南方多利增强债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方多利增强债券
基金主代码	202102
交易代码	202102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 8 月 28 日
报告期末基金份额总额	7,682,080,446.42 份
投资目标	本基金属于债券型基金，投资目标是在债券稳定收益的基础上，通过股票一级市场申购等投资手段积极投资获取高于投资基准的收益。
投资策略	首先我们根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期和债券组合结构；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合影响确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，我们采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。
业绩比较基准	中债-信用债总全价(总值)指数收益率×85%+中证可转债及可交换债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的低风险品种，预期收益高于货币市场基金，风险低于混合型基金。
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

下属分级基金的基金简称	南方多利增强债券 A	南方多利增强债券 C
下属分级基金的交易代码	202103	202102
报告期末下属分级基金的份额总额	7,056,520,233.22 份	625,560,213.20 份

注：1.本基金系原南方多利中短期债券投资基金于 2007 年 8 月 28 日转型而来。

2.本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方多利”。

3.本基金自 2009 年 9 月 23 日起增加 A 类收费模式，原有收费模式称为 C 类。

§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 7 月 1 日－2026 年 9 月 30 日）	
	南方多利增强债券 A	南方多利增强债券 C
1.本期已实现收益	-4,205,823.81	-1,242,643.99
2.本期利润	-185,037,463.15	-18,798,978.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0275	-0.0273
4.期末基金资产净值	8,567,104,106.99	757,176,468.15
5.期末基金份额净值	1.2141	1.2104

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

南方多利增强债券 A

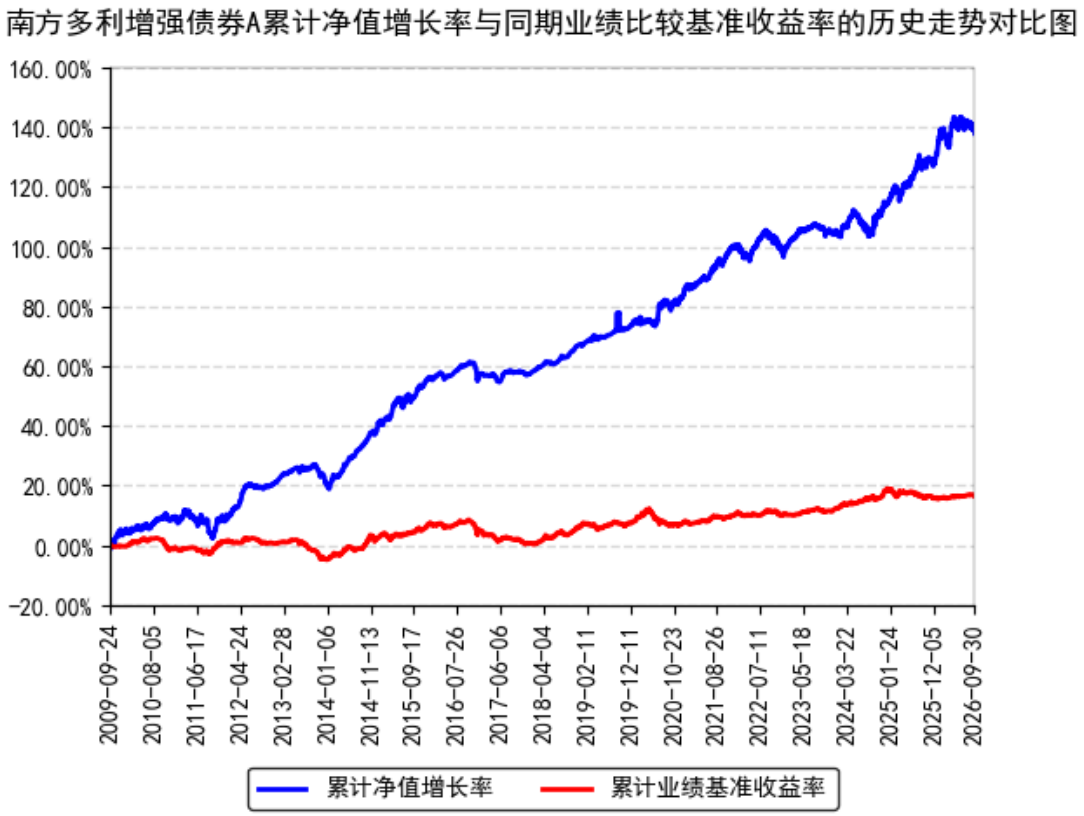
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.28%	0.28%	-0.02%	0.05%	-2.26%	0.23%
过去六个月	2.05%	0.30%	0.47%	0.05%	1.58%	0.25%
过去一年	4.24%	0.29%	0.47%	0.06%	3.77%	0.23%
过去三年	14.61%	0.26%	4.46%	0.09%	10.15%	0.17%
过去五年	21.46%	0.22%	6.34%	0.09%	15.12%	0.13%
过去七年	37.55%	0.21%	8.68%	0.10%	28.87%	0.11%

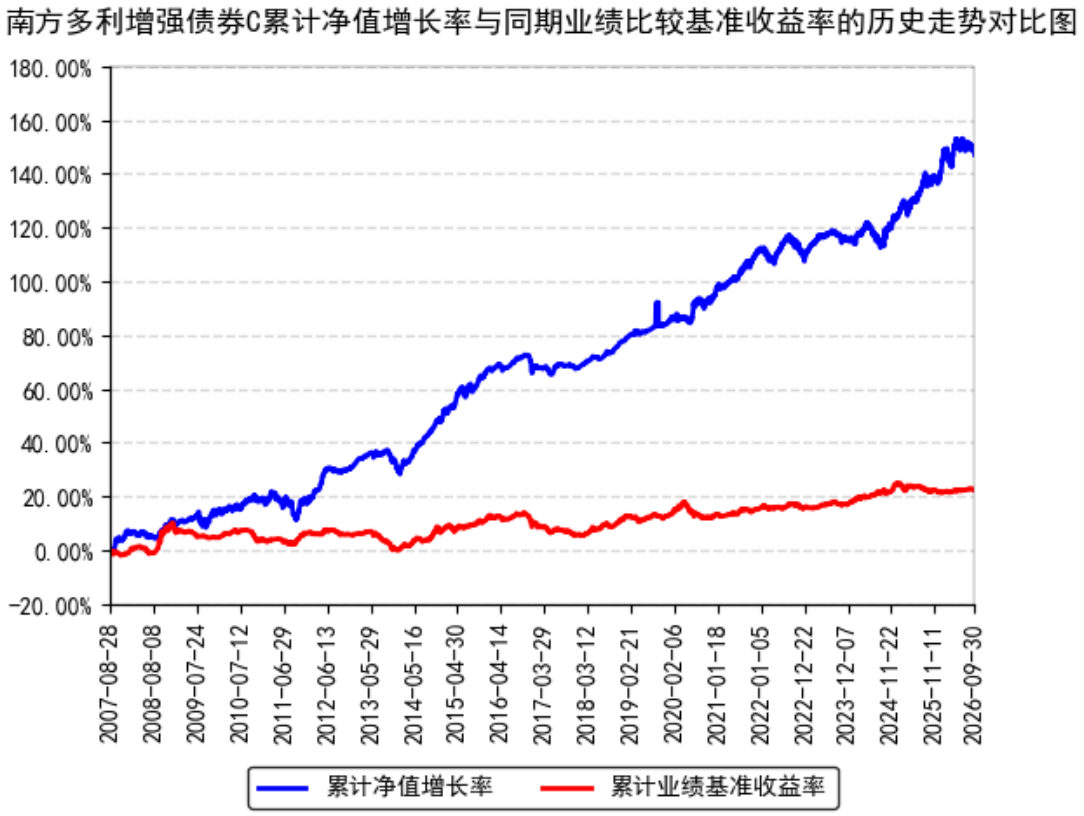
过去十年	48.19%	0.18%	7.90%	0.10%	40.29%	0.08%
自基金合同生效起至今	137.88%	0.20%	16.46%	0.11%	121.42%	0.09%

南方多利增强债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-2.36%	0.28%	-0.02%	0.05%	-2.34%	0.23%
过去六个月	1.90%	0.30%	0.47%	0.05%	1.43%	0.25%
过去一年	3.94%	0.29%	0.47%	0.06%	3.47%	0.23%
过去三年	13.60%	0.26%	4.46%	0.09%	9.14%	0.17%
过去五年	19.66%	0.22%	6.34%	0.09%	13.32%	0.13%
过去七年	34.71%	0.21%	8.68%	0.10%	26.03%	0.11%
过去十年	43.83%	0.18%	7.90%	0.10%	35.93%	0.08%
自基金合同生效起至今	147.18%	0.20%	22.37%	0.11%	124.81%	0.09%

3.2.2 自基金转型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





注：本基金自 2007 年 8 月 28 日起由南方多利中短期债券投资基金转型而来。

本基金从 2009 年 9 月 23 日起新增 A 类份额，A 类份额自 2009 年 9 月 24 日起存续。

注：本基金业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起由“中央国债登记结算公司中债总指数（全价）”变更为“中债-信用债总全价（总值）指数收益率×85%+中证可转债及可交换债券指数收益率×15%”。

§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		
李璇	本基金基金经理	2020 年 9 月 4 日	-	19 年	中国国籍，女，清华大学金融学学士、硕士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2007 年加入南方基金，担任信用债高级分析师。2010 年 9 月 21 日至 2012 年 6 月 7 日，任南方宝元基金经理；2012 年 12 月 21 日至 2014 年 9 月 19 日，任南方安心基金经理；2015 年 12 月 30 日至 2017 年 2 月 24 日，任南方润

					元基金经理；2013 年 7 月 23 日至 2017 年 9 月 21 日，任南方稳利基金经理；2016 年 8 月 5 日至 2017 年 12 月 15 日，任南方通利基金经理；2016 年 8 月 10 日至 2017 年 12 月 15 日，任南方荣冠基金经理；2016 年 8 月 5 日至 2018 年 2 月 2 日，任南方丰元基金经理；2016 年 11 月 23 日至 2018 年 2 月 2 日，任南方荣安基金经理；2017 年 1 月 25 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方和利基金经理；2017 年 3 月 24 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方荣优基金经理；2017 年 5 月 22 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方荣尊基金经理；2017 年 6 月 15 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方荣知基金经理；2017 年 7 月 13 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方荣年基金经理；2016 年 9 月 29 日至 2019 年 3 月 29 日，任南方多元基金经理；2010 年 9 月 21 日至 2019 年 5 月 24 日，任南方多利基金经理；2016 年 12 月 21 日至 2019 年 5 月 24 日，任南方睿见混合基金经理；2017 年 1 月 18 日至 2019 年 5 月 24 日，任南方宏元基金经理；2019 年 1 月 10 日至 2020 年 7 月 31 日，任南方国利基金经理；2018 年 7 月 13 日至 2021 年 8 月 3 日，任南方配售基金经理；2021 年 8 月 3 日至 2022 年 11 月 11 日，任南方优势产业混合基金经理；2017 年 9 月 12 日至 2024 年 5 月 24 日，任南方兴利基金经理；2023 年 3 月 30 日至 2024 年 6 月 28 日，任南方达元债券基金经理；2023 年 8 月 4 日至 2026 年 8 月 28 日，任南方卓利 3 个月定开债券发起基金经理；2021 年 8 月 27 日至 2026 年 9 月 4 日，任南方交元债券基金经理；2024 年 9 月 24 日至 2026 年 9 月 4 日，任南方稳信 180 天持有债券基金经理；2012 年 5 月 17 日至今，任南方金利定开债券基金经理；2020 年 9 月 4 日至今，任南方多利增强债券基金经理；2022 年 7 月 22 日至今，任南方丰元信用增强债券基金经理；2023 年 8 月 23 日至今，任南方宁元债券基金经理；2023 年 12 月 18 日至今，任南方金添利三年定开债券基金经理；2024 年 3 月 12 日至今，

					任南方尊利一年定开债券发起基金经理；2024 年 6 月 19 日至今，任南方惠利 6 个月定开债券基金经理；2025 年 7 月 11 日至今，任南方祥元债券基金经理。
刘文良	本基金基金经理	2024 年 6 月 28 日	-	14 年	中国国籍，北京大学金融学专业硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师；2015 年 2 月 26 日至 2015 年 8 月 20 日，任南方永利基金经理助理；2015 年 12 月 11 日至 2017 年 2 月 24 日，任南方弘利基金经理；2015 年 12 月 30 日至 2017 年 5 月 5 日，任南方安心基金经理；2016 年 11 月 8 日至 2018 年 2 月 2 日，任南方荣发基金经理；2016 年 11 月 11 日至 2018 年 2 月 9 日，任南方卓元基金经理；2017 年 5 月 5 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方和利基金经理；2017 年 5 月 19 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方和元基金经理；2017 年 5 月 23 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方纯元基金经理；2017 年 6 月 16 日至 2018 年 7 月 27 日，任南方高元基金经理；2017 年 8 月 3 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方祥元基金经理；2017 年 9 月 12 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方兴利基金经理；2016 年 7 月 6 日至 2019 年 7 月 5 日，任南方甑智混合基金经理；2015 年 8 月 20 日至 2020 年 9 月 23 日，任南方永利基金经理；2019 年 7 月 5 日至 2021 年 3 月 25 日，任南方甑智混合基金经理；2021 年 4 月 9 日至 2021 年 6 月 4 日，任南方荣欢、南方荣发基金经理；2019 年 7 月 19 日至 2022 年 2 月 24 日，任南方旭元基金经理；2021 年 5 月 7 日至 2022 年 7 月 22 日，任南方晖元 6 个月持有期债券基金经理；2022 年 7 月 22 日至 2023 年 11 月 27 日，任南方荣尊基金经理；2020 年 5 月 28 日至 2023 年 12 月 1 日，任南方招利一年债券基金经理；2019 年 3 月 29 日至 2025 年 5 月 12 日，任南方多元基金经理；2024 年 6 月 28 日至 2026 年 1 月 23 日，任南方达元债券基金经理；2022 年 9 月 16 日至 2026 年 6 月 12 日，任南方耀元债券基金经理；2016 年 6 月

					24 日至今，任南方广利基金经理；2018 年 3 月 14 日至今，任南方希元转债基金经理；2020 年 2 月 14 日至今，任南方宁利一年债券基金经理；2020 年 3 月 6 日至今，任南方昌元转债基金经理；2024 年 6 月 28 日至今，任南方多利基金经理；2025 年 6 月 27 日至今，任南方贤元一年持有债券基金经理；2025 年 12 月 17 日至今，任南方安福混合基金经理；2026 年 4 月 22 日至今，任南方丰泽稳健添利债券基金经理；2026 年 6 月 12 日至今，任南方弘利定开债券发起基金经理。

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。

4.2 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》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 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 8 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

三季度国内经济延续弱修复态势，供需失衡、内外分化的矛盾仍较为突出。AI 产业链高景气持续并支撑出口和生产的韧性表现，制造业 PMI 季内逐月改善，并于 9 月重回扩张区间；内需修复相对乏力，基建投资受财政资金投放节奏偏慢制约，消费呈边际走弱态势；海外方面，全球通胀黏性较强，美联储于 9 月加息 25BP，为三年来首次，外部利率中枢高企但未对国内形成实质掣肘，国内货币政策保持适度宽松基调，央行多措并举维护资金面平稳，流动性维持合理充裕；财政端政策性金融工具积极投放。市场方面，三季度债券市场延续强势行情，10 年期国债收益率由季初 1.74%震荡下行至季末 1.68%，收益率曲线进一步平坦化；信用债收益率低位运行，期限及等级利差进一步压缩，中长端信用债表现占优。转债市场三季度跟随权益市场震荡下行，估值水平持续压缩，中证转债指数季度收跌 7.0%。

投资运作上，南方多利以中高等级信用债投资为主，并通过投资部分转债力争为组合增厚收益。三季度组合纯债仓位以信用债为主，在严防信用风险的前提下积极进行信用债精细化管理，兼顾组合的资本利得和票息收益，在市场波动中持续优化持仓结构，组合仓位及久期水平小幅降低；可转债仓位以绝对收益增厚为目标，根据基本面、估值和市场判断调整仓位、精选个券，三季度转债市场调整过程中着力于控制回撤，但受市场影响净值仍有一定波动。

展望未来，海外局势动荡反复，美国经济韧性与通胀黏性并存，美联储紧缩窗口尚未关闭，外部流动性约束仍存；国内经济预计延续“外强内弱”的弱复苏格局，出口韧性仍在但高基数下增速趋于回落；9 月末国常会部署“存量提效、增量加码”相关举措，四季度将迎来政策密集落地窗口，有望带动内需边际改善；货币政策仍将坚持以我为主，PSL 等结构性工具降息已经落地，总量宽松的窗口亦未关闭；综上，债券市场有望延续低利率及低利差环境，政策预期扰动或将加大市场波动，组合将在震荡行情中积极捕捉信用债波动带来的配置窗口，并把握利率债的波段操作机会。转债市场方面，估值压力持续释放，转债择券空间重新打开，配置性价比有所提升，组合以自下而上择券思路为主，精选个券进行配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.2141 元，报告期内，份额净值增长率为-2.28%，同期业绩基准增长率为-0.02%；本基金 C 份额净值为 1.2104 元，报告期内，份额净值增长率为-2.36%，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,960,421,258.52	99.15
	其中：债券	9,960,421,258.52	99.15
	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	5,537,144.25	0.06
8	其他资产	79,579,831.64	0.79
9	合计	10,045,538,234.41	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

无。

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

无。

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	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	4,662,072,537.89	50.00
	其中：政策性金融债	513,088,188.28	5.50
4	企业债券	535,303,303.61	5.74
5	企业短期融资券	30,505,596.71	0.33
6	中期票据	2,693,800,303.72	28.89
7	可转债（可交换债）	1,801,225,645.22	19.32
8	同业存单	237,513,871.37	2.55
9	其他	-	-
10	合计	9,960,421,258.52	106.82

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	2228041	22 农业银行二级 01	3,700,000	378,736,764.38	4.06
2	09260401	26 农发清发 01	2,800,000	281,290,761.64	3.02
3	2228014	22 交通银行二级 01	2,500,000	257,121,095.89	2.76
4	232580067	25 中行二级资本债 03A(BC)	1,600,000	165,755,642.74	1.78
5	2228017	22 邮储银行二级 01	1,600,000	164,633,749.04	1.77

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

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通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；中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚；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。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库。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）没有超出基金合同约定的备选股票库，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	113,618.29
2	应收证券清算款	78,938,180.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	528,032.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,579,831.64

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	118030	睿创转债	124,065,367.35	1.33
2	127045	牧原转债	71,580,305.10	0.77
3	127030	盛虹转债	68,781,472.98	0.74
4	118034	晶能转债	66,220,485.53	0.71
5	113691	和邦转债	60,906,216.86	0.65
6	110099	福能转债	53,721,283.65	0.58
7	113673	岱美转债	49,389,678.97	0.53
8	113699	金 25 转债	42,418,241.24	0.45
9	123247	万凯转债	41,915,657.18	0.45
10	127049	希望转 2	39,902,429.74	0.43
11	123158	宙邦转债	39,520,514.12	0.42
12	123241	欧通转债	38,495,433.04	0.41
13	110087	天业转债	34,438,897.31	0.37
14	113615	金诚转债	33,337,692.81	0.36
15	123176	精测转 2	30,821,721.65	0.33
16	118059	颀中转债	29,647,698.68	0.32
17	118058	微导转债	26,421,860.94	0.28
18	118044	赛特转债	25,858,632.93	0.28
19	123255	鼎龙转债	25,788,052.23	0.28
20	118013	道通转债	24,635,819.18	0.26
21	128136	立讯转债	24,011,243.33	0.26
22	123109	昌红转债	22,795,686.48	0.24
23	127092	运机转债	22,209,186.05	0.24
24	118056	路维转债	20,283,779.10	0.22
25	113677	华懋转债	19,719,506.07	0.21
26	118051	皓元转债	19,581,476.31	0.21
27	113043	财通转债	19,400,657.62	0.21
28	123178	花园转债	18,226,858.09	0.20
29	113661	福 22 转债	18,177,221.47	0.19
30	123195	蓝晓转 02	17,798,393.34	0.19

31	123165	回天转债	17,723,818.94	0.19
32	123213	天源转债	17,680,183.68	0.19
33	118035	国力转债	17,671,395.41	0.19
34	118042	奥维转债	17,449,405.18	0.19
35	123131	奥飞转债	16,965,938.92	0.18
36	127089	晶澳转债	16,193,074.38	0.17
37	123259	锦浪转 02	11,805,268.46	0.13
38	118060	瑞可转债	11,711,740.65	0.13
39	127103	东南转债	11,364,735.80	0.12
40	111000	起帆转债	11,033,509.78	0.12
41	127070	大中转债	9,978,749.57	0.11
42	118061	茂莱转债	7,492,533.08	0.08
43	127088	赫达转债	3,865,608.55	0.04
44	123261	普联转债	3,639,660.97	0.04
45	123211	阳谷转债	2,130,040.24	0.02

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

项目	南方多利增强债券 A	南方多利增强债券 C
报告期期初基金份额总额	5,278,633,463.24	612,637,096.57
报告期期间基金总申购份额	3,150,537,351.23	288,828,326.19
减：报告期期间基金总赎回份额	1,372,650,581.25	275,905,209.56
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	7,056,520,233.22	625,560,213.20

§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

单位：份

项目	份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	52,119,518.76
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	52,119,518.76

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.68

注：申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260701-20260930	1,312,022,813.61	649,191,520.77	-	1,961,214,334.38	25.53%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

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、《南方多利增强债券型证券投资基金基金合同》；

2、《南方多利增强债券型证券投资基金托管协议》；

3、南方多利增强债券型证券投资基金 2026 年 3 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