

南方改革机遇灵活配置混合型证券投资 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§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.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 盈利投资者数量占比.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	56
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方改革机遇灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	南方改革机遇灵活配置混合
基金主代码	001181
交易代码	001181
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 19 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	204,775,019.01 份
基金合同存续期	不定期

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，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	周易	谷澍

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

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	45,070,823.19
本期利润	116,388,443.49
加权平均基金份额本期利润	0.6199
本期加权平均净值利润率	25.87%
本期基金份额净值增长率	28.87%
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	303,321,998.77
期末可供分配基金份额利润	1.4812
期末基金资产净值	572,059,539.62
期末基金份额净值	2.794
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	179.40%

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。

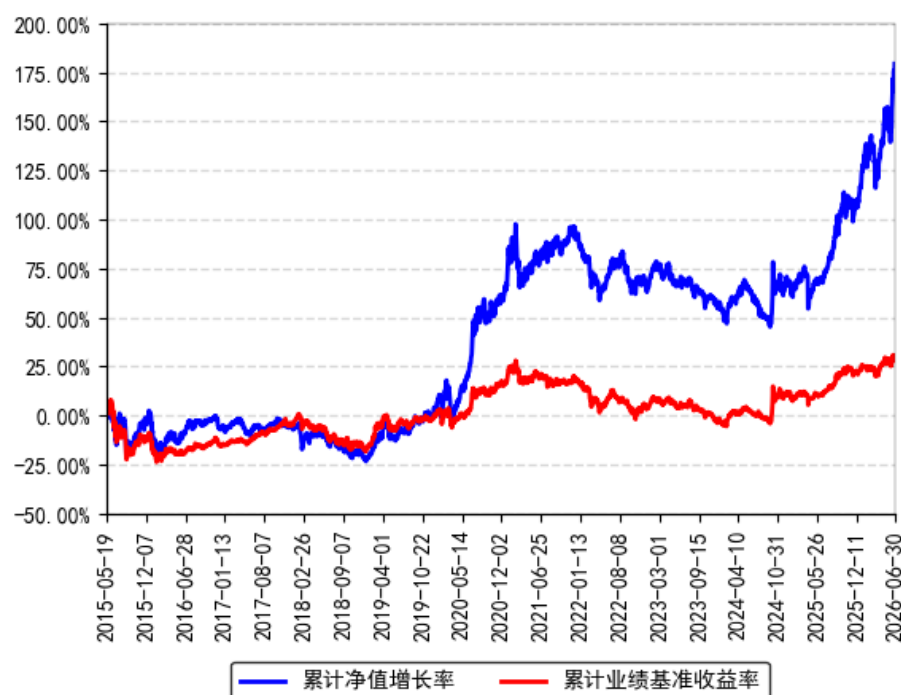
3.2 基金净值表现

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

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	26.48%	1.51%	7.52%	0.76%	18.96%	0.75%
过去六个月	28.87%	1.39%	5.33%	0.68%	23.54%	0.71%
过去一年	62.16%	1.19%	16.06%	0.61%	46.10%	0.58%
过去三年	65.72%	1.07%	23.88%	0.66%	41.84%	0.41%
过去五年	51.35%	0.98%	7.24%	0.67%	44.11%	0.31%
过去七年	204.36%	1.08%	34.54%	0.70%	169.82%	0.38%
过去十年	202.71%	1.03%	58.61%	0.69%	144.10%	0.34%
自基金合同 生效起至今	179.40%	1.14%	29.70%	0.80%	149.70%	0.34%

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

南方改革机遇灵活配置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	2019 年 1	-	17 年	中国国籍，女，清华大学会计学硕士，

	基金经 理	月 25 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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 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，本基金份额净值为 2.794 元，报告期内，份额净值增长率为 28.87%，同期业绩基准增长率为 5.33%。

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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在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》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、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：南方改革机遇灵活配置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	95,156,401.37	83,151,661.78
结算备付金		-	-
存出保证金		2.16	2.16
交易性金融资产	6.4.7.2	477,156,654.94	282,975,993.61
其中：股票投资		475,781,319.69	281,526,911.85
基金投资		-	-
债券投资		1,375,335.25	1,449,081.76
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,198,134.36	1,518,350.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		573,511,192.83	367,646,007.83
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		-	-
应付赎回款		769,706.69	4,100,412.63
应付管理人报酬		505,779.84	357,284.14
应付托管费		84,296.63	59,547.38
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6.72	17.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	91,863.33	173,347.32
负债合计		1,451,653.21	4,690,609.18
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	204,775,019.01	167,405,222.46
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	367,284,520.61	195,550,176.19
净资产合计		572,059,539.62	362,955,398.65
负债和净资产总计		573,511,192.83	367,646,007.83

注 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.794 元，基金份额总额 204,775,019.01 份。

6.2 利润表

会计主体：南方改革机遇灵活配置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		119,601,409.93	11,174,649.89

1.利息收入		56,414.61	31,075.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	56,414.61	30,180.20
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		-	895.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		47,842,275.15	12,429,983.51
其中：股票投资收益	6.4.7.10	45,043,512.63	9,365,117.33
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	142,053.20	3,033.14
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	2,656,709.32	3,061,833.04
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	71,317,620.30	-1,306,761.44
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	385,099.87	20,351.98
减：二、营业总支出		3,212,966.44	1,973,731.43
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,666,777.22	1,593,704.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	444,462.89	265,617.40
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		8.10	8.75
8.其他费用	6.4.7.19	101,718.23	114,401.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		116,388,443.49	9,200,918.46
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		116,388,443.49	9,200,918.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		116,388,443.49	9,200,918.46

6.3 净资产变动表

会计主体：南方改革机遇灵活配置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	167,405,222.46	-	195,550,176.19	362,955,398.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	167,405,222.46	-	195,550,176.19	362,955,398.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	37,369,796.55	-	171,734,344.42	209,104,140.97
（一）、综合收益总额	-	-	116,388,443.49	116,388,443.49
（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）	37,369,796.55	-	55,345,900.93	92,715,697.48
其中：1.基金申购款	96,481,096.34	-	136,200,503.20	232,681,599.54
2.基金赎回款	-59,111,299.79	-	-80,854,602.27	-139,965,902.06
（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	204,775,019.01	-	367,284,520.61	572,059,539.62
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	155,446,564.86	-	103,599,504.68	259,046,069.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	155,446,564.86	-	103,599,504.68	259,046,069.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,723,102.44	-	11,484,806.10	15,207,908.54
(一)、综合收益总额	-	-	9,200,918.46	9,200,918.46
(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）	3,723,102.44	-	2,283,887.64	6,006,990.08
其中：1.基金申购款	17,493,487.94	-	11,869,841.12	29,363,329.06
2.基金赎回款	-13,770,385.50	-	-9,585,953.48	-23,356,338.98
(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	159,169,667.30	-	115,084,310.78	274,253,978.08
---------------	----------------	---	----------------	----------------

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

南方改革机遇灵活配置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[2015]440 号《关于准予南方改革机遇灵活配置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(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《南方改革机遇灵活配置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 3,372,182,313.70 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(2015)第 510 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方改革机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,373,919,162.72 份，其中认购资金利息折合 1,736,849.02 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方改革机遇灵活配置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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证)、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、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、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)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本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 0-95%。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)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的 5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货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%+上证国债指数收益率×40%。

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[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[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。

(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。

(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	25,119,693.64
等于：本金	25,117,782.42
加：应计利息	1,911.22
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	70,036,707.73
等于：本金	70,035,460.61
加：应计利息	1,247.12
减：坏账准备	-
合计	95,156,401.37

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		349,869,536.46	-	475,781,319.69	125,911,783.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	828,100.00	1,988.31	1,375,335.25	545,246.94
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	828,100.00	1,988.31	1,375,335.25	545,246.94
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		350,697,636.46	1,988.31	477,156,654.94	126,457,030.17

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	1,470.90
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	90,130.98
其他	261.45
合计	91,863.33

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

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	167,405,222.46	167,405,222.46
本期申购	96,481,096.34	96,481,096.34
本期赎回（以“-”号填列）	-59,111,299.79	-59,111,299.79
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	204,775,019.01	204,775,019.01

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	208,055,919.27	-12,505,743.08	195,550,176.19
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	208,055,919.27	-12,505,743.08	195,550,176.19
本期利润	45,070,823.19	71,317,620.30	116,388,443.49

本期基金份额交易产生的变动数	50,195,256.31	5,150,644.62	55,345,900.93
其中：基金申购款	130,019,712.48	6,180,790.72	136,200,503.20
基金赎回款	-79,824,456.17	-1,030,146.10	-80,854,602.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	303,321,998.77	63,962,521.84	367,284,520.61

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	16,329.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	36,714.92
结算备付金利息收入	-
其他	3,370.36
合计	56,414.61

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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	45,043,512.63
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	45,043,512.63

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	390,608,482.63
减：卖出股票成本总额	344,948,223.54
减：交易费用	616,746.46
买卖股票差价收入	45,043,512.63

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	3,088.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	138,964.88
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	142,053.20

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	645,985.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	503,800.00
减：应计利息总额	3,195.14
减：交易费用	25.86
买卖债券差价收入	138,964.88

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	2,656,709.32
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	2,656,709.32

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	71,317,620.30
——股票投资	71,204,402.99
——债券投资	113,217.31
——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	71,317,620.30

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	377,884.17
基金转换费收入	7,215.70
合计	385,099.87

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	18,600.00
银行费用	2,278.69
其他	8.56
合计	101,718.23

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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
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	856,360,126.15	100.00%	231,266,364.65	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	645,985.88	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回	成交金额	占当期债券回

		购成交总额的 比例		购成交总额的 比例
华泰证券	-	-	10,000,000.00	100.00%

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 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	365,799.37	100.00%	-	-
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	99,170.13	100.00%	-	-

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	2,666,777.22	1,593,704.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	826,641.26	540,025.71
应支付基金管理人的净管理费	1,840,135.96	1,053,678.55

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	444,462.89	265,617.40

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

无。

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
中国农业银行- 银行存款	25,119,693.64	16,329.33	3,168,213.07	9,639.57
华泰证券-券商 保证金	70,036,707.73	36,714.92	54,637,789.75	19,593.21

注：1. 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。

2. 本基金的券商保证金为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

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	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84
华泰联合	118068	迪威转债	配债	190	19,000.00

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	1,368	36,252.00

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：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定期	114.28	676.94	1,280	146,278.40	866,483.20	-

688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁 定期	104.6 6	768.8 9	932	97,543.12	716,605.48	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	46.08	463.3 3	654	30,136.32	303,017.82	-
001248	华润新能 源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	10.11	10.11	16,366	165,460.26	165,460.26	-
001248	华润新能 源	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	10.11	10.11	7,014	70,911.54	70,911.54	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	81.88	1,584 .33	112	9,170.56	177,444.96	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股锁 定期	22.68	42.16	4,005	90,833.40	168,850.80	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	44.56	468.6 7	188	8,377.28	88,109.96	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.68	141.4 9	608	11,965.44	86,025.92	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	9.47	70.14	1,104	10,454.88	77,434.56	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	10.12	27.73	2,537	25,674.44	70,351.01	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	92.18	463.1 5	90	8,296.20	41,683.50	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	26.28	172.0 9	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	40.98	308.1 9	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月	6 个月	新股锁 定期	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

		24 日								
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	17.70	84.32	288	5,097.60	24,284.16	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	27.19	31.31	451	12,262.69	14,120.81	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	58.00	112.1 6	117	6,786.00	13,122.72	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	30.38	38.99	317	9,630.46	12,359.83	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	78.38	121.7 7	96	7,524.48	11,689.92	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	53.26	58.74	186	9,906.36	10,925.64	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	55.95	57.10	149	8,336.55	8,507.90	-

601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	11.18	17.59	351	3,924.18	6,174.09	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	21.88	25.52	111	2,428.68	2,832.72	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代 码	证券名称	成功认 购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位： 张）	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月 内 （含）	新债未 上市	100.0 0	100.0 0	650	65,000.00	65,001.99	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内 （含）	新债未 上市	100.0 0	100.0 0	160	16,000.00	16,000.28	-

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	879.5 3	2026 年 7 月 13 日	890.99	3,284	561,378.10	2,888,376.52	-

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，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综合持仓集中度指标、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 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	95,156,401.37	-	-	-	95,156,401.37
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	2.16	-	-	-	2.16
交易性金融资产	-	696,885.69	678,449.56	475,781,319.69	477,156,654.94
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	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	53,897.99	-	-	1,144,236.37	1,198,134.36
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	95,210,301.52	696,885.69	678,449.56	476,925,556.06	573,511,192.83
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	769,706.69	769,706.69
应付管理人报酬	-	-	-	505,779.84	505,779.84
应付托管费	-	-	-	84,296.63	84,296.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6.72	6.72
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	91,863.33	91,863.33
负债总计	-	-	-	1,451,653.21	1,451,653.21
利率敏感度缺口	95,210,301.52	696,885.69	678,449.56	475,473,902.85	572,059,539.62
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	83,151,661.78	-	-	-	83,151,661.78
结算备付金	-	-	-	-	-

存出保证金	2.16	-	-	-	2.16
交易性金融资产	-	973,176.14	475,905.62	281,526,911.85	282,975,993.61
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	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	20.00	-	-	1,518,330.28	1,518,350.28
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	83,151,683.94	973,176.14	475,905.62	283,045,242.13	367,646,007.83
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,100,412.63	4,100,412.63
应付管理人报酬	-	-	-	357,284.14	357,284.14
应付托管费	-	-	-	59,547.38	59,547.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	17.71	17.71
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	173,347.32	173,347.32
负债总计	-	-	-	4,690,609.18	4,690,609.18

利率敏感度 缺口	83,151,683.9 4	973,176.14	475,905.62	278,354,632. 95	362,955,398. 65
-------------	-------------------	------------	------------	--------------------	--------------------

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	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

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-	475,781,319.69	83.17	281,526,911.85	77.57

股票投资				
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,375,335.25	0.24	1,449,081.76	0.40
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	477,156,654.94	83.41	282,975,993.61	77.96

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%	34,689,026.05	17,202,622.51
	2.沪深 300 下降 5%	-34,689,026.05	-17,202,622.51

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	470,961,376.72
第二层次	3,205,750.59
第三层次	2,989,527.63
合计	477,156,654.94

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	475,781,319.69	82.96
	其中：股票	475,781,319.69	82.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,375,335.25	0.24
	其中：债券	1,375,335.25	0.24
	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	95,156,401.37	16.59
8	其他各项资产	1,198,136.52	0.21
9	合计	573,511,192.83	100.00

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	5,708,448.82	1.00
C	制造业	418,959,546.55	73.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,451,910.80	0.60
E	建筑业	323,400.00	0.06
F	批发和零售业	1,770,000.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	3,163,691.86	0.55
H	住宿和餐饮业	160,111.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,928,352.03	2.96
J	金融业	13,388,834.30	2.34
K	房地产业	524,286.00	0.09
L	租赁和商务服务业	2,403,815.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	5,891,611.65	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	3,107,311.68	0.54
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	475,781,319.69	83.17

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	69,100	10,537,750.00	1.84
2	300750	宁德时代	22,000	8,646,220.00	1.51
3	300308	中际旭创	6,400	8,128,000.00	1.42
4	300567	精测电子	25,500	8,098,800.00	1.42
5	300604	长川科技	20,000	6,828,400.00	1.19
6	600183	生益科技	37,200	6,450,480.00	1.13
7	688256	寒武纪	3,904	6,229,027.20	1.09
8	300502	新易盛	9,356	5,679,092.00	0.99
9	688409	富创精密	16,480	5,047,000.00	0.88
10	600549	厦门钨业	58,300	4,967,160.00	0.87
11	688362	甬矽电子	48,170	4,643,588.00	0.81
12	300684	中石科技	75,900	4,629,900.00	0.81

13	688596	正帆科技	57,588	4,552,907.28	0.80
14	600176	中国巨石	62,470	4,552,813.60	0.80
15	600487	亨通光电	40,500	4,428,270.00	0.77
16	688627	精智达	5,804	4,149,860.00	0.73
17	002409	雅克科技	18,200	4,085,900.00	0.71
18	301086	鸿富瀚	19,380	4,055,846.40	0.71
19	300037	新宙邦	42,800	3,973,980.00	0.69
20	300408	三环集团	23,300	3,888,770.00	0.68
21	002008	大族激光	25,600	3,842,816.00	0.67
22	603324	盛剑科技	73,400	3,762,484.00	0.66
23	002491	通鼎互联	112,000	3,628,800.00	0.63
24	603986	兆易创新	4,300	3,504,500.00	0.61
25	002484	江海股份	32,800	3,444,000.00	0.60
26	002371	北方华创	3,880	3,432,092.80	0.60
27	300223	北京君正	13,500	3,360,150.00	0.59
28	603259	药明康德	25,800	3,212,358.00	0.56
29	688368	晶丰明源	14,738	3,191,071.76	0.56
30	688037	芯源微	7,212	3,166,428.60	0.55
31	688720	艾森股份	31,174	3,148,574.00	0.55
32	603950	长源东谷	36,900	3,115,467.00	0.54
33	300666	江丰电子	8,000	2,948,800.00	0.52
34	601318	中国平安	61,500	2,936,010.00	0.51
35	688347	华虹宏力	8,721	2,932,872.30	0.51
36	688072	拓荆科技	3,284	2,888,376.52	0.50
37	688668	鼎通科技	7,725	2,883,742.50	0.50
38	688981	中芯国际	18,125	2,878,612.50	0.50
39	002138	顺络电子	39,200	2,865,520.00	0.50
40	600379	宝光股份	183,800	2,769,866.00	0.48
41	002916	深南电路	6,000	2,747,400.00	0.48
42	605358	立昂微	35,280	2,737,728.00	0.48
43	300054	鼎龙股份	25,300	2,681,041.00	0.47
44	300274	阳光电源	16,446	2,615,242.92	0.46
45	600522	中天科技	42,600	2,584,968.00	0.45
46	002475	立讯精密	35,900	2,527,360.00	0.44
47	002142	宁波银行	83,370	2,475,255.30	0.43
48	603078	江化微	48,500	2,396,870.00	0.42
49	002384	东山精密	9,100	2,387,385.00	0.42
50	301611	珂玛科技	12,900	2,322,903.00	0.41
51	002318	久立特材	97,150	2,321,885.00	0.41
52	688200	华峰测控	4,326	2,271,582.60	0.40
53	688386	泛亚微透	24,925	2,239,262.00	0.39
54	000811	冰轮环境	39,500	2,220,690.00	0.39
55	688630	芯碁微装	3,952	2,171,189.28	0.38

56	688548	广钢气体	41,180	2,145,478.00	0.38
57	002645	华宏科技	76,760	2,111,667.60	0.37
58	688652	京仪装备	10,174	2,036,529.58	0.36
59	688012	中微公司	4,284	2,007,054.00	0.35
60	300751	迈为股份	7,100	2,005,466.00	0.35
61	300260	新莱应材	19,774	1,986,496.04	0.35
62	300088	长信科技	170,188	1,974,180.80	0.35
63	002463	沪电股份	12,800	1,955,840.00	0.34
64	688110	东芯股份	9,382	1,911,113.40	0.33
65	000100	TCL 科技	326,414	1,899,729.48	0.33
66	601138	工业富联	26,100	1,883,115.00	0.33
67	688605	先锋精科	17,186	1,787,687.72	0.31
68	688396	华润微	18,206	1,775,995.30	0.31
69	002831	裕同科技	49,908	1,774,728.48	0.31
70	300475	香农芯创	5,900	1,770,000.00	0.31
71	300820	英杰电气	19,600	1,768,508.00	0.31
72	688002	睿创微纳	11,393	1,762,383.17	0.31
73	002850	科达利	9,300	1,760,490.00	0.31
74	688808	联讯仪器	793	1,758,951.69	0.31
75	000725	京东方 A	202,300	1,755,964.00	0.31
76	688025	杰普特	3,697	1,737,590.00	0.30
77	688383	新益昌	9,239	1,737,301.56	0.30
78	688307	中润光学	21,530	1,721,323.50	0.30
79	601077	渝农商行	280,100	1,711,411.00	0.30
80	300679	电连技术	28,400	1,703,716.00	0.30
81	600516	方大炭素	274,200	1,691,814.00	0.30
82	002821	凯莱英	10,400	1,684,800.00	0.29
83	603606	东方电缆	40,080	1,663,720.80	0.29
84	688478	晶升股份	18,750	1,660,312.50	0.29
85	600030	中信证券	57,700	1,657,721.00	0.29
86	000657	中钨高新	17,300	1,655,956.00	0.29
87	301571	国科天成	25,300	1,649,054.00	0.29
88	002422	科伦药业	42,700	1,644,804.00	0.29
89	600563	法拉电子	8,600	1,640,880.00	0.29
90	600233	圆通速递	103,800	1,634,850.00	0.29
91	688052	纳芯微	5,661	1,632,122.91	0.29
92	688498	源杰科技	863	1,627,618.00	0.28
93	301251	威尔高	30,440	1,621,843.20	0.28
94	002245	蔚蓝锂芯	84,692	1,584,587.32	0.28
95	601601	中国太保	55,200	1,574,304.00	0.28
96	603228	景旺电子	21,600	1,564,056.00	0.27
97	300227	光韵达	130,000	1,547,000.00	0.27
98	600309	万华化学	22,600	1,546,066.00	0.27

99	688187	时代电气	22,243	1,527,204.38	0.27
100	600353	旭光电子	33,300	1,518,480.00	0.27
101	002937	兴瑞科技	34,200	1,502,406.00	0.26
102	300568	星源材质	80,200	1,501,344.00	0.26
103	000415	渤海租赁	368,500	1,499,795.00	0.26
104	002947	恒铭达	19,700	1,498,185.00	0.26
105	688082	盛美上海	3,457	1,493,424.00	0.26
106	603823	百合花	26,600	1,451,562.00	0.25
107	688531	日联科技	8,117	1,443,527.28	0.25
108	300702	天宇股份	70,700	1,425,312.00	0.25
109	688048	长光华芯	2,804	1,407,608.00	0.25
110	600323	瀚蓝环境	51,000	1,400,460.00	0.24
111	688008	澜起科技	4,517	1,399,818.30	0.24
112	300483	首华燃气	79,500	1,397,610.00	0.24
113	688249	晶合集成	23,401	1,381,361.03	0.24
114	000977	浪潮信息	19,400	1,358,000.00	0.24
115	600105	永鼎股份	20,100	1,356,348.00	0.24
116	688392	骄成超声	5,902	1,340,816.36	0.23
117	688361	中科飞测	3,082	1,325,260.00	0.23
118	000425	徐工机械	162,800	1,317,052.00	0.23
119	301196	唯科科技	10,420	1,306,876.40	0.23
120	002001	新和成	45,700	1,298,794.00	0.23
121	600452	涪陵电力	138,800	1,295,004.00	0.23
122	600150	中国船舶	37,700	1,273,883.00	0.22
123	605507	国邦医药	85,960	1,272,208.00	0.22
124	688516	奥特维	22,083	1,267,343.37	0.22
125	300661	圣邦股份	8,800	1,262,624.00	0.22
126	000301	东方盛虹	109,500	1,253,775.00	0.22
127	688308	欧科亿	6,789	1,234,308.09	0.22
128	300731	科创新源	21,000	1,225,560.00	0.21
129	300083	创世纪	87,100	1,186,302.00	0.21
130	603650	彤程新材	12,000	1,175,760.00	0.21
131	301070	开勒股份	13,300	1,170,400.00	0.20
132	300136	信维通信	9,800	1,168,650.00	0.20
133	603893	瑞芯微	6,200	1,167,832.00	0.20
134	688112	鼎阳科技	15,885	1,166,912.10	0.20
135	603687	大胜达	56,700	1,150,443.00	0.20
136	600482	中国动力	34,958	1,146,622.40	0.20
137	688333	铂力特	11,153	1,142,067.20	0.20
138	688127	蓝特光学	11,587	1,130,891.20	0.20
139	002281	光迅科技	4,400	1,130,536.00	0.20
140	000960	锡业股份	26,400	1,127,016.00	0.20
141	300757	罗博特科	1,800	1,114,200.00	0.19

142	688485	九州一轨	17,328	1,110,031.68	0.19
143	002240	盛新锂能	24,700	1,107,301.00	0.19
144	688521	芯原股份	2,977	1,104,883.78	0.19
145	300976	达瑞电子	13,860	1,103,949.00	0.19
146	603268	松发股份	7,900	1,100,312.00	0.19
147	300394	天孚通信	3,620	1,095,701.60	0.19
148	603766	隆鑫通用	91,500	1,091,595.00	0.19
149	603260	合盛硅业	22,500	1,085,850.00	0.19
150	301362	民爆光电	5,900	1,085,128.00	0.19
151	688385	复旦微电	15,204	1,083,893.16	0.19
152	300835	龙磁科技	4,700	1,078,603.00	0.19
153	002273	水晶光电	30,100	1,067,948.00	0.19
154	600499	科达制造	77,200	1,065,360.00	0.19
155	601628	中国人寿	30,100	1,064,035.00	0.19
156	301183	东田微	4,000	1,059,480.00	0.19
157	688306	均普智能	104,859	1,059,075.90	0.19
158	688772	珠海冠宇	53,941	1,058,861.83	0.19
159	688120	华海清科	3,280	1,056,750.40	0.18
160	688003	天准科技	8,272	1,053,025.60	0.18
161	300304	云意电气	58,600	1,046,010.00	0.18
162	605090	九丰能源	28,000	1,040,760.00	0.18
163	603296	华勤技术	14,000	1,039,780.00	0.18
164	688785	恒运昌	2,126	1,027,168.58	0.18
165	603520	司太立	92,500	1,021,200.00	0.18
166	300316	晶盛机电	16,700	1,008,680.00	0.18
167	002258	利尔化学	78,800	1,001,548.00	0.18
168	002203	海亮股份	43,700	998,545.00	0.17
169	605111	新洁能	10,000	991,400.00	0.17
170	603269	海鸥股份	59,920	986,882.40	0.17
171	002812	恩捷股份	14,700	983,577.00	0.17
172	300548	长芯博创	3,500	973,000.00	0.17
173	002648	卫星化学	40,800	958,392.00	0.17
174	300990	同飞股份	9,100	956,137.00	0.17
175	001696	宗申动力	45,600	948,936.00	0.17
176	002938	鹏鼎控股	9,000	948,420.00	0.17
177	603993	洛阳钼业	53,900	945,945.00	0.17
178	603067	振华股份	20,400	944,316.00	0.17
179	001389	广合科技	3,900	925,275.00	0.16
180	600153	建发股份	114,000	904,020.00	0.16
181	688545	兴福电子	6,789	903,344.34	0.16
182	688188	柏楚电子	8,386	894,786.20	0.16
183	688469	芯联集成	83,876	889,924.36	0.16
184	301021	英诺激光	7,300	889,870.00	0.16

185	688401	路维光电	9,258	888,582.84	0.16
186	601702	华峰铝业	62,600	882,660.00	0.15
187	300435	中泰股份	32,500	879,775.00	0.15
188	300286	安科瑞	36,200	874,230.00	0.15
189	688603	天承科技	4,200	873,390.00	0.15
190	603290	斯达半导	5,700	871,758.00	0.15
191	688387	信科移动	43,730	867,603.20	0.15
192	603031	安孚科技	16,280	866,910.00	0.15
193	688795	摩尔线程	1,280	866,483.20	0.15
194	301307	美利信	11,500	865,835.00	0.15
195	603308	应流股份	14,300	863,720.00	0.15
196	300825	阿尔特	59,900	855,372.00	0.15
197	000893	亚钾国际	20,900	854,601.00	0.15
198	688536	思瑞浦	2,341	852,334.69	0.15
199	688019	安集科技	2,500	848,650.00	0.15
200	301603	乔锋智能	5,900	848,420.00	0.15
201	600346	恒力石化	47,600	842,996.00	0.15
202	688233	神工股份	3,929	842,456.18	0.15
203	300620	光库科技	2,200	832,040.00	0.15
204	688222	成都先导	25,655	823,782.05	0.14
205	300857	协创数据	2,420	822,558.00	0.14
206	000688	国城矿业	23,800	814,674.00	0.14
207	605376	博迁新材	3,000	813,900.00	0.14
208	688601	力芯微	13,397	811,188.35	0.14
209	301291	明阳电气	22,328	803,584.72	0.14
210	688147	微导纳米	4,907	794,345.16	0.14
211	601233	桐昆股份	36,200	783,730.00	0.14
212	300677	英科医疗	19,900	779,483.00	0.14
213	688150	莱特光电	11,284	774,308.08	0.14
214	603225	新凤鸣	39,400	774,210.00	0.14
215	688676	金盘科技	9,084	768,869.76	0.13
216	688503	聚和材料	5,792	768,598.40	0.13
217	301205	联特科技	2,300	768,430.00	0.13
218	600186	莲花控股	54,200	758,800.00	0.13
219	688411	海博思创	2,592	754,790.40	0.13
220	688300	联瑞新材	3,028	740,043.20	0.13
221	300487	蓝晓科技	12,400	729,740.00	0.13
222	688456	有研粉材	5,169	721,592.40	0.13
223	688802	沐曦股份	932	716,605.48	0.13
224	002595	豪迈科技	15,370	716,242.00	0.13
225	688131	皓元医药	7,426	702,499.60	0.12
226	688206	概伦电子	15,517	688,489.29	0.12
227	603931	格林达	11,500	683,100.00	0.12

228	605305	中际联合	16,200	679,104.00	0.12
229	601187	厦门银行	99,100	676,853.00	0.12
230	600060	海信视像	24,200	674,454.00	0.12
231	688257	新锐股份	6,617	674,272.30	0.12
232	002438	江苏神通	45,122	673,671.46	0.12
233	600893	航发动力	17,400	667,116.00	0.12
234	688099	晶晨股份	6,463	665,042.70	0.12
235	601012	隆基绿能	49,700	652,064.00	0.11
236	688020	方邦股份	2,589	646,214.40	0.11
237	300570	太辰光	2,600	641,446.00	0.11
238	688700	东威科技	7,021	627,677.40	0.11
239	600507	方大特钢	154,400	625,320.00	0.11
240	688001	华兴源创	7,241	620,553.70	0.11
241	688380	中微半导	9,393	619,092.63	0.11
242	002428	云南锗业	5,100	612,918.00	0.11
243	000333	美的集团	8,100	611,793.00	0.11
244	688301	奕瑞科技	4,869	603,756.00	0.11
245	600968	海油发展	180,600	601,398.00	0.11
246	688388	嘉元科技	13,425	590,700.00	0.10
247	301626	苏州天脉	1,500	575,940.00	0.10
248	603915	国茂股份	40,100	569,019.00	0.10
249	300488	恒锋工具	12,100	566,643.00	0.10
250	603618	杭电股份	11,300	563,644.00	0.10
251	300617	安靠智电	10,600	561,694.00	0.10
252	600392	盛和资源	18,700	556,699.00	0.10
253	600066	宇通客车	20,700	554,967.00	0.10
254	002870	香山股份	14,100	543,414.00	0.09
255	603871	嘉友国际	52,940	540,517.40	0.09
256	688375	国博电子	5,165	538,709.50	0.09
257	000338	潍柴动力	19,700	536,825.00	0.09
258	920045	衡东光	851	536,223.61	0.09
259	603822	ST 嘉澳	8,100	533,385.00	0.09
260	300767	震安科技	23,800	530,502.00	0.09
261	601155	新城控股	51,100	524,286.00	0.09
262	300699	光威复材	18,200	521,430.00	0.09
263	600458	时代新材	31,200	516,360.00	0.09
264	605060	联德股份	9,100	516,334.00	0.09
265	688519	南亚新材	1,355	514,954.20	0.09
266	301232	飞沃科技	3,340	514,193.00	0.09
267	688800	瑞可达	5,314	509,984.58	0.09
268	301123	奕东电子	4,200	507,024.00	0.09
269	688551	科威尔	7,112	499,760.24	0.09
270	603309	维力医疗	43,700	490,314.00	0.09

271	002738	中矿资源	8,300	489,617.00	0.09
272	688316	青云科技	9,059	489,186.00	0.09
273	600259	中稀有色	4,800	487,728.00	0.09
274	300373	扬杰科技	3,100	487,413.00	0.09
275	300033	同花顺	2,000	482,000.00	0.08
276	688100	威胜信息	15,651	478,764.09	0.08
277	301035	润丰股份	10,210	473,744.00	0.08
278	688376	美埃科技	4,002	465,432.60	0.08
279	601100	恒立液压	4,300	462,508.00	0.08
280	920186	中科仪	4,011	460,462.80	0.08
281	002533	金杯电工	42,200	450,274.00	0.08
282	688090	瑞松科技	4,211	448,260.95	0.08
283	002311	海大集团	9,900	441,639.00	0.08
284	600901	江苏金租	74,300	427,225.00	0.07
285	688141	杰华特	2,775	425,962.50	0.07
286	688598	金博股份	8,566	423,588.70	0.07
287	600732	爱旭股份	30,400	421,040.00	0.07
288	603678	火炬电子	5,000	415,000.00	0.07
289	601111	中国国航	68,500	414,425.00	0.07
290	688172	燕东微	4,866	407,089.56	0.07
291	002068	黑猫股份	26,700	401,301.00	0.07
292	000962	东方钨业	4,300	389,580.00	0.07
293	601211	国泰海通	21,100	384,020.00	0.07
294	002733	雄韬股份	12,100	374,858.00	0.07
295	301538	骏鼎达	7,420	373,745.40	0.07
296	300816	艾可蓝	5,100	373,320.00	0.07
297	002444	巨星科技	12,000	373,200.00	0.07
298	601899	紫金矿业	14,800	372,072.00	0.07
299	300881	盛德鑫泰	9,900	370,755.00	0.06
300	600029	南方航空	70,300	364,154.00	0.06
301	600276	恒瑞医药	6,800	353,872.00	0.06
302	600521	华海药业	23,800	342,720.00	0.06
303	002135	东南网架	49,900	338,821.00	0.06
304	601857	中国石油	38,900	337,652.00	0.06
305	300409	道氏技术	16,900	336,817.00	0.06
306	002028	思源电气	1,900	328,700.00	0.06
307	601088	中国神华	8,300	324,032.00	0.06
308	600988	赤峰黄金	12,300	323,736.00	0.06
309	601117	中国化学	44,000	323,400.00	0.06
310	688508	芯朋微	3,441	319,875.36	0.06
311	002179	中航光电	6,900	318,780.00	0.06
312	600298	安琪酵母	8,600	311,320.00	0.05
313	301536	星宸科技	2,400	308,904.00	0.05

314	600765	中航重机	23,700	306,204.00	0.05
315	301666	大普微	654	303,017.82	0.05
316	301080	百普赛斯	6,200	297,600.00	0.05
317	002380	科远智慧	8,600	293,948.00	0.05
318	600862	中航高科	16,000	288,480.00	0.05
319	688282	理工导航	4,880	284,016.00	0.05
320	600808	马钢股份	109,900	274,750.00	0.05
321	603087	甘李药业	4,800	272,448.00	0.05
322	002536	飞龙股份	5,600	264,208.00	0.05
323	600993	马应龙	12,100	261,602.00	0.05
324	002324	普利特	21,600	260,712.00	0.05
325	301261	恒工精密	3,300	257,730.00	0.05
326	601636	旗滨集团	24,200	247,566.00	0.04
327	600760	中航沈飞	6,000	246,600.00	0.04
328	300179	四方达	4,000	237,720.00	0.04
329	001248	华润新能源	23,380	236,371.80	0.04
330	300446	航天智造	13,900	233,937.00	0.04
331	000888	峨眉山 A	25,000	223,500.00	0.04
332	603416	信捷电气	4,200	222,054.00	0.04
333	688143	长盈通	1,245	218,970.60	0.04
334	688075	安旭生物	7,201	214,301.76	0.04
335	000582	北部湾港	19,400	208,162.00	0.04
336	002534	西子洁能	10,900	202,195.00	0.04
337	002415	海康威视	5,900	201,780.00	0.04
338	000408	藏格矿业	2,900	201,028.00	0.04
339	688781	视涯科技	4,005	168,850.80	0.03
340	002993	奥海科技	2,300	164,703.00	0.03
341	600754	锦江酒店	8,900	160,111.00	0.03
342	688677	海泰新光	1,528	154,526.64	0.03
343	688279	峰岬科技	631	141,621.64	0.02
344	301031	中熔电气	1,184	141,428.80	0.02
345	002832	比音勒芬	6,100	125,904.00	0.02
346	603298	杭叉集团	5,200	124,072.00	0.02
347	688199	久日新材	3,347	115,571.91	0.02
348	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.02
349	688203	海正生材	10,731	107,095.38	0.02
350	002539	云图控股	8,200	92,824.00	0.02
351	688518	联赢激光	2,857	88,281.30	0.02
352	688797	臻宝科技	188	88,109.96	0.02
353	688820	盛合晶微	608	86,025.92	0.02
354	688818	电科蓝天	1,104	77,434.56	0.01
355	688377	迪威尔	3,258	76,823.64	0.01
356	001399	惠科股份	2,537	70,351.01	0.01

357	000063	中兴通讯	1,900	68,761.00	0.01
358	600301	华锡有色	1,100	67,452.00	0.01
359	301285	鸿日达	600	66,198.00	0.01
360	688809	强一股份	101	62,923.00	0.01
361	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
362	688371	菲沃泰	1,317	51,349.83	0.01
363	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
364	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
365	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
366	603459	红板科技	288	24,284.16	0.00
367	002824	和胜股份	596	20,609.68	0.00
368	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
369	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
370	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
371	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
372	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
373	600835	上海机电	700	14,420.00	0.00
374	001365	天海电子	451	14,120.81	0.00
375	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
376	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
377	001393	维通利	317	12,359.83	0.00
378	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
379	001237	惠康科技	186	10,925.64	0.00
380	600562	国睿科技	500	10,610.00	0.00
381	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
382	688816	易思维	149	8,507.90	0.00
383	001369	双欣材料	572	7,733.44	0.00
384	601112	振石股份	351	6,174.09	0.00
385	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
386	688765	禾元生物	88	4,488.00	0.00
387	603352	至信股份	111	2,832.72	0.00
388	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
389	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
390	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
391	920394	民士达	17	1,172.15	0.00
392	002209	达意隆	100	1,038.00	0.00

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	000977	浪潮信息	5,532,918.00	1.52
2	600549	厦门钨业	5,329,566.00	1.47
3	300684	中石科技	5,329,062.00	1.47
4	601318	中国平安	4,183,777.00	1.15
5	688256	寒武纪	3,736,614.26	1.03
6	000951	中国重汽	3,537,482.60	0.97
7	300308	中际旭创	3,501,066.00	0.96
8	300136	信维通信	3,378,580.93	0.93
9	688362	甬矽电子	3,317,346.52	0.91
10	002491	通鼎互联	3,056,883.00	0.84
11	603324	盛剑科技	3,041,198.00	0.84
12	301086	鸿富瀚	3,034,973.00	0.84
13	688275	万润新能	2,988,722.56	0.82
14	300476	胜宏科技	2,943,142.00	0.81
15	688652	京仪装备	2,921,358.33	0.80
16	000657	中钨高新	2,882,841.00	0.79
17	688596	正帆科技	2,878,506.26	0.79
18	688008	澜起科技	2,844,985.86	0.78
19	300223	北京君正	2,774,158.00	0.76
20	603950	长源东谷	2,751,780.00	0.76

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	000977	浪潮信息	4,882,940.00	1.35
2	688275	万润新能	3,559,509.94	0.98
3	002222	福晶科技	3,342,568.00	0.92
4	300476	胜宏科技	3,253,766.00	0.90
5	688545	兴福电子	3,090,884.68	0.85
6	000951	中国重汽	3,028,378.00	0.83
7	600989	宝丰能源	2,942,964.00	0.81
8	600176	中国巨石	2,922,712.00	0.81
9	688257	新锐股份	2,727,072.68	0.75
10	300136	信维通信	2,597,648.00	0.72
11	000893	亚钾国际	2,489,374.00	0.69
12	600028	中国石化	2,399,962.00	0.66
13	000933	神火股份	2,389,494.00	0.66
14	002379	宏桥控股	2,350,740.00	0.65
15	600353	旭光电子	2,289,410.00	0.63

16	000807	云铝股份	2,279,296.00	0.63
17	603688	石英股份	2,191,285.00	0.60
18	002353	杰瑞股份	2,165,954.00	0.60
19	603993	洛阳钼业	2,164,296.00	0.60
20	000657	中钨高新	2,151,505.00	0.59

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	467,998,228.39
卖出股票收入（成交）总额	390,608,482.63

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	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）	1,375,335.25	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,375,335.25	0.24

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	113062	常银转债	1,880	238,390.44	0.04
2	123255	鼎龙转债	347	193,743.60	0.03
3	123269	金杨转债	1,086	177,899.36	0.03
4	123270	盛德转债	734	166,253.31	0.03
5	110099	福能转债	830	116,552.26	0.02

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。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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	2.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,198,134.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,198,136.52

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	113062	常银转债	238,390.44	0.04
2	123255	鼎龙转债	193,743.60	0.03
3	110099	福能转债	116,552.26	0.02
4	113059	福莱转债	76,246.85	0.01
5	118024	冠宇转债	66,255.08	0.01
6	111022	锡振转债	45,180.42	0.01
7	123250	嘉益转债	44,978.55	0.01
8	118053	正帆转债	19,603.98	0.00
9	123257	安克转债	12,486.77	0.00
10	118059	顾中转债	10,261.01	0.00

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

持有人户数	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	持有份额	占总份

(户)			额比例		额比例
8,721	23,480.68	68,803,161.28	33.60%	135,971,857.73	66.40%

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	92.84%

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	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	820,348.25	0.4006%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 5 月 19 日)基金份额总额	3,373,919,162.72
本报告期初基金份额总额	167,405,222.46

本报告期基金总申购份额	96,481,096.34
减：本报告期基金总赎回份额	59,111,299.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	204,775,019.01

§ 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未发生重大人事变动。

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

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	
华泰证券	3	856,360,126.15	100.00%	365,799.37	100.00%	-

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
华泰证券	645,985.88	100.00%	-	-	-	-

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	2026-03-21
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	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证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-11
4	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
5	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
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	2026-06-19
8	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改革机遇灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方改革机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《南方改革机遇灵活配置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、《南方改革机遇灵活配置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>