651.25	190,758,832.36	-
本报告期期初基金份额总额	396,980.11	1,993,209.71	2,263,303,969.24	145,533,883,401.40
本报告期期间基金总申购份额	2,447,662,844.15	36,263,529.49	2,466,168,509.74	2,912,874,881,059.97
减:本报告期基金总赎回份额	2,447,693,975.85	37,471,504.94	3,474,461,882.36	2,894,469,569,750.15
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	365,848.41	785,234.26	1,255,010,596.62	163,939,194,711.22

注： 1.本基金 A 类基金份额开放认购、申购和赎回业务，B 类和 C 类基金份额不开放申购业务，只开放赎回业务。B 类和 C 类基金份额是根据持有时间或持有数量在满足一定条件后由系统自动升级生成。上表中申购、赎回份额均包含份额升级部分。

2.根据 2014 年 7 月 2 日刊登《关于南方现金通货币市场基金增加基金份额类别、开放申购赎回业务并修改基金合同的公告》,决定增加南方现金通货币市场基金的E类份额类别、开放申购赎回业务，E 类份额自 2014 年 7 月 4 日起开放申购和赎回业务，不随持有时间或持有数量升级或降级为其他基金份额类别。

§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

2022 年 5 月 27 日，周易先生任南方基金管理股份有限公司董事长（法定代表人）。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 9 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 162,000.00 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 1 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	个别基金内部控制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已及时按要求改正并报告
其他	/

11.6.2 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	
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的比例		额的比例
华泰证券	-	-	4,364,267,000.00	0.42%	-	-
银河证券	295,554,343.18	100.00%	1,041,653,889,000.00	99.58%	-	-

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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下基金大额申购等业务安排的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
3	南方基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-28
4	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
5	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16
6	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16

§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现金通货币市场基金的文件；

2、《南方现金通货币市场基金基金合同》；

3、《南方现金通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、《南方现金通货币市场基金 2022 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