

# 2008年年度报告摘要

注：本期累计买入金额/卖出金额 成交金额 成交均价/成交数量 期间，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	601398	工商银行	486,940,690.58
2	600016	民生银行	459,057,651.23
3	601898	中煤能源	450,118,646.51
4	600019	宝钢股份	408,431,899.11
5	601318	中国平安	326,083,665.38
6	600005	武钢股份	315,340,530.18
7	000002	万科A	306,200,377.38
8	600000	浦发银行	305,407,951.66
9	601186	中国铁建	304,674,345.34
10	000898	被服股份	301,163,746.64
11	601601	中国太保	276,340,833.79
12	000968	煤气化	266,580,951.67
13	000024	招商地产	266,042,585.34
14	600031	三一重工	233,871,198.50
15	600795	国电电力	226,409,392.87
16	600900	华电国际	223,044,273.06
17	000839	中信国安	219,584,841.04
18	000669	华鲁恒升	209,729,121.91
19	600585	海螺水泥	203,406,686.20
20	601001	大秦铁路	203,109,389.71
21	600030	中信证券	191,511,964.22
22	601699	招商环保	182,017,748.58
23	600036	招商银行	182,013,958.38
24	601088	中国神华	177,354,222.78
25	600631	百联股份	177,309,019.09

注：本期累计卖出金额/卖出成交金额 成交均价/成交数量 期间，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

		单位:人民币元	
买入股票的成本(成交总额)	卖出股票的收入(成交总额)		
		13,494,608,034.67	13,806,820,497.64

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额 成交均价/成交数量 期间，不考虑相关交易费用。

8.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	--	--
2	央行票据	341,140,000.00	7.71
3	金融债券	--	--
4	企业债	34,405,337.43	0.78
5	企业短期融资券	--	--
6	可转换债券	--	--
7	其他	--	--
8	合计	375,545,337.43	8.49

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	占基金资产净值比例(%)
1	0801064	08央行票据64	2,500,000	243,250,000.00	5.30
2	0801095	08央行票据95	1,000,000	97,890,000.00	2.21
3	126018	08浦江债	464,720	33,752,613.60	0.76
4	112005	08万科G1	3,498	374,076.12	0.01
5	112006	08万科G2	2,629	278,647.71	0.01

8.7 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发生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。

8.9.2 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。

8.9.3 其他资产构成

		单位:人民币元	
序号	名称	金额	
1	存出保证金	1,281,224.83	
2	应收证券清算款	--	
3	应收股利	--	
4	应收利息	--	
5	应收申购款	--	
6	其他应收款	20,223,836.43	
7	其他	--	
8	合计	28,838,039.41	

8.9.4 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.9 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.10 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.11 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.12 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.13 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.14 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.15 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.17 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.18 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.19 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.20 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.21 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.22 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.23 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.24 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.25 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.26 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.27 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.28 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.29 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.30 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.31 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.32 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.33 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.34 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.35 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.36 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.37 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.38 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.39 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.40 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.41 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.42 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.43 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.44 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.45 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.46 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.47 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.48 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.49 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.50 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.51 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.52 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.53 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.54 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.55 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.56 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.57 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.58 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.59 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.60 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.61 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.62 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.63 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.64 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.65 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.66 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.67 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.68 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.9.69 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1.1 重要提示

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本年度报告自 2008 年 1 月 1 日起至 2008 年 12 月 31 日止。

2.1 基金基本情况

基金名称	交银成长
股票代码	前 601902,后 519903
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 10 月 23 日
报告期末基金份额总额	2,879,656,334.56
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

本基金属于成长型股票基金,主要通过投资于经过严格的质量筛选且具有良好成长性的上市公司股票,在适度控制风险的前提下,追求超越收益,为基金份额持有人谋求长期稳定的资本增值。

本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化,以及上市公司成长潜力的基础上,通过优选成长性好、成长具有可持续性、成长质量良好、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。

业绩比较基准:75%\*新华富时 A600 成长指数+25%\*新华富时中国国债指数。

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种。

2.3 基金管理人基本情况

项目	基金管理人	基金托管人
名称	交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
法定代表人	陈超	李秀芳
联系电话	021-61050550	010-68424199
电子邮箱	xsp@jysd.com, disclosure@jysd.com	litang@abcchina.com
客户服务电话	400-700-5000,021-61055000	95599
传真	021-61055034	010-68424181

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的网址: www.jysd.com, www.locomotord.com

基金年度报告备置地点: 基金管理人办公场所

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标

	2008 年	2007 年	2006 年 12 月 31 日至 2007 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,680,937,463.44	5,965,795,360.83	145,924,131.61
本期利润	-4,056,238,063.16	5,599,622,714.60	2,580,668,491.05
加权平均基金份额本期利润	-1.3009	1.5153	0.3475
本期基金份额净值增长率	-45.11%	124.76%	33.11%

3.1.2 期末数据和指标

	2008 年	2007 年	2006 年 10 月 23 日至 2006 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额总额	0.5364	1.5027	0.0182
期末基金资产净值	4,424,255,986.88	8,783,762,792.12	10,823,430,943.07
期末基金份额净值	1.5364	2.7993	1.3311

注:1、本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低于所列数字。

2、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 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	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③	④	
过去三个月	-11.60%	1.88%	-11.85%	2.33%	0.25%	-0.45%
过去六个月	-21.76%	1.79%	-26.43%	2.28%	4.67%	-0.49%
过去一年	-45.11%	1.98%	-54.48%	2.28%	9.37%	-0.30%
自基金合同生效日起至 2008 年 10 月 23 日止	64.20%	1.97%	12.18%	1.95%	52.02%	0.02%

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

注:报告截止日 2008 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.5364 元,基金份额总额 2,879,656,334.56 份。

7.2 利润分配

会计主体:交银施罗德成长股票证券投资基金

本报告期:2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

项目	附注号	2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日	2007 年 01 月 01 日至 2007 年 12 月 31 日
一收入		-3,864,392,564.33	5,846,884,914.85
1.利息收入		24,662,335.42	13,438,253.11
其中:存款利息收入	7.4.7.11	11,005,901.92	5,333,489.66
债券利息收入		13,490,709.91	8,104,765.45
2.投资收益		-1,516,140,976.86	6,182,781,920.82
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-1,552,728,472.19	6,114,707,294.06
债券投资收益	7.4.7.13	1,461,127.12	7,643,074.57
3.公允价值变动收益		-5,857,451.99	25,215,694.25
4.其他收入	7.4.7.15	40,983,820.20	3,355,827.94
5.公允价值变动收益	7.4.7.16	-2,375,300,599.72	-366,172,646.23
6.其他收入	7.4.7.17	2,386,676.83	16,837,387.15
二费用		-191,845,498.83	-247,262,200.25
1.管理人报酬		-96,553,630.28	-114,664,198.90
2.托管费		-16,092,271.66	-19,110,699.92
3.销售服务费		--	--
4.交易费用	7.4.7.18	-77,707,194.00	-109,473,062.10
5.利息支出		-1,008,766.63	-3,480,753.37
其中:卖出回购金融资产支出		-1,008,766.63	-3,480,753.37
6.其他费用	7.4.7.19	-483,766.26	-533,485.96
三、利润总额		-4,066,238,063.16	5,599,622,714.60
四、净利润		-4,066,238,063.16	5,599,622,714.60

7.3 所有者权益(或基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德成长股票证券投资基金

本报告期:2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

项目	2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日	2007 年 01 月 01 日至 2007 年 12 月 31 日
一、期初所有者权益	3,137,849,036.59	5,646,013,755.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	-4,056,238,063.16	-4,056,238,063.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-258,192,702.03	-45,176,040.05
其中:1.基金申购款	1,057,124,603.28	1,326,222,810.12
2.基金赎回款	-1,315,317,305.31	-1,371,398,850.17
四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动	-258,192,702.03	-45,176,040.05
五、其他所有者权益变动	1,057,124,603.28	1,326,222,810.12
六、其他	-	-
七、期末所有者权益	3,137,849,036.59	5,646,013,755.