# 2008年年度报告摘要

**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**
**报告送出日期:2009年03月26日**

## §1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")根据本基金合同规定,于2009年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自2008年1月1日起至12月31日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 交银施罗德稳健配置混合 |
| 基金主代码 | 519690 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年04月14日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,049,320,927.34 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 下属两类基金的交易代码 | 519690 |
| 基金管理人注册地 | 上海浦东新区 |
| 基金托管人注册地 | 北京市西城区 |
| 基金合同生效日 | 2006年04月14日 |
| 基金管理人办公地址 | 上海浦东新区 |
| 基金托管人办公地址 | 北京市西城区 |
| 基金管理人邮政编码 | 200120 |
| 基金托管人邮政编码 | 100037 |
| 基金管理人电话 | 021-61055050 |
| 基金托管人电话 | 010-67595003 |
| 基金管理人电子信箱 | xxpl@jysld.com |
| 基金托管人电子信箱 | yindong@ccb.cn |
| 基金管理人网址 | www.jysld.com |
| 基金托管人网址 | www.bocomschroder.com |
| 基金管理人办公地址 | 上海浦东新区 |
| 基金托管人办公地址 | 北京市西城区 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在控制风险并获得稳定收益的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将根据宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望,结合自上而下的宏观经济分析和自下而上的个股精选,在股票、债券、现金等资产之间进行动态配置,并在股票、债券等大类资产内部进行结构调整。 |
| 业绩比较基准 | 65%×MSCI A+35%×中信标普全债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金,其风险收益特征一般低于股票型基金,高于债券型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| | | |
|---|---|---|
| 名称 | 交银施罗德基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名:王晓芳 | 姓名:王丹 |
| 联系电话 | 021-61055050 | 010-67595096 |
| 电子信箱 | xxpl@jysld.com | yindong@ccb.cn |
| 客户服务电话 | 400-700-5000,021-61055000 | 010-67595003 |
| 传真 | 021-61055034 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本年度报告摘要刊载的报纸名称 | 证券时报 |
| 登载本年度报告正文的互联网网址 | www.jysld.com,www.bocomschroder.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人办公场所 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3.1.1 本期利润 | 2008年 | 2007年 | 2006年6月14日-2006年12月31日 |
| 本期利润 | -182,787,975.32 | 5,686,607,925.37 | 474,191,557.46 |
| 加权平均净利润 | -3.1710 | 4.9172 | 0.5490 |
| 扣除非经常性损益后的加权平均净利润 | -0.1054 | 1.5945 | 0.5292 |
| 本期净利润比上年同期增减(%) | -42.93% | 106.33% | 57.11% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2008年 | 2007年 | 2006年6月14日-2006年12月31日 |
| 期末可供分配利润 | 0.2084 | 1.7816 | 0.0278 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0683 | 0.5842 | 0.0091 |
| 期末基金资产净值 | 3,684,902,954.62 | 7,762,168,485.45 | 8,694,688,444.93 |
| 期末基金份额净值 | 1.2084 | 1.3156 | 1.5197 |

注:1、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -12.44% | 2.42% | -9.59% | 1.92% | -2.85% | 0.50% |
| 过去三个月 | -24.49% | 2.11% | -20.81% | 1.89% | -3.68% | 0.22% |
| 过去六个月 | -42.93% | 2.16% | -46.18% | 1.95% | 3.25% | 0.21% |
| 过去一年 | 85.00% | 1.91% | 36.22% | 1.61% | 48.78% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今(2006年6月14日-2008年12月31日) | 85.00% | 1.91% | 36.22% | 1.61% | 48.78% | 0.30% |

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:图示日期为2006年6月14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。截至2008年12月31日,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:图示日期为2006年6月14日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度 | 应分配利润 | 分配方案 | 实际分配数 | 年末可供分配利润 | 分配率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2008年 | 7,800 | 1,147,356,788.54 | 856,972,584.86 | 2,004,329,373.40 | - |
| 2007年 | - | - | - | - | - |
| 2006年 | 0.500 | 212,042,900.95 | 74,023,057.32 | 286,065,958.27 | - |
| 合计 | 8,300 | 1,359,399,689.49 | 930,995,642.18 | 2,290,395,331.67 | - |

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司。交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月4日成立的合资基金管理公司。公司总部设于上海,注册资本为2亿元人民币。

截止到2008年12月31日,公司已经发行并管理的的基金共有七只,均为开放式基金:交银施罗德精选股票证券投资基金(基金合同生效日:2005年9月29日)、交银施罗德货币市场证券投资基金(基金合同生效日:2006年1月20日)、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2006年6月14日)、交银施罗德成长股票证券投资基金(基金合同生效日:2006年10月23日)、交银施罗德蓝筹股票证券投资基金(基金合同生效日:2007年8月8日)、交银施罗德增利债券证券投资基金(基金合同生效日:2008年3月31日)和交银施罗德环球精选价值证券投资基金(基金合同生效日:2008年8月22日)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任职日期 | 离职日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 王立平 | 基金经理 | 2007年07月04日 | - | 14年 | 硕士,曾任中国人民银行总行金融研究所研究员,中国人民银行总行货币政策司主任科员,中国人民银行总行货币政策司副处长,中国人民银行总行货币政策司处长,中国人民银行总行货币政策司副司长,中国人民银行总行货币政策司司