

# 中银全球策略证券投资基金(FOF)

## 2017第一季度报告

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

报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

47 日内基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 投资组合报告

报告期内,盈加值因为经济增长及政治因素的压抑而相对便宜,我们相对看好欧洲的表现,而美股在经历过去一年的高涨后,可能会进入震荡盘整阶段。

47 日内期内没有出现人数或基金资产净值预警情形。于2017年4月10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,确认不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

§ 6 公告基本信息

报告期自2017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)
基金主代码	163813
交易代码	163813
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月3日
报告期末基金资产总额	100,669,450.61
投资目标	通过全球化的资产配置和合理管理,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,追求基金的长期稳健增值。
投资策略	坚持价值投资,价值投资和价值投资,通过对全球经济观察,各主要经济体及行业基本面的深入分析,在全球范围内配置基金资产,应用“核心+卫星”投资策略,构建多元化的投资组合,通过基金资产的配置,提高投资组合的风险调整后的收益。此外,本基金通过精选基金、股票和债券,进一步为投资者提供稳健的、长周期的回报。
业比较基准	60%×MSCI所有国家指数(MSCI All Country World Index)+40%美国国债指数(T-Bill+1-Month T-Bill)收益率
风险收益特征	本基金属混合型基金,其预期风险与收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于全部股票型基金。
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
境外资产账户名称	Bank of New York Mellon
境外资产账户币种名称	组阁港币

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期	(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益		204,573.00
2.期初利润		832,534.03
3.本期利润		0.0002
4.期末未分配利润		68,963,022.12
5.期末可供分配利润		0.0586

注:1.1 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的数字。

(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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.2 本期报告期基金净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

中银全球策略证券投资基金(FOF) 2011年3月3日至2017年3月31日

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年3月3日至2017年3月31日)

中银全球策略证券投资基金(FOF) 2011年3月3日至2017年3月31日

中银全球策略证券投资基金(FOF) 2011年3月3日至