

基金管理人:中银基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告期截止日期:2012年4月24日  
重要提示:  
1. 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、完整性和及时性承担个别及连带责任。  
2. 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等內容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
3. 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。  
4. 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。  
5. 本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

# 中银动态策略股票型证券投资基金

## 2012 第一 季度 报告

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合			
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	96,670,000.00	6.30
3	金融债券	-	-
4	其中：政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,934,795.79	0.19
8	其他	-	-
9	合计	99,604,795.79	6.49

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110107	11央行票据79	1,000,000	96,670,000.00	6.30
2	110013	国投债	23,930	2,354,472.70	0.15
3	125887	中航转债	5,189	575,325.19	0.04
4	110015	石化转债	30	3,032.40	0.00
5	110018	国电转债	10	1,043.30	0.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.8 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.13 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.14 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.16 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.17 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.18 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.19 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.20 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.21 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.22 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.23 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.24 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.25 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.26 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.27 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.28 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.29 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.30 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.31 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.32 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.33 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.34 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.35 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.36 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.37 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.38 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.39 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.40 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.41 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.42 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.43 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.44 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.45 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.46 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.47 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.48 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.49 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.50 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.51 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.52 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.53 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.54 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.55 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.56 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.57 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.58 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.59 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.60 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.61 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.62 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.63 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.64 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.65 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.66 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.67 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.68 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.69 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.70 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.71 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.72 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.73 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.74 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.75 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.76 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.77 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.78 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.79 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.80 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.81 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.82 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.83 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.84 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.85 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.86 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.87 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.88 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.89 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.90 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.91 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.92 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.93 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.94 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.95 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.96 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.97 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.98 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.99 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.13 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.14 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.16 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.17 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.18 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.19 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.20 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.21 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.22 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.23 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.24 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.25 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.26 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.27 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.28 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.29 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.30 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.31 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.32 期末持有的处于转股期的可转换债券明细