

交银施罗德精选股票证券投资基金 2007 年年度报告摘要

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	累计买入金额占期初基金资产净值比例
1	600016	民生银行	1,376,400,210.38	52.24%
2	600000	浦发银行	1,216,259,264.13	46.16%
3	600036	招商银行	1,077,423,700.88	40.69%
4	600028	中国石化	1,021,985,594.14	38.78%
5	600030	中信证券	987,774,336.67	37.49%
6	600050	中国联通	851,693,851.84	32.32%
7	600000	格力电器	720,720,360.63	27.88%
8	600005	宝钢股份	690,915,985.74	26.22%
9	000002	万科 A	638,369,833.32	24.22%
10	600019	浦发银行	628,838,862.74	23.79%
11	600009	新华百货	626,649,489.22	23.43%
12	601919	中信证券	571,461,515.74	21.69%
13	601016	大秦铁路	526,488,355.22	19.89%
14	000008	神州数码	523,671,883.88	19.87%
15	600034	大港股份	511,110,620.31	19.40%
16	600833	盐湖股份	472,071,203.57	17.92%
17	601388	工商银行	416,529,589.27	15.91%
18	000098	兴发集团	410,265,645.22	15.74%
19	600031	百联股份	397,647,355.52	15.09%
20	600887	伊泰股份	391,773,402.71	14.87%
21	000157	中联重科	383,068,630.28	14.54%
22	000009	一汽轿车	381,331,234.84	14.44%
23	000762	盐湖股份	365,400,173.51	13.49%
24	000983	兰州银行	351,700,660.04	13.36%
25	000037	航发动力	341,701,000.68	13.24%
26	600348	国统机械	338,131,327.44	12.83%
27	600775	国电电力	333,516,909.68	12.66%
28	600104	上汽汽车	289,744,983.88	11.03%
29	600040	奇安信	289,673,078.88	10.89%
30	000402	金鑫股份	282,184,754.64	10.71%
31	600619	贵州茅台	281,797,451.34	10.69%
32	601988	中国银行	273,289,300.41	10.09%
33	000024	招商地产	258,490,257.78	9.81%
34	000069	华侨城 A	243,768,864.47	9.26%
35	600004	白云机场	227,166,274.94	9.00%
36	000001	平安银行	226,268,435.62	8.97%
37	600066	宁波银行	220,210,477.88	8.36%
38	000668	六国矿业	219,254,030.22	8.32%
39	600325	浦发银行	218,773,079.72	8.30%
40	600088	金发科技	212,628,110.64	8.18%
41	601318	中国平安	212,000,188.64	8.05%
42	000776	山东三鼎	197,776,942.41	7.51%
43	600070	福建路桥	188,710,643.28	7.09%
44	600748	上海发展	178,106,102.91	6.76%
45	600083	金地集团	176,178,796.04	6.65%
46	600897	开元证券	172,027,299.67	6.53%
47	601001	浦发银行	170,269,022.68	6.47%
48	000086	广发证券	168,538,894.84	6.40%
49	002024	苏宁电器	162,747,990.62	6.18%
50	600049	浦发银行	158,710,929.64	6.03%
51	600049	厦门国贸	158,710,929.64	6.02%
52	600085	同益	156,218,285.63	5.93%
53	000960	银亿股份	151,008,937.78	5.79%
54	600718	中航地产	148,020,603.28	5.62%
55	000881	苏宁电器	148,330,730.74	5.52%
56	600080	博隆传媒	140,204,668.68	5.32%
57	600881	北京鹏润	138,840,695.82	5.27%
58	000019	浦发银行	137,727,842.64	5.23%
59	600666	南京股份	137,430,000.38	5.22%
60	600011	华能国际	132,333,496.82	5.02%
61	600001	浦发银行	132,030,931.84	5.01%
62	000061	农产品	129,852,334.72	4.93%
63	000060	中金岭南	126,423,170.34	4.76%
64	600036	中信证券	123,204,695.03	4.69%
65	000007	华能国际	122,850,888.62	4.68%
66	600031	百联股份	122,452,937.68	4.65%
67	600759	无锡商业	120,494,888.54	4.57%
68	000063	浦发银行	116,663,619.23	4.43%
69	601121	华能国际	110,162,444.62	4.19%
70	600081	华能国际	108,884,030.24	4.13%
71	600036	中信证券	106,226,948.52	4.03%
72	000006	浦发银行	104,660,670.28	3.97%
73	000037	苏宁电器	104,000,223.28	3.96%
74	601169	北京银行	98,678,427.68	3.74%
75	600046	中国国贸	96,919,368.14	3.67%
76	000042	中航地产	96,188,428.14	3.62%
77	601857	中国铝业	94,429,390.04	3.58%
78	000027	深圳能源	93,697,696.62	3.56%
79	600031	百联股份	92,383,945.68	3.56%
80	000017	广电网络	88,106,696.64	3.34%
81	600026	华夏银行	87,903,586.54	3.34%
82	600038	浦发银行	87,007,775.40	3.30%
83	000088	浦发银行	86,540,563.72	3.28%
84	600039	浦发银行	83,559,454.60	3.17%
85	601628	中国人寿	81,336,039.36	3.09%
86	600729	重庆百货	79,423,377.28	3.01%
87	000046	中原建设	76,396,738.52	2.97%
88	000040	中航地产	77,046,704.42	2.92%
89	000092	江铃汽车	73,256,414.16	2.78%
90	601600	中国铝业	71,023,064.38	2.70%
91	600125	铁龙物流	70,569,556.44	2.69%
92	601019	浦发银行	68,536,286.47	2.60%
93	600019	浦发银行	68,214,229.28	2.58%
94	600037	苏宁集团	62,038,961.18	2.36%
95	600088	中国铝业	61,339,553.68	2.33%
96	600075	中华企业	60,552,451.45	2.30%
97	601038	中国平安	60,221,700.00	2.29%
98	600176	招商地产	59,521,668.88	2.28%
99	000088	戴维山 A	58,989,694.69	2.24%
100	000068	辰光股份	56,612,150.52	2.11%
101	000076	新希望	56,040,083.65	2.09%

注:截至报告期内买入股票的成本总额为 27,519,757,043.07 元,卖出股票的收入总额为 28,465,190,416.00 元。

(元) 报告期末按券种分类的债券投资组合

债券种类	市值(元)	市值占基金资产净值比例
国债	--	--
央行票据	970,630,000.00	5.68%
可转债	250,220,000.00	1.46%
企业债	24,918,060.00	0.15%
可转债	--	--
合计	1,245,768,060.00	7.29%

(六) 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	债券名称	数量(张)	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	07央行票据 22	4,000,000	398,400,000.00	2.27%
2	07央行票据 09	2,000,000	198,540,000.00	1.14%
3	07央行票据 07	2,000,000	193,000,000.00	1.13%
4	07农发 02	1,500,000	149,940,000.00	0.88%
5	07国债 11	1,000,000	100,280,000.00	0.59%

(七) 报告期末未持有资产支持证券。

(八) 报告期末投资组合

1. 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2. 报告期末本基金投资组合前十名股票中不存在基金合同规定备选股票库之外的股票。

3. 截至 2007 年 12 月 31 日,本基金的其它资产项目包括:

其他资产	期末余额(元)
存出保证金	1,300,000.00
买入返售金融资产	1,731,001,630.00
应收证券交易保证金	49,821,871.74
应收利息	26,062,803.05
应收股利	--
应收申购款	14,383,073.30
其他资产	--
合计	1,822,589,380.00

4. 报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期末持有的权证信息

权证名称	权证代码	权证名称	报告期末持有数量(份)	成本总额(元)
被动持有	680016	上汽 CWH1	1,249,416	10,530,688.64
主动持有	000002	五粮 YQC1	1,249,416	10,530,688.64
合计	--	--	3,321,404	142,698,688.23

八、基金份额持有人户数、持有人结构

项目名称	2007年12月31日
基金份额持有人户数(户)	502,110
基金份额持有人户数(户)	38,077
机构投资者持有的基金份额(份)	1,120,985,071.41
机构投资者持有的基金份额占总额比例	6.40%
个人投资者持有的基金份额(份)	10,843,873,461.68
个人投资者持有的基金份额占总额比例	90.63%

九、开放式基金管理人从业人数情况

项目	期末持有本开放式基金基金份额的比例	
基金管理人持有本基金的从业人员	764,207.29	0.006%

十、开放式基金业绩变动

基金合同生效以来基金业绩变动情况

项目名称	基金份额(份)
期初基金份额总额	1,373,827,021.87
期末基金份额总额	11,964,531,520.89
报告期基金份额申购总额	14,844,692,860.02
报告期基金份额赎回总额	1,120,985,071.41
报告期基金份额申购净额	13,723,707,788.61
报告期基金份额赎回净额	18,061,182,046.17

注:1. 如果本报告期间发生转换入、红利再投资业务,则总申购份额中包含该业务;

2. 如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

十一、重大关联交易

(一) 报告期末未召开基金份额持有人大会。

(二) 报告期末内,基金管理人、基金托管人、基金托管人的从业人员:

2008 年 2 月 28 日本基金管理人、基金托管人、基金托管人的从业人员:

四次会议通过,选举莫泰山先生担任公司董事长;免去公司原经理贾达先生职务,选举莫泰山先生担任公司副经理;选举贾达先生担任公司副董事长。

(三) 基金托管人的从业人员变动: 依据国务院文件,2007 年 6 月 16 日国务院决定任命项俊波同志为中国人民银行行长。依据相关法律法规,中国工商银行法定代表人变更为项俊波先生。

(四) 报告期末本基金投资策略发生重大变化:

(五) 报告期末本基金进行了一次收益分配:于 2007 年 7 月 13 日每 10 份基金份额派发现金红利 2.00 元。

(六) 报告期末,为本基金提供审计服务的会计师事务所为德勤华永会计师事务所。报告年度支付给德勤华永会计师事务所的审计费用 100,000 元,日本基金合同生效以来,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

(七) 报告期末,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员均未受监管部门稽查或处罚。

(八) 报告期末本基金租用专用席位情况

券商名称	租用席位数量(个)	股票成交金额(元)	占股票成交总额的比例	佣金(元)	占佣金总额比例
国信证券有限责任公司	1	8,136,263,443.29	14.74%	6,666,569.81	14.8%
国泰君安证券股份有限公司	1	8,000,844,478.78	14.6%	6,569,258.91	14.61%
中国国际金融有限公司	2	7,260,828,509.67	13.14%	5,917,066.78	13.19%
中信证券股份有限公司	1	6,891,444,046.38	10.67%	4,689,074.57	10.44%
招商证券股份有限公司	1	4,746,209,703.68	8.6%	3,889,821.52	8.66%
申银万国证券股份有限公司	2	4,287,501,460.82	7.79%	3,389,401.26	7.57%
华泰证券股份有限公司	1	3,527,215,404.67	7.11%	3,220,368.88	7.17%
兴业证券股份有限公司	1	3,716,421,098.99	6.73%	3,044,741.68	6.78%
渤海证券股份有限公司	1	3,207,982,276.18	5.81%	2,629,293.32	5.86%
国金证券股份有限公司	1	2,627,726,940.23	4.79%	2,092,844.39	4.66%
光大证券股份有限公司	1	1,700,981,046.82	3.08%	1,394,713.88	3.11%
海通证券股份有限公司	1	1,698,326,626.82	3.08%	1,362,625.18	3.10%
合计	14	56,201,696,959.31	100.00%	44,896,211.06	100.00%

2. 债券交易情况

券商名称	债券成交金额(元)	占债券成交总额的比例
中国国际金融有限公司	49,962,918.30	53.80%
国信证券有限责任公司	30,033,966.60	33.00%
国泰君安证券股份有限公司	6,122,686.20	6.73%
光大证券股份有限公司	4,103,403.90	4.51%
华泰证券股份有限公司	1,773,886.00	1.96%
中银国际证券有限责任公司	4,217.50	0.00%
合计	91,001,049.50	100.00%

3. 债券回购交易情况

券商名称	债券回购成交金额(元)	占债券回购成交总额的比例
国信证券有限责任公司	1,783,900,000.00	38.73%
兴业证券股份有限公司	1,102,400,000.00	23.94%
中银国际证券有限责任公司	900,000,000.00	19.54%
招商证券股份有限公司	369,300,000.00	7.93%
国泰君安证券股份有限公司	300,000,000.00	6.52%
光大证券股份有限公司	160,000,000.00	3.47%
合计	4,605,600,000.00	100.00%

4. 权证交易情况

券商名称	权证成交金额(元)	占权证成交总额的比例
中信证券股份有限公司	87,690,848.63	47.88%
国信证券有限责任公司	40,274,693.34	21.90%
华泰证券股份有限公司	31,663,072.34	17.21%
中国国际金融有限公司	14,724,148.20	8.01%
国信证券有限责任公司	4,004,284.58	2.2%
兴业证券股份有限公司	3,052,893.30	1.65%
中银国际证券有限责任公司	2,436,966.58	1.32%
合计	183,394,768.02	100.00%

注:(1) 上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的证券结算风险基金;

(2) 报告期内,本基金新增席位为中银国际、海通证券、华泰证券、华泰证券、华泰证券,其它席位未发生变化;

(3) 租用证券公司专用席位的选择标准主要包括:券商基本信用评级(财务状况、经营状况)、券商研究报告评价报告质量、及时性数量和、券商每日信息评价(及时性及有效性)和券商作为表现评价等四个方面;

(4) 租用证券公司专用席位的程序:首先根据租用证券公司专用席位的选择标准进行综合评价,然后根据评价选择基金专用席位。研究部提交方案,并上报公司批准。

(九) 报告期内基金披露的其他重要事项

(十) 报告期内聘任或解聘基金经理

序号	基金经理	披露日期
1	交银施罗德精选股票证券投资基金第二次分红公告	(《中国证券报》) 2007年1月4日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选股票证券投资基金申购费率调整的公告	(《中国证券报》) 2007年1月18日
3	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行办理定期定额投资业务的公告	(《中国证券报》) 2007年1月18日
4	交银施罗德基金管理有限公司关于增加国都证券有限责任公司为场外代销机构的公告	(《中国证券报》) 2007年1月18日
5	交银施罗德精选股票证券投资基金季度报告(2006年第四季度)	(《中国证券报》) 2007年1月19日
6	交银施罗德基金管理有限公司关于对交银施罗德精选股票证券投资基金实施基金份额拆分和限购的公告	(《中国证券报》) 2007年1月23日
7	交银施罗德精选股票证券投资基金恢复日常申购和转换入业务的	