

南方天天利货币市场基金 2026 年中期 报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

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 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 债券回购融资情况.....	45
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	45
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允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.....	46
7.7 “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.....	47
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.9 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.4 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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	51
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	52
10.9 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 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	126,171,080,327.86 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 C	南方天天利货币 E
下属分级基金的交易代码	003473	003474	020888	005194
报告期末下属分级基金的份额总额	7,999,483,129.28 份	115,400,683,008.95 份	91,544,216.86 份	2,679,369,972.77 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	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.
		方圆
		95559
		fangy_20@bankcomm.com

		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		周易	任德奇

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告置备地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方天天利货币 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	50,199,685.87
本期利润	50,199,685.87
本期净值收益率	0.5677%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	7,999,483,129.28
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	26.3263%

2、南方天天利货币 B

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	907,703,142.41
本期利润	907,703,142.41
本期净值收益率	0.6875%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	115,400,683,008.95
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	29.2960%

3、南方天天利货币 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	677,055.33
本期利润	677,055.33
本期净值收益率	0.6875%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	91,544,216.86
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	3.8978%

4、南方天天利货币 E

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,445,342.75
本期利润	18,445,342.75
本期净值收益率	0.6426%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	2,679,369,972.77
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	23.6570%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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；

本基金无持有人认购或交易基金的各项费用；

本基金收益分配为按日结转份额；

本基金从 2024 年 3 月 4 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2024 年 3 月 5 日起存续；

本基金从 2017 年 9 月 13 日起新增 E 类份额，E 类份额自 2017 年 9 月 14 日起存续。

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	0.2726%	0.0001%	0.3366%	0.0000%	-0.0640%	0.0001%
过去六个月	0.5677%	0.0002%	0.6747%	0.0000%	-0.1070%	0.0002%
过去一年	1.1793%	0.0002%	1.3694%	0.0000%	-0.1901%	0.0002%
过去三年	4.7536%	0.0009%	4.1772%	0.0000%	0.5764%	0.0009%
过去五年	9.1016%	0.0010%	7.0591%	0.0000%	2.0425%	0.0010%
过去七年	14.2774%	0.0012%	10.0250%	0.0000%	4.2524%	0.0012%
自基金合同生效起至今	26.3263%	0.0027%	14.1480%	0.0000%	12.1783%	0.0027%

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	0.3327%	0.0001%	0.3366%	0.0000%	-0.0039%	0.0001%
过去六个月	0.6875%	0.0002%	0.6747%	0.0000%	0.0128%	0.0002%
过去一年	1.4225%	0.0002%	1.3694%	0.0000%	0.0531%	0.0002%
过去三年	5.5108%	0.0009%	4.1772%	0.0000%	1.3336%	0.0009%
过去五年	10.4190%	0.0010%	7.0591%	0.0000%	3.3599%	0.0010%
过去七年	16.2135%	0.0012%	10.0250%	0.0000%	6.1885%	0.0012%
自基金合同生效起至今	29.2960%	0.0027%	14.1480%	0.0000%	15.1480%	0.0027%

南方天天利货币 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	0.3327%	0.0001%	0.3366%	0.0000%	-0.0039%	0.0001%
过去六个月	0.6875%	0.0002%	0.6747%	0.0000%	0.0128%	0.0002%
过去一年	1.4225%	0.0002%	1.3694%	0.0000%	0.0531%	0.0002%
自基金合同生效起至今	3.8978%	0.0007%	3.2160%	0.0000%	0.6818%	0.0007%

南方天天利货币 E

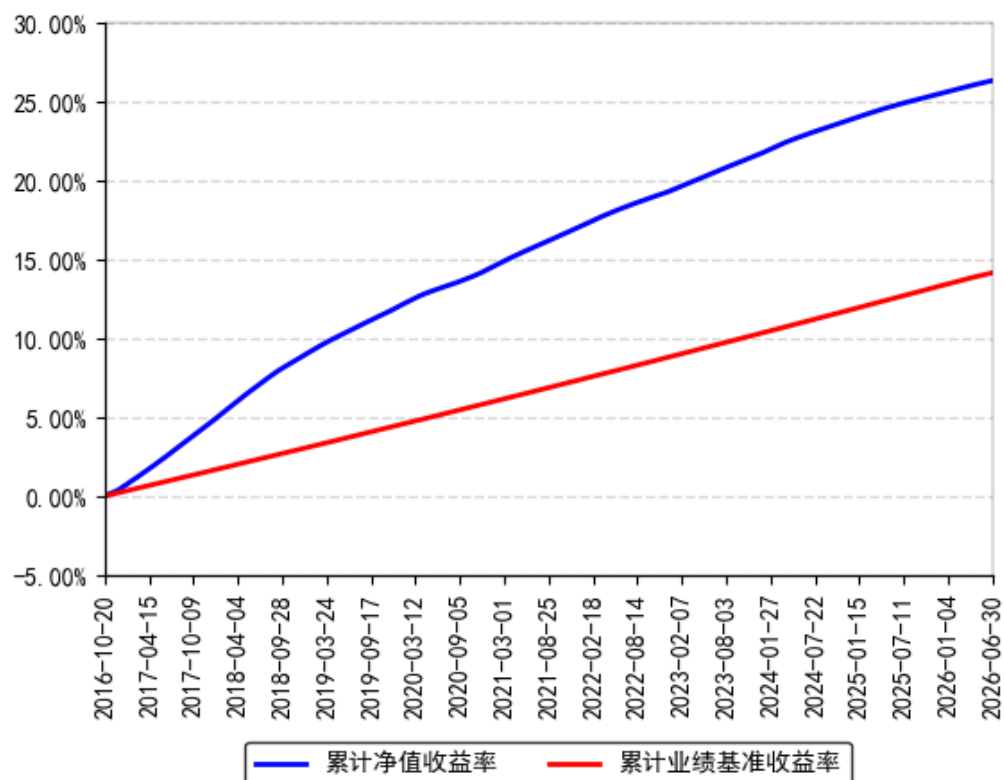
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3102%	0.0001%	0.3366%	0.0000%	-0.0264%	0.0001%
过去六个月	0.6426%	0.0002%	0.6747%	0.0000%	-0.0321%	0.0002%

过去一年	1.3313%	0.0002%	1.3694%	0.0000%	-0.0381%	0.0002%
过去三年	5.2262%	0.0009%	4.1772%	0.0000%	1.0490%	0.0009%
过去五年	9.9232%	0.0010%	7.0591%	0.0000%	2.8641%	0.0010%
过去七年	15.4833%	0.0012%	10.0250%	0.0000%	5.4583%	0.0012%
自基金合同生效起至今	23.6570%	0.0024%	12.7525%	0.0000%	10.9045%	0.0024%

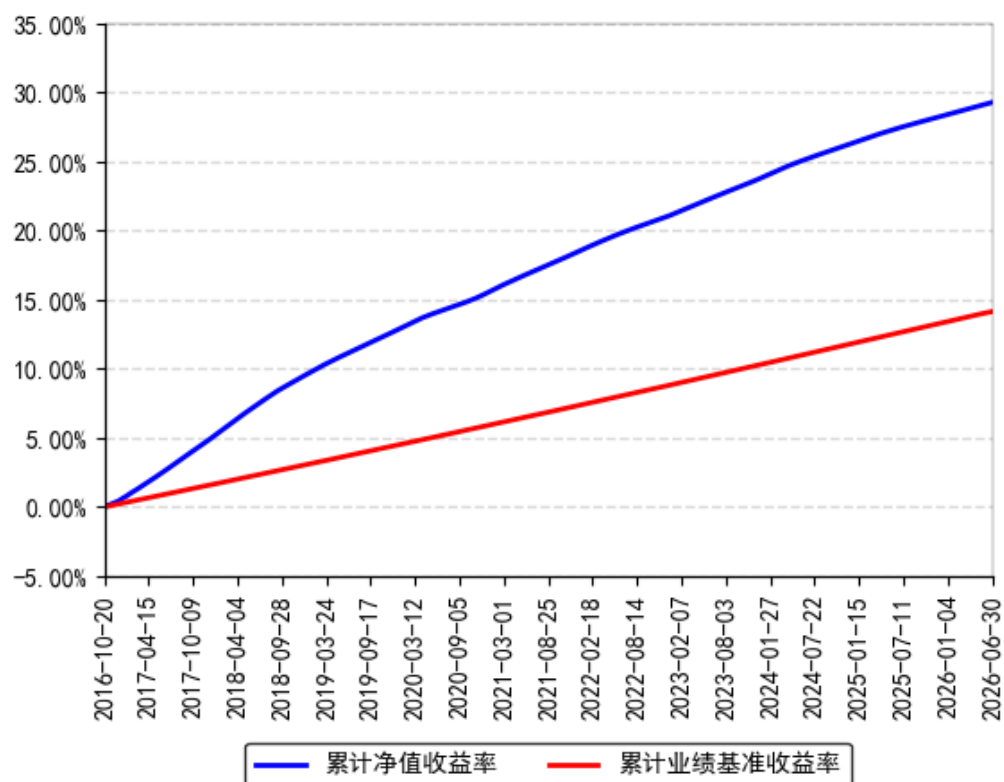
注：本基金收益分配为按日结转份额。

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

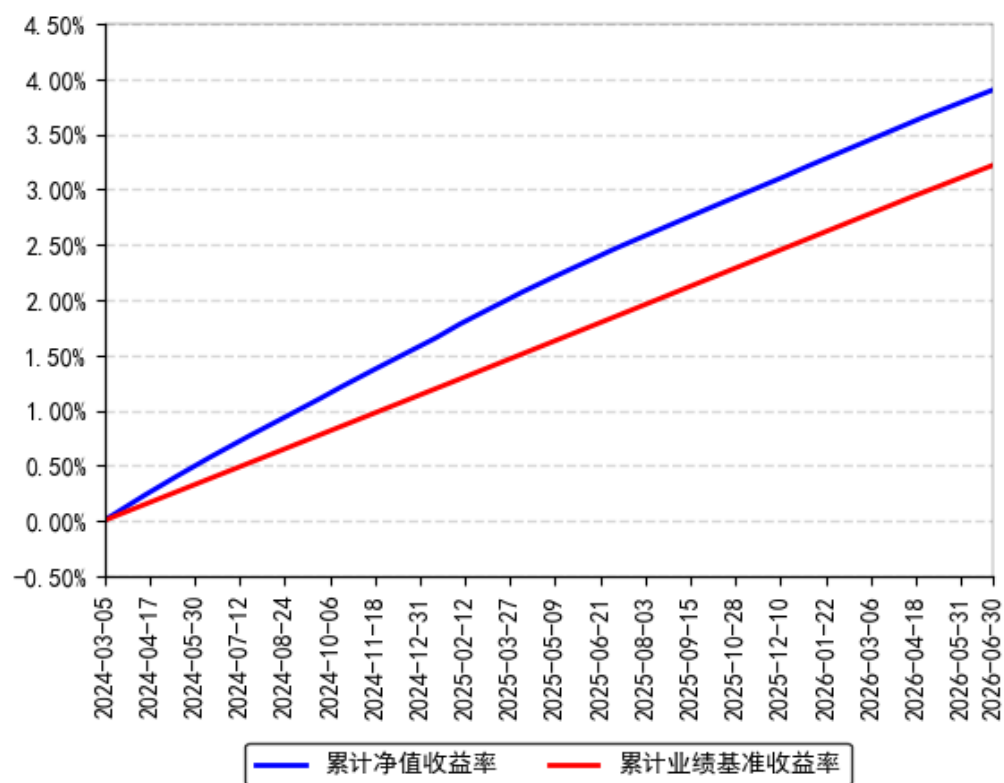
南方天天利货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



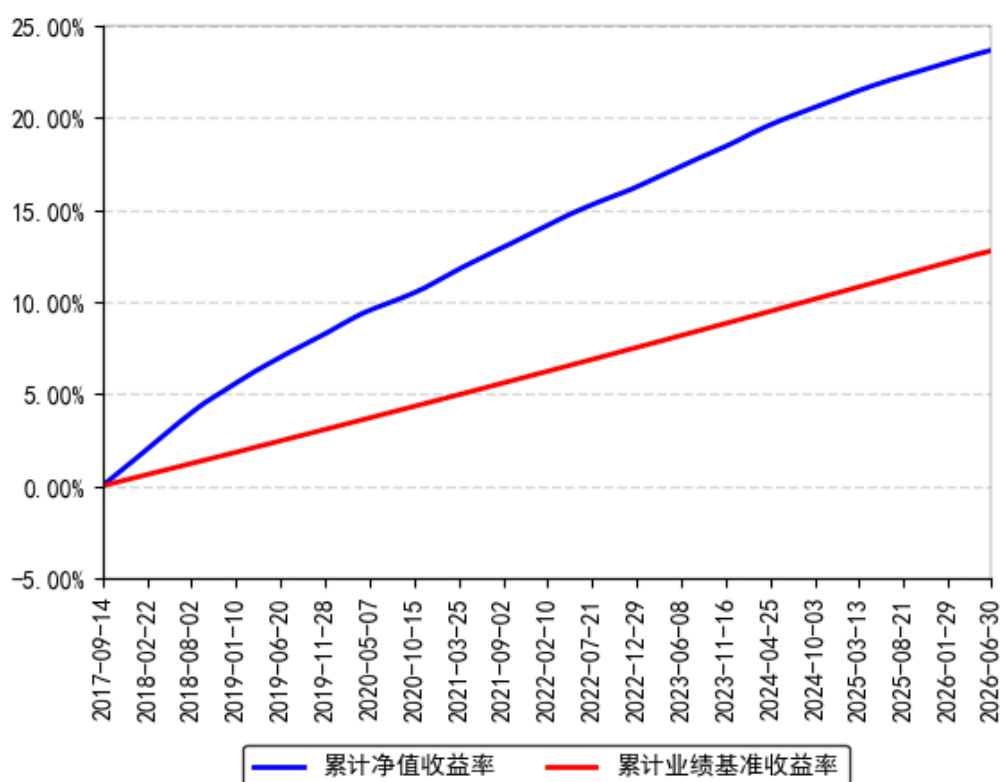
南方天天利货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方天天利货币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



南方天天利货币E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



注：本基金从 2024 年 3 月 4 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2024 年 3 月 5 日起存续；
 本基金从 2017 年 9 月 13 日起新增 E 类份额，E 类份额自 2017 年 9 月 14 日起存续。

§ 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。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。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

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	-	21 年	中国国籍，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；2020 年 3 月 5 日至 2023 年 6 月 19 日，任南方 0-5 年江苏城投债基金经理；2014 年 7 月 25 日至今，任南方现金通基金经理；2016 年 10 月 20 日至今，任南方天天利基金经理；2018 年 11 月 8 日至今，任南方 1-3 年国开债基金经理；2021 年 12 月 20 日至今，任南方中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金经理；2023 年 6 月 19 日至今，任南方现金增利基金经理；2025 年 7 月 4 日至今，

					任南方理财金货币 ETF 基金经理。
蔡奕奕	本基金基金经理	2016 年 11 月 17 日	-	20 年	中国国籍，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 2025 年 3 月 28 日，任南方理财金货币 ETF 基金经理；2016 年 8 月 26 日至今，任南方薪金宝货币基金经理；2016 年 11 月 17 日至今，任南方天天利货币基金经理；2019 年 5 月 24 日至今，任南方天天宝货币基金经理；2022 年 4 月 1 日至今，任南方收益宝货币基金经理；2025 年 8 月 8 日至今，任南方现金增利货币基金经理。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》及其他有关法律法规的规定及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下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 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 24 次，是由于指数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

上半年国内经济总体运行平稳，呈现“开局良好、稳中趋缓、结构分化”的特征。宏观政策维持“财政积极、货币适度宽松”的基调。货币市场工具收益率走势受央行货币政策的阶段性调整影响较大，呈先下后上，区间震荡的格局。

具体来看，央行一季度提前投放流动性，而存款类机构“开门红”期间存款完成情况显著优于贷款，银行体系流动性非常充裕。二季度伊始，同业存款自律机制执行新的标准，流动性开始同时在银行和非银体系淤积。在观察到 DR001、DR007 较大幅度低于政策利率后，央行主动回笼流动性，买断式回购持续大幅缩量，存单利率跟随资金利率的上行触底回升。在此期间，1Y 存单利率也始终未低于 1.4% 这一政策利率水平。在二季度末，央行推出了新型的货币政策工具，并收窄了临时正逆回购的利率区间，强调公开市场操作 7 天逆回购利率的唯一性。从整个上半年来看，无论是一季度大幅投放货币，还是二季度回笼流动性，央行始终围绕着保持市场流动性处于合理充裕这一目标进行操作。货币政策的基调并未发生改变。

因此，在央行投放流动性的数量发生显著变化的两个相邻季度，我们对产品的运作思路也进行了一定的调整。基于公开市场操作 7 天逆回购利率 1.4% 是唯一的政策工具锚的理解，我们认为对货币市场工具的定价应始终考虑 1.4% 这一政策利率锚，基于此，对货币市场工具进行定价和判断是简单而又高效的。也因此，当货币市场利率因阶段性的流动性紧缺而出现显著的上行时，我们也积极进行了配置。

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 0.5677%，同期业绩基准收益率为 0.6747%；本基金 B 份额净值收益率为 0.6875%，同期业绩基准收益率为 0.6747%；本基金 C 份额净值

收益率为 0.6875%，同期业绩基准收益率为 0.6747%；本基金 E 份额净值收益率为 0.6426%，同期业绩基准收益率为 0.6747%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，货币政策方面，央行回归中性，重启中长期资金净投放，新增的隔夜逆回购操作在月末时点如约而至，向市场释放了较为积极的态度，但通胀和海外加息也约束了宽松的空间，下半年资金利率仍然难以显著偏离政策利率。财政方面，三季度需要关注政府债发行和支出的影响。

在产品运作方面，本产品持有人既有个人客户，也有机构客户，整体负债端受流动性环境的影响较大，因此，产品的运作上将始终围绕以流动性管理为核心展开，满足各类型客户的流动性管理需求。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、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，组成人员包括财务负责人、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、指数研究部总经理、现金及债券指数投资部总经理、国际投资部总经理、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。

4.7 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 977,025,226.36 元，实际分配收益 977,025,226.36 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，基金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

本报告期内，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、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方天天利货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	84,374,720,063.14	50,948,848,881.65
结算备付金		-	48,505,186.83
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	50,343,005,930.57	61,526,200,786.74
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		50,343,005,930.57	61,526,200,786.74
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	15,445,445,689.44	24,154,480,362.05
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,545,481.56	156,420,335.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		150,164,717,164.71	136,834,455,553.03
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		22,685,974,579.44	3,685,169,602.27
应付清算款		1,278,689,000.00	3,500,000,000.00
应付赎回款		1,518,588.92	2,895,769.53
应付管理人报酬		17,602,366.85	17,772,656.64
应付托管费		5,867,455.64	5,924,218.86
应付销售服务费		2,991,166.62	3,038,395.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		38,322.21	11,968.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	955,357.17	885,480.47
负债合计		23,993,636,836.85	7,215,698,091.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	126,171,080,327.86	129,618,757,461.59
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		126,171,080,327.86	129,618,757,461.59
负债和净资产总计		150,164,717,164.71	136,834,455,553.03

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，南方天天利货币 A 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 7,999,483,129.28 份；南方天天利货币 B 份额净值 1.0000 元，基金份额总额

115,400,683,008.95 份；南方天天利货币 C 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 91,544,216.86 份；南方天天利货币 E 份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,679,369,972.77 份；总份额合计 126,171,080,327.86 份。

6.2 利润表

会计主体：南方天天利货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,243,050,001.49	1,537,726,928.30
1.利息收入		760,812,247.69	869,614,320.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	627,906,100.78	464,394,804.34
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		132,906,146.91	405,219,515.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		482,237,753.80	668,112,608.11
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	482,237,753.80	668,112,608.11
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
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）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、营业总支出		266,024,775.13	193,139,085.00

1.管理人报酬	6.4.10.2.1	107,460,461.50	120,174,325.53
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	35,820,153.82	40,058,108.52
3.销售服务费	6.4.10.2.3	18,988,932.56	20,869,476.95
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		103,448,996.26	11,795,929.45
其中：卖出回购金融资产支出		103,448,996.26	11,795,929.45
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		43,685.63	-
8.其他费用	6.4.7.19	262,545.36	241,244.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		977,025,226.36	1,344,587,843.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		977,025,226.36	1,344,587,843.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		977,025,226.36	1,344,587,843.30

6.3 净资产变动表

会计主体：南方天天利货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	129,618,757,461.59	-	-	129,618,757,461.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	129,618,757,461.59	-	-	129,618,757,461.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 3,447,677,133.73	-	-	- 3,447,677,133.73
（一）、综合收益总额	-	-	977,025,226.36	977,025,226.36
（二）、本期基	-	-	-	-

金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	3,447,677,133.73			3,447,677,133.73
其中：1.基金申购款	128,163,947,813.84	-	-	128,163,947,813.84
2.基金赎回款	-131,611,624,947.57	-	-	-131,611,624,947.57
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-977,025,226.36	-977,025,226.36
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	126,171,080,327.86	-	-	126,171,080,327.86
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	159,345,028,950.47	-	-	159,345,028,950.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	159,345,028,950.47	-	-	159,345,028,950.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,866,242,797.38	-	-	-11,866,242,797.38
（一）、综合收益总额	-	-	1,344,587,843.30	1,344,587,843.30
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号	-11,866,242,797.38	-	-	-11,866,242,797.38

填列)				
其中：1.基金申购款	124,628,623,819.49	-	-	124,628,623,819.49
2.基金赎回款	-136,494,866,616.87	-	-	-136,494,866,616.87
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-1,344,587,843.30	-1,344,587,843.30
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	147,478,786,153.09	-	-	147,478,786,153.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松____ ____蔡忠评____ ____徐超____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于2017年9月12日发布的《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》以及更新后的《南方天天利货币市场基金招募说明书》的有关规定,自2017年9月13日起,本

基金增加 E 类基金份额。根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 1 日发布的《关于南方天天利货币市场基金新增 C 类基金份额并修订相关法律文件的公告》以及更新后的《南方天天利货币市场基金基金合同》的有关规定，自 2024 年 3 月 4 日起，本基金新增 C 类基金份额。本基金根据投资人认购、申购本基金的金额或其他条件，对投资人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，将基金份额分为不同的类别。本基金设 A 类、B 类、C 类和 E 类四级基金份额，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)。

6.4.2 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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	38,035,321,412.80
等于：本金	38,021,512,931.12
加：应计利息	13,808,481.68
减：坏账准备	-

定期存款	46,339,398,650.34
等于：本金	46,220,000,000.00
加：应计利息	119,398,650.34
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	3,500,613,194.50
存款期限 1-3 个月	2,200,861,888.83
存款期限 3 个月以上	40,637,923,567.01
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	84,374,720,063.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 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	170,855,064.11	170,916,064.11	61,000.00	0.0000
	银行间市场	50,172,150,866.46	50,187,397,054.68	15,246,188.22	0.0121
	合计	50,343,005,930.57	50,358,313,118.79	15,307,188.22	0.0121
资产支持证券		-	-	-	-
合计		50,343,005,930.57	50,358,313,118.79	15,307,188.22	0.0121

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,278,689,000.00	-
银行间市场	14,166,756,689.44	-
合计	15,445,445,689.44	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	470.29
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	836,490.94
其中：交易所市场	-
银行间市场	836,490.94
应付利息	-
预提费用	118,395.94
合计	955,357.17

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方天天利货币 A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,212,004,067.55	8,212,004,067.55
本期申购	30,211,555,493.19	30,211,555,493.19
本期赎回（以“-”号填列）	-30,424,076,431.46	-30,424,076,431.46
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,999,483,129.28	7,999,483,129.28

南方天天利货币 B		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	118,541,072,292.39	118,541,072,292.39
本期申购	91,334,483,181.92	91,334,483,181.92
本期赎回（以“-”号填列）	-94,474,872,465.36	-94,474,872,465.36
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	115,400,683,008.95	115,400,683,008.95

南方天天利货币 C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	105,889,015.19	105,889,015.19
本期申购	125,577,434.15	125,577,434.15
本期赎回（以“-”号填列）	-139,922,232.48	-139,922,232.48
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	91,544,216.86	91,544,216.86

南方天天利货币 E		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,759,792,086.46	2,759,792,086.46
本期申购	6,492,331,704.58	6,492,331,704.58
本期赎回（以“-”号填列）	-6,572,753,818.27	-6,572,753,818.27
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,679,369,972.77	2,679,369,972.77

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

6.4.7.8 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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	50,199,685.87	-	50,199,685.87
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	-50,199,685.87	-	-50,199,685.87
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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	907,703,142.41	-	907,703,142.41
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	-907,703,142.41	-	-907,703,142.41
本期末	-	-	-

南方天天利货币 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	677,055.33	-	677,055.33
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	-677,055.33	-	-677,055.33
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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	18,445,342.75	-	18,445,342.75
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	-18,445,342.75	-	-18,445,342.75
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	268,794,210.04
定期存款利息收入	358,077,264.04
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	84,826.84
其他	949,799.86
合计	627,906,100.78

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	478,102,343.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,135,410.11
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	482,237,753.80

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	69,762,703,383.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	69,670,254,101.57
减：应计利息总额	88,313,872.31
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	4,135,410.11

6.4.7.13 资产支持证券投资收益**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	134,849.42
合计	262,545.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司（“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
南方资本管理有限公司（“南方资本”）	基金管理人的子公司
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
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
广东省南方基金慈善基金会	基金管理人发起的慈善基金会
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
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合”）	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
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
伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	107,460,461.50	120,174,325.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,884,309.58	14,469,275.08
应支付基金管理人的净管理费	92,576,151.92	105,705,050.45

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	35,820,153.82	40,058,108.52

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 C	南方天天利货币 E	合计

华泰证券	14,056.70	114,219.86	-	674,141.01	802,417.57
交通银行	34,305.98	19,137.46	-	-	53,443.44
南方基金	37,724.64	4,369,415.79	4,891.50	85,078.25	4,497,110.18
兴业证券	1,495.64	6,350.24	-	-	7,845.88
合计	87,582.96	4,509,123.35	4,891.50	759,219.26	5,360,817.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 C	南方天天利货币 E	合计
华泰证券	10,770.49	123,932.22	-	741,920.47	876,623.18
交通银行	38,784.36	30,757.76	-	-	69,542.12
南方基金	39,469.38	5,303,689.03	17,812.82	124,072.05	5,485,043.28
兴业证券	1,731.65	2,190.40	-	-	3,922.05
合计	90,755.88	5,460,569.41	17,812.82	865,992.52	6,435,130.63

注：1. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类、B 类、C 类、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，按月支付给各基金销售机构。A 类、B 类、C 类、E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%、0.24%、0.10%。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日各类基金份额的基金资产净值×约定年费率÷当年天数。

2. 根据《南方基金关于开展旗下南方天天利货币市场基金 C 类份额销售服务费优惠的公告》，自 2024 年 3 月 14 日起，本基金 C 类基金份额的销售服务费适用 0.01% 的年费率。

6.4.10.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	320,969,014.80	-	-	-	82,485,800,000.00	5,261,959.65

上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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

联方名称						
交通银行	-	-	1,000,000,000.00	50,064.93	58,483,600,000.00	3,913,025.60

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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

无。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 C	南方天天利货币 E
报告期初持有的基金份额	0.17	668,226,653.58	-	7,269.89
报告期内申购/买入总份额	-	2,045,621,335.87	-	47.01
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	1,840,089,761.15	-	-
报告期末持有的基金份额	0.17	873,758,228.30	-	7,316.90
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.69%	-	-

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	南方天天利货	南方天天利货币 B	南方天天利货	南方天天利货币 E

	币 A		币 C	
报告期初持有的基金份额	0.17	1,138,454,910.34	-	7,163.43
报告期间申购/买入总份额	-	3,035,015,974.34	-	57.33
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	1,325,082,453.11	-	-
报告期末持有的基金份额	0.17	2,848,388,431.57	-	7,220.76
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.93%	-	-

注：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。

6.4.10.5.2 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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
广东省南方基金慈善基金会	4,192,075.95	0.00%	1,214,096.48	0.00%
华泰创新投资有限公司	302,477,972.23	0.24%	300,411,117.81	0.23%
华泰联合证券有限责任公司	264,035,504.05	0.21%	660,373,633.51	0.51%
华泰期货有限公司	-	-	50,895,318.96	0.04%
华泰证券股份有限公司	301,070,430.24	0.24%	405,026,308.74	0.31%
华泰紫金投资有限责任公司	644,823,684.40	0.51%	799,611,592.14	0.62%
交通银行股份有限公司	9,835,587,374.84	7.80%	8,370,166,157.35	6.46%

南方资本管理有限公司	19,284,681.09	0.02%	22,224,853.90	0.02%
深圳南方股权投资基金管理有限公司	4,061,180.22	0.00%	6,592,951.24	0.01%
深圳市投资控股有限公司	721,163,918.90	0.57%	716,236,152.36	0.55%
厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）	365,719.27	0.00%	51,283,342.21	0.04%
厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）	442,876.77	0.00%	66,757,072.72	0.05%
厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）	438,138.36	0.00%	66,905,827.52	0.05%
厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）	500,251.27	0.00%	69,156,861.27	0.05%
伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业（有限合伙）	41,454,207.41	0.03%	41,170,947.72	0.03%

关联方名称	南方天天利货币 E			
	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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
华泰紫金投资有限责任公司	35,952.30	0.00%	35,722.53	0.00%

注：本基金其他关联方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。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	1,131,365,947.32	38,984,463.94	814,865.64	2,722,710.99

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	112606094	26 交通银行 CD094	报价发行	5,000,000	494,614,500.00

交通银行	112606129	26 交通银行 CD129	报价发行	5,000,000	492,659,500.00
交通银行	112606113	26 交通银行 CD113	报价发行	3,000,000	296,781,300.00
交通银行	112606108	26 交通银行 CD108	报价发行	2,000,000	197,883,600.00

上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	112506126	25 交通银行 CD126	报价发行	10,000,000	991,701,000.00
交通银行	112506089	25 交通银行 CD089	报价发行	10,000,000	990,315,000.00
交通银行	112506116	25 交通银行 CD116	报价发行	5,000,000	493,654,000.00
交通银行	112506023	25 交通银行 CD023	报价发行	4,800,000	471,976,320.00
交通银行	112506076	25 交通银行 CD076	报价发行	4,000,000	397,934,000.00
交通银行	112506102	25 交通银行 CD102	报价发行	3,000,000	297,375,900.00

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本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 2,779,679,131.49 元，占本基金基金净资产的比例为 2.20%（于上期末，本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 7,946,117,029.24 元，占本基金基金净资产的比例为 6.13%）。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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
50,199,685.87	-	-	50,199,685.87	-

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
907,703,142.41	-	-	907,703,142.41	-

南方天天利货币 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
677,055.33	-	-	677,055.33	-

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
18,445,342.75	-	-	18,445,342.75	-

注：本基金报告期后分红情况（如有）详见本报告“资产负债表日后事项”部分内容。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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 22,685,974,579.44 元，是以如下债券作为质押：

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
112603127	26 农业银行 CD127	2026 年 7 月 1 日	99.78	20,000,000	1,995,640,298.82
112610119	26 兴业银行 CD119	2026 年 7 月 1 日	99.65	20,000,000	1,993,022,772.72
112605106	26 建设银行 CD106	2026 年 7 月 1 日	99.50	18,000,000	1,790,947,804.50
112603111	26 农业银行 CD111	2026 年 7 月 1 日	99.81	15,000,000	1,497,151,804.40
112605098	26 建设银行 CD098	2026 年 7 月 1 日	99.53	15,000,000	1,493,005,375.10
112603119	26 农业银行 CD119	2026 年 7 月 1 日	99.79	13,000,000	1,297,284,978.13
112604032	26 中国银行 CD032	2026 年 7 月 1 日	98.91	13,000,000	1,285,871,297.99
112604007	26 中国银行 CD007	2026 年 7 月 1 日	99.44	12,000,000	1,193,276,713.57
11260503	26 建设银	2026 年 7	99.43	11,160,000	1,109,639,175.39

0	行 CD030	月 1 日			
112605058	26 建设银行 CD058	2026 年 7 月 1 日	99.25	10,910,000	1,082,809,291.80
112603085	26 农业银行 CD085	2026 年 7 月 1 日	99.54	10,000,000	995,358,931.90
112602062	26 工商银行 CD062	2026 年 7 月 1 日	99.49	10,000,000	994,853,448.68
112603155	26 农业银行 CD155	2026 年 7 月 1 日	99.29	10,000,000	992,923,018.04
112604006	26 中国银行 CD006	2026 年 7 月 1 日	99.25	8,637,000	857,180,258.98
250214	25 国开 14	2026 年 7 月 1 日	99.84	8,000,000	798,744,638.53
220402	22 农发 02	2026 年 7 月 1 日	101.70	7,200,000	732,272,328.90
112610011	26 兴业银行 CD011	2026 年 7 月 1 日	99.90	7,000,000	699,328,168.40
220305	22 进出 05	2026 年 7 月 1 日	101.70	5,000,000	508,511,760.18
250431	25 农发 31	2026 年 7 月 1 日	101.24	5,000,000	506,182,898.86
112509282	25 浦发银行 CD282	2026 年 7 月 1 日	99.87	5,000,000	499,348,660.78
112617038	26 光大银行 CD038	2026 年 7 月 1 日	98.87	5,000,000	494,356,073.41
112608040	26 中信银行 CD040	2026 年 7 月 1 日	99.43	4,926,000	489,813,332.29
112505415	25 建设银行 CD415	2026 年 7 月 1 日	99.74	4,732,000	471,975,881.52
112506284	25 交通银行 CD284	2026 年 7 月 1 日	99.64	4,291,000	427,570,554.97
112609056	26 浦发银行 CD056	2026 年 7 月 1 日	99.36	4,000,000	397,435,376.61
170303	17 进出 03	2026 年 7 月 1 日	103.02	2,000,000	206,033,612.33
170210	17 国开 10	2026 年 7 月 1 日	102.85	1,900,000	195,407,911.38
240303	24 进出 03	2026 年 7 月 1 日	100.84	432,000	43,561,014.99
合计	-	-	-	251,188,000	25,049,507,383.17

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，投资于各类货币市场工具。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。

6.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+ 级以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基

金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 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%。

于本期末,本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大;除此之外,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,该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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%。于本期末，本基金投资组合的平均剩余期限和平均剩余存续期符合上述规定。

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%。于本期末，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符合该要求。

同时，本基金的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，本基金的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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	82,866,774,334.37	1,507,945,728.77	-	-	84,374,720,063.14
结算备付金	-	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	40,730,285,085.59	9,612,720,844.98	-	-	50,343,005,930.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	15,445,445,689.44	-	-	-	15,445,445,689.44
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,545,481.56	1,545,481.56
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	139,042,505,109.40	11,120,666,573.75	-	1,545,481.56	150,164,717,164.71
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	22,685,974,579.44	-	-	-	22,685,974,579.44
应付清算款	-	-	-	1,278,689,000.00	1,278,689,000.00
应付赎回款	-	-	-	1,518,588.92	1,518,588.92
应付管理人报酬	-	-	-	17,602,366.85	17,602,366.85
应付托管费	-	-	-	5,867,455.64	5,867,455.64
应付销售服务费	-	-	-	2,991,166.62	2,991,166.62
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	38,322.21	38,322.21
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	955,357.17	955,357.17

负债总计	22,685,974,579.44	-	-	1,307,662,257.41	23,993,636,836.85
利率敏感度缺口	116,356,530,529.96	11,120,666,573.75	-	-1,306,116,775.85	126,171,080,327.86
上年度末 2025 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					
货币资金	49,147,777,937.27	1,801,070,944.38	-	-	50,948,848,881.65
结算备付金	48,505,186.83	-	-	-	48,505,186.83
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	53,178,467,662.29	8,347,733,124.45	-	-	61,526,200,786.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	24,154,480,362.05	-	-	-	24,154,480,362.05
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	156,420,335.76	156,420,335.76
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	126,529,231,148.44	10,148,804,068.83	-	156,420,335.76	136,834,455,553.03
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	3,685,169,602.27	-	-	-	3,685,169,602.27
应付清算款	-	-	-	3,500,000.00	3,500,000.00

				0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	2,895,769.53	2,895,769.53
应付管理人 报酬	-	-	-	17,772,656.6 4	17,772,656.6 4
应付托管费	-	-	-	5,924,218.86	5,924,218.86
应付销售服 务费	-	-	-	3,038,395.14	3,038,395.14
应付投资顾 问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	11,968.53	11,968.53
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	885,480.47	885,480.47
负债总计	3,685,169,60 2.27	-	-	3,530,528,48 9.17	7,215,698,09 1.44
利率敏感度 缺口	122,844,061, 546.17	10,148,804,0 68.83	-	- 3,374,108,15 3.41	129,618,757, 461.59

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-49,114,327.53	-55,814,954.66
	2.市场利率平行下降 25 个基点	49,231,205.46	55,929,028.08

6.4.13.4.2 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。本基金本期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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或固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	50,343,005,930.57
第三层次	-
合计	50,343,005,930.57

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	50,343,005,930.57	33.53
	其中：债券	50,343,005,930.57	33.53
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	15,445,445,689.44	10.29
	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	84,374,720,063.14	56.19
4	其他各项资产	1,545,481.56	0.00
5	合计	150,164,717,164.71	100.00

7.2 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	10.43	
	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	22,685,974,579.44	17.98
	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。

7.2.1 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	78
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	57

7.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.3 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	53.21	18.99
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.63	-
2	30 天（含）-60 天	7.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
3	60 天（含）-90 天	11.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）-120 天	12.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）-397 天（含）	34.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	119.02	18.99

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 （%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,590,711,657.72	2.85
	其中：政策性金融债	3,419,856,593.61	2.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	572,039,919.92	0.45
6	中期票据	-	-
7	同业存单	46,180,254,352.93	36.60
8	其他	-	-
9	合计	50,343,005,930.57	39.90
10	剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债券	798,744,638.53	0.63

7.6 期末按公允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

金额单位：人民币元

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	112603127	26 农业银行 CD127	20,000,000	1,995,640,298.82	1.58
2	112610119	26 兴业银行 CD119	20,000,000	1,993,022,772.72	1.58

3	112605058	26 建设银行 CD058	20,000,000	1,984,984,952.88	1.57
4	112605106	26 建设银行 CD106	18,000,000	1,790,947,804.50	1.42
5	112603111	26 农业银行 CD111	15,000,000	1,497,151,804.40	1.19
6	112605098	26 建设银行 CD098	15,000,000	1,493,005,375.10	1.18
7	112605030	26 建设银行 CD030	15,000,000	1,491,450,504.56	1.18
8	112603119	26 农业银行 CD119	13,000,000	1,297,284,978.13	1.03
9	112604006	26 中国银行 CD006	13,000,000	1,290,186,797.12	1.02
10	112604032	26 中国银行 CD032	13,000,000	1,285,871,297.99	1.02

7.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0234%
报告期内偏离度的最低值	0.0046%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0140%

7.7.1 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。

7.7.2 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚；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国家金融监督管理总局的处罚；兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	1,545,481.56
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,545,481.56

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方天天利 货币 A	3,460,989	2,311.33	93,935,575. 21	1.17%	7,905,547,5 54.07	98.83%
南方天天利 货币 B	2,086,966	55,295.91	87,822,938, 304.94	76.10%	27,577,744, 704.01	23.90%
南方天天利 货币 C	11,516	7,949.31	15,022,616. 10	16.41%	76,521,600. 76	83.59%
南方天天利	494,643	5,416.78	465,437,428	17.37%	2,213,932,5	82.63%

货币 E			.28		44.49	
合计	6,054,114	20,840.55	88,397,333, 924.53	70.06%	37,773,746, 403.33	29.94%

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。

8.2 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	9,835,587,374.84	7.80%
2	其他机构	5,184,730,922.72	4.11%
3	银行类机构	4,025,256,068.43	3.19%
4	银行类机构	3,516,957,231.01	2.79%
5	银行类机构	2,464,627,605.04	1.95%
6	银行类机构	2,361,058,120.83	1.87%
7	银行类机构	2,322,624,963.31	1.84%
8	其他机构	2,071,197,457.55	1.64%
9	其他机构	2,067,106,682.31	1.64%
10	银行类机构	1,912,138,669.57	1.52%

8.3 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	1,960,000.30	0.0245%
	南方天天利货币 B	92,943,802.90	0.0805%
	南方天天利货币 C	504,860.00	0.5515%
	南方天天利货币 E	1,204,668.12	0.0450%
	合计	96,613,331.32	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）。

8.4 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 C	0~10
	南方天天利货币 E	0

	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	0~10
	南方天天利货币 C	0
	南方天天利货币 E	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方天天利货币 A	南方天天利货币 B	南方天天利货币 C	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	8,212,004,067.55	118,541,072,292.39	105,889,015.19	2,759,792,086.46
本报告期基金总申购份额	30,211,555,493.19	91,334,483,181.92	125,577,434.15	6,492,331,704.58
减：本报告期基金总赎回份额	30,424,076,431.46	94,474,872,465.36	139,922,232.48	6,572,753,818.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期末基金份额总额	7,999,483,129.28	115,400,683,008.95	91,544,216.86	2,679,369,972.77

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。
本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
广发证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：根据 2024 年 7 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3 号），基金管理人制定了证券公司交易单元的选择标准和程序：

1、选择标准

基金管理人建立了选择机制，选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并制定了定性与定量相结合的具体标准。

2、选择程序

（1）基金管理人根据上述标准对证券公司进行评估，与符合标准的证券公司签订证券综合研究服务协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

（2）基金管理人根据其建立的服务评价及交易量分配机制，定期对证券公司开展评价后，根据评价结果进行交易量的分配。

3、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；减少交易单元：无。

10.7.2 基金租用或者通过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
广发证券	-	-	41,860,344,400.00	100.00%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金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在部分销售机构的申购、	证券时报、基金管理人网站、中国证监会	2026-02-09

	定投和转换转入业务金额限制的公告	基金电子披露网站	
2	南方天天利货币市场基金 2026 年春节前暂停申购和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	2026-02-09
3	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	南方天天利货币市场基金 2026 年五一劳动节前暂停申购和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	2026-04-22
5	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
6	南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
7	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在部分销售机构的申购、定投和转换转入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	2026-06-15

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方天天利货币市场基金的文件；
- 2、《南方天天利货币市场基金基金合同》；
- 3、《南方天天利货币市场基金托管协议》；
- 4、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 2026 年中期报告》原文。

12.2 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。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>