

# 交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金 2008年上半年度报告摘要

报告期年份:2008年上半年度  
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司

报送日期:2008年8月26日  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

## 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。半年报披露日起三至三个工作日内，由董事签字同意，并由董事长签发。

本基金的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”)根据本基金合同的规定，于2008年8月25日复核了本报告的财务指标、净值表现、财务报表、收费会计报告、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。

基金的历史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。

本报告财务资料未经审计。

本半年度报告摘要能简要地半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

## 一、基金简介

## (一) 基金概况

基金名称:交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金

基金简称:交银稳健

交易代码:519690(前端收费模式), 519691(后端收费模式)

基金份额运作方式:契约型开放式基金

基金合同生效日:2006年6月14日

报告期末基金份额总额:3,468,346,459.21份

基金合同存续期:不定期

(二) 基金投资概况

## 1. 基金投资目标

本基金将坚持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，自下而上灵活配置资产，有效分散风险，寻求实现基金财产的长期稳定增长。

## 2. 投资策略

本基金采取的投资策略是: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，自下而上精选证券，有效分散风险。本基金利用经济周期理论，对宏观经济的运行情况往和预期进行预测，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，伴随着各类型金融产品收益率的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，以规避分散投资风险，提高基金收益。

## 3. 绩效比较基准

本基金的绩效比较基准采用:65%×MSCI中国A股指数+35%×新华富时中国全债指数。

## 4. 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。

## (三)基金管理人

名称:交银施罗德基金管理有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1号10层

邮编编码:200120

法定代表人:彭彤

信息披露负责人:陈超

联系电话:021-61065034

电子信箱:xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com

## (四) 基金托管人

名称:中国建设银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街25号

邮编编码:100036

法定代表人:郭树清

信息披露负责人:尹东

联系电话:010-66769003

传真:010-66276595

电子信箱:yjdc@ccb.com

## (五) 信息披露部

信息披露致谢:《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

基金管理人网址:www.jysld.com, www.bocomschroder.com

基金半年度报告所载地点:基金管理人的办公场所

## 二、主要财务指标和净值表现

## (一) 主要会计数据和财务指标

指标名称 2008年1月1日至2008年6月30日

本期利润(元) 1,850,181,258.24

本期期间平均公允价值变动损益的金额(元) 365,731,504.05

加权平均基金份额利润率(%) (0.0799)

期末(可供分配)基金份额利润(元) 2,081,938,971.59

份额累计净值增长率 144.98%

注:以上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;

## (二) 基金净值表现

1. 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的变动情况表

单位:人民币元/份

项目 2008年1月1日至2008年6月30日

净值增长率 (%) 175% (142%)

业净值标准差 (%) 224% 61% (0.49%)

过去1个月 86% 17% (173%)

过去3个月 204% (320%) 21% (102%)

过去6个月 219% (320%) 201% 76% 0.1%

过去1年 40% 198% (151%) 172% 155% 0.2%

过去3年 - - - - -

自基金合同生效日至今年 (2006年6月14日至2008年6月30日) 144.99% 185% 72.01% 15% 72.98% 0.32%

注:上表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. 基金合同生效以来本基金净值的变动情况, 并与同期业绩比较基准的变动进行比较

本基金合同生效应与同期业绩比较基准的走势图

(注:基金在任何交易日买入认购的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的5%;

9) 投资人不能低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内政府债券;

(10) 本基金投资于货币市场基金的品种, 不得超过该货币市场基金总资产的10%;

(11) 本基金持有的同一银行同一期限级别的资产支持证券的品种, 不得超过该资产支持证券规模的10%;

(12) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的10%;

(13) 同一基金管理公司管理的全部资产支持基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过该类资产支持证券规模的10%;

(14) 本基金持有的全部资产, 包括证券投资基金、股票、债券、基金、基金投资、基金资产、基金资产净值, 不得超过其净资产的20%;

(15) 法律法规或监管机构限制的其他情形除外, 则本基金不受上述限制。

因证券市场价格波动, 上市公司合并、基金规模变动, 股票分派或支付对价等基金管理人之外的因素致使基金资产净值发生较大波动的, 基金管理人应当在10个交易日内进行公告, 基金管理人应当自该日起10个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定; 截至2008年6月30日, 本基金符合上述投资比例的约定。

## 三、基金管理人情况

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2006年4月1日正式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。

截至到2008年6月底, 本公司已经发行并管理的基金共有六只, 均为开放式基金: 交银施罗德精选股票型证券投资基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金、交银施罗德蓝筹股票型证券投资基金和交银施罗德债券型证券投资基金已于2006年5月29日正式生效; 交银施罗德成长股票型证券投资基金已于2006年10月13日正式生效; 交银施罗德货币市场证券投资基金已于2006年10月14日正式生效; 交银施罗德深证蓝筹股票型证券投资基金已于2006年10月15日正式生效; 交银施罗德货币市场证券投资基金已于2007年8月8日正式生效; 交银施罗德货币型证券投资基金已于2008年3月1日正式生效。

## (一) 基金经理人员情况

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2006年4月1日正式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。

截至到2008年6月底, 本公司已经发行并管理的基金共有六只, 均为开放式基金: 交银施罗德精选股票型证券投资基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金、交银施罗德蓝筹股票型证券投资基金和交银施罗德债券型证券投资基金已于2006年5月29日正式生效; 交银施罗德成长股票型证券投资基金已于2006年10月13日正式生效; 交银施罗德货币市场证券投资基金已于2006年10月14日正式生效; 交银施罗德深证蓝筹股票型证券投资基金已于2006年10月15日正式生效; 交银施罗德货币型证券投资基金已于2007年8月8日正式生效; 交银施罗德货币型证券投资基金已于2008年3月1日正式生效。

## (二) 基金经营情况

陈治先, 基金经理, CFA, 美国芝加哥大学MBA, 14年证券从业经验, 历任黑龙江省进出口公司业务代表, 贵阳证券公司投资经理, 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投资分析师, 基金经理助理、基金经理。曾于2006年4月至2006年9月担任海富通精选股票投资基金基金经理, 于2006年5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10月至2007年3月担任海富通货币型证券投资基金基金经理, 于2007年4月至2007年7月担任海富通货币型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。2007年7月4日起担任本基金基金经理。

陈治先先生, 2006年6月14日至2007年7月3日期间担任本基金基金经理。

注:报告期内, 本基金基金经理无变更说明

本基金报告期内, 本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为规范指导意见》、基金合同的有关规定, 基本符合有关规定, 不存在损害基金持有人利益的行为。

报告期间内, 公司严格执行公平交易制度, 公平对待旗下各投资基金, 所管理的不同投资组合的整体收益率、分类资产类别(股票、债券)的收益率以及不同时间区间(同日内、5日内、10日内)向同交易的交

易报告期间内买入股票的成本总额为4,296,827,491.13元, 卖出股票的收入总额为5,339,265,387元。

报告期间内, 本基金管理人严格执行公平交易制度, 公平对待旗下各投资基金, 所管理的不同投资组合的整体收益率、分类资产类别(股票、债券)的收益率以及不同时间区间(同日内、5日内、10日内)向同交易的交

易报告期间内买入股票的成本总额为4,296,827,491.13元, 卖出股票的收入总额为5,339,

报告期间内, 本基金管理人严格执行公平交易制度, 公平对待旗下各投资基金, 所管理的不同投资组合的整体收益率、分类资产类别(股票、债券)的收益率以及不同时间区间(同日内、5日内、10日内)向同交易的交

易报告期间内买入股票的成本总额为4,296,827,491.13元, 卖出股票的收入总额为5,339,