

南方利达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：北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。

基金托管人北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.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
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.....	13
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
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.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 盈利投资者数量占比.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方利达灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	南方利达灵活配置混合	
基金主代码	001566	
交易代码	001566	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 8 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	71,716,089.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方利达灵活配置混合 A	南方利达灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001566	001567
报告期末下属分级基金的份 额总额	49,029,492.35 份	22,686,597.37 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，通过专业化研究分析及投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，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	本基金的业绩比较基准为：人民币三年期定期存款利率（税后）+2%。人民币三年期定期存款利率以中国人民银行公布的金融机构人民币三年期存款基准利率为准。
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		北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	闫朝
	联系电话	0755-82763888	010-66223587
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yanzhao@bankofbeijing.com.cn

客户服务电话	400-889-8899	95526
传真	0755-82763889	010-89661115
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	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
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	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码	518017	100033
法定代表人	周易	关文杰

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、南方利达灵活配置混合 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	1,142,370.24
本期利润	-5,589,570.43
加权平均基金份额本期利润	-0.1284
本期加权平均净值利润率	-9.22%
本期基金份额净值增长率	-7.36%
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	7,591,830.52
期末可供分配基金份额利润	0.1548
期末基金资产净值	63,824,556.07
期末基金份额净值	1.3018

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	51.85%

2、南方利达灵活配置混合 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	536,928.46
本期利润	-2,337,613.40
加权平均基金份额本期利润	-0.1322
本期加权平均净值利润率	-9.57%
本期基金份额净值增长率	-7.40%
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	6,619,281.99
期末可供分配基金份额利润	0.2917
期末基金资产净值	29,305,879.36
期末基金份额净值	1.2918
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	34.21%

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；

本基金从 2015 年 7 月 8 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2015 年 11 月 12 日起存续。

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

南方利达灵活配置混合 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	-7.09%	0.69%	1.18%	0.01%	-8.27%	0.68%
过去六个月	-7.36%	0.63%	1.97%	0.02%	-9.33%	0.61%
过去一年	-4.50%	0.46%	3.60%	0.02%	-8.10%	0.44%
过去三年	-1.83%	0.39%	10.66%	0.01%	-12.49%	0.38%
过去五年	-0.04%	0.35%	18.75%	0.02%	-18.79%	0.33%
过去七年	26.97%	0.34%	28.15%	0.01%	-1.18%	0.33%
过去十年	47.71%	0.30%	45.41%	0.01%	2.30%	0.29%

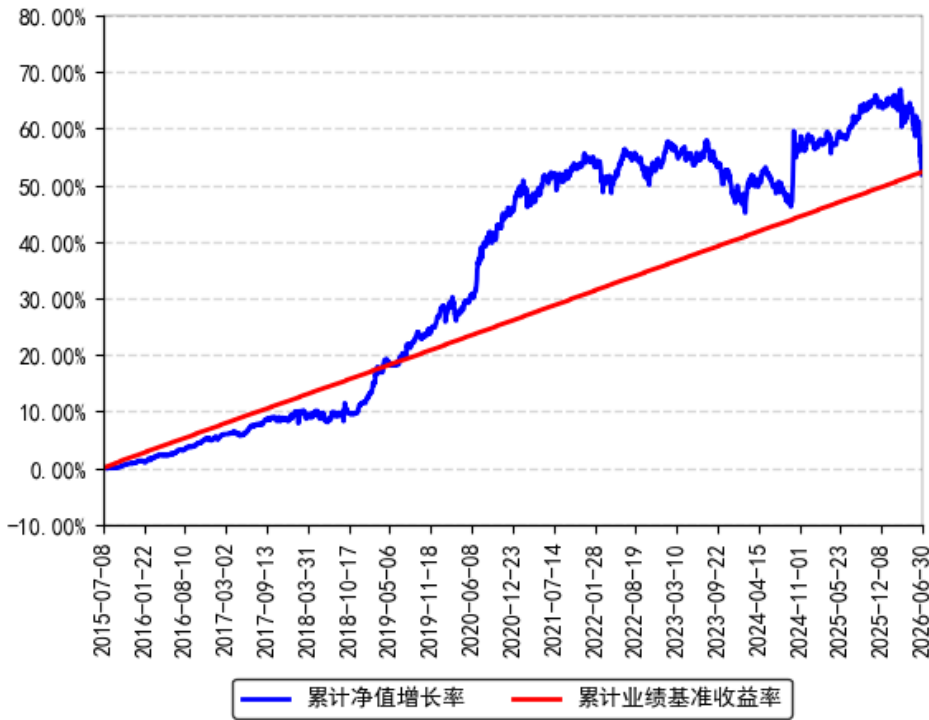
自基金合同生效起至今	51.85%	0.29%	52.31%	0.01%	-0.46%	0.28%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

南方利达灵活配置混合 C

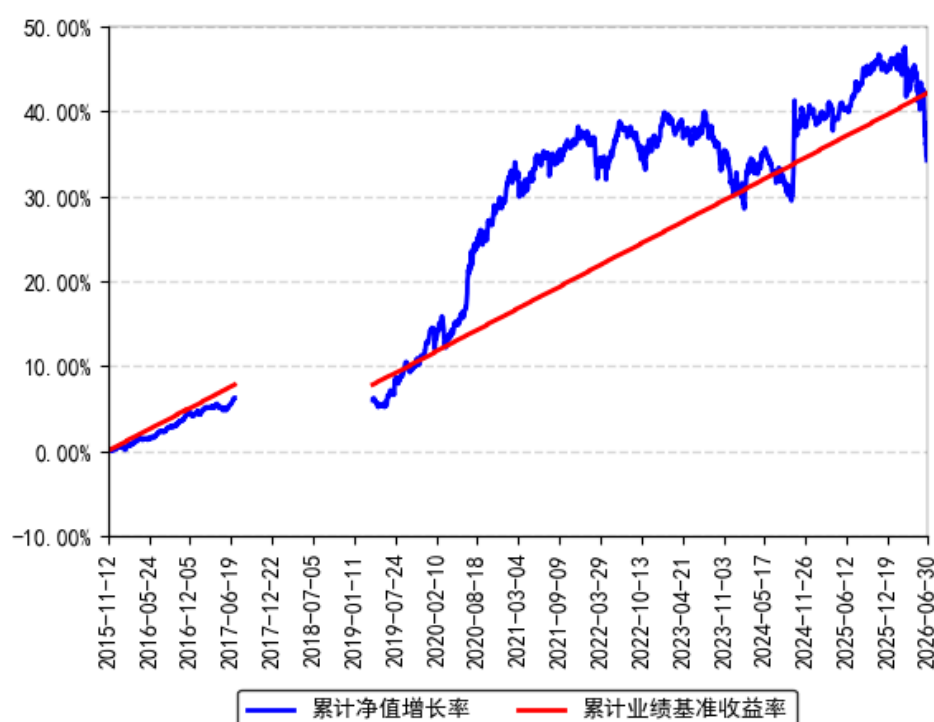
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-7.12%	0.69%	1.18%	0.01%	-8.30%	0.68%
过去六个月	-7.40%	0.63%	2.02%	0.02%	-9.42%	0.61%
过去一年	-4.59%	0.46%	3.78%	0.02%	-8.37%	0.44%
过去三年	-2.14%	0.39%	11.41%	0.01%	-13.55%	0.38%
过去五年	-0.58%	0.35%	20.26%	0.02%	-20.84%	0.33%
过去七年	26.03%	0.34%	30.67%	0.01%	-4.64%	0.33%
过去十年	31.73%	0.31%	37.98%	0.01%	-6.25%	0.30%
自基金合同生效起至今	34.21%	0.30%	42.11%	0.01%	-7.90%	0.29%

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

南方利达灵活配置混合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



南方利达灵活配置混合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



注：本基金从 2015 年 7 月 8 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2015 年 11 月 12 日起存续。
本基金 C 级份额相关数据和指标按投资者实际持有份额的期间计算。

§ 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	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		(助理) 期限		从业 年限	
		任职日期	离任日期		
吴剑毅	本基金 基金经 理	2015 年 7 月 8 日	-	16 年	中国国籍，清华大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009 年 7 月加入南方基金，任南方基金研究部金融行业研究员；2012 年 3 月 15 日至 2014 年 7 月 18 日，担任南方避险、南方保本基金经理助理；2015 年 11 月 26 日至 2017 年 12 月 2 日，任南方顺康保本基金经理；2014 年 7 月 18 日至 2018 年 1 月 16 日，任南方恒元基金经理；2015 年 9 月 11 日至 2018 年 11 月 28 日，任南方消费活力基金经理；2015 年 10 月 28 日至 2018 年 11 月 3 日，任南方顺达保本基金经理；2017 年 8 月 3 日至 2019 年 1 月 25 日，任南方金融混合基金经理；2017 年 12 月 2 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方顺康混合基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方安养混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至 2022 年 1 月 5 日，任南方新蓝筹混合基金经理；2016 年 12 月 14 日至 2024 年 6 月 28 日，任南方安颐混合基金经理；2024 年 2 月 6 日至 2025 年 9 月 26 日，任南方誉民稳健一年持有混合基金经理；2020 年 11 月 18 日至 2025 年 11 月 27 日，任南方誉鼎一年持有期混合基金经理；2017 年 11 月 2 日至 2025 年 12 月 17 日，任南方安福混合基金经理；2022 年 8 月 2 日至 2026 年 3 月 20 日，任南方宝祥混合基金经理；2018 年 11 月 3 日至 2026 年 6 月 29 日，任南方中小盘成长股票基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，任南方利众基金经理；2015 年 7 月 8 日至今，任南方利达基金经理；2015 年 11 月 19 日至今，任南方利安基金经理；2020 年 4 月 29 日至今，任南方誉慧一年混合基金经理。
姚万宁	本基金 基金经 理助理	2015 年 11 月 23 日	-	13 年	中国国籍，深圳大学金融学硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，担任投资部投资账户助理；2015 年 11 月 27 日至 2017 年 12 月 2 日，任南方顺康保本的基金经理助理；2015 年 11 月 23 日至 2018 年 1 月 16 日，任南方恒元的基金经理助理；2015 年 11 月 23 日

					至 2018 年 11 月 3 日，任南方顺达保本的基金经理助理；2017 年 12 月 2 日至 2021 年 5 月 14 日，任南方顺康混合的基金经理助理；2015 年 11 月 23 日至今，任南方利众、南方利达、南方利安基金经理助理；2016 年 12 月 23 日至今，任南方安颐混合基金经理助理；2018 年 1 月 16 日至今，任南方中证 100 基金经理助理；2018 年 11 月 3 日至今，任南方中小盘成长股票基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合同单日、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，并且交易占优比也没有明显异常，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

2026 年上半年，A 股市场经历了从防御避险到极致风格分化的剧烈切换。年初至春节前后，市场延续去年四季度的上涨惯性，情绪较为积极。2 月下旬，地缘政治风险急剧升温，市场随之明显回落，期间大盘价值风格占优。进入二季度，市场风格发生剧烈翻转——以科创板与创业板为代表的科技成长板块，在 AI 产业趋势火爆、流动性宽松等多重催化下吸引了巨量资金涌入。上半年科创 50 大幅上涨 64%，创业板指上涨 36%；而上证指数仅涨 3%。传统板块遭遇系统性资金抽离，形成了“一半是海水，一半是火焰”的极致分化。

本基金始终坚持“以优质企业的长期价值创造为核心收益来源”的投资理念，将股票视为一种特殊的债券——我们关注的不是短期价格波动，而是企业持续创造自由现金流并回报股东的能力。上半年操作层面，基于对权益资产相对价值的判断，我们显著提升了股票仓位。核心逻辑在于：即便在最保守的假设下，组合中大量优质公司的预期股息率仍达 4% 以上，而同期十年期国债收益率仅约 1.6%-1.9%。这种跨资产类别的收益率倒挂，为权益资产提供了较高的安全边际和性价比。持仓结构上，组合以金融、消费、制造等领域的优质公司为核心配置，重仓具备稳定商业模式和持续分红能力的龙头企业。上半年我们对组合进行了动态再平衡：在市场回调中增持了部分因情绪性抛售而估值更具吸引力的标的，同时减持了短期涨幅较大的个股。

然而必须反思的是：我们对“价值回归”的时间判断确实出现了偏差。一季度我们预期，随着原油价格大涨推动通胀预期、全球流动性边际收紧，市场风格将逐步回归到估值与现金流的基本面框架上来，高股息价值股将迎来重估。这一逻辑在长期维度上没有问题，但二季度的现实走势是——AI 产业趋势的强劲程度远超预期，几乎完全主导了市场资金的流向与关注度。传统价值板块尽管估值更低、股息率更高，却仍被市场系统性抛弃，我们的组合在本轮结构分化中承受了较大的净值回撤。值得欣慰的是，组合中不少公司在此期间已积极开启分红与回购，以实际行动维护股东价值，其内在价值并未发生实质性变化。

需要澄清的是，我们低配科技股，并非不看好 AI 的产业趋势。恰恰相反，我们充分认可人工智能对经济与社会效率的颠覆性潜力——这或许是这个时代最具确定性的技术浪潮之一。但投资的核心问题从来不是“赛道好不好”，而是“以什么价格、买哪家公司、能获得多少股东回报”。历史上，改变世界的技术并不等同于带来确定性回报的投资。20 世纪初，汽车彻底重塑了人类出行方式，但美国历史上先后出现过大量的汽车制造商，其中绝大多数早已消失。21 世纪初的互联网泡沫更是经典案例：互联网确实改变了世界，但在 2000 年高点买入的投资者，此后多年甚至难以回本，尽管他们当初对“互联网将改变一切”的判断完全正确。技术浪潮的本质特征，恰恰是早期参与者众多、最终收敛于极少数赢家——而这个收敛过程往往伴随着惨烈的资本毁灭。在我们能力圈的认知范围内，当前的估值水平下，AI 赛道中的多数公司所隐含的股东回报率，与我们持有的那些商业模式稳定、护城河清晰、每

年真金白银分红回购的优质公司相比，风险收益比并不占优。因此，在我们能够评估的概率和赔率框架下，我们更愿意将资金配置于那些确定性更高、能够穿越周期、持续以内在价值回报股东的企业。越是在狂热的市场氛围下，我们越是要冷静进行评估。如果市场停止交易，随着时间推移，我们能否从持仓的公司身上获得满意的回报？

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 1.3018 元，报告期内，份额净值增长率为-7.36%，同期业绩基准增长率为 1.97%；本基金 C 份额净值为 1.2918 元，报告期内，份额净值增长率为-7.40%，同期业绩基准增长率为 2.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们对权益资产维持积极态度。当前市场上被集体抛弃的所谓“老登资产”，其定价中实际上隐含了对中国经济极度悲观的预期——但我们认为，这种悲观缺乏扎实的根基。

首先，中国拥有十四亿人口的巨大内需市场，人均 GDP 仍在持续提升。相比人口减少和短期经济数据扰动的担心，更具决定性的长期变量是：亿万人民对美好生活的向往从未改变，消费升级、产业转型、技术进步的底层动力依然充沛。人口不仅是数量概念，更是质量概念——受过高等教育的庞大群体、日益成熟的企业家群体、不断完善的制度基础设施，这些才是决定经济长期走向的核心要素。

其次，房地产市场的调整正在接近一个关键拐点。当前主要城市的租金收益率已经超过十年期国债收益率——这一历史上并不多见的信号，意味着房价正在逐步具备考量估值的锚。房屋作为一种能够持续产生现金流（租金）的实物资产，当它的收益率超过无风险利率时，预示着房价已经具备企稳基础，这将为居民资产负债表修复、消费信心回升提供重要支撑。

基于此，我们相信中国经济长期仍将稳步向上，并最终带动那些被市场错误定价的优质公司迎来价值重估。短期的宏观噪音和悲观情绪无法掩盖一个基本事实：在当前的估值水平下，我们能够找到足够多“无需担心市场关门”的优质公司。无论市场如何变化，只要企业持续创造现金流并回馈股东，我们的长期回报就有坚实的底座。

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，本基金托管人在托管南方利达灵活配置混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《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有关规定，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，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议约定，对本基金的投资运作进行了监督，为本基金独立建账、独立核算、独立估值，按照托管协议约定的频率与管理人进行账务核对，本报告中利润分配情况真实、准确。

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，本基金托管人在能够知悉和掌握的信息范围内，按照国家法律法规规定、基金合同和托管协议约定，复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财

务会计报告中的“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”、“关联方报酬-应支付销售机构的客户维护费”、“关联方报酬-销售服务费”、“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告相关内容，复核内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方利达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	270,612.16	385,551.07
结算备付金		379,004.76	321,337.87
存出保证金		46,184.77	7,200.42
交易性金融资产	6.4.7.2	88,591,469.27	54,752,579.11
其中：股票投资		83,244,281.79	16,410,792.19
基金投资		-	-
债券投资		5,347,187.48	38,341,786.92
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	4,100,000.00	99,958.35
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		398,715.62	179,791.50
应收股利		-	-
应收申购款		16,307.25	8,276.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		93,802,293.83	55,754,695.24
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		-	1,699,592.77
应付清算款		264,840.85	-
应付赎回款		237,116.12	432,277.10
应付管理人报酬		64,645.00	36,783.80
应付托管费		16,161.27	9,195.96
应付销售服务费		2,555.27	2,022.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		302.60	868.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	86,237.29	114,183.57
负债合计		671,858.40	2,294,923.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	71,716,089.72	38,166,000.33
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	21,414,345.71	15,293,771.13
净资产合计		93,130,435.43	53,459,771.46
负债和净资产总计		93,802,293.83	55,754,695.24

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，南方利达灵活配置混合 A 份额净值 1.3018 元，基金份额总额 49,029,492.35 份；南方利达灵活配置混合 C 份额净值 1.2918 元，基金份额总额 22,686,597.37 份；总份额合计 71,716,089.72 份。

6.2 利润表

会计主体：南方利达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		-7,403,645.55	650,496.63
1.利息收入		15,587.43	10,842.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,618.91	2,298.38
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		8,968.52	8,543.69

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,184,764.62	1,144,378.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	982,923.57	104,687.57
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	143,870.60	678,023.28
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
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	1,057,970.45	361,667.72
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	-9,606,482.53	-506,291.17
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	2,484.93	1,567.16
减：二、营业总支出		523,538.28	441,378.81
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	338,816.68	241,335.79
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	84,704.20	60,333.95
3.销售服务费	6.4.10.2.3	12,112.50	12,323.72
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		18,013.67	28,139.25
其中：卖出回购金融资产 支出		18,013.67	28,139.25
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		382.06	861.42
8.其他费用	6.4.7.19	69,509.17	98,384.68
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-7,927,183.83	209,117.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-7,927,183.83	209,117.82
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-7,927,183.83	209,117.82

6.3 净资产变动表

会计主体：南方利达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	38,166,000.33	-	15,293,771.13	53,459,771.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	38,166,000.33	-	15,293,771.13	53,459,771.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	33,550,089.39	-	6,120,574.58	39,670,663.97
（一）、综合收益总额	-	-	-7,927,183.83	-7,927,183.83
（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）	33,550,089.39	-	14,047,758.41	47,597,847.80
其中：1.基金申购款	46,996,393.47	-	19,330,892.47	66,327,285.94
2.基金赎回款	-13,446,304.08	-	-5,283,134.06	-18,729,438.14
（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	71,716,089.72	-	21,414,345.71	93,130,435.43
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	50,709,194.63	-	17,895,909.98	68,605,104.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	50,709,194.63	-	17,895,909.98	68,605,104.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,172,401.50	-	-2,610,464.13	-10,782,865.63
（一）、综合收益总额	-	-	209,117.82	209,117.82
（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）	-8,172,401.50	-	-2,819,581.95	-10,991,983.45
其中：1.基金申购款	1,263,847.20	-	443,191.87	1,707,039.07
2.基金赎回款	-9,436,248.70	-	-3,262,773.82	-12,699,022.52
（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	42,536,793.13	-	15,285,445.85	57,822,238.98

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

南方利达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]1285号《关于准予南方利达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《南方利达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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,685,664,803.77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895号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方利达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年7月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,685,721,406.28份基金份额,其中认购资金利息折合56,602.51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,基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《南方利达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,并分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方利达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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、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(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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、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:人民币三年期定期存款利率(税后)+2%。

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、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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入

免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，对证券投资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）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《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[2016]127 号《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	270,612.16
等于：本金	270,577.82
加：应计利息	34.34
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	270,612.16

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	93,102,163.68	-	83,244,281.79	-9,857,881.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所	5,302,978.00	43,057.48	5,347,187.48	1,152.00

	市场				
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	5,302,978.00	43,057.48	5,347,187.48	1,152.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		98,405,141.68	43,057.48	88,591,469.27	-9,856,729.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,100,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,100,000.00	-

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	18.21
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	27,330.51
其中：交易所市场	27,330.51
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	58,888.57
合计	86,237.29

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方利达灵活配置混合 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	21,314,275.55	21,314,275.55
本期申购	35,598,086.89	35,598,086.89
本期赎回（以“-”号填列）	-7,882,870.09	-7,882,870.09
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	49,029,492.35	49,029,492.35

南方利达灵活配置混合 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	16,851,724.78	16,851,724.78
本期申购	11,398,306.58	11,398,306.58
本期赎回（以“-”号填列）	-5,563,433.99	-5,563,433.99
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	22,686,597.37	22,686,597.37

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

南方利达灵活配置混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,604,169.90	6,032,053.51	8,636,223.41
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,604,169.90	6,032,053.51	8,636,223.41
本期利润	1,142,370.24	-6,731,940.67	-5,589,570.43
本期基金份额交易产生的变动数	3,845,290.38	7,903,120.36	11,748,410.74
其中：基金申购款	4,913,487.98	9,993,180.75	14,906,668.73
基金赎回款	-1,068,197.60	-2,090,060.39	-3,158,257.99

本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,591,830.52	7,203,233.20	14,795,063.72

南方利达灵活配置混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,624,059.74	2,033,487.98	6,657,547.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,624,059.74	2,033,487.98	6,657,547.72
本期利润	536,928.46	-2,874,541.86	-2,337,613.40
本期基金份额交易产生的变动数	1,784,660.40	514,687.27	2,299,347.67
其中：基金申购款	3,413,244.53	1,010,979.21	4,424,223.74
基金赎回款	-1,628,584.13	-496,291.94	-2,124,876.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,945,648.60	-326,366.61	6,619,281.99

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	1,551.94
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	858.55
其他	4,208.42
合计	6,618.91

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	982,923.57
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	982,923.57

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	58,194,984.90

减：卖出股票成本总额	57,087,117.63
减：交易费用	124,943.70
买卖股票差价收入	982,923.57

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	186,437.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-42,566.62
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	143,870.60

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	39,277,338.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	38,970,989.59
减：应计利息总额	347,822.82
减：交易费用	1,092.50
买卖债券差价收入	-42,566.62

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	1,057,970.45
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	1,057,970.45

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	-9,606,482.53
——股票投资	-9,714,133.12
——债券投资	107,650.59
——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	-9,606,482.53

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	2,484.90
基金转换费收入	0.03
合计	2,484.93

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	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00

银行费用	1,155.29
其他	165.31
合计	69,509.17

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
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
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
北京银行股份有限公司("北京银行")	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	338,816.68	241,335.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	65,929.43	87,777.31
应支付基金管理人的净管理费	272,887.25	153,558.48

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%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×0.80%÷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	84,704.20	60,333.95

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		
	南方利达灵活配置混合 A	南方利达灵活配置混合 C	合计
	-	1,670.64	1,670.64
合计	-	1,670.64	1,670.64
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		
	南方利达灵活配置混	南方利达灵活配置混	合计

	合 A	合 C	
南方基金	-	139.45	139.45
合计	-	139.45	139.45

注：1. 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 0.50% 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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.50% ÷ 当年天数。

2. 根据《南方基金关于继续开展旗下部分基金销售服务费优惠的公告》，自 2018 年 12 月 1 日起，本基金 C 类基金份额的销售服务费适用 0.10% 的年费率。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

份额单位：份

关联方名称	南方利达灵活配置混合 C			
	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券股份有限公司-自营债衍	1,471,129.09	2.05%	-	-

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

北京银行	270,612.16	1,551.94	353,488.49	1,837.02
------	------------	----------	------------	----------

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	603293	埃泰克	网下申购	186	6,229.14

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	-	-	-	-	-

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
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定期	81.88	1,584.33	26	2,128.88	41,192.58	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期	19.68	141.49	140	2,755.20	19,808.60	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月	6 个月	新股锁定期	44.56	468.67	40	1,782.40	18,746.80	-

		16 日								
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	40.98	308.1 9	42	1,721.16	12,943.98	-
001248	华润新能 源	2026 年 6 月 25 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	6.41	24.13	316	2,025.56	7,625.08	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	17.70	84.32	66	1,168.20	5,565.12	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	13.86	73.46	66	914.76	4,848.36	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	15.76	46.71	46	724.96	2,148.66	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	33.49	33.93	19	636.31	644.67	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票基金。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,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本基金的基金管理人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	270,612.16	-	-	-	270,612.16
结算备付金	379,004.76	-	-	-	379,004.76
存出保证金	46,184.77	-	-	-	46,184.77
交易性金融资产	5,347,187.48	-	-	83,244,281.79	88,591,469.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	4,100,000.00	-	-	-	4,100,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	398,715.62	398,715.62
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	10.00	-	-	16,297.25	16,307.25
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,142,999.17	-	-	83,659,294.66	93,802,293.83
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	-	-	-	264,840.85	264,840.85
应付赎回款	-	-	-	237,116.12	237,116.12
应付管理人报酬	-	-	-	64,645.00	64,645.00
应付托管费	-	-	-	16,161.27	16,161.27
应付销售服务费	-	-	-	2,555.27	2,555.27
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	302.60	302.60
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	86,237.29	86,237.29
负债总计	-	-	-	671,858.40	671,858.40
利率敏感度缺口	10,142,999.17	-	-	82,987,436.26	93,130,435.43
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	385,551.07	-	-	-	385,551.07
结算备付金	321,337.87	-	-	-	321,337.87
存出保证金	7,200.42	-	-	-	7,200.42
交易性金融资产	16,849,826.37	21,491,960.55	-	16,410,792.19	54,752,579.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	99,958.35	-	-	-	99,958.35
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	179,791.50	179,791.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2.00	-	-	8,274.92	8,276.92

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,663,876.08	21,491,960.55	-	16,598,858.61	55,754,695.24
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	1,699,592.77	-	-	-	1,699,592.77
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	432,277.10	432,277.10
应付管理人报酬	-	-	-	36,783.80	36,783.80
应付托管费	-	-	-	9,195.96	9,195.96
应付销售服务费	-	-	-	2,022.38	2,022.38
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	868.20	868.20
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	114,183.57	114,183.57
负债总计	1,699,592.77	-	-	595,331.01	2,294,923.78
利率敏感度缺口	15,964,283.31	21,491,960.55	-	16,003,527.60	53,459,771.46

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	-5,220.99	-143,747.64
	2.市场利率平行下降 25 个基点	5,232.21	144,807.96

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-股票投资	83,244,281.79	89.38	16,410,792.19	30.70
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	83,244,281.79	89.38	16,410,792.19	30.70

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	上年度末（2025 年

		月 30 日)	12 月 31 日)
	1.沪深 300 上升 5%	1,327,930.46	565,390.56
	2.沪深 300 下降 5%	-1,327,930.46	-565,390.56

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	83,120,647.94
第二层次	5,357,297.48
第三层次	113,523.85
合计	88,591,469.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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	83,244,281.79	88.74
	其中：股票	83,244,281.79	88.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,347,187.48	5.70
	其中：债券	5,347,187.48	5.70
	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	4,100,000.00	4.37
	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	649,616.92	0.69
8	其他各项资产	461,207.64	0.49
9	合计	93,802,293.83	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	2,418,498.00	2.60
C	制造业	25,674,739.19	27.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,895,437.00	7.40
E	建筑业	3,183,118.00	3.42
F	批发和零售业	409,640.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	9,099,209.00	9.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,679,535.00	1.80
J	金融业	31,278,367.60	33.59
K	房地产业	533,376.00	0.57
L	租赁和商务服务业	890,076.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,182,286.00	1.27
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	83,244,281.79	89.38

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	601318	中国平安	51,500	2,458,610.00	2.64
2	600036	招商银行	67,800	2,406,900.00	2.58
3	601668	中国建筑	532,000	2,308,880.00	2.48
4	600886	国投电力	173,200	2,305,292.00	2.48
5	689009	九号公司	55,335	2,111,030.25	2.27
6	601766	中国中车	394,700	2,052,440.00	2.20
7	600690	海尔智家	98,600	2,012,426.00	2.16
8	000651	格力电器	50,400	1,890,000.00	2.03
9	601166	兴业银行	112,000	1,854,720.00	1.99
10	600941	中国移动	19,500	1,679,535.00	1.80
11	600015	华夏银行	231,700	1,480,563.00	1.59
12	688009	中国通号	300,055	1,428,261.80	1.53
13	688169	石头科技	14,993	1,423,885.21	1.53
14	600887	伊利股份	59,375	1,422,625.00	1.53
15	601211	国泰海通	77,700	1,414,140.00	1.52
16	601328	交通银行	216,700	1,393,381.00	1.50
17	600028	中国石化	310,300	1,383,938.00	1.49
18	000429	粤高速 A	100,100	1,366,365.00	1.47
19	600030	中信证券	44,250	1,271,302.50	1.37
20	002233	塔牌集团	175,100	1,220,447.00	1.31
21	601229	上海银行	136,900	1,188,292.00	1.28
22	601298	青岛港	147,100	1,184,155.00	1.27
23	601816	京沪高铁	252,600	1,144,278.00	1.23
24	600741	华域汽车	72,500	1,125,200.00	1.21
25	600016	民生银行	347,100	1,117,662.00	1.20
26	600000	浦发银行	126,000	1,084,860.00	1.16
27	601088	中国神华	26,500	1,034,560.00	1.11
28	600132	重庆啤酒	24,800	1,024,240.00	1.10
29	600585	海螺水泥	59,900	1,015,305.00	1.09
30	601985	中国核电	109,800	991,494.00	1.06
31	001965	招商公路	106,400	974,624.00	1.05
32	600377	宁沪高速	83,500	966,095.00	1.04

33	601825	沪农商行	128,800	964,712.00	1.04
34	688696	极米科技	14,817	956,289.18	1.03
35	002736	国信证券	95,700	956,043.00	1.03
36	601009	南京银行	92,700	916,803.00	0.98
37	002027	分众传媒	183,900	890,076.00	0.96
38	600820	隧道股份	167,800	874,238.00	0.94
39	002807	江阴银行	229,460	851,296.60	0.91
40	600098	广州发展	143,600	848,676.00	0.91
41	601939	建设银行	87,900	846,477.00	0.91
42	601006	大秦铁路	183,600	846,396.00	0.91
43	601128	常熟银行	144,100	838,662.00	0.90
44	000895	双汇发展	37,300	835,520.00	0.90
45	601818	光大银行	289,000	835,210.00	0.90
46	600519	贵州茅台	700	829,843.00	0.89
47	600352	浙江龙盛	66,000	799,260.00	0.86
48	000100	TCL 科技	132,800	772,896.00	0.83
49	601577	长沙银行	87,100	758,641.00	0.81
50	603323	苏农银行	192,550	745,168.50	0.80
51	601288	农业银行	122,700	744,789.00	0.80
52	688041	海光信息	1,923	712,086.90	0.76
53	600660	福耀玻璃	13,800	696,072.00	0.75
54	600461	洪城环境	74,800	677,688.00	0.73
55	601018	宁波港	213,300	671,895.00	0.72
56	601916	浙商银行	251,800	662,234.00	0.71
57	601988	中国银行	115,600	661,232.00	0.71
58	601077	渝农商行	108,100	660,491.00	0.71
59	600908	无锡银行	128,100	650,748.00	0.70
60	601330	绿色动力	92,800	646,816.00	0.69
61	002839	张家港行	165,100	643,890.00	0.69
62	601963	重庆银行	63,700	642,096.00	0.69
63	600901	江苏金租	95,900	551,425.00	0.59
64	002572	索菲亚	73,700	538,010.00	0.58
65	600323	瀚蓝环境	19,500	535,470.00	0.57
66	600332	白云山	26,700	535,068.00	0.57
67	600048	保利发展	115,200	533,376.00	0.57
68	000999	华润三九	23,300	524,017.00	0.56
69	600350	山东高速	47,000	523,110.00	0.56
70	001872	招商港口	25,000	485,750.00	0.52
71	000538	云南白药	10,100	478,437.00	0.51
72	000513	丽珠集团	16,400	473,796.00	0.51
73	600023	浙能电力	89,000	468,140.00	0.50
74	601998	中信银行	67,100	465,003.00	0.50
75	600803	新奥股份	29,200	461,360.00	0.50

76	601997	贵阳银行	89,200	457,596.00	0.49
77	002267	陕天然气	68,300	446,682.00	0.48
78	600018	上港集团	90,600	427,632.00	0.46
79	600061	国投资本	64,700	423,785.00	0.46
80	600674	川投能源	29,700	420,849.00	0.45
81	601607	上海医药	26,600	409,640.00	0.44
82	002966	苏州银行	54,500	379,320.00	0.41
83	600926	杭州银行	25,900	374,255.00	0.40
84	600482	中国动力	9,200	301,760.00	0.32
85	600919	江苏银行	27,900	300,762.00	0.32
86	601187	厦门银行	40,600	277,298.00	0.30
87	000598	兴蓉环境	41,300	265,146.00	0.28
88	600033	福建高速	81,200	261,464.00	0.28
89	000088	盐田港	60,500	247,445.00	0.27
90	000338	潍柴动力	7,100	193,475.00	0.21
91	000333	美的集团	2,500	188,825.00	0.20
92	688808	联讯仪器	26	41,192.58	0.04
93	688820	盛合晶微	140	19,808.60	0.02
94	688797	臻宝科技	40	18,746.80	0.02
95	688635	长进光子	42	12,943.98	0.01
96	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.01
97	688811	有研复材	316	7,625.08	0.01
98	603459	红板科技	66	5,565.12	0.01
99	603407	长裕集团	66	4,848.36	0.01
100	603435	嘉德利	46	2,148.66	0.00
101	603293	埃泰克	19	644.67	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	601766	中国中车	3,442,846.00	6.44
2	600886	国投电力	3,400,237.00	6.36
3	689009	九号公司	3,335,712.49	6.24
4	600036	招商银行	3,289,660.00	6.15
5	601318	中国平安	3,234,865.00	6.05
6	601668	中国建筑	2,894,537.00	5.41
7	601288	农业银行	2,879,569.00	5.39
8	600941	中国移动	2,835,296.00	5.30
9	600000	浦发银行	2,661,525.00	4.98
10	601988	中国银行	2,564,677.00	4.80

11	688169	石头科技	2,435,936.02	4.56
12	600690	海尔智家	2,409,014.00	4.51
13	601985	中国核电	2,155,108.00	4.03
14	601166	兴业银行	2,127,921.27	3.98
15	601000	唐山港	1,973,398.00	3.69
16	601328	交通银行	1,966,838.00	3.68
17	688696	极米科技	1,934,623.05	3.62
18	601939	建设银行	1,910,526.00	3.57
19	688009	中国通号	1,859,530.88	3.48
20	600028	中国石化	1,831,442.00	3.43
21	600015	华夏银行	1,804,755.00	3.38
22	001965	招商公路	1,790,187.00	3.35
23	600887	伊利股份	1,781,312.00	3.33
24	002233	塔牌集团	1,770,159.00	3.31
25	601963	重庆银行	1,768,330.00	3.31
26	601816	京沪高铁	1,760,645.00	3.29
27	600273	嘉化能源	1,751,002.00	3.28
28	600352	浙江龙盛	1,721,658.00	3.22
29	601211	国泰海通	1,695,143.00	3.17
30	600350	山东高速	1,681,035.00	3.14
31	601088	中国神华	1,675,631.00	3.13
32	601825	沪农商行	1,649,062.00	3.08
33	000651	格力电器	1,612,281.00	3.02
34	000429	粤高速 A	1,571,690.00	2.94
35	600030	中信证券	1,503,291.00	2.81
36	601298	青岛港	1,426,264.00	2.67
37	603195	公牛集团	1,409,813.00	2.64
38	601229	上海银行	1,339,106.00	2.50
39	600598	北大荒	1,336,615.00	2.50
40	600098	广州发展	1,324,466.00	2.48
41	600016	民生银行	1,323,447.00	2.48
42	600741	华域汽车	1,303,501.00	2.44
43	600660	福耀玻璃	1,299,222.00	2.43
44	002736	国信证券	1,235,694.00	2.31
45	601077	渝农商行	1,204,453.00	2.25
46	601006	大秦铁路	1,201,916.00	2.25
47	301109	军信股份	1,199,631.00	2.24
48	600642	申能股份	1,170,803.00	2.19
49	600585	海螺水泥	1,155,527.00	2.16
50	601009	南京银行	1,151,256.00	2.15
51	600132	重庆啤酒	1,137,808.00	2.13

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	601288	农业银行	2,114,771.00	3.96
2	601988	中国银行	2,043,858.00	3.82
3	601000	唐山港	1,997,672.00	3.74
4	603195	公牛集团	1,802,071.55	3.37
5	600886	国投电力	1,696,437.00	3.17
6	600941	中国移动	1,691,845.00	3.16
7	600000	浦发银行	1,406,079.00	2.63
8	600350	山东高速	1,309,957.00	2.45
9	601985	中国核电	1,286,667.00	2.41
10	600642	申能股份	1,254,188.00	2.35
11	601939	建设银行	1,246,724.00	2.33
12	001965	招商公路	1,230,673.00	2.30
13	601963	重庆银行	1,174,324.00	2.20
14	600273	嘉化能源	1,124,578.00	2.10
15	688256	寒武纪	1,076,245.00	2.01
16	600598	北大荒	1,041,105.00	1.95
17	600519	贵州茅台	1,023,413.00	1.91
18	301109	军信股份	1,021,838.00	1.91
19	688036	传音控股	1,007,186.04	1.88
20	601766	中国中车	982,163.00	1.84

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	133,634,740.35
卖出股票收入（成交）总额	58,194,984.90

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	5,347,187.48	5.74
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,347,187.48	5.74

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	019792	25 国债 19	32,000	3,233,575.45	3.47
2	019827	26 国债 01	18,000	1,811,667.45	1.95
3	102326	国债 2601	3,000	301,944.58	0.32

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，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或期限套利等操作。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**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 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	46,184.77
2	应收清算款	398,715.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,307.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	461,207.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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
南方利达灵活配置混合 A	3,328	14,732.42	40,648,411.00	82.91%	8,381,081.35	17.09%
南方利达灵活配置混合 C	6,866	3,304.19	9,926,412.38	43.75%	12,760,184.99	56.25%
合计	10,194	7,035.13	50,574,823.38	70.52%	21,141,266.34	29.48%

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	17.81%

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	南方利达灵活配置混合 A	100,055.07	0.2041%
	南方利达灵活配置混合 C	2.21	0.0000%
	合计	100,057.28	0.1395%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方利达灵活配置混合 A	0
	南方利达灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方利达灵活配置混合 A	10~50
	南方利达灵活配置混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方利达灵活配置混合 A	南方利达灵活配置混合 C
基金合同生效日(2015 年 7 月 8 日)基金份额总额	1,685,721,406.28	-
本报告期期初基金份额总额	21,314,275.55	16,851,724.78
本报告期基金总申购份额	35,598,086.89	11,398,306.58
减：本报告期基金总赎回份额	7,882,870.09	5,563,433.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,029,492.35	22,686,597.37

§ 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。
报告期内，未发生基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

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。
报告期内，未发生涉及基金托管业务的诉讼。

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

报告期内，未发生托管人受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	

中信建投	2	129,004,591.95	67.30%	56,265.09	67.31%	-
中金公司	2	62,677,765.48	32.70%	27,330.51	32.69%	-

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
中信建投	10,974,181.00	45.64%	173,100,000.00	51.18%	-	-
中金公司	13,073,068.00	54.36%	165,144,000.00	48.82%	-	-

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	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
2	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
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	证券时报、基金管理	2026-04-28

	册信息变更公告	人网站、中国证监会 基金电子披露网站	
--	---------	-----------------------	--

§ 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利达灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方利达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方利达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、《南方利达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>