

交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金

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：二〇一七年三月二十九日

1.1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员在本基金报告期间内未出现虚假记载、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。
本年度报告已由三分之一以上独立董事签字同意，并经董事长签章。

4.2 报告期内基金业绩表现

本基金在2015年10月底开始建仓，目前基本完成了建仓运作，未来计划在市场回调中逐步提高仓位。

本基金报告表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于2017年3月24日批准报出。

4.3 财务报告

本基金财务报告表按照财政部于2006年2月15日及以期间颁布的《企业会计准则—基本原则》，各项具体会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）编制，符合企业会计准则的规定。

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”）根据本基金合同的规定，于2017年3月28日核对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，确认本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要自公告之日起文本报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年10月20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	交银施罗德经济动力混合
基金代码	530797
交易账户	530797
基金销售方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-10-20
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
报告期末基金总资产	697,677,900.73
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金通过深度挖掘在经济新常态下受益于发展新动力的优质企业， 分别从行业景气度、公司治理和行业发展趋势等角度出发，力争实现基金资产的长期增值。

投资策略 本基金分析宏观经济形势，在分析和判断宏观经济形势和金融市场的变化趋势的基础上，结合对股票市场的深入研究，精选具有持续竞争优势的上市公司，通过积极主动的资产配置，力求在控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数

风险收益特征 本基金是一只股票型基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、短期债券基金，属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	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
住所	上海市浦东新区银城中路16号	北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人	李文宾	田国立
联系人	021-67500000	010-67500000
电子邮箱	xyq@jzsf.com.cn; dianxiao@jzsf.com.cn	tianli@ccb.com
客户服务电话	400-700-0000; 021-61666000	010-67500000
传真	021-61666064	010-66297693

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的指定网址 www.jzsf01.com, www.jzsfchina.com

基金半年度报告备查地址 本公司住所地

基金管理人办公场所

§ 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

2.11 期间数据和指标		2016年10月20日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
本期末期初基金总资产	-	1,742,063,668	
本期期末基金总资产	-	-3,006,823,150	
本期平均基金份额净值	-0.0119		
报告期末基金份额总额	-1.21%		

3.2 期间数据和指标

2016年末

期末可供分配基金份额总额 -0.012

报告期末基金资产净值 840,242,760.00

报告期末可供分配基金份额总额 0.0079

注：本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%，每日计算。

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

3.3.1 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	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率为	差额
份额净值	-1.21%	0.47%	-0.62%
基金份额净值	0.44%	-0.30%	0.03%
份额净值	-0.03%	-0.03%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%，每日计算。

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

3.3.2 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

2.12 期间数据和指标		2016年10月20日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
本期末期初基金总资产	-	1,742,063,668	
本期期末基金总资产	-	-3,006,823,150	
本期平均基金份额净值	-0.0119		
报告期末基金份额总额	-1.21%		

3.4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1 基金管理人及基金经理的基本情况

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，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司共同发起设立。公司成立于2005年8月4日，注册资本在中国上海，注册资本金为人民币1亿元。其中，交通银行股份有限公司持有65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有30%的股份，中国国海国际海运集装箱(集团)股份有限公司和交银施罗德资产管理有限公司各持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理(香港)有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的69只基金，其中股票型基金规模占65%，货币型基金规模占30%，债券型基金规模占5%，保本型基金规模占1%。

4.1.2 基金经理（或基金经理助理）及基金经理的简介

4.1.2.1 管理人对报告期内基金运作总体评价

本报告期内，本基金严格遵守法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.2 对报告期内基金运作的回顾

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.3 对报告期内基金投资策略和业绩表现的评价

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.4 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.5 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.6 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.7 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.8 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.9 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.10 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.11 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.12 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.13 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.14 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.15 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.16 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.17 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.18 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.19 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.20 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.21 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.22 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.23 对基金未来业绩的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.24 对基金未来投资策略的展望

本报告期内，本基金严格按照基金合同的约定，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

4.1.2.25 对基金未来业绩的展望