

中银全球策略证券投资基金 (FOF) 更新招募说明书摘要

(2015年第1号)

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

二〇一五年四月

重要提示
本基金经中国证监会2010年8月19日证监许可[2010]1134号文核准募集。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于境外证券市场,基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前,投资者应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的投资意愿、目标、数额等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。本基金的主要风险一是基金投资的一般风险,包括利率风险、信用风险、交易结算风险、流动性风险等。二是全球投资的特殊风险,包括海外市场风险、汇率风险、政治风险等。三是本基金特有的风险。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读招募说明书。
基金的过往业绩并不预示其未来表现。
本招募说明书基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额时,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受,并视同《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人保证本基金招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值或收益做出实质性判断或保证,也不表明其对本基金没有投资风险。
本招募说明书所载内容截止日为2015年3月3日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年12月31日。本基金托管人中国建设银行股份有限公司已复核了本次更新的部分招募说明书中与托管业务相关的内容。

一、基金合同生效日期
2011年3月3日
二、基金名称
中银全球策略证券投资基金(FOF)

三、基金类型
基金中基金(FOF)

四、基金的投资目标
本基金投资于全球证券市场,通过资产配置和组合管理,实现组合资产的分散化投资,运用“核心—卫星”投资策略,力争实现投资组合的收益最大化,严格遵守投资纪律,追求基金长期资产增值。

五、基金的投资范围
本基金投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具,包括在与中国证监会及中国证监会派出机构备案的境外国家或地区证券监管机构登记注册的境外公募基金(包括ETF)。在与中国证监会及中国证监会派出机构备案的境外国家或地区证券市场公开发行的和挂牌交易的股票,以及货币、现金、货币市场工具、股指期货等证券和衍生品投资。本基金投资于中国境内和中国证监会允许本基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其它品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资。

本基金投资组合中,本基金的投资不低于本基金资产的60%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于本基金资产净值的5%。

六、基金的投资策略
(一)资产配置策略

本基金在资产配置采用“双层配置”策略。第一层是大类资产类别配置,第二层是在权益型资产内的核心组合与卫星组合的配置。权益型资产包括股票型基金和股票。本基金资产配置策略如图1所示。

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

图1. 资产配置策略图

过程中,本基金将灵活运用收益率曲线配置策略、市场套利策略、跨品种套利策略等积极的技术投资策略,发现、确认并利用资产定价偏离或市场不平衡等来实现投资组合的增值。本基金在整个投资决策过程中将认真遵守投资纪律并有效管理投资风险。

(二) 投资决策依据和流程
1. 投资决策依据
(1) 本基金投资遵循国家有关法律、法规和基金合同等的有关规定,依法决策是本基金进行投资的首要原则;
(2) 全球宏观经济、各区域经济发展趋势、各国宏观经济取向和微观经济运行周期以及证券市场走势是本基金投资决策的基础;
(3) ODII研究团队,包括宏观分析、股票分析、基金分析、债券分析、期货和数量分析,分别完成其相应的研究报告,为投资决策提供依据;
(4) 投资管理流程,包括投资决策委员会对投资评估的审议和决策。投资团队在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下,做出投资决策,本基金维护投资者利益的首要原则;

(5) 部门投资策略。本基金在ODII投资决策委员会领导下,由基金管理人组成投资决策委员会,通过投资团队的共同努力与分工合作,由基金管理人具体执行投资计划,争取良好投资业绩。

2. 投资决策机制
本基金的决策机制是在ODII投资决策委员会授权范围内,实行投资决策监督下的基金经理负责制。

(1) ODII投资决策委员会:投资决策委员会每月召开一次,根据投资绩效评估和风控与回报评价等资料,在充分讨论全球、区域和国家宏观经济、产业经济以及固定收益市场的基础上,评估并审核资产配置方案和投资建议,确定核心投资对象、范围和禁止投资的事项,决定投资策略等重大投资决策,负责基金投资组合的计划、实施、跟踪、调整的日常管理。

在投资决策中,ODII投资决策委员会、ODII基金经理和投资队伍各职能部门的工作关系参见图2。

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

图2. ODII投资决策委员会的工作关系

序号 基金名称 基金类别 运作方式 管理人 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 DIRECTION DAILY SEMI BULL 3X ETF基金 契约型 开放式 Rufferty Asset Management LLC 8,662,117.59 5.33

2 PROSHARES ULTRA NASD BIOTECH ETF基金 契约型 开放式 ProShare Advisors LLC 8,562,409.68 5.27

3 DIRECTION HEALTHCARE BULL 3X ETF基金 契约型 开放式 Rufferty Asset Management LLC 8,142,914.32 5.01

4 DIRECTION DAILY TECH BULL 3X ETF基金 契约型 开放式 Rufferty Asset Management LLC 8,091,765.60 4.98

5 SPDR S&P 500 ETF ETF基金 契约型 开放式 SP&A Fund Management Inc 7,644,356.56 4.70

6 DIRECTION DAILY FTSE CHINA BULL ETF基金 契约型 开放式 Rufferty Asset Management LLC 7,614,777.31 4.69

7 DIRECTION DAILY FIN BULL 3X ETF基金 契约型 开放式 Rufferty Asset Management LLC 7,391,293.08 4.55

8 PROSHARES ULTRA HEALTH CARE ETF基金 契约型 开放式 ProShare Advisors LLC 7,201,781.83 4.43

9 PROSHARES ULTRAPROQQ ETF基金 契约型 开放式 ProShare Advisors LLC 7,155,558.60 4.40

10 PROSHARES ULTRAPRO S&P 500 ETF基金 契约型 开放式 ProShare Advisors LLC 6,897,245.02 4.24

10. 投资组合报告摘要

(1) 本基金本报告期的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查