交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定，于2006年10月24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。

本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。

本报告期为2006年7月1日至9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。

二、基金产品概况

基金简称：交银稳健

基金代码：前端519690，后端519691

运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006年6月14日

报告期末基金份额总额：6,672,768,339.22份

投资目标：本基金将坚持并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，根据宏观经济周期和市场环境的变化，自上而下灵活配置资产，自下而上精选证券，有效分散风险，谋求实现基金财产的长期稳定增长。

投资策略：把握宏观经济和投资市场的变化趋势，根据经济周期理论动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效分散风险。

基金业绩比较基准：65%×MSCI中国A股指数+35%×新华雷曼中国全债指数。

风险收益特征：本基金是一只混合型基金，属于证券投资基金产品中的中等风险品种，本基金的风险与预期收益处于股票型基金和债券型基金之间。本基金力争在有效分散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：中国建设银行股份有限公司

三、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

主要财务指标	2006年7月1日至2006年9月30日
基金本期净收益(元)	43,704,541.62
基金份额本期净收益(元)	0.0063
期末基金资产净值(元)	7,144,786,186.44
期末基金份额净值(元)	1.0707
期末基金累计份额净值（元）	1.0707

上述基金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。

（二）、基金净值表现

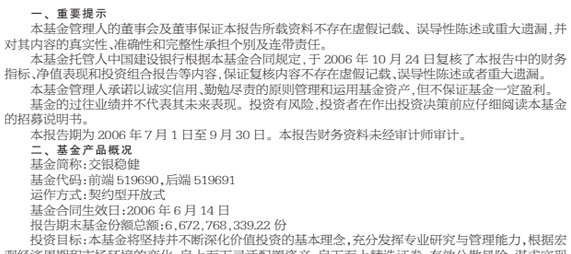
1. 报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	5.84%	0.50%	0.96%	0.87%	4.88%	-0.37%
自基金成立起至今（2006年6月14日－2006年9月30日）	7.07%	0.46%	5.93%	0.85%	1.14%	-0.39%

2. 基金合同生效以来基金份额净值变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较

交银稳健基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（时间2006年6月14日至2006年9月30日）



本基金自成立起至本报告期末不满一年。

注：基金合同中关于基金投资比例的约定：

1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

3、本基金财产参与股票发行申购，基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

4、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；

5、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的百分之十；

6、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五；

7、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

8、法律法规或监管部门取消上述限制，则本基金不受上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述1—6项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

四、管理人报告

1、基金经理简介

李旭利先生，基金经理，中国人民银行研究生部经济学硕士。1998年至2005年任职于南方基金管理有限公司，曾担任公司研究员、交易员、基金经理、投资总监等职务。其中1999年9月至2004年1月担任基金天元基金经理助理、基金经理，2004年1月至2005年7月担任南方基金管理有限公司投资总监及南方稳健成长证券投资基金基金经理。现任交银施罗德基金管理有限公司投资总监。

于晖先生，基金经理助理，金融学硕士，工学学士，工程师，4年证券、基金从业经验，历任上海证券有限公司研究发展中心研究员，申银万国证券研究所行业研究员，国联安基金管理有限公司投资组合管理部高级研究员，曾获2004年度“新财富”最佳分析师汽车行业全国第一名。2005年加入交银施罗德基金管理有限公司，任投资研究部研究员。

李立先生，基金经理助理，经济学硕士，6年证券、基金从业经验。历任中国科技证券有限公司高级经理，招商基金管理有限公司股票投资高级经理，2006年加入交银施罗德基金管理有限公司，任投资研究部研究员。

2、本报告期内基金运作情况说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

3、报告期内基金的投资策略和业绩表现

本基金在6月完成募集后开始了正常的投资运作。在此期间股票市场基本维持盘整的格局，而固定收益证券市场的收益率维持稳定，为我们的投资建仓提供了比较好的机会。考虑到当前固定收益证券收益率不到3%，相对股票投资的潜在收益水平，这么低的收益预期对投资者没有太大的吸引力，我们将大部分资产投向股票市场。

在经过今年以来的大幅度上涨后，我们认为A股市场的价值回归过程基本结束。比较A股估值水平，从PE指标看，现在市场的估值都处于基本合理的水平，虽然比年初已经有很大涨幅，但估值水平并没有超过投资者能接受的程度。但从PB值来看，则明显比亚太区其他市场要低。这说明中国上市公司资产的收益潜力并没有完全发挥出来。在股权分置问题基本解决后，大股东和小股东的利益可以说已经基本一致，但如何调动上市公司管理层的积极性，提高资产收益水平则有待管理层股权激励机制的推行。也就是说中国资本市场的效率仍有较大改善空间，上市公司ROE仍然有提升的空间。

在A股市场估值合理化后，投资的收益将更多依赖于上市公司利润增长，依赖于企业的成长。在中国经济维持高速增长的宏观环境下，可以找到成长性的企业作中长期投资，分享企业成长带来的收益。在过去几年里我们看到比较多的区域性企业成长为全国性企业，以国内市场为主的企业成长为全球企业，优质企业的成长为投资人带来了成倍的投资收益。这种机会在今后几年中仍然会屡见不鲜。而寻找到估值合理的优质成长企业则是分析师和基金经理的主要挑战。

对于未来一段时间的投资方向，我们有两个基本判断。一是我们认为以美国为代表的发达国家经济在经过几年的高速增长后有明显的减速迹象，美国房地产市场的转势和原油市场的急速下跌都是比较明确的信号。经济减速可能会导致全球大宗商品牛市的结束，虽然在宽松的货币环境下商品市场未必很快步入熊市，但我们对商品类企业的投资仍会趋于谨慎。另一方面这可能会对中国出口产生负面影响，导致我们对出口型企业的选择标准变得更加严格和苛刻。如果外围经济环境变坏，则其对人民币升值的压力可能会进一步加大，而全球大量资本会进一步涌向高速增长的中国经济。这也会对我们的投资产生影响。我们的第二个判断是国内固定资产投资的增长仍会保持较高的水平，但增速可能会有所回落，对于投资驱动的投资机会我们更多是看一些明确的方向，比如3G、城市轨道交通、电网改造等。

由于人口因素造成的中国经济高速的增长是难以抑制的，合理的宏观调控会让这种增长更为健康和持续，在这个过程中消费的增长是我们投资的重点。但消费是一个宽泛的概念，在居民收入增长到一定程度后，消费绝不仅仅是吃饭穿衣这么简单。其实只要看看我们自己的家庭支出情况，就可以看到中国老百姓正将大量的钱用到住房、教育、医疗、休闲娱乐、金融服务、电信与交通等服务项目上，这些行业的增长持续保持较高的速度，而传统的基本消费品支出的比重正逐年下降。这种消费结构的变化正是我们投资的指引。

五、投资组合报告

（一）报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	4,864,771,700.18	67.54%
权证	-	-
债券	266,225,840.91	3.70%
银行存款及清算备付金合计	2,066,901,162.07	28.69%
其他资产	5,258,533.91	0.07%
资产总值	7,203,157,237.07	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值（元）	占基金资产净值比例
A农、林、牧、渔业	27,068,389.92	0.38%
B采掘业	371,786,271.29	5.20%
C制造业	1,486,718,670.92	20.81%
C0食品、饮料	279,374,393.27	3.91%
C1纺织、服装、皮毛	5,227,340.00	0.07%
C2木材、家具	79,336,611.20	1.11%
C3造纸、印刷	-	-
C4石油、化学、塑胶、塑料	371,076,202.36	5.19%
C5电子	16,535,373.07	0.23%
C6金属、非金属	135,008,547.00	1.89%
C7机械、设备、仪表	327,717,079.68	4.59%
C8医药、生物制品	263,246,398.34	3.68%
C99其他制造业	9,196,726.00	0.13%
D电力、煤气及水的生产和供应业	26,223,750.00	0.37%
E建筑业	-	-
F交通运输、仓储业	339,170,978.62	4.75%
G信息技术业	424,661,128.57	5.94%
H批发和零售贸易	272,342,636.48	3.81%
I金融、保险业	1,108,907,118.58	15.52%
J房地产业	603,972,392.65	8.45%
K社会服务业	126,421,778.15	1.77%
L传播与文化产业	77,498,585.00	1.08%
M综合类	-	-
合计	4,864,771,700.18	68.09%

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	53,183,091	528,639,924.54	7.40%
2	601988	中国银行	79,223,914	263,815,633.62	3.69%
3	600028	中国石化	38,294,111	260,017,013.69	3.64%
4	000002	万科A	30,168,057	228,372,191.49	3.20%
5	600016	民生银行	39,007,754	210,251,794.06	2.94%
6	000063	中兴通讯	6,000,667	191,841,323.99	2.69%
7	000792	盐湖钾肥	10,214,831	187,952,890.40	2.63%
8	000024	招商地产	11,401,820	173,763,736.80	2.43%
9	601006	大秦铁路	26,920,200	169,597,260.00	2.37%
10	600009	上海机场	10,045,710	139,434,454.80	1.95%

（四）报告期末按券种分类的债券投资组合明细

序号	债券种类	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	国债	-	-
2	央行票据	196,977,435.69	2.76%
3	金融债	-	-
4	企业债	-	-
5	可转债	-	-
合计		196,977,435.69	2.76%

（五）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	601049	06央行票据49	1,000,000	99,450,027.47	1.39%
2	601048	06央行票据48	1,000,000	97,527,408.22	1.37%

（六）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量（张）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	119003	澜电02	400,000	39,553,158.26	0.55%
2	119004	澜电03	300,000	29,695,246.96	0.42%
合计			700,000	69,248,405.22	0.97%

（七）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

2、本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

其他资产	期末余额（元）
交易保证金	751,432.08
应收证券交易清算款	-
应收股利	-
应收利息	2,345,575.93
应收申购款	2,161,525.90
其他应收款	-
配股权证	-
买入返售债券	-
待摊费用	-
合计	5,258,533.91

4、本报告期内无处于转股期的可转债

5、本报告期间未持有权证

6、交银施罗德基金管理有限公司在本期及期末持有本基金份额35,017,900份，占本基金期末总份额的0.52%，适用申购/赎回费率按照《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金招募说明书》规定

六、基金份额变动表

项目名称	基金份额（份）
报告期期初基金份额	7,016,138,522.08
报告期间总申购份额	125,396,435.33
报告期间总赎回份额	468,765,618.19
报告期期末基金份额	6,672,768,339.22

七、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金设立的文件；

2、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、关于募集交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金之法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

（三）查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.jysld.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：021-61055000，或发电子邮件：services@jysld.com。

交银施罗德基金管理有限公司

2006年10月27日

交银施罗德精选股票证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2006年10月24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。

本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。

本报告期为2006年7月1日至9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。

二、基金产品概况

基金简称：交银精选

基金代码：前端519688，后端519689

运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2005年9月29日

报告期末基金份额总额：1,227,460,281.55份

投资目标：本基金将坚持并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，自上而下配置资产，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成长的成果，谋求实现基金财产的长期稳定增长。

投资策略：自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效控制下行风险。

基金业绩比较基准：交银精选基金总体业绩评价基准＝沪深300指数×75%＋中信全债指数（中信标普全债指数）×25%。

风险收益特征：本基金是一只主动投资的股票型基金。基金的预期收益和风险都要高于混合型基金。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

三、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

主要财务指标	2006年7月1日至2006年9月30日
基金本期净收益(元)	62,903,505.54
基金份额本期净收益(元)	0.0517
期末基金资产净值(元)	1,894,895,777.58
期末基金份额净值(元)	1.5438
期末基金累计份额净值（元）	1.6438

上述基金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。

（二）基金净值表现

1. 报告期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	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	4.47%	0.96%	0.90%	1.00%	3.57%	-0.04%
自基金成立起至今（2005年9月29日－2006年9月30日）	66.77%	1.04%	40.24%	0.95%	26.53%	0.09%

2. 基金合同生效以来基金份额净值变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较

交银精选基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（时间2005年9月29日至2006年9月30日）

注：基金合同中关于基金投资比例的约定：

1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

3、本基金财产参与股票发行申购，基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

4、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；

5、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的百分之十；

6、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五；

7、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

8、法律法规或监管部门取消上述限制，则本基金不受上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述1—6项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

四、管理人报告

1、基金经理简介

赵枫先生，基金经理，美国哥伦比亚大学硕士。基金从业经验7年。曾任职于中国技术进出口总公司投资研究员，融通基金管理有限公司研究员、研究部经理和基金经理。2005年加入交银施罗德基金管理有限公司。

张媚钗女士，基金经理助理，经济学硕士。4年证券、基金从业经历，2003年进入申银万国证券研究所，任电力行业研究员，2005年10月加入交银施罗德基金管理有限公司，任投资研究部研究员，负责食品饮料、电力、煤炭等行业研究工作。

2、本报告期内遵规守信情况说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《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》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

3、报告期内基金的投资策略和业绩表现

二季度，A股市场经过短暂的调整后再度上攻，支持市场上升的因素主要有三个：一是上市公司的基本面持续改善，半年报显示A股上市公司的盈利仍保持较高的增长，虽然市场整体估值水平有所提高，但盈利的增长使得当前的股价并没有显得昂贵；二是资金面的持续改善，虽然央行不断的通过各种措施控制货币供应的增长，但持续的高额外贸顺差仍然使得整个经济体资金非常充裕，在有限的投资品种选择面前，股票投资的吸引力仍然是最高的；最后，伴随着资本市场改革的推进，市场功能逐步恢复，融资者和投资者的信心得到了极大的恢复，资本市场的地位正在逐步提高。

展望四季度，我们对市场相对乐观，A股市场将呈现资金推动和价值驱动双重效应。相对于我国的GDP水平和巨大的存款余额，A股市场的总市值仍处于较低的水平；良好的宏观经济形势和有利于资本市场的政策取向将进一步提升投资者的信心，我们对市场的资金供给持有乐观的看法，市场可能出现一定程度上的资金推动，估值水平将进一步提高。另一方面，经过多年的整合和竞争，具备竞争优势的上市公司的行业龙头地位日益稳固，国内无序竞争的减少将有利于利润的体现，而竞争实力的进一步加强使得这些公司面临更为广阔的国际市场；资本市场融资功能的恢复也将使得优质的实业资源加速向上市公司集中。我们将看到越来越多的上市公司出现销售收入和利润的同步增长，企业的净资产回报率得到提升。

五、投资组合报告

（一）报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	1,642,208,763.43	86.23%
债券	3,210,938.92	0.17%
银行存款及清算备付金合计	218,144,021.73	11.45%
其他资产	40,907,031.05	2.15%
合计	1,904,470,755.13	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值（元）	占基金资产净值比例
A农、林、牧、渔业	3,649,680.32	0.19%
B采掘业	67,900,000.00	3.58%
C制造业	739,857,191.99	39.04%
C0食品、饮料	345,886,318.83	18.25%
C1纺织、服装、皮毛	-	-
C2木材、家具	31,709,000.00	1.67%
C3造纸、印刷	-	-
C4石油、化学、塑胶、塑料	81,810,763.61	4.32%
C5电子	1,390,563.13	0.07%
C6金属、非金属	50,175,000.00	2.65%
C7机械、设备、仪表	114,483,118.10	6.04%
C8医药、生物制品	114,402,428.32	6.04%
C99其他制造业	-	-
D电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E建筑业	-	-
F交通运输、仓储业	56,262,980.00	2.97%
G信息技术业	117,133,147.90	6.18%
H批发和零售贸易	198,797,414.66	10.49%
I金融、保险业	229,141,591.76	12.09%
J房地产业	157,390,955.62	8.31%
K社会服务业	41,850,772.20	2.21%
L传播与文化产业	30,225,028.98	1.60%
M综合类	-	-
合计	1,642,208,763.43	86.66%

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	000895	S双汇	5,514,999	171,902,518.83	9.07%
2	600036	招商银行	15,000,000	149,100,000.00	7.87%
3	600887	伊利股份	3,500,000	73,150,000.00	3.86%
4	600016	民生银行	13,000,000	70,070,000.00	3.70%
5	600028	中国石化	10,000,000	67,900,000.00	3.58%
6	600361	华联综超	4,000,000	67,320,000.00	3.55%
7	000002	万科A	8,000,000	60,560,000.00	3.20%
8	600383	金地集团	6,000,000	56,340,000.00	2.97%
9	000063	中兴通讯	1,699,950	54,347,401.50	2.87%
10	600031	三一重工	3,000,000	48,900,000.00	2.58%

（四）报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	-	-
5	可转债	3,210,938.92	0.17%
合计		3,210,938.92	0.17%

（五）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	125024	招商转债	25,109	3,210,938.92	0.17%

（六）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

2、本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

其他资产	期末余额（元）
交易保证金	2,210,306.35
应收证券交易清算款	6,737,603.14
应收股利	-
应收利息	42,626.32
应收申购款	30,566,005.64
其他应收款	-
配股权证	1,350,489.60
买入返售债券	-
待摊费用	-
合计	40,907,031.05

4、本报告期内无处于转股期的可转债

5、本报告期间因股权分置改革而被动持有的权证明细

序号	代码	权证名称	持有数量（份）	成本总额
1	580005	万华HXB1	115,200	0.00

6、交银施罗德基金管理有限公司在本期及期末持有本基金份额21,680,147.48份，占本基金期末总份额的1.77%，适用申购/赎回费率按照《交银施罗德精选股票证券投资基金招募说明书》规定

六、基金份额变动表

项目名称	基金份额（份）
报告期期初基金份额	1,229,574,235.97
报告期间总申购份额	116,460,937.93
报告期间总赎回份额	118,574,892.35
报告期期末基金份额	1,227,460,281.55

七、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德精选股票证券投资基金设立的文件；

2、《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德精选股票证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德精选股票证券投资基金托管协议》；

5、关于募集交银施罗德精选股票证券投资基金之法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内交银施罗德精选股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

（三）查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.jysld.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：021-61055000，或发电子邮件：services@jysld.com。

交银施罗德基金管理有限公司

2006年10月27日

东吴基金管理有限公司关于增加旗下开放式基金代销机构的公告

东吴基金管理有限公司已与天相投资顾问有限公司签署了《开放式基金销售和服务代理协议》，天相投资顾问有限公司将代理东吴基金管理有限公司旗下基金的销售业务。投资者欲了解详细信息请仔细阅读相关的基金合同、招募说明书和最新的招募说明书更新。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

1、天相投资顾问有限公司

咨询电话：（010）84533151-822或802

网站：http://www.txsec.com

2、东吴基金管理有限公司

客户服务中心电话：021-50509666

公司网站：www.scfund.com.cn

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2006年10月27日

光大证券股份有限公司关于创设雅戈尔认沽权证的公告

依照上海证券交易所发布的《关于证券公司创设雅戈尔权证有关事项的通知》，光大证券股份有限公司向上海证券交易所申请创设雅戈尔认沽权证并已获核准，中国证券登记结算有限责任公司上海分公司已办理相应登记手续。本公司此次获准创设的雅戈尔认沽权证数量为200万份，该权证的条款与原雅戈尔认沽权证(交易简称雅戈QCP1、交易代码580992、行权代码582992)的条款完全相同。

本公司此次创设的雅戈尔认沽权证的上市日期为2006年10月27日（相关信息请登录光大证券网www.ebscn.com查询）。

特此公告。

光大证券股份有限公司

2006年10月27日

东海证券有限责任公司关于注销武钢认购权证的公告

依照上海证券交易所发布的《关于证券公司创设武钢权证有关事项的通知》，东海证券有限责任公司向上海证券交易所申请注销武钢认购权证并已获核准，中国证券登记结算有限责任公司上海分公司已办理相应登记手续。本公司此次获准注销的武钢认购权证数量为2000万份，该权证的条款与原武钢认购权证（交易简称武钢JTB1、交易代码580001、行权代码582001）的条款完全相同。

本公司此次注销的武钢认购权证的生效日期为2006年10月27日。

特此公告。

东海证券有限责任公司

2006年10月27日

证券简称：空港股份　证券代码：600463　公告编号：临2006-020

北京空港科技园区股份有限公司第三季度报告更正公告

特别提示

本公司及全体董事会成员保证公告内容的真实、准确、完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

本公司于2006年10月25日公布的第三季度报告中合并资产负债表的“负债合计”项出现错误，由于编制合并资产负债表时表间计算公式链接出错，未将合并资产负债表中的“长期负债合计”（金额为：120000000元）项纳入合并资产负债表的“负债合计”项中来。现将第三季度报告中合并资产负债表的“负债合计”项金额由244930139.26元更正为364930139.26元。变更后的2006年第三季度报告详见上海证券交易所网站http://www.sse.com.cn。

特此公告。

北京空港科技园区股份有限公司

董事会

2006年10月26日

证券代码：600516　股票简称：S*ST海龙　编号：2006-044

兰州海龙新材料科技股份有限公司关于推迟披露股权分置改革说明书及相关文件的公告

公司披露股权分置改革说明书及相关文件的日期推迟至2006年10月30日。

特此公告。

兰州海龙新材料科技股份有限公司

董事会

2006年10月26日

证券代码：600703　股票简称：S*ST天颐　编号：临2006-060

天颐科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

天颐科技股份有限公司近期股票交易异常，交易价格连续三个交易日内收盘价格跌幅偏离值累计达到15%。公司董事会特作出如下说明：在咨询公司控股股东和管理层后，董事会认为公司近期没有应披露而未披露的重大信息，公司生产经营仍处于停顿状态。

本公司董事会特提请广大投资者注意风险。

特此公告。

天颐科技股份有限公司

2006年10月26日