交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金

招募说明书(更新)摘要

(2008年第1号)

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

【重要提示】

交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经2006年4月25日中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】78号文核准募集。本基金基金合同于2006年6月14日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会审核同意,但中国证监会对本基金作出的任何决定,均不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

投资有风险,投资人在认(申)购本基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为2008年6月14日,有关财务数据和净值表现截止日为2008年3月31日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:上海市交通银行大楼二层(裙)
办公地址:上海市浦东银城中路188号交银金融大厦
邮政编码:200120
法定代表人:谢红兵
成立时间:2005年8月4日
注册资本:贰亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:陈超
电话:(021)61055050
传真:(021)61055034

交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准设立。公司股权结构如下:

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	5%

(二)主要成员情况

1.基金管理人董事会成员

彭纯先生,董事长,博士学历。历任新疆财经学院讲师、教研室主任、科研处副处长、经济研究所副所长;新疆维吾尔自治区党委政研室副处长、处长;1994年起历任交通银行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长,交通银行总行行长助理;现任交通银行执行董事、副行长。经公司股东会2007年第五次会议通过,免去公司董事谢红兵先生的职务,选举彭纯先生担任公司董事。

雷贤达先生,副董事长,学士学历,加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、施罗德投资管理(香港)有限公司执行董事、交银施罗德基金管理有限公司总经理。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

莫泰山先生,董事,总经理,硕士学历。历任中国证券监督管理委员会基金监管部副处长、办公厅主席秘书、基金监管部处长、交银施罗德基金管理有限公司副总经理。经公司股东会2007年第五次会议通过,免去公司董事周翔女士的职务,选举莫泰山先生担任公司董事。

阮红女士,董事,博士学历。历任交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、交通银行资产托管部总经理,现任交通银行投资管理部总经理。经公司股东会2007年第五次会议通过,免去公司董事金大建先生的职务,选举阮红女士担任公司董事。

吴伟先生,董事,博士学历。历任交通银行总行财会部财务处主管、副处长,总行预算财务部副总经理,现任交通银行总行预算财务部总经理。

葛礼达先生,董事,大专学历。历任施罗德集团信息技术工作集团信息技术部董事、施罗德集团首席营运官,现任施罗德集团亚太地区总裁。

孙祁祥女士,独立董事,博士学历、国务院政府特殊津贴专家、博士生导师。现任北京大学经济学院副院长、风险管理及保险学系主任。

王松奇先生,独立董事,博士学历。历任中国人民大学讲师、中国社会科学院财贸所金融研究中心研究员,现任中国社会科学院金融研究中心副主任、研究员,北京创业投资协会常务副理事长、秘书长。

陈家乐先生,独立董事,博士学历。历任香港科技大学金融学系副教授、教授,现任香港科技大学金融学系系主任。

2.基金管理人监事会成员

徐俊康先生,监事长,学士学历。曾任职于中国人民银行长宁区办事处和工商银行长宁区办事处,历任交通银行上海分行人事教育处副处长、交通银行人事教育部副总经理、总经理,交通银行党委委员、纪委书记。经公司股东会2007年第三次会议通过,免去公司监事尹宝玉女士职务,选举徐俊康先生担任公司监事。

金玉凤女士,监事,学士学历。历任海通证券有限公司办公室副主任(主持工作)、交通银行信托部主任科员、交通银行基金托管部综合处副处长、交通银行资产托管部客户服务处处长,现任交银施罗德基金管理有限公司总经理助理。

裴关淑仪女士,监事,CFA、CIPM、FRM,双硕士学位。历任施罗德投资管理(香港)有限公司资讯科技部主管、业务延续计划的负责人。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员,负责营运及IT部分。现任交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监。

3.公司高管人员

彭纯先生,董事长,博士学历。简历同上。经公司第一届董事会第二十四次会议通过,免去公司董事长谢红兵先生的职务,选举彭纯先生担任公司董事长。

莫泰山先生,董事,总经理,硕士学历。简历同上。经公司第一届董事会第二十四次会议通过,免去公司总经理雷贤达先生的职务,选举莫泰山先生担任公司总经理。

吴建中先生,督察长,大专学历。历任交通银行宁波分行副行长、行长、交通银行风险资产管理部副总经理、总经理、交通银行宁波分行行长、党委书记。

许珊燕女士,副总经理,硕士学历,高级经济师。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师,湘财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理,湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

4.本基金基金经理

郑祐先生,基金经理,CFA,美国芝加哥大学MBA。14年证券、基金从业经验。历任黑龙江省进出口公司业务代表、君安证券有限公司投资经理、广达投资管理公司投资经理、贝尔德投资银行分析师、海富通基金管理有限公司股票分析师、基金经理助理和基金经理。曾于2005年4月至2006年9月担任海富通精选证券投资基金基金经理,于2005年8月至2007年3月担任海富通股票证券投资基金基金经理,于2006年5月至2006年9月担任海富通强化回报证券投资基金基金经理,2006年10月至2007年3月担任海富通风格优势证券投资基金基金经理。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司,经本基金管理人公告自2007年7月4日起担任本基金基金经理。

历任基金经理:李旭利先生,2006年6月14日至2007年7月3日担任本基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

主席:李旭利(投资总监)
委员:莫泰山(总经理)
华昕(研究总监)
周炜炜(权益部副总经理)
项廷锋(固定收益部总经理)
上述人员之间无近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1.基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
成立时间:2004年9月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰任叁佰叁拾陆亿捌任玖佰零捌万肆任元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:尹东
联系电话:(010)67595003

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代号:HK0939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司普身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。2007年,中国建设银行的综合盈利能力达到同业领先水平,实现净利润691.42亿元,较上年上升49.27%。平均资产回报率为1.15%,平均股东权益回报率为19.50%,分别较上年提高0.23个百分点和4.50个百分点,每股盈利为0.30元,较上年提高0.09元。总资产达到65,981.77亿元,较上年增长21.10%。资产质量稳步上升,不良贷款额和不良贷款率实现双降,信贷资产质量持续改善,不良贷款率为2.60%,较上年下降0.69个百分点。拨备水平充分,拨备覆盖率为104.41%,较上年末提升22.17个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行,在伦敦、纽约、悉尼设有代表处。2006年8月24日,中国建设银行在香港与美国银行签署协定,收购美国银行在香港的全资子公司美国银行(亚洲)股份有限公司100%的股权,并于2006年12月29日完成收购交割,美国银行(亚洲)有限公司更名为“中国建设银行(亚洲)股份有限公司”。

2007年,中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的世界银行1000强中列第14位;被美国《福布斯》杂志评为全球上市公司2000强第69位;被英国《金融时报》评为“全球500强”第35位;荣获美国《环球金融》杂志“年度中国最佳银行奖”、香港《资本》杂志“中国杰出银行奖”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”、《亚洲风险》杂志“中国最佳金融风险管理奖”、《亚洲银行家》杂志“零售风险管理卓越奖”等奖项。中国建设银行在2007年首届中国基金行业年度评选中荣获“最佳托管银行奖”;荣获《财资》杂志颁发的“2007中国最佳次托管银行奖”。在取得出色的经营业绩的同时,中国建设银行亦积极承担企业公民的社会责任,2007年获得中国扶贫基金会“扶贫中国公益家”荣誉称号,获得新华网颁发的“企业社会责任贡献奖”,获得香港上市公司公会和浸会大学工商管理学院颁发的“企业社会责任奖”,连续两次获得中国红十字基金会颁发的“最具责任感企业奖”。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室,现有员工110余人。

2.主要人员情况

罗中涛,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

3.基金托管业务经营情况

截止到2008年3月31日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、鸿飞、银丰等8只封闭式证券投资基金,以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华-道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长、信达澳银领先增长、诺德价值优势、工银瑞信债券、国泰金鼎价值、富国天博、融通领先成长、华宝兴业行业精选、工银瑞信红利、泰达荷银市值优选、长城品牌优选、交银施罗德蓝筹、易方达增强回报、南方盛元红利、交银施罗德增利等58只开放式证券投资基金。

(二)基金托管人的内部控制制度

1.内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2.内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3.内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1.监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2.监督流程

(1)每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

(2)收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3)根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

(4)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台。

机构名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:上海市交通银行大楼二层(裙)
办公地址:上海市浦东银城中路188号交银金融大厦
法定代表人:谢红兵
成立时间:2005年8月4日
电话:(021)61055023
传真:(021)61055054
联系人:张蓉
客户服务电话:400-700-5000(免长途话费),(021)61055000
网址:www.jysld.com,www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、申购、赎回及转换等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.jysld.com ,www.bocomschroder.com

2.代销机构

场外代销机构

(1)中国建设银行
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(2)中国农业银行
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
电话:(010)68297268
传真:(010)85109219
联系人:蒋浩
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

(3)交通银行
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:蒋超良
电话:(021)58781234
传真:(021)58408842
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(4)广东发展银行股份有限公司
住所:广州市农林下路83号
法定代表人:李若虹
联系人:詹全鑫、张大奕
客户服务电话:(020)38322542、38322974、38322730
网址:www.gdb.com.cn

(5)中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:孔丹
电话:(010)65542337
传真:(010)65541281
联系人:王斌
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

(6)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
电话:(010)58351666
传真:(010)83914283
联系人:李群
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(7)光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
电话:(021)68816000
传真:(021)68815009
联系人:刘晨
客户服务电话:10108998
网址:www.ebscn.com

(8)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:祝幼一
电话:(021)62580818
传真:(021)62569400
联系人:苏敏棋
客户服务电话:400-8888-666,(021)962588
网址:www.gtja.com

(9)中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:黎晓宏
电话:(010)65186080
传真:(010)65182261
联系人:魏明
客户服务电话:400-8888-108(免长途费)
网址:www.csc108.com

(10)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:(021)53594566
传真:(021)53858549
联系人:金芸、杨薇
客户服务电话:400-8888-001,(021)962503
网址:www.htsec.com

(11)广发证券股份有限公司
住所:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888-875
传真:(020)87557985
联系人:肖中梅
客户服务电话:(020)87555888-875
网址:www.gf.com.cn

(12)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:肖时庆
电话:(010)66568587
联系人:郭京华
客户服务电话:800-820-1868
网址:www.chinastock.com.cn

(13)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755)82943666
传真:(0755)82943636
联系人:黄健
客户服务电话:400-8888-111,95565
网址:www.newone.com.cn

(14)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海陆家嘴东路166号中保大厦
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419974
传真:(021)68419867
联系人:杨盛芳
客户服务电话:(021)68419974
网址:www.xyzq.com.cn

(15)中信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区湖贝路1030号海龙王大厦
办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人:王东明
电话:(010)84588266
传真:(010)84865560
联系人:陈忠
客户服务电话:(010)84588903
网址:www.cs.ecitic.com

(16)湘财证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:上海浦东银城东路139号华能联合大厦五层
法定代表人:陈学荣
电话:(021)68634518
传真:(021)50543470
联系人:陈伟
客户服务电话:(021)68865020或当地营业部客服电话
网址:www.xcsc.com

(17)申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:(021)54033888
联系人:黄维琳
客户服务电话:(021)962505
网址:www.sw2000.com.cn

(18)联合证券有限责任公司
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马昭明
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492962
联系人:盛宗凌
客户服务电话:400-8888-555,(0755)25125666
网址:www.lhzq.com

(19)国都证券有限责任公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格广场45层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人:王少华
电话:(010)84183389
传真:(010)64482090
联系人:黄静
客户服务电话:800-810-8809
网址:www.guodu.com

(20)华泰证券有限责任公司
住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:(025)84457777-950、248
传真:(025)84579778
联系人:李金龙、张小波
客户服务电话:(025)84579897
网址:www.htsc.com.cn

(21)中信金通证券有限责任公司
住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人:刘军
电话:(0571)85783715
传真:(0571)85783771
联系人:王勤
客户服务电话:(0571)96598
网址:www.96598.com.cn

(22)中银国际证券有限责任公司
住所:上海市银城中路200号39层
办公地址:中国上海浦东银城中路200号中银大厦39-40层
法定代表人:平岳
联系人:张静
客户服务电话:400-620-8888
网址:www.bocichina.com

(23)中信万通证券有限责任公司
住所:青岛市东海西路28号
法定代表人:史洁民
客户服务电话:(0532)96577
网址:www.zxwt.com.cn

(24)恒泰证券有限责任公司
住所:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
法定代表人:刘汝军
客户服务电话:(0471)4960762,(021)68405273
网址:www.cnht.com.cn

(25)国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦9楼
法定代表人:何如
电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133302
联系人:林建闽
客户服务电话:800-810-8868
网址:www.guosen.com.cn

(26)国元证券股份有限公司
住所:安徽省合肥市寿春路179号
办公地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
客户服务电话:400-8888-777
网址:www.gyzq.com.cn

场内代销机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格,并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员(以下简称“有资格的上证所会员”),名单详见上海证券交易所网站:

http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjtl.jsp

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)份额登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
电话:(010)58598839
传真:(010)58598907
联系人:朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所
住所:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
联系人:廖海
经办律师:廖海、吕红

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区东昌路568号
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)61238888
传真:(021)61238800
联系人:金毅
经办注册会计师:薛竞、金毅

四、基金的名称

本基金名称:交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标: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,目下而上精选证券,有效分散风险,谋求实现基金财产的长期稳定增长。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、现金、短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的35%—95%;债券资产占基金资产净值的0%—60%;现金、短期金融工具、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的5%-65%,其中基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金的投资策略为: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。

1.资产配置

本基金将采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统,结合定性分析和定量分析进行大类资产的配置。具体而言,首先利用经济周期理论,对宏观经济的经济周期进行预测,在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断,确定基金资产在各类别资产间的分配比例,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整组合中各类资产的比例,以规避或分散市场风险,提高基金收益率。与传统的配置型基金不同,借鉴施罗德集团在平衡型基金方面成功的投资经验,本基金在资产配置方面有以下两大特点。

第一大特点是本基金管理人在进行资产配置的时候,除了考察各类资产的风险收益特征随市场环境的变化,同时关注资产之间相关性随时间的变化。对于配置型基金而言,投资于债券资产是为了分散股票资产投资的风险,以达到投资中风险和收益的最佳平衡。但是随着宏观经济环境和市场环境的变化,各类资产之间的相关性并不是一成不变的,最近一段时间的历史未必总能很好地反映未来的情况。因此,本基金管理人在“自上而下”进行资产配置的时候,除了考虑到不同经济周期下各类资产自身风险收益特征的变化,还会考察各类资产之间相关性随时间的变化,以经风险调整后的收益最大化为前提确定各类资产最优的配置比例,并随时间进行动态调整。

配置型基金灵活的资产配置使得基金管理人可以因时制宜,把握投资市场的变化趋势,在有效分散风险的同时获得长期稳定的投资回报。因此,正确把握投资市场的变化趋势对于配置型基金的成败至关重要。为了尽可能准确地把握投资市场变化的趋势,本基金管理人在对各种证券进行收益率预测的时候,一方面避免从短期的历史进行推断可能造成的错误,在合理范围内考察较长的历史区间,同时前瞻性地预测中长期经济环境的变化,并将该变化对证券未来收益的影响反映到对证券收益率的预期中去。这也是本基金的另一大特点。

具体操作中,本基金管理人采用经济周期理论下的资产配置模型,通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析,对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测,然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。

2.行业配置

本基金将通过对经济周期、产业环境、产业政策和行业竞争格局的分析和预测,确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,得出各行业的相对投资价值与投资时机,并据此对基金股票投资资产的行业分布进行动态调整。

3.股票选择

本基金综合运用施罗德集团的股票研究分析方法和经济周期理论精选股票构建成份股。具体分以下两个层次进行:

(1)品质筛选

筛选出在财务及管理品质上符合基本品质要求的上市公司。

(2)风格配置和组合优化

对备选股票进行风格分类,利用经济周期理论在不同风格类别的股票之间进行战略配置,同时结合组合优化模型以实现尽可能高的经风险调整后的收益。

4.债券投资

配置型基金中债券投资管理的目标是分散股票投资的市场风险,保持投资组合稳定收益和充分流动性,追求基金资产的长期增值。在目前中国债券市场处于制度与规则快速调整的阶段,对于债券投资组合的构建本基金管理人将采取自上而下的主动式管理,灵活运用各种消极和积极策略,寻找各种市场机会,获得超过市场水平的平均收益。消极债券投资的目标是在满足现金管理需要的基础上为基金资产提供稳定的收益。积极债券投资的目标是利用市场定价的无效率来获得低风险甚至是无风险的超额收益。

在全球经济的框架下,本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断,运用数量化工具,对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测,通过组合优化进行合理的配置。

5.权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

6.资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

九、基金的业绩比较标准

本基金的整体业绩比较基准采用:

65%×MSCI中国A股指数+35%×新华雷曼中国全债指数

如果市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人可以视情况在经过适当的程序后调整本基金的业绩比较基准,并及时公告。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告

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2008年4月18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。

本报告期为2008年1月1日至2008年3月31日。

1.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	3,544,090,277.94	60.45%
权证	574,457.50	0.01%
债券	226,818,000.00	3.87%
银行存款及清算备付金合计	2,080,295,709.97	35.48%
其他资产	11,497,245.30	0.20%
资产总值	5,863,275,690.71	100.00%

2.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	53,292,971.60	0.92%
B 采掘业	768,397,893.86	13.20%
C 制造业	1,537,422,949.10	26.41%
C0 食品、饮料	289,414,629.23	4.97%
C1 纺织、服装、皮毛	-	-
C2 木材、家具	21,690,580.56	0.37%
C3 造纸、印刷	-	-
C4 石油、化学、塑胶、塑料	622,150,353.36	10.69%
C5 电子	-	-
C6 金属、非金属	48,053,579.46	0.83%
C7 机械、设备、仪表	362,548,026.09	6.23%
C8 医药、生物制品	171,891,010.40	2.95%
C99 其他制造业	21,674,770.00	0.37%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E 建筑业	34,428,044.70	0.59%
F 交通运输、仓储业	70,757,000.00	1.22%
G 信息技术业	38,009,955.18	0.65%
H 批发和零售贸易	703,964,392.54	12.10%
I 金融、保险业	225,190,000.00	3.87%
J 房地产业	6,844,000.00	0.12%
K 社会服务业	34,948,144.00	0.60%
L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	70,834,926.96	1.22%
合计	3,544,090,277.94	60.90%

3.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	000792	盐湖钾肥	2,883,283	246,809,024.80	4.24%
2	600036	招商银行	7,000,000	225,190,000.00	3.87%
3	000983	西山煤电	5,399,911	221,666,346.55	3.81%
4	600859	王府井	5,460,738	214,333,966.50	3.68%
5	600596	新安股份	2,720,486	184,993,048.00	3.18%
6	000568	泸州老窖	2,700,000	167,400,000.00	2.88%
7	000937	金牛能源	3,849,900	146,257,701.00	2.51%
8	600997	开滦股份	3,880,924	142,740,384.72	2.45%
9	600150	中国船舶	1,166,532	141,815,295.24	2.44%
10	002152	广电运通	1,528,488	128,775,114.00	2.21%

4.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	137,124,000.00	2.36%
金融债	89,694,000.00	1.54%
企业债	-	-
可转换债券	-	-
合计	226,818,000.00	3.90%

5.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	0701031	07央行票据31	1,000,000	97,120,000.00	1.67%
2	060218	06国开18	900,000	89,694,000.00	1.54%
3	0501043	05央行票据43	400,000	40,004,000.00	0.69%

6.报告期期末未持有资产支持证券。

7.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)
存出保证金	1,243,754.79
买入返售金融资产	-
应收证券交易清算款	3,541,101.47
应收利息	6,202,648.84
应收股利	-
应收申购款	509,740.20
其他资产	-
合计	11,497,245.30

(4)报告期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明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额(元)
1	580019	石化CWB1	278,053	790,706.99

(6)交银施罗德基金管理有限公司期末持有本基金份额36,169,956.19份,占本基金期末总份额的1.57%,报告期内未发生申购、赎回。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2008年3月31日,所载财务数据未经审计师审计。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下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。

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
过去三个月	(19.25%)	2.35%	(17.81%)	1.86%	(1.44%)	0.49%
自基金合同生效日起至今(2006年6月14日-2008年3月31日)	161.75%	1.82%	108.03%	1.41%	53.72%	0.41%

2. 基金合同生效