

南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资 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：南京银行股份有限公司

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。

基金托管人南京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.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
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.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	50
7.7 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.....	51
7.8 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.....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 盈利投资者数量占比.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	55
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.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	南方鑫悦 15 个月持有混合	
基金主代码	016553	
交易代码	016553	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 9 月 14 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	南京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	68,708,562.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	南方鑫悦 15 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	016553	016554
报告期末下属分级基金的份额总额	63,965,776.19 份	4,742,786.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，投资于精选的股票，通过严谨的风险管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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		南京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	王峰
	联系电话	0755-82763888	021-24198808
	电子邮箱	manager@southernfund.com	wangf3@njcb.com.cn

客户服务电话	400-889-8899	95302
传真	0755-82763889	025-86776189
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	南京市建邺区江山大街 88 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	南京市建邺区江山大街 88 号
邮政编码	518017	210019
法定代表人	周易	谢宁

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、南方鑫悦 15 个月持有混合 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	19,029,214.57
本期利润	23,985,184.15
加权平均基金份额本期利润	0.3349
本期加权平均净值利润率	22.82%
本期基金份额净值增长率	25.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	34,761,788.00
期末可供分配基金份额利润	0.5434
期末基金资产净值	107,360,327.03
期末基金份额净值	1.6784

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	67.84%

2、南方鑫悦 15 个月持有混合 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	1,172,332.37
本期利润	1,525,110.21
加权平均基金份额本期利润	0.3290
本期加权平均净值利润率	22.82%
本期基金份额净值增长率	25.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,410,364.92
期末可供分配基金份额利润	0.5082
期末基金资产净值	7,780,689.29
期末基金份额净值	1.6405
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	64.05%

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；

对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

南方鑫悦 15 个月持有混合 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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	23.58%	1.56%	6.42%	0.83%	17.16%	0.73%
过去六个月	25.38%	1.47%	3.53%	0.76%	21.85%	0.71%
过去一年	59.18%	1.29%	15.00%	0.69%	44.18%	0.60%
过去三年	63.05%	1.15%	24.12%	0.75%	38.93%	0.40%
自基金合同 生效起至今	67.84%	1.05%	21.80%	0.75%	46.04%	0.30%

南方鑫悦 15 个月持有混合 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	23.40%	1.56%	6.42%	0.83%	16.98%	0.73%
过去六个月	25.01%	1.47%	3.53%	0.76%	21.48%	0.71%
过去一年	58.21%	1.29%	15.00%	0.69%	43.21%	0.60%
过去三年	60.13%	1.15%	24.12%	0.75%	36.01%	0.40%
自基金合同生效起至今	64.05%	1.05%	21.80%	0.75%	42.25%	0.30%

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

南方鑫悦15个月持有混合A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



南方鑫悦15个月持有混合C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		
卢玉珊	本基金	2022 年 9	-	17 年	中国国籍，女，清华大学会计学硕士，

	基金经 理	月 14 日			具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员，负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作；2015 年 2 月 26 日至 2015 年 12 月 30 日，任南方成份、南方安心基金经理助理；2015 年 5 月 19 日至 2015 年 12 月 30 日，任南方改革机遇基金经理助理；2015 年 12 月 30 日至 2019 年 1 月 9 日，任南方安心基金经理；2022 年 2 月 7 日至 2025 年 11 月 21 日，任南方比较优势混合基金经理；2022 年 11 月 15 日至 2026 年 2 月 6 日，任南方君誉混合基金经理；2019 年 1 月 9 日至今，任南方核心竞争混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至今，任南方改革机遇基金经理；2020 年 5 月 15 日至今，任南方君选基金经理；2021 年 6 月 21 日至今，任南方价值臻选混合基金经理；2022 年 9 月 14 日至今，任南方鑫悦 15 个月持有混合基金经理；2024 年 5 月 24 日至今，兼任投资经理。
--	----------	--------	--	--	--

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
卢玉珊	公募基金	5	1,733,997,992.67	2015 年 12 月 30 日
	私募资产管理计划	1	1,383,350,492.08	2024 年 10 月 31 日
	其他组合	33	65,493,281,910.70	2022 年 12 月 01 日
	合计	39	68,610,630,395.45	-

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 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

上半年市场整体震荡上涨，行情结构高度分化、极致演绎。一季度美伊冲突爆发带来阶段性调整，市场风险偏好回落；二季度在地缘冲击缓和后风险偏好快速回升，5-6 月行情围绕 AI 产业链加速演绎，资金高度集中于科技成长方向，形成极致的结构性行情。具体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000、创业板指、科创 50 分别上涨 7.55%、20.97%、15.99%、35.58% 和 64.25%，创业板指和科创 50 的表现大幅领先。

风格方面，成长显著优于价值，科创板与创业板大幅领先主板，市场定价权重高度向 AI 相关科技成长方向集中。成交方面，全 A 日均成交维持较高水平，市场活跃度延续。行业层面，由于宏观经济呈现明显分化，以 AI 算力和半导体为代表的成长风格演绎进一步趋于极致，31 个申万一级行业中仅 10 个录得上涨。电子、通信、建材涨幅居前，分别录得 86.29%、73.59%、46.26%。其中电子、通信引领 AI 硬件主线，受益于全球算力资本开支持续扩张叠加国产替代加速，半导体、光模块等方向持续高景气；建材涨幅领先，主因建材中玻璃纤维等新方向受 AI 硬件需求拉动明显，AI 景气向上游环节扩散。另一方面，内需消费景气下行，商贸零售、农林牧渔、美容护理表现靠后，分别录得 -29.42%、-25.26%、-24.86%，主因消费复苏进程偏缓、终端需求疲软叠加行业竞争加剧，农林牧渔亦受生猪价格

低位运行拖累。AI 硬件是上半年最为清晰的产业主线，光通信、半导体等方向涨幅超 60%；而消费和传统周期方向缺乏持续需求支撑，市场呈现显著的科技虹吸效应。

我们在上半年主要增配了电子、通信、机械设备等方向，结构上继续加大了成长方向的仓位配置。超额收益主要来自电子和通信持仓贡献正收益，并适当减仓了资源品控制回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.6784 元，报告期内，份额净值增长率为 25.38%，同期业绩基准增长率为 3.53%；本基金 C 份额净值为 1.6405 元，报告期内，份额净值增长率为 25.01%，同期业绩基准增长率为 3.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，宏观经济延续平稳修复态势，十五五规划各项政策逐步启动，企业盈利基本面整体呈温和改善趋势。反内卷政策的推进对部分制造业的供需格局产生积极影响，上市公司利润增速结构性分化明显。资本市场方面，政策层面持续呵护，长期资金稳步入市，市场流动性整体维持充裕格局。回顾上半年，A 股在经历年初的震荡整固后，市场风格快速向高景气成长方向集中，5-6 月泛 AI 产业链与出海制造板块出现极致行情，赚钱效应高度集中于少数方向。

我们认为，A 股已从此前的“牛市中继”阶段进一步演化为以结构性行情为主的震荡分化格局，市场驱动力从估值修复和流动性推动全面转向企业盈利兑现与产业逻辑验证的深度挖掘。在整体估值并不便宜的背景下，唯有具备真实业绩增长且产业逻辑持续得到验证的方向和个股，才能穿越波动、创造阿尔法收益。展望下半年，我们预计指数层面仍将呈现以结构性行情为主的震荡状态，风格上市场有适度再平衡的需求。外部环境上，我们保持对大型 IPO 上市对市场流动性的阶段性冲击、国际地缘政治及贸易保护政策扰动的关注。

我们将保持对宏观环境变化、产业逻辑变迁、企业业绩兑现度等主要因素的跟踪，AI 相关持仓将根据产业逻辑和企业兑现度做适度集中和调整。我们仍将聚焦以下四条主线：1) 泛 AI 产业链：围绕算力硬件、应用、核心设备纵深，重点关注光通信与半导体为主的硬科技方向，以及新能源板块的重要环节；2) 优秀的出海企业：受益于海外能源成本抬升而竞争力进一步增强的中国制造业，在内需领域增长平缓的背景下，具备全球竞争力的中国制造和品牌企业仍是我们获取超额收益的重要来源；3) 上游资源品与化工：部分上游行业供给侧改革持续深化，供需格局的改善有望带来持续的景气周期；4) 经营数据开始改善的底部消费品企业：部分消费品经历了充分的估值消化与基本面出清，经营拐点已现，具备左侧布局价值。此外，我们也会继续关注地产产业链的边际变化。

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，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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，南京银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的托管过程中，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、基金合同和托管协议的相关规定，切实履行了受托管理职责，未出现任何损害基金份额持有人利益的行为，独立、勤勉尽责地履行了受托管理职责。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作实施了必要的监督。针对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、利润分配及基金费用开支等方面，本托管人进行了审慎复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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、经本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（其中“金融工具风险及管理”部分未经本托管人复核）、投资组合报告等内容均真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金

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	9,421,629.62	3,369,757.02
结算备付金		877,676.62	35,007.52
存出保证金		51,183.90	84,386.93
交易性金融资产	6.4.7.2	105,368,859.39	110,839,929.55
其中：股票投资		101,893,989.31	107,996,726.99
基金投资		-	-
债券投资		3,474,870.08	2,843,202.56
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	-	-
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		543,829.32	426,136.53

应收股利		77,686.65	1,534.40
应收申购款		151,616.37	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		116,492,481.87	114,756,751.95
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		-	-
应付清算款		866,757.85	0.36
应付赎回款		217,292.78	230,559.89
应付管理人报酬		108,014.83	115,458.29
应付托管费		18,002.48	19,243.02
应付销售服务费		3,622.39	2,595.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		34.46	4.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	137,740.76	185,960.93
负债合计		1,351,465.55	553,822.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	68,708,562.34	85,389,076.16
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	46,432,453.98	28,813,853.51
净资产合计		115,141,016.32	114,202,929.67
负债和净资产总计		116,492,481.87	114,756,751.95

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，南方鑫悦 15 个月持有混合 A 份额净值 1.6784 元，基金份额总额 63,965,776.19 份；南方鑫悦 15 个月持有混合 C 份额净值 1.6405 元，基金份额总额 4,742,786.15 份；总份额合计 68,708,562.34 份。

6.2 利润表

会计主体：南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金

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		26,396,819.55	13,000,393.10

1.利息收入		8,566.30	26,154.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,566.30	26,154.98
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		21,079,505.83	14,595,438.06
其中：股票投资收益	6.4.7.10	20,276,677.66	11,665,569.24
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	47,570.65	4,569.74
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	755,257.52	2,925,299.08
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	5,308,747.42	-1,621,199.94
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		886,525.19	1,755,554.38
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	665,428.51	1,405,240.74
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	110,904.75	234,206.81
3.销售服务费	6.4.10.2.3	19,830.19	16,978.13
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产			
支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		8.45	3.91
8.其他费用	6.4.7.19	90,353.29	99,124.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,510,294.36	11,244,838.72
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,510,294.36	11,244,838.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		25,510,294.36	11,244,838.72

6.3 净资产变动表

会计主体：南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金

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	85,389,076.16	-	28,813,853.51	114,202,929.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	85,389,076.16	-	28,813,853.51	114,202,929.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,680,513.82	-	17,618,600.47	938,086.65
（一）、综合收益总额	-	-	25,510,294.36	25,510,294.36
（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）	-16,680,513.82	-	-7,891,693.89	-24,572,207.71
其中：1.基金申购款	8,565,765.33	-	3,894,668.11	12,460,433.44
2.基金赎回款	-25,246,279.15	-	-11,786,362.00	-37,032,641.15
（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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	68,708,562.34	-	46,432,453.98	115,141,016.32
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	282,196,299.85	-	2,070,896.54	284,267,196.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	282,196,299.85	-	2,070,896.54	284,267,196.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-97,509,607.88	-	7,887,795.76	-89,621,812.12
(一)、综合收益总额	-	-	11,244,838.72	11,244,838.72
(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）	-97,509,607.88	-	-3,357,042.96	-100,866,650.84
其中：1.基金申购款	596,879.65	-	8,947.68	605,827.33
2.基金赎回款	-98,106,487.53	-	-3,365,990.64	-101,472,478.17
(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）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末 净资产	184,686,691.97	-	9,958,692.30	194,645,384.27
---------------	----------------	---	--------------	----------------

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

南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金(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[2022]1750 号《关于准予南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》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 983,460,241.92 元,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(22)第 00452 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 9 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 983,837,284.70 份,其中认购资金利息折合 377,042.78 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,基金托管人为南京银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证(下同))、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)以及经中国证

监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为 60%-95%(其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%)。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+上证国债指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、

财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]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》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，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。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(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；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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，继续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，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 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	9,421,629.62
等于：本金	9,421,180.63
加：应计利息	448.99
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	9,421,629.62

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			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		69,172,337.81	-	101,893,989.31	32,721,651.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,146,149.00	29,780.84	3,474,870.08	298,940.24
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,146,149.00	29,780.84	3,474,870.08	298,940.24
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	72,318,486.81	29,780.84	105,368,859.39	33,020,591.74

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

无。

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	52,409.78
其中：交易所市场	52,409.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,330.98
合计	137,740.76

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方鑫悦 15 个月持有混合 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	81,415,379.77	81,415,379.77
本期申购	7,247,547.23	7,247,547.23
本期赎回（以“-”号填列）	-24,697,150.81	-24,697,150.81
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	63,965,776.19	63,965,776.19

南方鑫悦 15 个月持有混合 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	3,973,696.39	3,973,696.39
本期申购	1,318,218.10	1,318,218.10
本期赎回（以“-”号填列）	-549,128.34	-549,128.34
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	4,742,786.15	4,742,786.15

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

南方鑫悦 15 个月持有混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,518,507.22	5,054,189.29	27,572,696.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	22,518,507.22	5,054,189.29	27,572,696.51
本期利润	19,029,214.57	4,955,969.58	23,985,184.15
本期基金份额交易产生的变动数	-6,785,933.79	-1,377,396.03	-8,163,329.82
其中：基金申购款	2,941,809.07	414,338.90	3,356,147.97
基金赎回款	-9,727,742.86	-1,791,734.93	-11,519,477.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,761,788.00	8,632,762.84	43,394,550.84

南方鑫悦 15 个月持有混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	998,406.35	242,750.65	1,241,157.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	998,406.35	242,750.65	1,241,157.00
本期利润	1,172,332.37	352,777.84	1,525,110.21
本期基金份额交易产生的变动数	239,626.20	32,009.73	271,635.93
其中：基金申购款	473,708.97	64,811.17	538,520.14
基金赎回款	-234,082.77	-32,801.44	-266,884.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,410,364.92	627,538.22	3,037,903.14

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	8,196.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	279.32
其他	90.30
合计	8,566.30

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	20,276,677.66
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	20,276,677.66

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	109,801,881.78
减：卖出股票成本总额	89,368,228.37
减：交易费用	156,975.75
买卖股票差价收入	20,276,677.66

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

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	21,669.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	25,901.58
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	47,570.65

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	4,304,029.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,224,327.00
减：应计利息总额	53,799.40
减：交易费用	1.99
买卖债券差价收入	25,901.58

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	755,257.52
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	755,257.52

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	5,308,747.42
——股票投资	5,145,142.96
——债券投资	163,604.46
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,308,747.42

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	21,323.61
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
其他	522.31
合计	90,353.29

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、注册登记机构、基金销售机构
南京银行股份有限公司(“南京银行”)	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
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

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	1,873,358.72	1.00%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金	占期末应付佣

		量的比例	余额	金总额的比例
华泰证券	683.82	0.84%	214.61	0.41%
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	-	-	-	-

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

2. 该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3 号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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	665,428.51	1,405,240.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	298,671.51	629,628.64
应支付基金管理人的净管理费	366,757.00	775,612.10

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%÷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	110,904.75	234,206.81

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%÷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

	南方鑫悦 15 个月持有 混合 A	南方鑫悦 15 个月持有 混合 C	合计
南京银行	-	8,424.39	8,424.39
合计	-	8,424.39	8,424.39
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		
	南方鑫悦 15 个月持有 混合 A	南方鑫悦 15 个月持有 混合 C	合计
南京银行	-	16,618.63	16,618.63
合计	-	16,618.63	16,618.63

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.60\% \div \text{当年天数}。$$

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

无。

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

无。

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

无。

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
南京银行	9,421,629.62	8,196.68	12,877,577.51	25,402.87

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
华泰联合	118068	迪威转债	配债	130	13,000.00

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
华泰联合	301458	钧崴电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合	603014	威高血净	网下申购	1,085	28,752.50

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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之外的基金

注：本期无。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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	300	30,000.00	30,000.92	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.05	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	678	246,414.03	596,321.34	-

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

无。

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

本基金是混合型基金，本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。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“风险和收益相匹配”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，将风险控制在此可承受的范围内。

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同责任，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，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净资产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。

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》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，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，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。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度；根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------	-------	-------	-------	-----	----

年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	9,421,629.62	-	-	-	9,421,629.62
结算备付金	877,676.62	-	-	-	877,676.62
存出保证金	51,183.90	-	-	-	51,183.90
交易性金融资产	2,829,822.14	411,128.61	233,919.33	101,893,989.31	105,368,859.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	543,829.32	543,829.32
应收股利	-	-	-	77,686.65	77,686.65
应收申购款	-	-	-	151,616.37	151,616.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,180,312.28	411,128.61	233,919.33	102,667,121.65	116,492,481.87
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	866,757.85	866,757.85
应付赎回款	-	-	-	217,292.78	217,292.78
应付管理人报酬	-	-	-	108,014.83	108,014.83
应付托管费	-	-	-	18,002.48	18,002.48
应付销售服务费	-	-	-	3,622.39	3,622.39
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	34.46	34.46
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	137,740.76	137,740.76
负债总计	-	-	-	1,351,465.55	1,351,465.55
利率敏感度缺口	13,180,312.28	411,128.61	233,919.33	101,315,656.10	115,141,016.32
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,369,757.02	-	-	-	3,369,757.02
结算备付金	35,007.52	-	-	-	35,007.52
存出保证金	84,386.93	-	-	-	84,386.93
交易性金融资产	2,423,379.61	184,246.74	235,576.21	107,996,726.99	110,839,929.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	426,136.53	426,136.53
应收股利	-	-	-	1,534.40	1,534.40
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,912,531.08	184,246.74	235,576.21	108,424,397.92	114,756,751.95
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	0.36	0.36
应付赎回款	-	-	-	230,559.89	230,559.89
应付管理人	-	-	-	115,458.29	115,458.29

报酬					
应付托管费	-	-	-	19,243.02	19,243.02
应付销售服务费	-	-	-	2,595.28	2,595.28
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4.51	4.51
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	185,960.93	185,960.93
负债总计	-	-	-	553,822.28	553,822.28
利率敏感度缺口	5,912,531.08	184,246.74	235,576.21	107,870,575.64	114,202,929.67

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	-1,581.36	-1,225.25
	2.市场利率平行下降 25 个基点	1,584.82	1,228.01

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	6,473,542.02	-	-	-	6,473,542.02
资产合计	-	6,473,542.02	-	-	-	6,473,542.02
以外币计						

价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口 净额	-	6,473,542.02	-	-	-	6,473,542.02

项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	14,879,788.09	-	-	-	14,879,788.09
资产合计	-	14,879,788.09	-	-	-	14,879,788.09
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口 净额	-	14,879,788.09	-	-	-	14,879,788.09

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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. 所有外币相对人民币升值 5%	323,677.10	743,989.40
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-323,677.10	-743,989.40

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。本基金可以投资于股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结

合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	101,893,989.31	88.49	107,996,726.99	94.57
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	645,047.94	0.56	419,822.95	0.37
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	102,539,037.25	89.06	108,416,549.94	94.93

注：交易性金融资产-债券投资项目仅包含可转换公司债券或可交换公司债券。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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.沪深 300 上升 5%	7,436,230.03	6,549,832.21
	2.沪深 300 下降 5%	-7,436,230.03	-6,549,832.21

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	101,909,714.94
第二层次	3,459,144.45
第三层次	-
合计	105,368,859.39

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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	权益投资	101,893,989.31	87.47
	其中：股票	101,893,989.31	87.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,474,870.08	2.98
	其中：债券	3,474,870.08	2.98

	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	10,299,306.24	8.84
8	其他各项资产	824,316.24	0.71
9	合计	116,492,481.87	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币 382,131.60 元，占基金资产净值比例 0.33%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 6,091,410.42 元，占基金资产净值比例 5.29%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	1,215,387.00	1.06
C	制造业	85,842,895.72	74.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	985,353.00	0.86
E	建筑业	113,190.00	0.10
F	批发和零售业	120,000.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	604,324.94	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,996,180.61	1.73
J	金融业	1,967,419.00	1.71
K	房地产业	46,170.00	0.04
L	租赁和商务服务业	633,312.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	1,053,438.24	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	842,776.78	0.73
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	95,420,447.29	82.87

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------

能源	488,420.41	0.42
材料	365,103.69	0.32
工业	387,677.29	0.34
非必需消费品	69,397.15	0.06
必需消费品	-	-
医疗保健	103,948.06	0.09
金融	797,242.05	0.69
科技	3,397,298.58	2.95
通讯	551,776.79	0.48
公用事业	-	-
房地产	312,678.00	0.27
政府	-	-
合计	6,473,542.02	5.62

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	002353	杰瑞股份	18,900	2,882,250.00	2.50
2	300750	宁德时代	6,660	2,617,446.60	2.27
3	600183	生益科技	13,000	2,254,200.00	1.96
4	300308	中际旭创	1,500	1,905,000.00	1.65
5	300604	长川科技	5,500	1,877,810.00	1.63
6	06869	长飞光纤光缆	8,000	1,774,621.36	1.54
7	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.05
8	300408	三环集团	10,000	1,669,000.00	1.45
9	002463	沪电股份	9,400	1,436,320.00	1.25
10	688409	富创精密	4,619	1,414,568.75	1.23
11	688668	鼎通科技	3,593	1,341,266.90	1.16
12	300502	新易盛	1,940	1,177,580.00	1.02
13	300567	精测电子	3,700	1,175,120.00	1.02
14	688596	正帆科技	13,700	1,083,122.00	0.94
15	600487	亨通光电	9,700	1,060,598.00	0.92
16	300037	新宙邦	11,200	1,039,920.00	0.90
17	688362	甬矽电子	10,630	1,024,732.00	0.89
18	603324	盛剑科技	19,800	1,014,948.00	0.88
19	301086	鸿富瀚	4,640	971,059.20	0.84
20	688256	寒武纪	590	941,374.50	0.82
21	688627	精智达	1,311	937,365.00	0.81
22	002475	立讯精密	12,400	872,960.00	0.76

23	002384	东山精密	3,200	839,520.00	0.73
24	688347	华虹宏力	1,928	648,386.40	0.56
25	01347	华虹宏力	1,000	186,911.96	0.16
26	600176	中国巨石	11,200	816,256.00	0.71
27	603986	兆易创新	1,000	815,000.00	0.71
28	300666	江丰电子	2,100	774,060.00	0.67
29	000425	徐工机械	95,200	770,168.00	0.67
30	002484	江海股份	7,300	766,500.00	0.67
31	01070	TCL 电子	68,000	761,301.45	0.66
32	603606	东方电缆	17,280	717,292.80	0.62
33	688720	艾森股份	6,910	697,910.00	0.61
34	002371	北方华创	780	689,956.80	0.60
35	603259	药明康德	5,400	672,354.00	0.58
36	300274	阳光电源	4,140	658,342.80	0.57
37	300223	北京君正	2,600	647,140.00	0.56
38	002916	深南电路	1,400	641,060.00	0.56
39	300054	鼎龙股份	6,000	635,820.00	0.55
40	002142	宁波银行	21,200	629,428.00	0.55
41	600522	中天科技	10,300	625,004.00	0.54
42	600309	万华化学	8,800	602,008.00	0.52
43	688072	拓荆科技	678	596,321.34	0.52
44	688981	中芯国际	3,651	579,851.82	0.50
45	600379	宝光股份	38,400	578,688.00	0.50
46	002138	顺络电子	7,900	577,490.00	0.50
47	600323	瀚蓝环境	20,800	571,168.00	0.50
48	688386	泛亚微透	6,302	566,171.68	0.49
49	605358	立昂微	7,100	550,960.00	0.48
50	605090	九丰能源	14,800	550,116.00	0.48
51	603228	景旺电子	7,400	535,834.00	0.47
52	00700	腾讯控股	1,400	522,623.91	0.45
53	02628	中国人寿	13,000	301,022.06	0.26
54	601628	中国人寿	6,100	215,635.00	0.19
55	002409	雅克科技	2,300	516,350.00	0.45
56	688037	芯源微	1,164	511,054.20	0.44
57	603078	江化微	10,300	509,026.00	0.44
58	02888	渣打集团	2,700	496,219.99	0.43
59	301611	珂玛科技	2,700	486,189.00	0.42
60	01385	上海复旦	18,000	485,588.93	0.42
61	300483	首华燃气	26,800	471,144.00	0.41
62	688200	华峰测控	885	464,713.50	0.40
63	688808	联讯仪器	200	464,466.00	0.40
64	600150	中国船舶	13,700	462,923.00	0.40
65	688548	广钢气体	8,785	457,698.50	0.40

66	002318	久立特材	18,700	446,930.00	0.39
67	002821	凯莱英	2,100	340,200.00	0.30
68	06821	凯莱英	1,100	103,948.06	0.09
69	300260	新莱应材	4,400	442,024.00	0.38
70	000725	京东方 A	50,100	434,868.00	0.38
71	000415	渤海租赁	106,700	434,269.00	0.38
72	002831	裕同科技	12,056	428,711.36	0.37
73	000100	TCL 科技	73,377	427,054.14	0.37
74	603290	斯达半导	2,700	412,938.00	0.36
75	600893	航发动力	10,300	394,902.00	0.34
76	002245	蔚蓝锂芯	21,052	393,882.92	0.34
77	688110	东芯股份	1,860	378,882.00	0.33
78	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.33
79	688605	先锋精科	3,550	369,271.00	0.32
80	601138	工业富联	5,100	367,965.00	0.32
81	002947	恒铭达	4,800	365,040.00	0.32
82	002645	华宏科技	13,120	360,931.20	0.31
83	300990	同飞股份	3,400	357,238.00	0.31
84	600516	方大炭素	57,600	355,392.00	0.31
85	688002	睿创微纳	2,297	355,322.93	0.31
86	300679	电连技术	5,900	353,941.00	0.31
87	00883	中国海洋石油	20,000	352,978.72	0.31
88	300286	安科瑞	14,600	352,590.00	0.31
89	600030	中信证券	12,000	344,760.00	0.30
90	002937	兴瑞科技	7,763	341,028.59	0.30
91	688052	纳芯微	1,181	340,494.11	0.30
92	688082	盛美上海	777	335,664.00	0.29
93	002422	科伦药业	8,600	331,272.00	0.29
94	605305	中际联合	7,900	331,168.00	0.29
95	002028	思源电气	1,900	328,700.00	0.29
96	603823	百合花	6,000	327,420.00	0.28
97	300568	星源材质	17,400	325,728.00	0.28
98	600563	法拉电子	1,700	324,360.00	0.28
99	601318	中国平安	6,700	319,858.00	0.28
100	688516	奥特维	5,526	317,137.14	0.28
101	688025	杰普特	671	315,370.00	0.27
102	600458	时代新材	19,000	314,450.00	0.27
103	01109	华润置地	12,000	312,678.00	0.27
104	688008	澜起科技	1,005	311,449.50	0.27
105	300731	科创新源	5,320	310,475.20	0.27
106	688048	长光华芯	606	304,212.00	0.26
107	688478	晶升股份	3,404	301,424.20	0.26

108	688392	骄成超声	1,319	299,650.42	0.26
109	300088	长信科技	25,800	299,280.00	0.26
110	600482	中国动力	9,104	298,611.20	0.26
111	600105	永鼎股份	4,400	296,912.00	0.26
112	603269	海鸥股份	17,920	295,142.40	0.26
113	000893	亚钾国际	6,900	282,141.00	0.25
114	688531	日联科技	1,511	268,716.24	0.23
115	002850	科达利	1,400	265,020.00	0.23
116	002938	鹏鼎控股	2,500	263,450.00	0.23
117	600499	科达制造	19,000	262,200.00	0.23
118	301571	国科天成	4,000	260,720.00	0.23
119	688112	鼎阳科技	3,533	259,534.18	0.23
120	000333	美的集团	3,400	256,802.00	0.22
121	600452	涪陵电力	27,500	256,575.00	0.22
122	603650	彤程新材	2,600	254,748.00	0.22
123	688019	安集科技	750	254,595.00	0.22
124	002203	海亮股份	11,100	253,635.00	0.22
125	300083	创世纪	18,600	253,332.00	0.22
126	688545	兴福电子	1,890	251,483.40	0.22
127	300394	天孚通信	820	248,197.60	0.22
128	300757	罗博特科	400	247,600.00	0.22
129	301251	威尔高	4,646	247,538.88	0.21
130	603893	瑞芯微	1,300	244,868.00	0.21
131	605376	博迁新材	900	244,170.00	0.21
132	002240	盛新锂能	5,400	242,082.00	0.21
133	688187	时代电气	3,484	239,211.44	0.21
134	603296	华勤技术	3,220	239,149.40	0.21
135	300976	达瑞电子	2,996	238,631.40	0.21
136	600549	厦门钨业	2,800	238,560.00	0.21
137	300136	信维通信	2,000	238,500.00	0.21
138	002273	水晶光电	6,700	237,716.00	0.21
139	603268	松发股份	1,700	236,776.00	0.21
140	002001	新和成	8,300	235,886.00	0.20
141	603687	大胜达	11,500	233,335.00	0.20
142	688001	华兴源创	2,690	230,533.00	0.20
143	688012	中微公司	492	230,502.00	0.20
144	688521	芯原股份	621	230,477.94	0.20
145	300835	龙磁科技	1,000	229,490.00	0.20
146	300620	光库科技	600	226,920.00	0.20
147	688333	铂力特	2,215	226,816.00	0.20
148	688003	天准科技	1,761	224,175.30	0.19
149	688785	恒运昌	459	222,169.77	0.19
150	688398	赛特新材	8,571	222,074.61	0.19

151	603260	合盛硅业	4,600	221,996.00	0.19
152	688306	均普智能	21,789	220,068.90	0.19
153	002738	中矿资源	3,710	218,852.90	0.19
154	601077	渝农商行	35,800	218,738.00	0.19
155	300304	云意电气	12,200	217,770.00	0.19
156	03808	中国重汽	6,500	217,580.46	0.19
157	300857	协创数据	640	217,536.00	0.19
158	01258	中国有色矿业	22,000	214,966.13	0.19
159	002812	恩捷股份	3,200	214,112.00	0.19
160	603871	嘉友国际	20,914	213,531.94	0.19
161	301196	唯科科技	1,700	213,214.00	0.19
162	688127	蓝特光学	2,182	212,963.20	0.18
163	688772	珠海冠宇	10,824	212,475.12	0.18
164	688307	中润光学	2,648	211,707.60	0.18
165	688361	中科飞测	488	209,840.00	0.18
166	300227	光韵达	17,600	209,440.00	0.18
167	000960	锡业股份	4,900	209,181.00	0.18
168	002648	卫星化学	8,900	209,061.00	0.18
169	600968	海油发展	61,800	205,794.00	0.18
170	688150	莱特光电	2,979	204,418.98	0.18
171	601100	恒立液压	1,900	204,364.00	0.18
172	603766	隆鑫通用	17,000	202,810.00	0.18
173	600066	宇通客车	7,500	201,075.00	0.17
174	688141	杰华特	1,303	200,010.50	0.17
175	600153	建发股份	25,100	199,043.00	0.17
176	002415	海康威视	5,800	198,360.00	0.17
177	301291	明阳电气	5,500	197,945.00	0.17
178	001696	宗申动力	9,500	197,695.00	0.17
179	600760	中航沈飞	4,800	197,280.00	0.17
180	000977	浪潮信息	2,800	196,000.00	0.17
181	002008	大族激光	1,300	195,143.00	0.17
182	688469	芯联集成	18,264	193,781.04	0.17
183	603308	应流股份	3,200	193,280.00	0.17
184	300677	英科医疗	4,900	191,933.00	0.17
185	000657	中钨高新	2,000	191,440.00	0.17
186	688411	海博思创	655	190,736.00	0.17
187	688676	金盘科技	2,239	189,508.96	0.16
188	002438	江苏神通	12,600	188,118.00	0.16
189	600276	恒瑞医药	3,500	182,140.00	0.16
190	688630	芯碁微装	330	181,298.70	0.16
191	688090	瑞松科技	1,698	180,752.10	0.16
192	301307	美利信	2,400	180,696.00	0.16

193	300435	中泰股份	6,600	178,662.00	0.16
194	688401	路维光电	1,836	176,219.28	0.15
195	688603	天承科技	846	175,925.70	0.15
196	301603	乔锋智能	1,200	172,560.00	0.15
197	00586	海螺创业	18,000	170,096.83	0.15
198	688233	神工股份	793	170,035.06	0.15
199	688601	力芯微	2,789	168,873.95	0.15
200	601111	中国国航	27,600	166,980.00	0.15
201	001389	广合科技	700	166,075.00	0.14
202	688020	方邦股份	661	164,985.60	0.14
203	688222	成都先导	5,124	164,531.64	0.14
204	688131	皓元医药	1,731	163,752.60	0.14
205	688456	有研粉材	1,164	162,494.40	0.14
206	688147	微导纳米	1,000	161,880.00	0.14
207	603087	甘李药业	2,800	158,928.00	0.14
208	300373	扬杰科技	1,000	157,230.00	0.14
209	301285	鸿日达	1,400	154,462.00	0.13
210	600186	莲花控股	11,000	154,000.00	0.13
211	002533	金杯电工	14,400	153,648.00	0.13
212	300487	蓝晓科技	2,600	153,010.00	0.13
213	603931	格林达	2,500	148,500.00	0.13
214	688257	新锐股份	1,450	147,755.00	0.13
215	600029	南方航空	28,500	147,630.00	0.13
216	301362	民爆光电	800	147,136.00	0.13
217	605507	国邦医药	9,940	147,112.00	0.13
218	002444	巨星科技	4,700	146,170.00	0.13
219	688249	晶合集成	2,460	145,213.80	0.13
220	601601	中国太保	5,000	142,600.00	0.12
221	605060	联德股份	2,500	141,850.00	0.12
222	688375	国博电子	1,343	140,074.90	0.12
223	688380	中微半导	2,094	138,015.54	0.12
224	688300	联瑞新材	560	136,864.00	0.12
225	688172	燕东微	1,621	135,612.86	0.12
226	03800	协鑫科技	226,000	135,441.69	0.12
227	300820	英杰电气	1,500	135,345.00	0.12
228	603950	长源东谷	1,600	135,088.00	0.12
229	002428	云南锗业	1,100	132,198.00	0.11
230	688503	聚和材料	986	130,842.20	0.11
231	300661	圣邦股份	900	129,132.00	0.11
232	920045	衡东光	200	126,022.00	0.11
233	603618	杭电股份	2,500	124,700.00	0.11
234	300570	太辰光	500	123,355.00	0.11
235	002311	海大集团	2,700	120,447.00	0.10

236	603309	维力医疗	10,700	120,054.00	0.10
237	300475	香农芯创	400	120,000.00	0.10
238	002870	香山股份	3,100	119,474.00	0.10
239	600392	盛和资源	4,000	119,080.00	0.10
240	688368	晶丰明源	534	115,621.68	0.10
241	301626	苏州天脉	300	115,188.00	0.10
242	688551	科威尔	1,621	113,907.67	0.10
243	601088	中国神华	2,900	113,216.00	0.10
244	601117	中国化学	15,400	113,190.00	0.10
245	300751	迈为股份	400	112,984.00	0.10
246	000688	国城矿业	3,300	112,959.00	0.10
247	002324	普利特	9,200	111,044.00	0.10
248	688316	青云科技	2,038	110,052.00	0.10
249	688485	九州一轨	1,713	109,734.78	0.10
250	688376	美埃科技	940	109,322.00	0.09
251	300316	晶盛机电	1,800	108,720.00	0.09
252	688519	南亚新材	286	108,691.44	0.09
253	300881	盛德鑫泰	2,900	108,605.00	0.09
254	301232	飞沃科技	700	107,765.00	0.09
255	00856	伟仕佳杰	14,000	107,370.15	0.09
256	301183	东田微	400	105,948.00	0.09
257	002258	利尔化学	8,300	105,493.00	0.09
258	688800	瑞可达	1,099	105,471.03	0.09
259	603993	洛阳钼业	6,000	105,300.00	0.09
260	00148	建滔集团	1,000	102,402.05	0.09
261	600259	中稀有色	1,000	101,610.00	0.09
262	688301	奕瑞科技	816	101,184.00	0.09
263	301123	奕东电子	800	96,576.00	0.08
264	300033	同花顺	400	96,400.00	0.08
265	688387	信科移动	4,841	96,045.44	0.08
266	002733	雄韬股份	3,100	96,038.00	0.08
267	002491	通鼎互联	2,900	93,960.00	0.08
268	603678	火炬电子	1,100	91,300.00	0.08
269	002135	东南网架	13,400	90,986.00	0.08
270	688598	金博股份	1,785	88,268.25	0.08
271	600993	马应龙	4,000	86,480.00	0.08
272	002068	黑猫股份	5,600	84,168.00	0.07
273	688700	东威科技	923	82,516.20	0.07
274	01415	高伟电子	4,000	81,504.73	0.07
275	000888	峨眉山 A	9,100	81,354.00	0.07
276	300816	艾可蓝	1,100	80,520.00	0.07
277	688677	海泰新光	793	80,196.09	0.07
278	603822	ST 嘉澳	1,200	79,020.00	0.07

279	600765	中航重机	5,900	76,228.00	0.07
280	000582	北部湾港	7,100	76,183.00	0.07
281	000962	东方钨业	800	72,480.00	0.06
282	09987	百胜中国	250	69,397.15	0.06
283	601857	中国石油	7,900	68,572.00	0.06
284	600808	马钢股份	27,200	68,000.00	0.06
285	300684	中石科技	1,100	67,100.00	0.06
286	002534	西子洁能	3,600	66,780.00	0.06
287	002536	飞龙股份	1,400	66,052.00	0.06
288	688199	久日新材	1,707	58,942.71	0.05
289	301538	骏鼎达	1,120	56,414.40	0.05
290	301031	中熔电气	444	53,035.80	0.05
291	301080	百普赛斯	1,100	52,800.00	0.05
292	600732	爱旭股份	3,600	49,860.00	0.04
293	688377	迪威尔	2,113	49,824.54	0.04
294	02788	创新实业	4,000	47,735.51	0.04
295	601155	新城控股	4,500	46,170.00	0.04
296	002993	奥海科技	600	42,966.00	0.04
297	688508	芯朋微	401	37,276.96	0.03
298	600301	华锡有色	600	36,792.00	0.03
299	002832	比音勒芬	1,600	33,024.00	0.03
300	603416	信捷电气	600	31,722.00	0.03
301	03690	美团-W	490	29,152.88	0.03
302	002539	云图控股	2,400	27,168.00	0.02
303	688388	嘉元科技	561	24,684.00	0.02
304	688518	联赢激光	779	24,071.10	0.02
305	688279	峰岬科技	93	20,872.92	0.02
306	688371	菲沃泰	423	16,492.77	0.01
307	301035	润丰股份	320	14,848.00	0.01
308	300767	震安科技	300	6,687.00	0.01
309	600562	国睿科技	300	6,366.00	0.01
310	002824	和胜股份	141	4,875.78	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	992,856.00	0.87
2	603324	盛剑科技	824,769.00	0.72
3	688256	寒武纪	806,623.06	0.71

4	300136	信维通信	801,504.00	0.70
5	688275	万润新能	746,936.53	0.65
6	688362	甬矽电子	744,143.57	0.65
7	301086	鸿富瀚	741,311.00	0.65
8	688545	兴福电子	667,096.33	0.58
9	000977	浪潮信息	651,790.00	0.57
10	688596	正帆科技	645,696.22	0.57
11	001979	招商蛇口	621,361.00	0.54
12	603986	兆易创新	569,724.00	0.50
13	688008	澜起科技	552,013.14	0.48
14	688981	中芯国际	549,022.50	0.48
15	600379	宝光股份	548,234.00	0.48
16	300568	星源材质	537,839.00	0.47
17	300857	协创数据	537,576.00	0.47
18	688627	精智达	532,587.69	0.47
19	300223	北京君正	529,297.00	0.46
20	688720	艾森股份	526,668.99	0.46

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600487	亨通光电	1,702,089.00	1.49
2	300750	宁德时代	1,594,638.00	1.40
3	002353	杰瑞股份	1,581,940.00	1.39
4	002532	天山铝业	1,579,793.00	1.38
5	00941	中国移动	1,380,184.90	1.21
6	000893	亚钾国际	1,217,763.00	1.07
7	01378	中国宏桥	1,198,829.00	1.05
8	002602	世纪华通	1,118,397.00	0.98
9	000425	徐工机械	1,102,056.00	0.96
10	000807	云铝股份	1,074,882.00	0.94
11	002027	分众传媒	1,025,248.00	0.90
12	688275	万润新能	904,727.95	0.79
13	601877	正泰电器	865,506.00	0.76
14	688545	兴福电子	824,007.61	0.72
15	600989	宝丰能源	799,207.00	0.70
16	300274	阳光电源	798,855.00	0.70
17	600183	生益科技	794,612.00	0.70
18	600873	梅花生物	782,464.00	0.69

19	600741	华域汽车	759,868.00	0.67
20	601077	渝农商行	750,936.00	0.66

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	78,120,347.73
卖出股票收入（成交）总额	109,801,881.78

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,829,822.14	2.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	645,047.94	0.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,474,870.08	3.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	19,000	1,923,988.41	1.67
2	019827	26 国债 01	9,000	905,833.73	0.79
3	123255	鼎龙转债	338	188,718.55	0.16
4	118024	冠宇转债	1,200	155,894.30	0.14
5	110099	福能转债	620	87,063.13	0.08

7.7 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。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，以达到降低投资组合整体风险的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，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、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	51,183.90
2	应收清算款	543,829.32
3	应收股利	77,686.65
4	应收利息	-
5	应收申购款	151,616.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	824,316.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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	123255	鼎龙转债	188,718.55	0.16
2	118024	冠宇转债	155,894.30	0.14
3	110099	福能转债	87,063.13	0.08
4	123250	嘉益转债	26,820.98	0.02
5	118053	正帆转债	19,603.98	0.02
6	111022	锡振转债	10,542.10	0.01
7	123257	安克转债	9,548.70	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 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
南方鑫悦 15 个月持有混合 A	962	66,492.49	-	-	63,965,776.19	100.00%
南方鑫悦 15 个月持	156	30,402.48	-	-	4,742,786.15	100.00%

有混合 C						
合计	1,118	61,456.67	-	-	68,708,562.34	100.00%

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 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	99.95%

盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

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	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	988.85	0.0015%
	南方鑫悦 15 个月持有混合 C	2.58	0.0001%
	合计	991.43	0.0014%

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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	南方鑫悦 15 个月持有混合 C
基金合同生效日(2022 年 9 月 14 日)基金份额总额	957,594,119.38	26,243,165.32
本报告期期初基金份额总额	81,415,379.77	3,973,696.39
本报告期基金总申购份额	7,247,547.23	1,318,218.10
减：本报告期基金总赎回份额	24,697,150.81	549,128.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	63,965,776.19	4,742,786.15

§ 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。

2026 年 4 月，朱群力同志不再担任南京银行股份有限公司资产托管部总经理职务，由王艳同志接任南京银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

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。

本基金本报告期内，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

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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	
中信证券	2	129,060,932.37	68.68%	55,749.28	68.87%	-
中泰证券	2	56,979,447.76	30.32%	24,519.87	30.29%	-
华泰证券	1	1,873,358.72	1.00%	683.82	0.84%	-

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
中信证券	1,600,798.00	34.41%	-	-	-	-
中泰证券	3,051,549.97	65.59%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	关于南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金 2026 年 4 月 3 日、4 月 7 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
2	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
3	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
4	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
5	关于南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-06
7	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§ 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鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 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、《南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金 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>