Explico un poco el código:  
Se han creado dos variables @fecha y @archivo, @fecha es la fecha en la que sea creado el respaldo, es una buena practica ponerle la fecha para identificar la antigüedad del respaldo. La otra variable es @archivo la cual contiene la ruta en la que se guardara el respaldo, si lo hacen directamente en la raíz de la unidad "C" es posible que tengan problemas de permiso de escrituras, por eso les recomiendo que coloquen el respaldo en una carpeta. Donde dice  "nombre\_de\_su\_base" deben cambiarlo por nombre  de la base a la cual se le generara un respaldo de seguridad.  
El resto del código es Transact-SQL, les dejo la siguiente URL para enriquezcan mas los conocimiento del mismo: <http://msdn.microsoft.com/es-es/library/ms189826(v=SQL.90).aspx>