

## 交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金

[2009]第四季度报告

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:二〇一〇年一月二十一日

基金管理人的董事会及基金管理人和基金托管人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对基金内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人:中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2010年1月20日复核了本报吿中的财务指标、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。

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未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报吿中财务数据未经审计。

本报告期自2009年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称:交银稳健配置混合

基金主代码:519690

前端交易代码:519690

后端交易代码:519691

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2006年6月14日

报告期末基金份额总额:4,839,757,824.32份

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风险管理能力,根据宏观经济形势和市场环境的变化,善于把握市场投资机会,精选个股,有效分散风险,力求实现基金资产的长期稳健增值。

根据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,并分散风险。

业绩比较基准:65%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资产中国全债指数

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。

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2009年10月1日-2009年12月31日)

1.本期已实现收益 518,117,163.70

2.本期利润 1,773,455,999.12

3.期初平均基金份额本期利润 0.3374

4.期末基金份额净值 10,846,268,794.78

5.期末基金份额总额 2,2411

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 本报吿期基金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 16.53% 1.64% 12.44% 1.13% 4.09% 0.51%

自基金合同生效日起至今 243.10% 1.93% 114.10% 1.53% 129.00% 0.40%

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

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 16.53% 1.64% 12.44% 1.13% 4.09% 0.51%

自基金合同生效日起至今 243.10% 1.93% 114.10% 1.53% 129.00% 0.40%

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起至6个月。截至2009年12月31日,本基金各项资产配置比例符合基金合同及相关说明书中投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

李立 本基金的基金经理,交银施罗德精选股票型证券投资基金基金经理,交银施罗德基金管理有限公司权益部副总经理

2009-8-21 - 8年 李立先生,中国国籍,经济学硕士,历任中国科技大学金融系高级工程师,招商基金管理有限公司股票投资高级经理,2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,曾任投资研究部基金经理助理,现任基金经理。

华昕 本基金的基金经理,公司研究总监 2009-9-10 - 13年 华昕先生,中国国籍,华东师范大学MBA,历任北京房地产信托投资公司上海业务部证券分析研究员,日兴证券有限公司证券投资分析师和提升部门经理,中国研究院主管,中银国际控股有限公司投行部总经理,2008年1月加入交银施罗德基金管理有限公司。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 公平交易制度的执行情况

4.5 公平交易制度的执行情况

4.6 公平交易制度的执行情况

4.7 公平交易制度的执行情况

4.8 公平交易制度的执行情况

4.9 公平交易制度的执行情况

4.10 公平交易制度的执行情况

4.11 公平交易制度的执行情况

4.12 公平交易制度的执行情况

4.13 公平交易制度的执行情况

4.14 公平交易制度的执行情况

4.15 公平交易制度的执行情况

4.16 公平交易制度的执行情况

4.17 公平交易制度的执行情况

4.18 公平交易制度的执行情况

4.19 公平交易制度的执行情况

4.20 公平交易制度的执行情况

4.21 公平交易制度的执行情况

4.22 公平交易制度的执行情况

4.23 公平交易制度的执行情况

4.24 公平交易制度的执行情况

4.25 公平交易制度的执行情况

4.26 公平交易制度的执行情况

4.27 公平交易制度的执行情况

4.28 公平交易制度的执行情况

4.29 公平交易制度的执行情况

4.30 公平交易制度的执行情况

4.31 公平交易制度的执行情况

4.32 公平交易制度的执行情况

4.33 公平交易制度的执行情况

4.34 公平交易制度的执行情况

4.35 公平交易制度的执行情况

4.36 公平交易制度的执行情况

4.37 公平交易制度的执行情况

4.38 公平交易制度的执行情况

4.39 公平交易制度的执行情况

4.40 公平交易制度的执行情况

4.41 公平交易制度的执行情况

4.42 公平交易制度的执行情况

4.43 公平交易制度的执行情况

4.44 公平交易制度的执行情况

4.45 公平交易制度的执行情况

4.46 公平交易制度的执行情况

4.47 公平交易制度的执行情况

4.48 公平交易制度的执行情况

4.49 公平交易制度的执行情况

4.50 公平交易制度的执行情况

4.51 公平交易制度的执行情况

4.52 公平交易制度的执行情况

4.53 公平交易制度的执行情况

4.54 公平交易制度的执行情况

4.55 公平交易制度的执行情况

4.56 公平交易制度的执行情况

4.57 公平交易制度的执行情况

4.58 公平交易制度的执行情况

4.59 公平交易制度的执行情况

4.60 公平交易制度的执行情况

4.61 公平交易制度的执行情况

4.62 公平交易制度的执行情况

4.63 公平交易制度的执行情况

4.64 公平交易制度的执行情况

4.65 公平交易制度的执行情况

4.66 公平交易制度的执行情况

4.67 公平交易制度的执行情况

4.68 公平交易制度的执行情况

4.69 公平交易制度的执行情况

4.70 公平交易制度的执行情况

4.71 公平交易制度的执行情况

4.72 公平交易制度的执行情况

4.73 公平交易制度的执行情况

4.74 公平交易制度的执行情况

4.75 公平交易制度的执行情况

4.76 公平交易制度的执行情况

4.77 公平交易制度的执行情况

4.78 公平交易制度的执行情况

4.79 公平交易制度的执行情况

4.80 公平交易制度的执行情况

4.81 公平交易制度的执行情况

4.82 公平交易制度的执行情况

4.83 公平交易制度的执行情况

4.84 公平交易制度的执行情况

4.85 公平交易制度的执行情况

4.86 公平交易制度的执行情况

4.87 公平交易制度的执行情况

4.88 公平交易制度的执行情况

4.89 公平交易制度的执行情况

4.90 公平交易制度的执行情况

4.91 公平交易制度的执行情况

4.92 公平交易制度的执行情况

4.93 公平交易制度的执行情况

4.94 公平交易制度的执行情况

4.95 公平交易制度的执行情况

4.96 公平交易制度的执行情况

4.97 公平交易制度的执行情况

4.98 公平交易制度的执行情况

4.99 公平交易制度的执行情况

4.10 公平交易制度的执行情况

4.11 公平交易制度的执行情况

4.12 公平交易制度的执行情况

4.13 公平交易制度的执行情况

4.14 公平交易制度的执行情况

4.15 公平交易制度的执行情况

4.16 公平交易制度的执行情况

4.17 公平交易制度的执行情况

4.18 公平交易制度的执行情况

4.19 公平交易制度的执行情况

4.20 公平交易制度的执行情况

4.21 公平交易制度的执行情况

4.22 公平交易制度的执行情况

4.23 公平交易制度的执行情况

4.24 公平交易制度的执行情况

4.25 公平交易制度的执行情况

4.26 公平交易制度的执行情况

4.27 公平交易制度的执行情况

4.28 公平交易制度的执行情况

4.29 公平交易制度的执行情况

4.30 公平交易制度的执行情况

4.31 公平交易制度的执行情况

4.32 公平交易制度的执行情况

4.33 公平交易制度的执行情况

4.34 公平交易制度的执行情况

4.35 公平交易制度的执行情况