

**（上接B57版）**

(二) 注册登记机构  
南方基金管理有限公司  
住所及办公地址: 深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦裙楼31、32、33层整层  
法定代表人: 吴万善  
电话: 0755 82676349  
传真: 0755 82763889  
联系人: 古和鹏

(三) 律师事务所和经办律师  
名称: 广东华瀚律师事务所  
注册地址: 深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室  
负责人: 李兆良  
电话: 0755 82687860  
传真: 0755 82687861  
经办律师: 杨忠、戴瑞冬

(四) 会计师事务所和经办注册会计师  
名称: 普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)  
住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
办公地址: 上海市湖南路202号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人: 杨绍信  
联系电话: 021 22388888  
传真: 021 22328800  
经办会计师: 王稼琼 单峰

**四、基金名称**  
南方瑞信成长股票型证券投资基金

**五、基金的类型**  
契约型开放式

**六、基金的投资目标**  
本基金为股票型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,根据对上市公司的业绩质量、成长性进行投资,以精选个股,力争为投资者寻求超越基准的长期增值回报。

**七、基金的投资策略**  
本基金的投资策略具有良好流动性的金融工具,包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资是对于上市公司业绩质量、成长性进行投资的权重,精选中长期持续增长或未来阶段高速增长、业绩质量优秀、且估值被低估的成长股票作为主要投资对象。债券投资主要包括国债、金融债、企业债和可转债等。其他金融工具投资主要包括年限小于397天的债券、期限在一年以内的债券回购以及中央银行票据等货币市场工具以及权证等。

**八、投资范围**  
**(一) 资产配置策略**  
本基金管理人将根据综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预期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,并据此确定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,定期或不定期进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。

**二、股票投资策略**  
本基金的投资策略主要采用“自下而上”的策略,通过对上市公司基本面的深入研究,基于对上市公司业绩质量、成长性进行投资的权重,不仅重视公司的业绩与成长性,更注重公司的业绩与成长性的质量,精选中长期持续增长或未来阶段高速增长、业绩质量优秀、且估值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金股票投资同时结合“自上而下”的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。

**1. 绩优成长股票的定义**  
绩优成长股票是指具有如下特征的种类:  
Q 被证监会行业分类标准,对各行各业上市公司按PEG指标由低到高进行排序,选取各行业排名前30%的股票;  
C ROE不低于6%的股票。

本基金将根据以上标准选择股票,构造绩优成长股票组合。

**三、自上而下”的行业选择**  
2. 相对成长性选择中的股票,本基金以定性和定量分析相结合的方法,精选个股,构建组合。在定性分析中,本基金注重上市公司以下五个方面的情况: Q 行业增长空间; Q 行业结构; Q 6) 上下游地位; Q 4) 竞争优势; Q 6) 管理能力。行业增长空间分析主要是按照行业发展四阶段理论,判断行业处于哪个发展阶段,行业结构分析主要考察行业集中度和上市公司行业地位,在行业竞争中上市公司受影响的程度。上下游地位分析主要考察企业在行业内的上下游行业态势与利益分配,决定企业在产业链中处于何种地位,竞争优势分析主要考察企业在规模经济、资源优越性、技术创新、品牌、经营效率等方面是否具有竞争优势在中长期时间内难以模仿的显著优势;管理能力分析主要考察企业管理层是否重视股东利益,管理水平是否能适应企业竞争优势的维持与开拓,以及管理层激励考核方式。

**三、资产配置策略**  
本基金管理人将根据综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预期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,并据此确定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,定期或不定期进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。

**二、股票投资策略**  
本基金的投资策略主要采用“自下而上”的策略,通过对上市公司基本面的深入研究,基于对上市公司业绩质量、成长性进行投资的权重,不仅重视公司的业绩与成长性,更注重公司的业绩与成长性的质量,精选中长期持续增长或未来阶段高速增长、业绩质量优秀、且估值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金股票投资同时结合“自上而下”的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。

**1. 绩优成长股票的定义**  
绩优成长股票是指具有如下特征的种类:  
Q 被证监会行业分类标准,对各行各业上市公司按PEG指标由低到高进行排序,选取各行业排名前30%的股票;  
C ROE不低于6%的股票。

本基金将根据以上标准选择股票,构造绩优成长股票组合。

**三、自上而下”的行业选择**  
2. 相对成长性选择中的股票,本基金以定性和定量分析相结合的方法,精选个股,构建组合。在定性分析中,本基金注重上市公司以下五个方面的情况: Q 行业增长空间; Q 行业结构; Q 6) 上下游地位; Q 4) 竞争优势; Q 6) 管理能力。行业增长空间分析主要是按照行业发展四阶段理论,判断行业处于哪个发展阶段,行业结构分析主要考察行业集中度和上市公司行业地位,在行业竞争中上市公司受影响的程度。上下游地位分析主要考察企业在行业内的上下游行业态势与利益分配,决定企业在产业链中处于何种地位,竞争优势分析主要考察企业在规模经济、资源优越性、技术创新、品牌、经营效率等方面是否具有竞争优势在中长期时间内难以模仿的显著优势;管理能力分析主要考察企业管理层是否重视股东利益,管理水平是否能适应企业竞争优势的维持与开拓,以及管理层激励考核方式。

**三、资产配置策略**  
本基金管理人将根据综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预期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,并据此确定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,定期或不定期进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,874,403,821.74	70.66
	其中:股票	4,874,403,821.74	70.66
2	固定收益投资	318,513,000.00	4.62
	其中:债券	318,513,000.00	4.62
3	货币资金	31,568,011.09	0.46
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	488,128,200.94	7.08
7	其他资产	1,217,121,544.54	17.64
8	合计	6,898,166,587.22	100.00

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	50,976,148.95	0.74
C	制造业	3,275,440,807.11	47.65
D	电力、热力、燃气及生产供应业	59,764,083.43	0.87
E	建筑业	49,857,600.00	0.72
F	交通运输、仓储和邮政业	84,477,028.89	0.65
H	信息传输、软件和信息技术服务业	996,051,637.10	14.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	88,198,094.88	1.28
L	租赁和商务服务业	31,568,011.09	0.46
M	科学研究和技术服务业	8,145,207.38	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
P	教育	-	-
Q	休闲和文体业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	229,965,192.91	3.35
S	综合	-	-
	合计	4,874,403,821.74	70.91

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	600703	三安光电	16,939,705	378,226,524.75	5.50
2	300226	上海钢联	4,000,000	202,160,000.00	2.94
3	600094	华信国际	4,199,978	171,987,461.00	2.50
4	002038	大洋股份	6,000,000	171,540,000.00	2.50
5	002466	天齐锂业	3,080,200	148,240,236.00	2.16
6	002396	华谊集团	5,824,485	139,863,374.55	2.04
7	601877	正海磁材	3,500,000	134,695,000.00	1.96
8	300315	掌趣科技	5,999,994	128,719,806.92	1.87
9	002048	宁波海运	12,177,345	127,496,802.15	1.85
10	002001	新和成	6,415,646	123,565,341.96	1.80

**三) 期末按行业分类的基金投资组合**

本基金管理人将根据以上标准选择股票,构造绩优成长股票组合。

**三、资产配置策略**  
本基金管理人将根据综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预期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,并据此确定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,定期或不定期进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。

**二、股票投资策略**  
本基金的投资策略主要采用“自下而上”的策略,通过对上市公司基本面的深入研究,基于对上市公司业绩质量、成长性进行投资的权重,不仅重视公司的业绩与成长性,更注重公司的业绩与成长性的质量,精选中长期持续增长或未来阶段高速增长、业绩质量优秀、且估值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金股票投资同时结合“自上而下”的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。

**1. 绩优成长股票的定义**  
绩优成长股票是指具有如下特征的种类:  
Q 被证监会行业分类标准,对各行各业上市公司按PEG指标由低到高进行排序,选取各行业排名前30%的股票;  
C ROE不低于6%的股票。

本基金将根据以上标准选择股票,构造绩优成长股票组合。

**三、自上而下”的行业选择**  
2. 相对成长性选择中的股票,本基金以定性和定量分析相结合的方法,精选个股,构建组合。在定性分析中,本基金注重上市公司以下五个方面的情况: Q 行业增长空间; Q 行业结构; Q 6) 上下游地位; Q 4) 竞争优势; Q 6) 管理能力。行业增长空间分析主要是按照行业发展四阶段理论,判断行业处于哪个发展阶段,行业结构分析主要考察行业集中度和上市公司行业地位,在行业竞争中上市公司受影响的程度。上下游地位分析主要考察企业在行业内的上下游行业态势与利益分配,决定企业在产业链中处于何种地位,竞争优势分析主要考察企业在规模经济、资源优越性、技术创新、品牌、经营效率等方面是否具有竞争优势在中长期时间内难以模仿的显著优势;管理能力分析主要考察企业管理层是否重视股东利益,管理水平是否能适应企业竞争优势的维持与开拓,以及管理层激励考核方式。

**三、资产配置策略**  
本基金管理人将根据综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预期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,并据此确定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,定期或不定期进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。

**二、股票投资策略**  
本基金的投资策略主要采用“自下而上”的策略,通过对上市公司基本面的深入研究,基于对上市公司业绩质量、成长性进行投资的权重,不仅重视公司的业绩与成长性,更注重公司的业绩与成长性的质量,精选中长期持续增长或未来阶段高速增长、业绩质量优秀、且估值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金股票投资同时结合“自上而下”的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。

**1. 绩优成长股票的定义**  
绩优成长股票是指具有如下特征的种类:  
Q 被证监会行业分类标准,对各行各业上市公司按PEG指标由低到高进行排序,选取各行业排名前30%的股票;  
C ROE不低于6%的股票。

本基金将根据以上标准选择股票,构造绩优成长股票组合。

**三、自上而下”的行业选择**  
2. 相对成长性选择中的股票,本基金以定性和定量分析相结合的方法,精选个股,构建组合。在定性分析中,本基金注重上市公司以下五个方面的情况: Q 行业增长空间; Q 行业结构; Q 6) 上下游地位; Q 4) 竞争优势; Q 6) 管理能力。行业增长空间分析主要是按照行业发展四阶段理论,判断行业处于哪个发展阶段,行业结构分析主要考察行业集中度和上市公司行业地位,在行业竞争中上市公司受影响的程度。上下游地位分析主要考察企业在行业内的上下游行业态势与利益分配,决定企业在产业链中处于何种地位,竞争优势分析主要考察企业在规模经济、资源优越性、技术创新、品牌、经营效率等方面是否具有竞争优势在中长期时间内难以模仿的显著优势;管理能力分析主要考察企业管理层是否重视股东利益,管理水平是否能适应企业竞争优势的维持与开拓,以及管理层激励考核方式。

**三、资产配置策略**  
本基金管理人将根据综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预期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,并据此确定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,定期或不定期进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。

**二、股票投资策略**  
本基金的投资策略主要采用“自下而上”的策略,通过对上市公司基本面的深入研究,基于对上市公司业绩质量、成长性进行投资的权重,不仅重视公司的业绩与成长性,更注重公司的业绩与成长性的质量,精选中长期持续增长或未来阶段高速增长、业绩质量优秀、且估值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金股票投资同时结合“自上而下”的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。

**2、自上而下”的行业选择**  
本基金股票投资同时结合“自上而下”的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。

在行业选择中,本基金注重以下四个方面的情况: Q 宏观经济景气状况及所处阶段,主要分析目前经济增长的构成、来源、景气状况; Q 寻找当前增长模式下降风险和弹性最大的行业,寻找经济转型中受益程度最高的行业; Q 审慎评估政策变化情况,主要根据不同阶段的利率、汇率、财政、货币政策,寻找阶段最佳行业; Q 产业政策及发展环境的变化,主要根据不同阶段对不同产业的政策和环境,寻找受扶持、受益快、发展环境得到持续改善的行业,获取这一行业高速发展的机会; Q 行业所处的生命周期及其在产业链中的地位变化,主要是动态分析行业发展周期,与上下游关系与谈判地位,寻找产业链中由弱转强或优势扩大”的行业。

**三、债券投资策略**  
本基金可投资的债券品种包括国债、金融债和企业债(包括可转换债)等。本基金将在研判利率走势的基础上做出最合理的资产配置及风险控制。在选择债券品种时,本基金重点分析债券发行人的资信品质,包括发行机构以及保证机构的偿债能力、财务结构与安全性,并根据对不同期限品种的研究,构造收益率曲线,采用久期策略构造最佳债券期限组合,降低利率风险;对可转债的投资,结合对股票走势的判断,发现其套利机会。

**四、权证投资策略**  
本基金在进行权证投资时,将通过对权证证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值投资策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、空仓保护性认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

**九、业绩比较基准**  
本基金业绩基准设置为:  
80%沪深300指数+20%上证国债指数  
如果该业绩基准计算方法编制指数或更改指数名称,或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,经与基金托管人协商一致,本基金管理人有权在此基础上进行调整并及时公告。

**十、风险收益特征**  
本基金为股票型基金,因此,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。基金资产净值波动较大,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。基金资产净值波动较大,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

**十一、基金的跟踪组合(未经审计)**  
基金资产净值波动较大,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。基金资产净值波动较大,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

**二) 期末按行业分类的基金投资组合**

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,874,403,821.74	70.66
	其中:股票	4,874,403,821.74	70.66
2	固定收益投资	318,513,000.00	4.62
	其中:债券	318,513,000.00	4.62
3	货币资金	31,568,011.09	0.46
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	488,128,200.94	7.08
7	其他资产	1,217,121,544.54	17.64
8	合计	6,898,166,587.22	100.00

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	50,976,148.95	0.74
C	制造业	3,275,440,807.11	47.65
D	电力、热力、燃气及生产供应业	59,764,083.43	0.87
E	建筑业	49,857,600.00	0.72
F	交通运输、仓储和邮政业	84,477,028.89	0.65
H	信息传输、软件和信息技术服务业	996,051,637.10	14.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	88,198,094.88	1.28
L	租赁和商务服务业	31,568,011.09	0.46
M	科学研究和技术服务业	8,145,207.38	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
P	教育	-	-
Q	休闲和文体业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	229,965,192.91	3.35
S	综合	-	-
	合计	4,874,403,821.74	70.91

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	600703	三安光电	16,939,705	378,226,524.75	5.50
2	300226	上海钢联	4,000,000	202,160,000.00	2.94
3	600094	华信国际	4,199,978	171,987,461.00	2.50
4	002038	大洋股份	6,000,000	171,540,000.00	2.50
5	002466	天齐锂业	3,080,200	148,240,236.00	2.16
6	002396	华谊集团	5,824,485	139,863,374.55	2.04
7	601877	正海磁材	3,500,000	134,695,000.00	1.96
8	300315	掌趣科技	5,999,994	128,719,806.92	1.87
9	002048	宁波海运	12,177,345	127,496,802.15	1.85
10	002001	新和成	6,415,646	123,565,341.96	1.80

**三) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600703	三安光电	16,939,705	378,226,524.75	5.50
2	300226	上海钢联	4,000,000	202,160,000.00	2.94
3	600094	华信国际	4,199,978	171,987,461.00	2.50
4	002038	大洋股份	6,000,000	171,540,000.00	2.50
5	002466	天齐锂业	3,080,200	148,240,236.00	2.16
6	002396	华谊集团	5,824,485	139,863,374.55	2.04
7	601877	正海磁材	3,500,000	134,695,000.00	1.96
8	300315	掌趣科技	5,999,994	128,719,806.92	1.87
9	002048	宁波海运	12,177,345	127,496,802.15	1.85
10	002001	新和成	6,415,646	123,565,341.96	1.80

**四) 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**

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	090417	09宏发17	1,700,000	168,708,000.00	2.45
2	130243	13财开43	1,500,000	149,805,000.00	2.18

**六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

**七) 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权证投资明细**

**八) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**九) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**十) 投资组合报告附注**

**1. 本基金报告期内没有持有处于转股期的可转换债券。**

**2. 本基金本报告期末前十名股票中未发现持有发行主体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、处罚的股票。**

**3. 本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

**4. 本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

**5. 本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

**6. 本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

**7. 本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

**8. 本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

**四) 期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	318,513,000.00	4.63
	其中:政策性金融债	318,513,000.00	4.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	318,513,000.00	4.63

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	090417	09宏发17	1,700,000		