

中银全球策略证券投资基金(FOF)

2012第一季度报告

2012年3月31日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告期出报告日:二〇一二年四月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及监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，并对内容的真实性、准确性和完整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本基金合同规定，于2012年4月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，复核结果显示，报告的内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人和基金托管人保证基金信息真实、准确、完整，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金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银全球策略(FOF-FOF)
基金代码	163813
交易代码	163813
基金合作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月13日
报告期末基金份额总额	494,477,220.10份

投资策略：在未来的数月为经济增长及股市稳定提供支撑。我们会持续关注美国及新兴市场在调整后带来的介入机会。
作为基金管理人，我们将一如既往地依据团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

§3 投资组合报告

§3.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,077,147.31	1.08
	其中：普通股	5,077,147.31	1.08
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托	—	—
2	基金投资	386,523,528.88	82.31
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	73,627,699.47	15.68
7	银行存款和结算备金合计	4,344,016.54	0.93
8	其他各项资产	469,572,392.20	100.00

业绩比较基准 60%×MSCI 所在国家指数+40%×MCSI All Country World Index+10%×3月政府债券+5%×3 Month T-Bills 择权指数。

风险收益特征 本基金为货币基金，预期风险与收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

基金管理人 中银基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

境外托管人英文名称 Rank of New York Mellon

境外托管人中文名称 纽约托管银行

§3.2 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期 2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -7,470,834.42

2.本期利润 61,091,495.09

3.加权平均基金份额本期利润 0.0619

4.期末基金资产净值 438,568,530.38

5.期末基金份额净值 0.887

注:①本基金的基金指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后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)减除相关费用后的余额,本期利润为当期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.3 基金净值表现

3.3.1 本基金报告期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

报告期 2012年1月1日至2012年3月31日

3.3.2 本基金合同生效以来基金资产份额净值的月度表现

3.3.3 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.4 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.5 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.6 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.7 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.8 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.9 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.10 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.11 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.12 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.13 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.14 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.15 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.16 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.17 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.18 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.19 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.20 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.21 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.22 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.23 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.24 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.25 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.26 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.27 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.28 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.29 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.30 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.31 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.32 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.33 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.34 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.35 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.36 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.37 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.38 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.39 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.40 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.41 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.42 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.43 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.44 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.45 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.46 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.47 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.48 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.49 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.50 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.51 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.52 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.53 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.54 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.55 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.56 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.57 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.58 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.59 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.60 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.61 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.62 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.63 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.64 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.65 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.66 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.67 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.68 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.69 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.70 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.71 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.72 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.73 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.74 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.75 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.76 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.77 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.78 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.79 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.80 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.81 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.82 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.83 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.84 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.85 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.86 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.87 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.88 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.89 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.90 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.91 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.92 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.93 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.94 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.95 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.96 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.97 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.98 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.99 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.100 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.101 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.102 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.103 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.104 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.105 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.106 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.107 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图

3.3.108 本基金合同生效以来基金资产净值收益率历史走势图