

# 南方安颐混合型证券投资基金 2026 年 第 1 季度报告

2026 年 03 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 南方安颐混合  |
| 基金主代码      | 003476  |
| 交易代码       | 003476  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2016 年 12 月 14 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 65,546,475.90 份   |
| 投资目标       | 本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值，为投资者提供稳健的养老理财工具。   |
| 投资策略       | 本基金力图通过大类资产配置和精细化选股分享养老产业的成长红利。实际投资过程中，将“优化的 CPPI 策略”作为大类资产配置的主要出发点，主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值，为投资者提供稳健的养老理财工具。本基金采用的主要策略包括：资产配置策略、存托凭证的投资策略、债券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 沪深 300 指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%  |
| 风险收益特征     | 本基金为债券投资为主的混合型基金，属于中低风险、中低收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。前款有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售   |

|       |   |
|-------|---|
|       | 机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同。本基金的风险等级可能有相应变化,具体风险评级结果应以销售机构的评级结果为准。 |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司  |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司  |

注:2018年5月23日起,本基金的基金名称由“南方安颐养老混合型证券投资基金”变更为“南方安颐混合型证券投资基金”。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标         | 报告期(2026年1月1日—2026年3月31日) |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 3,348,993.28              |
| 2.本期利润         | -1,256,735.02             |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0193                   |
| 4.期末基金资产净值     | 81,048,019.36             |
| 5.期末基金份额净值     | 1.2365                    |

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

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

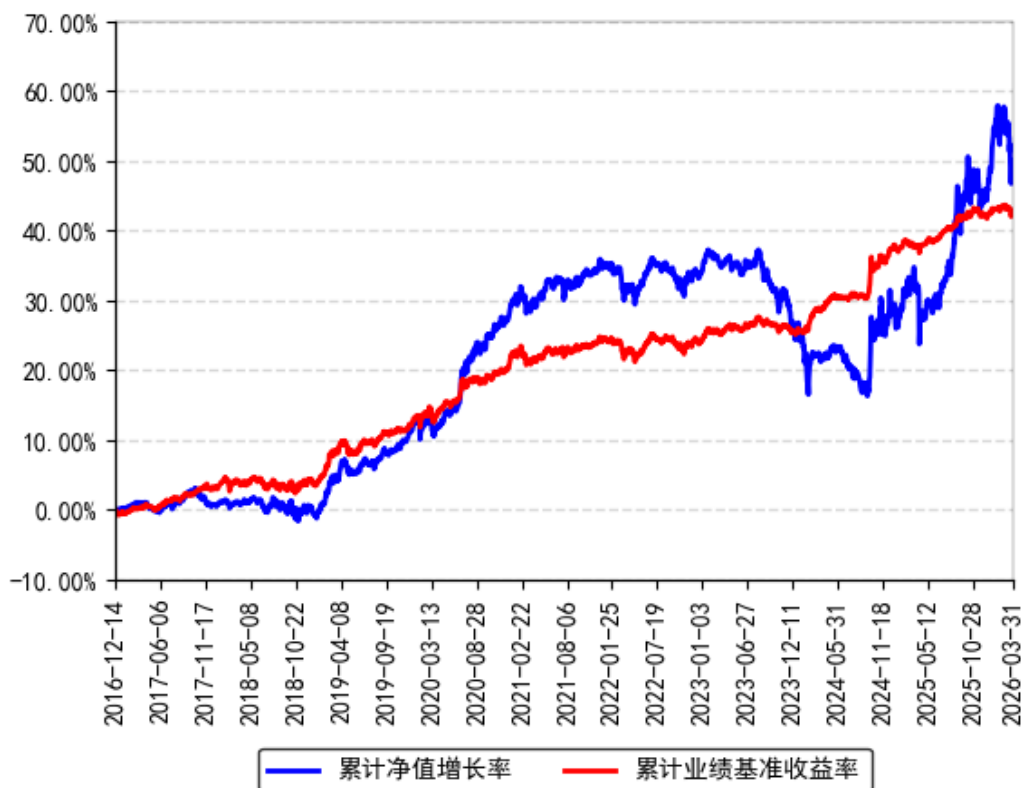
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -0.96%     | 0.81%         | -0.02%         | 0.15%                 | -0.94% | 0.66% |
| 过去六个月          | -1.29%     | 0.75%         | 0.12%          | 0.15%                 | -1.41% | 0.60% |
| 过去一年           | 12.53%     | 0.78%         | 3.45%          | 0.14%                 | 9.08%  | 0.64% |
| 过去三年           | 8.81%      | 0.61%         | 13.21%         | 0.15%                 | -4.40% | 0.46% |
| 过去五年           | 13.83%     | 0.50%         | 17.35%         | 0.16%                 | -3.52% | 0.34% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 47.45%     | 0.41%         | 42.44%         | 0.17%                 | 5.01%  | 0.24% |

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

南方安颐混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---------|-------------|------|--------|---|
|    |         | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 李轶 | 本基金基金经理 | 2023年6月19日  | -    | 19年    | 中国国籍，女，中央财经大学国民经济学硕士，具有基金从业资格。曾就职于摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，任助理总经理、固定收益投资部总监兼基金经理。2008年11月12日至2015年1月22日，任大摩货币基金经理；2012年8月28日至2022年9月2日，任大摩多元收益债券基金经理；2013年6月25日至2022年9月2日，任大摩18个月定开债基金经理；2014年9月2日至2022年9月2日，任大摩添利18个月定开债基金经理。2015年11月17日至2017 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 年 6 月 16 日，任大摩收益 18 个月开放债券基金经理 2021 年 1 月 26 日至 2022 年 9 月 2 日，任大摩民丰盈和一年持有混合基金经理 2021 年 5 月 24 日至 2022 年 9 月 2 日，任大摩招惠一年持有期混合基金经理。2022 年 9 月加入南方基金，2023 年 6 月 19 日至今，任南方安颐混合、南方誉尚一年持有期混合基金经理；2024 年 7 月 18 日至今，任南方尊享稳健增利债券基金经理。 |
|--|--|--|--|---|

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 16 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来宏观经济继续呈现内需承压、外需韧性较强的结构性特征。生产端景气度维持高位，工业利润修复主要由中游装备制造业驱动，下游消费与房地产投资仍显疲弱。一季度

受到美伊冲突影响，全球油价持续上涨推升通胀预期，但我国商品价格优势依然显著，表现为年初以来我国出口的贸易条件仍在持续优化。从资本市场表现来看，2 月底中东地缘冲突的骤然升级下油价上涨引起了能源市场的波动，更通过“通胀抬升—滞涨—衰退”的传导链条，压制市场风险偏好，权益市场表现为调整，债券市场延续震荡，利率中枢小幅下行。报告期内，我们密切跟踪宏观微观层面的变化以及各类资产的估值比较，在此基础上进行资产配置及组合调整。告期内保持相对均衡的配置，主要配置能源、化工、信息技术、半导体等。债券方面相对中性。

展望未来一个阶段，原油上涨隐忧与地缘不确定性交织、国内复苏逻辑与政策协同效应共振。宏观环境上内外需均面临增长压力。国内经济修复尚不均衡，货币环境不具备转向条件，宽财政客观上需要偏松的流动性环境和偏低融资成本。从国内支撑基础来看，我国综合国力与国家治理能力持续提升，叠加经济基本面具备较强韧性、全产业链供应链体系带来的产品竞争力，共同构成了当前中国经济环境稳定的基础，而这种稳定性在全球动荡的市场环境中具备显著稀缺性，为 A 股提供了坚实支撑。当前 A 股资本市场生态环境重塑、经济结构转型推进、无风险收益率下降等核心驱动因素未发生实质性变化，将有助于风险资产的定价。重点关注传统周期修复与新兴科技成长的结构机会，权益配置上沿着确定性溢价和成长性空间的维度布局，经济向高质量发展的转型阶段，继续积极布局低估值蓝筹公司以及有业绩兑现的科技龙头公司。债券市场方面，利率在底部震荡，上下行空间有限。银行体系资金成本下降带来短端的债券性价比，通胀预期的变化以及经济的筑底影响长端和超长端。风险偏好上升使得资产再平衡形成债市潜在扰动。

在宏观环境、金融环境与政策尚未发生超预期变化，预计债市整体呈震荡走势，利率中枢面临小幅上行压力。配置方面我们对债券组合维持中短久期的策略，并根据市场情况灵活调整。关注国际政治经济环境变化等因素带来的调整，把握波段机会。未来我们将力争保障持仓品种的安全性和流动性，以获取相对稳定的票息收益为目标。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2365 元，报告期内，份额净值增长率为-0.96%，同期业绩基准增长率为-0.02%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 23,325,145.56 | 24.22        |
|    | 其中：股票             | 23,325,145.56 | 24.22        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 71,480,981.13 | 74.24        |
|    | 其中：债券             | 71,480,981.13 | 74.24        |
|    | 资产支持证券            | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,460,533.05  | 1.52         |
| 8  | 其他资产              | 20,715.35     | 0.02         |
| 9  | 合计                | 96,287,375.09 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 335,460.00    | 0.41         |
| C  | 制造业              | 19,652,905.56 | 24.25        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 154,000.00    | 0.19         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 201,500.00    | 0.25         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,143,820.00  | 1.41         |
| J  | 金融业              | 382,200.00    | 0.47         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 112,060.00    | 0.14         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,181,830.00  | 1.46         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 161,370.00    | 0.20         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |

|   |    |               |       |
|---|----|---------------|-------|
| S | 综合 | -             | -     |
|   | 合计 | 23,325,145.56 | 28.78 |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1  | 300274 | 阳光电源 | 6,500  | 979,940.00 | 1.21         |
| 2  | 688037 | 芯源微  | 5,500  | 921,580.00 | 1.14         |
| 3  | 603259 | 药明康德 | 8,000  | 784,800.00 | 0.97         |
| 4  | 000893 | 亚钾国际 | 12,000 | 733,200.00 | 0.90         |
| 5  | 300395 | 菲利华  | 8,000  | 731,200.00 | 0.90         |
| 6  | 301489 | 思泉新材 | 4,300  | 708,984.00 | 0.87         |
| 7  | 300558 | 贝达药业 | 15,000 | 654,000.00 | 0.81         |
| 8  | 600989 | 宝丰能源 | 22,000 | 639,320.00 | 0.79         |
| 9  | 000063 | 中兴通讯 | 18,000 | 583,920.00 | 0.72         |
| 10 | 600426 | 华鲁恒升 | 16,000 | 579,200.00 | 0.71         |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 6,258,648.21  | 7.72         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 39,428,703.47 | 48.65        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 25,793,629.45 | 31.83        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 71,480,981.13 | 88.20        |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

|   |        |          |        |              |      |
|---|--------|----------|--------|--------------|------|
| 1 | 019785 | 25 国债 13 | 60,000 | 6,057,057.53 | 7.47 |
| 2 | 242871 | 25 苏港 01 | 40,000 | 4,056,079.78 | 5.00 |
| 3 | 148240 | 23 光大 Y4 | 30,000 | 3,208,410.41 | 3.96 |
| 4 | 240498 | 24 交投 02 | 30,000 | 3,119,783.84 | 3.85 |
| 5 | 524225 | 25 鲲鹏 01 | 30,000 | 3,083,556.00 | 3.80 |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

无。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 9,764.51  |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 10,950.84 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 20,715.35 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 110075 | 南航转债 | 1,180,664.38 | 1.46         |
| 2  | 113691 | 和邦转债 | 975,419.18   | 1.20         |
| 3  | 113648 | 巨星转债 | 966,648.77   | 1.19         |
| 4  | 123222 | 博俊转债 | 902,396.58   | 1.11         |
| 5  | 127066 | 科利转债 | 876,706.85   | 1.08         |
| 6  | 123107 | 温氏转债 | 830,020.92   | 1.02         |
| 7  | 111020 | 合顺转债 | 785,801.45   | 0.97         |
| 8  | 127045 | 牧原转债 | 761,997.53   | 0.94         |
| 9  | 113647 | 禾丰转债 | 736,325.75   | 0.91         |
| 10 | 113658 | 密卫转债 | 671,788.36   | 0.83         |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 11 | 118024 | 冠宇转债    | 669,090.07 | 0.83 |
| 12 | 127072 | 博实转债    | 663,189.73 | 0.82 |
| 13 | 110087 | 天业转债    | 661,535.62 | 0.82 |
| 14 | 127031 | 洋丰转债    | 637,248.39 | 0.79 |
| 15 | 128128 | 齐翔转 2   | 635,409.59 | 0.78 |
| 16 | 118013 | 道通转债    | 624,742.33 | 0.77 |
| 17 | 118044 | 赛特转债    | 566,976.77 | 0.70 |
| 18 | 123113 | 仙乐转债    | 541,399.93 | 0.67 |
| 19 | 110090 | 爱迪转债    | 530,645.48 | 0.65 |
| 20 | 127026 | 超声转债    | 507,598.90 | 0.63 |
| 21 | 123188 | 水羊转债    | 499,626.33 | 0.62 |
| 22 | 127041 | 弘亚转债    | 481,364.38 | 0.59 |
| 23 | 111010 | 立昂转债    | 460,612.95 | 0.57 |
| 24 | 118037 | 上声转债    | 450,751.57 | 0.56 |
| 25 | 127082 | 亚科转债    | 443,416.85 | 0.55 |
| 26 | 113058 | 友发转债    | 431,693.67 | 0.53 |
| 27 | 127079 | 华亚转债    | 414,556.38 | 0.51 |
| 28 | 118038 | 金宏转债    | 411,076.44 | 0.51 |
| 29 | 113661 | 福 22 转债 | 409,072.19 | 0.50 |
| 30 | 113644 | 艾迪转债    | 404,951.92 | 0.50 |
| 31 | 123178 | 花园转债    | 404,836.44 | 0.50 |
| 32 | 123194 | 百洋转债    | 395,494.52 | 0.49 |
| 33 | 118035 | 国力转债    | 394,776.58 | 0.49 |
| 34 | 127069 | 小熊转债    | 389,950.77 | 0.48 |
| 35 | 123192 | 科思转债    | 379,511.10 | 0.47 |
| 36 | 113632 | 鹤 21 转债 | 377,251.29 | 0.47 |
| 37 | 127030 | 盛虹转债    | 357,041.51 | 0.44 |
| 38 | 127067 | 恒逸转 2   | 309,705.15 | 0.38 |
| 39 | 123091 | 长海转债    | 301,742.46 | 0.37 |
| 40 | 127104 | 姚记转债    | 270,464.90 | 0.33 |
| 41 | 118036 | 力合转债    | 264,491.40 | 0.33 |
| 42 | 127054 | 双箭转债    | 257,406.63 | 0.32 |
| 43 | 123193 | 海能转债    | 253,407.40 | 0.31 |
| 44 | 123250 | 嘉益转债    | 249,834.25 | 0.31 |
| 45 | 127038 | 国微转债    | 249,807.67 | 0.31 |
| 46 | 123176 | 精测转 2   | 238,998.63 | 0.29 |
| 47 | 127088 | 赫达转债    | 231,294.25 | 0.29 |
| 48 | 113666 | 爱玛转债    | 229,248.24 | 0.28 |
| 49 | 127049 | 希望转 2   | 227,992.05 | 0.28 |
| 50 | 113046 | 金田转债    | 164,028.45 | 0.20 |
| 51 | 118057 | 甬矽转债    | 160,112.30 | 0.20 |
| 52 | 118025 | 奕瑞转债    | 135,392.74 | 0.17 |
| 53 | 123149 | 通裕转债    | 133,436.99 | 0.16 |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 54 | 113659 | 莱克转债 | 128,585.62 | 0.16 |
| 55 | 123121 | 帝尔转债 | 67,864.79  | 0.08 |
| 56 | 118011 | 银微转债 | 26,863.83  | 0.03 |
| 57 | 128142 | 新乳转债 | 12,879.59  | 0.02 |
| 58 | 118032 | 建龙转债 | 12,357.89  | 0.02 |
| 59 | 113059 | 福莱转债 | 12,189.89  | 0.02 |
| 60 | 127085 | 韵达转债 | 11,991.68  | 0.01 |
| 61 | 111002 | 特纸转债 | 11,941.18  | 0.01 |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 58,834,070.28 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 13,802,142.83 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 7,089,737.21  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 65,546,475.90 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《南方安颐混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方安颐混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方安颐混合型证券投资基金 2026 年 1 季度报告原文。

### 9.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>