

**\$1 重要提示**

基金管理人的基本信息及基金销售机构不在于虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同，于2009年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚信经营、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告期财务未审计。

本报告期自2008年10月1日起至2008年12月31日止。

**\$2 基金产品概况**

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金简称       | 交银施罗德精选股票证券投资基金   |
| 交易代码       | 前端519689,后端519690 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同期生日    | 2006年09月29日       |
| 报告期末基金份额总额 | 9,679,696,924.07  |

本基金坚持“不断深化价值投资的基本理念，充分发挥专业研究与管理能力，上自宏观配置资产，自下而上精选证券，有效控制风险，分享中国经济与资本市场高速增长的成果，谋取实现资金时间的长期稳定增长。”

业绩比较基准

**50%×沪深300指数+25%×中证全债指数**

风险收益特征

**本基金是一只股票型的股权投资基金，属于股票型基金中的中等风险品种，本基金的预期收益和风险都要高于货币型基金。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长。**

基金管理人

**交银施罗德基金管理有限公司**

基金托管人

**中国农业银行****\$3 主要财务指标和基金净值表现**

| 主要财务指标         |  | 单位:人民币元                      |  |  |  |
|----------------|--|------------------------------|--|--|--|
| 1.本期已实现收益      |  | 报告期(2008年10月01日-2008年12月31日) |  |  |  |
| 2.本期利润         |  | (1,401,061,698.96)           |  |  |  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 |  | 0.0976                       |  |  |  |
| 4.期末基金资产净值     |  | 6,669,365,681.09             |  |  |  |
| 5.期末基金份额净值     |  | 0.6889                       |  |  |  |

注:1.本报告中的财务数据如以括号表示，则为负数；  
2.上述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；  
3.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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

| 阶段                                       | 净值增长率①   | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④     |
|--|----------|-----------|------------|---------------|--------|---------|
| 过去三个月                                    | (12.26%) | 1.86%     | (13.20%)   | 2.28%         | 0.94%  | (0.42%) |
| 自基金合同生效日至至今<br>(2006年09月29日-2008年12月31日) | 166.42%  | 1.62%     | 80.33%     | 1.73%         | 85.09% | (0.11%) |

3.2.2本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:该示意图表示为2006年9月29日至2008年12月31日，本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。

**\$4 报告期组合报告**

4.1基金管理人报告期内按行业分类的股票投资组合

4.2报告期内本基金运作遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金投资管理

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

4.3.2本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.3本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.4本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.5本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.6本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.7本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.8本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.9本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.10本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.11本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.12本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.13本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.14本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.15本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.16本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.17本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.18本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.19本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.20本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.21本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.22本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.23本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.24本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.25本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.26本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.27本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.28本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.29本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.30本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.31本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.32本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.33本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.34本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.35本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.36本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.37本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.38本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.39本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.40本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.41本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.42本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.43本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.44本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.45本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.46本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.47本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.48本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.49本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.50本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.51本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.52本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.53本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.54本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.55本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.56本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.57本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.58本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.59本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.60本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.61本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.62本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.63本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.64本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.65本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.66本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.67本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.68本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.69本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.70本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.71本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.72本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.73本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.74本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.75本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.76本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.77本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.78本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.79本公司没有发现旗下股票型基金与债券型基金之间存在不公平交易的情况。

4.3.80本公司