

# 中银全球策略证券投资基金（FOF）

## 2012年半年度报告

### 2012年6月30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

报告送出日期：二〇一二年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 22 日复核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、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

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及其更新。

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 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5	信息披露方式.....	6
2.6	其他相关资料.....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	33
7.1	期末基金资产组合情况.....	33
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	33
7.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	34
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	34
7.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	36

7.7	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 .....	37
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	37
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	37
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	37
7.11	投资组合报告附注 .....	38
8	基金份额持有人信息 .....	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
9	开放式基金份额变动 .....	39
10	重大事件揭示 .....	39
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	39
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
10.4	基金投资策略的改变 .....	40
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况 .....	40
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8	其他重大事件 .....	42
11	备查文件目录 .....	43
11.1	备查文件目录 .....	43
11.2	存放地点 .....	44
11.3	查阅方式 .....	44

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中银全球策略证券投资基金（FOF）
基金简称	中银全球策略（QDII-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
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
报告期末基金份额总额	473,857,481.19份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过全球化的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。
投资策略	本基金在资产配置采用“双重配置”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和卫星组合的配置，权益型资产包括股票型基金和股票。在核心组合中，本基金将主要投资于跟踪全球主要市场指数低成本的ETF等指数化投资工具，以获得所投资市场和行业平均收益；在卫星组合中，本基金将主要投资于主动化管理的股票型基金或股票，追求超越市场平均收益。本基金的债券投资策略包括平均久期配置策略、利差策略、期限结构配置策略、类属配置策略、收益率曲线配置策略、跨市场套利策略及跨品种套利策略等。本基金在金融衍生品的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。
业绩比较基准	60%×MSCI所有国家世界指数(MSCI All Country World Index)+40%×美国3月政府债券(US 3-Month T-Bills)收益率
风险收益特征	本基金为基金中基金，预期风险与收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于全球股票型基金。

## 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		中银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程明	尹东
	联系电话	021-38834999	010-67595003
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	010-67595096
传真		021-68873488	010-66275853
注册地址		上海市银城中路 200 号中银大厦 45 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市银城中路 200 号中银大厦 26 层、45 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		谭炯	王洪章

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of New York Mellon
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	One Wall Street, New York, NY 10286 USA
办公地址		-	One Wall Street, New York, NY 10286 USA
邮政编码		-	-

注：本基金目前不设境外投资顾问。基金管理人有权选择、更换或撤销境外投资顾问，并根据法律法规和《基金合同》的有关规定公告。

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金半年度报告备置地点	上海市银城中路 200 号中银大厦 26 层

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	-9,362,324.69
本期利润	365,609.04
加权平均基金份额本期利润	0.0007
本期加权平均净值利润率	0.08%
本期基金份额净值增长率	-0.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-83,688,883.39
期末可供分配基金份额利润	-0.1766
期末基金资产净值	390,168,597.80
期末基金份额净值	0.823
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-17.70%

注：1、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。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、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数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.13%	1.16%	2.86%	0.71%	0.27%	0.45%
过去三个月	-7.22%	1.01%	-3.78%	0.66%	-3.44%	0.35%
过去六个月	-0.72%	0.88%	2.63%	0.56%	-3.35%	0.32%

过去一年	-18.19%	1.13%	-4.80%	0.83%	-13.39%	0.30%
自基金合同生效起至今	-17.70%	0.98%	-4.75%	0.77%	-12.95%	0.21%

### 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

中银全球策略证券投资基金（FOF）  
 份额累计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 2012 年 6 月 30 日）



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条（二）的规定，即本基金的基金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基金资产净值的 5%。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中银基金管理有限公司前身为中银国际基金管理有限公司，于 2004 年 8 月 12 日正式成立，由中银国际和美林投资管理合资组建（2006 年 9 月 29 日美林投资管理有限公司与贝莱德投资管理有限公司合并，合并后新公司名称为“贝莱德投资管理有限公司”）。2007 年 12 月 25 日，经中国证券监督管理委员会批复，同意中国银行股份有限公司直接控股中银基金。公司注册地为中国上海市，注册资本为一亿元人民币，其中中国银行拥有 83.5% 的股

权，贝莱德投资管理拥有 16.5% 的股权。截至 2012 年 6 月 30 日，本管理人共管理十七只开放式证券投资基金：中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长股票型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金、中银动态策略股票型证券投资基金、中银稳健增利债券型证券投资基金、中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金、中银中证 100 指数增强型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、中银全球策略证券投资基金（FOF）、上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、中银中小盘成长股票型证券投资基金、中银信用增利债券型证券投资基金及中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF），同时管理着多个特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐华	本基金的基金 经理、公司 QDII 业 务主管	2011-03-03	-	14	中银基金管理有限公司 QDII 业务主管、副总裁 (VP)，金融学学士。曾任美联证券公司金融投资顾问，保德信证券公司注册投资经理，瑞士银行金融策略顾问。2008 年加入中银基金管理有限公司，现任 QDII 业务主管。2011 年 3 月至今任中银全球策略基金经理。具有 14 年证券从业年限，10 年境外证券投资研究管理从业经验。具有美国综合证券注册投资代表资格 (Series 7) 从业资格、统一投资顾问 (Series 65) 从业资格、美国保德信证券集团注册投资组合经理 (Certified Portfolio Manager) 资格。具备基金从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日

期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金目前不设境外投资顾问。基金管理人有权选择、更换或撤销境外投资顾问，并根据法律法规和《基金合同》的有关规定公告。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制订了《中银基金管理有限公司公平交易管理制度》，建立了《投资研究管理制度》及细则、《新股询价和申购管理制度》、《集中交易管理制度》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生异常交易行为。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

###### 1、宏观经济分析

纵观 2012 年上半年，欧洲债务危机和美国经济走势仍是影响全球资本市场表现的主导因素。上半年欧元区国家相继出现了西班牙的国债危机和希腊退出欧元区危机，从而促使欧元区国家思考更加紧密的财政联盟的可能性。对此，各国依旧纷争不断。德国民众不支持希腊等国继续留在欧元区，同时担心德国的责任与财政权利不对等。欧洲债务集中在 3、4 月到期，欧元区再次陷入危机，德国总理默克尔也表态等到欧元区统一财政联盟建立后，才支持欧元债券的发行。欧元区局势持续震荡，曲折前进。6 月底欧盟峰会取得进展，欧元区不仅就银行业监管以及稳定债券市场等方面内容达成协议，而且还推出了 1200 亿欧元刺激经济的计划。欧债问题得到阶段性解决。

美国一季度经济增长 2%，经济复苏势头在 4 月初开始放缓，二季度经济增速放缓至 1.5%。美国的就业、消费及企业设备投资均处于弱势。美国企业现金充裕，杠杆较低，基本面状况健康。但欧洲债务危机和对美国年底财政断崖的担忧（即 2010 年生效的减税延长计划将在年底到期），抑制了企业雇人的意愿。相对于增加雇员，企业倾向于雇用临时工和延长工时。故一季度整体就业增长 67.7 万人，而二季度仅为 22.5 万人。劳动力市场的疲弱和信心的不振导致了消费的疲软。实际消费支出一季度月均增速为 0.2%，二季度仅为 0.1%。不过，油价下跌带动通胀回落，从而促进实际可支配收入上升。加之美国房地产市场触底回升，都会为未来消费的回升提供支撑。企业设备投资同样受到欧洲债务危机和财政断崖的抑制，加之目前企业设备投资已经恢复到了危机前的水平，置换周期已经完成，未来的投资增长依赖于需求是否强劲。在 6 月第 3 周中举行的美联储议息会议中，伯南克决定延长 OT 操作至 2012 年底，买入 2670 亿美元的 6-30 年期国债，卖出等量的 3 年期以内国债，并且表示在适当时机将会采取进一步的行动。

新兴市场经济表现同样偏弱。同时，金砖四国的通胀已有所缓和，物价中枢较去年高点

下降 2%-3%。这也给金砖四国政府的货币政策更多腾挪空间，各国均启动了降息周期，期待刺激经济增长。

## 2、行情回顾

上半年，全球整体市场呈现前高后低的走势。由于欧洲债务集中在 3、4 月份到期，传统 5 月效应再现。上半年，美国标普 500 指数上涨 8.31%，欧洲指数基本持平，金砖四国指数上涨 1.37%；美国 10 年期国债收益率在 2%左右震荡，5 月份市场恐慌情绪导致资金再次涌向债市，10 年期国债收益率创下 1.452%的低点。德国债市也成为避险标的，相反西班牙 10 年期债券收益率从 2 月低点 4.85%开始一路上扬，至 6 月创出 7%的新高；大宗商品方面，贵金属市场表现平平，截至 6 月底在 1600 美元水平徘徊。天然气从 4 月下旬开始启动强劲反弹行情，至 6 月末上涨 32.5%。汇率方面，美元整体呈上扬态势，美元指数于 5 月底创出 83.5 的新高。

## 3、基金运作分析

报告期内，中银全球按照既定的投资理念及策略进行了投资操作，取得了相应收益。但部分所选 ETF 投资标的的业绩表现在一定程度上影响了投资业绩。另外，本基金对全球股市做出了正确的超买预判，但未能精准把握市场转向时点，导致错过了部分前期涨幅。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日为止，本基金的单位净值为 0.823 元，本基金的累计单位净值为 0.823 元。2012 年上半年本基金净值增长率为 -0.72%，同期业绩基准增长率为 2.63%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年三季度，全球宏观经济局势仍然充满变数。预计近期资本市场调整仍将持续。值得注意的是，今年二季度结束时，美国 10 年期国债收益率在 2%上下浮动，对比来看，2011 年上半年的水平在 3%左右。因此，债市中数万亿投资有待寻找更具吸引力的投资品种，如高分红的蓝筹股等等。目前经济形势的确不如 2008 年前，但若不发生大危机引起大恐慌，并有欧美持续的量化宽松做后盾，相信股市会在流动性的推升和市盈率重心下移中寻找平衡。

欧美政府都不会任由经济形势恶化，并会适时推出量化宽松政策。因此，过去数月股市的调整可能预示着相应的投资机会，本年三季度股市有望迎来阶段性反弹。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。

作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

##### **4.7.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述**

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资管理部、风险管理部、基金运营部、法律合规与稽核部和信息披露相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金运营部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值模型并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由中央交易室做出提示，风险管理部相关人员负责估值相关数值的处理和计算，待运营部人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。基金运营部将收到的公司估值委员会确认的公允价值数据传至托管银行，并提示托管银行认真核查，并通知会计师事务所审核。公司按上述规定原则进行估值时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，各方确认无误后，基金运营部可使用上述公允价值进行证券投资基金净值计算处理，与托管行核对无误后产生当日估值结果，并将结果反馈至公司估值委员会，同时按流程对外公布。

##### **4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度**

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，与估值委员会共同商定估值原则和政策。

##### **4.7.3 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。**

##### **4.7.4 本公司现没有签订任何与估值相关的定价服务。**

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的25%。

本报告期末可供分配利润为-83,688,883.39元，本基金份额净值低于面值。根据本基金基金合同第十七部分基金的收益与分配相关约定，无相关收益分配事项。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中银全球策略证券投资基金（FOF）

报告截止日：2012年6月30日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	43,342,060.39	67,243,231.34
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	349,337,712.19	373,900,725.39
其中: 股票投资		14,890,871.49	16,187,471.43
基金投资		334,446,840.70	357,713,253.96
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		248,997.01	-
应收利息	6.4.7.5	1,272.79	438,647.02
应收股利		448,513.50	601,544.98
应收申购款		7,312.20	32,852.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,365,863.79	-
资产总计		394,751,731.87	442,217,001.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,403,461.08	-
应付赎回款		952,877.88	2,546,811.50
应付管理人报酬		561,741.57	689,316.37
应付托管费		109,227.54	134,033.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,555,826.00	87,598.44
负债合计		4,583,134.07	3,457,760.01
所有者权益:			

实收基金	6.4.7.9	473,857,481.19	529,535,550.94
未分配利润	6.4.7.10	-83,688,883.39	-90,776,309.38
所有者权益合计		390,168,597.80	438,759,241.56
负债和所有者权益总计		394,751,731.87	442,217,001.57

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.823 元，基金份额总额 473,857,481.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银全球策略证券投资基金(FOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 3 月 3 日(基金合 同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>5,892,940.85</b>	<b>9,768,584.31</b>
1.利息收入		387,273.95	6,075,814.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	387,273.95	877,148.86
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收入		-	5,198,665.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-4,325,014.63	876,993.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	127,589.07	314,691.22
基金投资收益	6.4.7.13	-8,202,683.18	307,817.61
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,750,079.48	254,484.44
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.17	9,727,933.73	3,962,859.74
4.汇兑收益(损失以“-”号 填列)		57,669.67	-1,696,882.21
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	6.4.7.18	45,078.13	549,799.11
<b>减：二、费用</b>		<b>5,527,331.81</b>	<b>6,407,842.75</b>
1. 管理人报酬		3,877,832.43	4,993,909.68
2. 托管费		754,022.98	971,038.00

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	704,879.99	317,808.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	190,596.41	125,086.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>365,609.04</b>	<b>3,360,741.56</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>365,609.04</b>	<b>3,360,741.56</b>

注：本基金合同生效日为2011年3月3日，上年度可比期间为2011年3月3日至2011年6月30日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银全球策略证券投资基金（FOF）

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	529,535,550.94	-90,776,309.38	438,759,241.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	365,609.04	365,609.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-55,678,069.75	6,721,816.95	-48,956,252.80
其中：1. 基金申购款	2,904,589.17	-340,620.38	2,563,968.79
2. 基金赎回款	-58,582,658.92	7,062,437.33	-51,520,221.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	473,857,481.19	-83,688,883.39	390,168,597.80
项目	上年度可比期间 2011年3月3日（基金合同生效日）至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	1,059,555,414.92	-	1,059,555,414.92

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,360,741.56	3,360,741.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-427,400,942.73	521,981.79	-426,878,960.94
其中：1. 基金申购款	1,738,266.33	-2,011.87	1,736,254.46
2. 基金赎回款	-429,139,209.06	523,993.66	-428,615,215.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	632,154,472.19	3,882,723.35	636,037,195.54

注：本基金合同生效日为 2011 年 3 月 3 日，上年度可比期间为 2011 年 3 月 3 日至 2011 年 6 月 30 日。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：谭炯，主管会计工作负责人：乔炳亚，会计机构负责人：乐妮

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中银全球策略证券投资基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]第 1134 号《关于核准中银全球策略证券投资基金（FOF）募集的批复》核准，由中银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银全球策略证券投资基金（FOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,059,115,187.61 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 066 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银全球策略证券投资基金（FOF）基金合同》于 2011 年 3 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,059,555,414.92 份，其中认购资金利息折合 440,227.31 份基金份额。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为纽约梅隆银行(Bank of New York Mellon)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行

办法》和《中银全球策略证券投资基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票（包括股票存托凭证），在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为：本基金的基金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基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：60%×MSCI 所有国家世界指数（MSCI All Country World Index）+40%×美国 3 月政府债券（US 3-Month T-Bills）收益率。摩根士丹利资本国际指数（MSCI）是摩根士丹利资本国际公司主持开发的一系列全球性证券市场指数，是全球投资组合经理作为投资基准最为广泛应用的指数，目前有 2000 多家国际机构投资者采用 MSCI 指数作为基准。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5 号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银全球策略证券投资基金（FOF）基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关

税收政策问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	43,342,060.39
定期存款	-
其他存款	-
合计	43,342,060.39

注：于 2012 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 6,000,217.20 元(折合人民币 37,950,773.77 元)。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	18,766,420.04	14,890,871.49	-3,875,548.55
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	403,241,762.52	334,446,840.70	-68,794,921.82
其他	-	-	-
合计	422,008,182.56	349,337,712.19	-72,670,470.37

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	1,272.79
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,272.79

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
其他应收款	1,365,863.79
待摊费用	-
合计	1,365,863.79

**6.4.7.7 应付交易费用**

本基金本报告期末无应付交易费用。

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,831.08
预提费用	187,964.14

其他应付款	1,366,030.78
合计	1,555,826.00

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	529,535,550.94	529,535,550.94
本期申购	2,904,589.17	2,904,589.17
本期赎回(以“-”号填列)	-58,582,658.92	-58,582,658.92
本期末	473,857,481.19	473,857,481.19

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,222,673.95	-77,553,635.43	-90,776,309.38
本期利润	-9,362,324.69	9,727,933.73	365,609.04
本期基金份额交易产生的变动数	1,952,126.57	4,769,690.38	6,721,816.95
其中：基金申购款	-101,684.56	-238,935.82	-340,620.38
基金赎回款	2,053,811.13	5,008,626.20	7,062,437.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20,632,872.07	-63,056,011.32	-83,688,883.39

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	315,042.91
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	0.76
合计	387,273.95

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	18,259,639.17

买卖股票差价收入	127,589.07
----------	------------

**6.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	301,265,406.07
减：卖出/赎回基金成本总额	309,468,089.25
基金投资收益	-8,202,683.18

**6.4.7.14 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	66,364.70
基金投资产生的股利收益	3,683,714.78
合计	3,750,079.48

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	9,727,933.73
——股票投资	-1,717,800.25
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	11,445,733.98
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	9,727,933.73

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	45,078.13
合计	45,078.13

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	704,879.99
银行间市场交易费用	-
合计	704,879.99

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	38,786.02
信息披露费	149,178.12
银行汇划费	1,782.00
其他	850.27
合计	190,596.41

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金没有需说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金没有需说明的资产负债表日后事项。

##### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司（“中银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
纽约梅隆银行有限公司	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

**6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年3月3日（基金合同生效日）至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,877,832.43	4,993,909.68
其中：支付销售机构的客户维护费	1,460,773.80	1,818,131.60

注：支付基金管理人中银基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.80% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年3月3日（基金合同生效日）至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	754,022.98	971,038.00

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内无管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年3月3日（基金合同生效日）至 2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国建设银行	5,391,286.62	72,230.28	29,904,277.66	268,720.93
纽约梅隆银行 有限公司	37,950,773.77	-	60,553,918.74	-
合计	43,342,060.39	72,230.28	90,458,196.40	268,720.93

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人纽约梅隆银行有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规与稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公

司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行及境外资产托管人纽约梅隆银行，定期存款存放在具有托管资格的上海银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2011 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控

制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有同一机构发行的具有投票权的证券不得超过该类证券发行总量的10%。同时本基金投资于中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不超过基金资产净值的3%。本基金所持证券在证券交易所上市,因此均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

##### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位:人民币元

本期末 2012年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	43,342,060.39	-	-	-	43,342,060.39
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	349,337,712.19	349,337,712.19
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	248,997.01	248,997.01
应收利息	-	-	-	1,272.79	1,272.79
应收股利	-	-	-	448,513.50	448,513.50
应收申购款	-	-	-	7,312.20	7,312.20
其他资产	-	-	-	1,365,863.79	1,365,863.79
资产总计	43,342,060.39	-	-	351,409,671.48	394,751,731.87
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,403,461.08	1,403,461.08
应付赎回款	-	-	-	952,877.88	952,877.88
应付管理人报酬	-	-	-	561,741.57	561,741.57
应付托管费	-	-	-	109,227.54	109,227.54
其他负债	-	-	-	1,555,826.00	1,555,826.00
负债总计	-	-	-	4,583,134.07	4,583,134.07
利率敏感度缺口	43,342,060.39	-	-	346,826,537.41	390,168,597.80
上年度末 2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	67,243,231.34	-	-	-	67,243,231.34
交易性金融资产	-	-	-	373,900,725.39	373,900,725.39
应收利息	-	-	-	438,647.02	438,647.02

应收股利	-	-	-	601,544.98	601,544.98
应收申购款	-	-	-	32,852.84	32,852.84
资产总计	67,243,231.34	-	-	374,973,770.23	442,217,001.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,546,811.50	2,546,811.50
应付管理人报酬	-	-	-	689,316.37	689,316.37
应付托管费	-	-	-	134,033.70	134,033.70
其他负债	-	-	-	87,598.44	87,598.44
负债总计	-	-	-	3,457,760.01	3,457,760.01
利率敏感度缺口	67,243,231.34	-	-	371,516,010.22	438,759,241.56

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2012年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2011年12月31日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	37,950,773.77	-	-	37,950,773.77
交易性金融资产	309,304,109.89	40,033,602.30	-	349,337,712.19
应收证券清算款	248,997.01	-	-	248,997.01
应收股利	38,443.69	372,069.81	-	410,513.50
其他资产	-	1,365,863.79	-	1,365,863.79

资产合计	347,542,324.36	41,771,535.90	-	389,313,860.26
以外币计价的负债	-	-	-	-
应付证券清算款	-	1,403,461.08	-	1,403,461.08
其他负债	1,366,030.78	-	-	1,366,030.78
负债合计	1,366,030.78	1,403,461.08	-	2,769,491.86
资产负债表外汇风险敞口净额	346,176,293.58	40,368,074.82	-	386,544,368.40
项目	上年度末 2011年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	7,325,239.52	-	-	7,325,239.52
交易性金融资产	337,924,136.14	35,976,589.25	-	373,900,725.39
应收股利	415,934.88	185,610.10	-	601,544.98
资产合计	345,665,310.54	36,162,199.35	-	381,827,509.89
以外币计价的负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	345,665,310.54	36,162,199.35	-	381,827,509.89

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	所有外币均相对人民币升值5%	增加约1,933	增加约1,909
	所有外币均相对人民币贬值5%	下降约1,933	下降约1,909

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于境外公募基金、证券交

交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用“自上而下”的策略,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金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基金资产净值的 5%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,通过特定指标测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	14,890,871.49	3.82	16,187,471.43	3.69
交易性金融资产-基金投资	334,446,840.70	85.72	357,713,253.96	81.53
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	349,337,712.19	89.54	373,900,725.39	85.22

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约2,457	成立未满一年

2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降5%	下降约2,457	成立未满一年
----------------------------	----------	--------

注：于2011年12月31日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	14,890,871.49	3.77
	其中：普通股	14,890,871.49	3.77
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	334,446,840.70	84.72
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	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	43,342,060.39	10.98
8	其他各项资产	2,071,959.29	0.52
9	合计	394,751,731.87	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家 (地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	12,285,780.92	3.15
美国	2,605,090.57	0.67
合计	14,890,871.49	3.82

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
日常消费品	6,489,205.66	1.66
非日常生活消费品	5,026,668.81	1.29
原材料	1,869,681.80	0.48
工业	735,408.77	0.19
金融	640,909.20	0.16
信息技术	128,997.25	0.03
合计	14,890,871.49	3.82

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	中国雨润食品集团有限公司	1068 HK	Hongkong Exchange	HK	1,179,000	6,489,205.66	1.66
2	GOME ELECTRICAL APPLIANCES	国美电器控股有限公司	493 HK	Hongkong Exchange	HK	5,481,000	4,558,625.70	1.17
3	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	加拿大钾肥公司	POT US	The United States Market	US	6,766	1,869,681.80	0.48
4	CSX CORP	美国 CSX 运输公司	CSX US	The United States Market	US	5,200	735,408.77	0.19

5	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	恒大地产集团有限公司	3333 HK	Hongkong Exchange	HK	200,000	640,909.20	0.16
6	EMPEROR WATCH & JEWELLERY	英皇钟表珠宝有限公司	887 HK	Hongkong Exchange	HK	820,000	468,043.11	0.12
7	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	Hongkong Exchange	HK	700	128,997.25	0.03

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、本基金本报告期末未持有存托凭证。

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	1068 HK	8,728,048.29	1.99
2	GOME ELECTRICAL APPLIANCES	493 HK	5,942,682.42	1.35
3	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	2,597,545.98	0.59
4	EMPEROR WATCH & JEWELLERY	887 HK	707,970.21	0.16
5	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	704,592.58	0.16
6			-	-
7			-	-
8			-	-
9			-	-
10			-	-
11			-	-
12			-	-
13			-	-
14			-	-
15			-	-
16			-	-
17			-	-
18			-	-
19			-	-
20			-	-

注：“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	10,171,259.46	2.32
2	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	2,663,697.75	0.61
3	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	1068 HK	2,174,252.08	0.50
4	MERCK & CO. INC.	MRK US	1,859,422.11	0.42
5	CSX CORP	CSX US	1,426,726.95	0.33
6	EMPEROR WATCH & JEWELLERY	887 HK	84,238.82	0.02
7	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	7,631.07	0.00
8			-	-
9			-	-
10			-	-
11			-	-
12			-	-
13			-	-
14			-	-
15			-	-
16			-	-
17			-	-
18			-	-
19			-	-
20			-	-

注：“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本(成交)总额	18,680,839.48
卖出收入(成交)总额	18,387,228.24

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	SELECTOR IVY ASSET STRGY-C5	ETF 基金	契约型开放式	Lemanik Asset Management Luxembourg	32,361,850.14	8.29
2	MORGAN STANLEY CHINA A SHARE	股票型基金	封闭式基金	Morgan Stanley Investment Management Ltd/Singapore	28,978,080.82	7.43
3	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF	ETF 基金	契约型开放式	Hang Seng Investment Management Ltd	27,747,821.38	7.11
4	US NATURAL GAS FUND LP	ETF 基金	契约型开放式	United States Commodities Fund LLC	22,736,064.27	5.83
5	SPDR S&P EMERGING LATIN AMER	ETF 基金	契约型开放式	State Street Global Advisors Inc	18,328,633.22	4.70
6	MARKET VECTORS INDIA S/C	ETF 基金	契约型开放式	Van Eck Associates Corp	16,120,298.56	4.13
7	SPDR S&P METALS & MINING ETF	ETF 基金	契约型开放式	State Street Global Advisors Inc	15,276,967.39	3.92
8	WISDOMTREE INDIA EARNINGS	ETF 基金	契约型开放式	WisdomTree Asset Management Inc	15,213,005.64	3.90
9	FINANCIAL SELECT SECTOR SPDR	ETF 基金	契约型开放式	State Street Global Advisors Inc	14,504,921.63	3.72

10	GLOBAL X URANIUM ETF	ETF 基金	契约型开 放式	Global X Management Co LLC	13,428,260.47	3.44
----	-------------------------	--------	------------	----------------------------------	---------------	------

### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 7.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	248,997.01
3	应收股利	448,513.50
4	应收利息	1,272.79
5	应收申购款	7,312.20
6	其他应收款	1,365,863.79
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,071,959.29

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额

					比例
15,364	30,842.06	14,519,430.08	3.06%	459,338,051.11	96.94%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	138,320.47	0.0292%

注：截至本报告期末，基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年3月3日）基金份额总额	1,059,555,414.92
本报告期期初基金份额总额	529,535,550.94
本报告期基金总申购份额	2,904,589.17
减：本报告期基金总赎回份额	58,582,658.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	473,857,481.19

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经本基金管理人董事会审议通过，聘任宁敏女士担任本基金管理人副执行总裁。宁敏女士的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准，详情参见 2012 年 2 月 1 日刊登的《中银基金管理有限公司关于副总经理变更事宜的公告》。

本报告期内，经本基金管理人股东会审议通过，选举李道滨先生为本基金管理人第三届董事会董事，陈儒先生不再担任本基金管理人第三届董事会董事职务，相关事项已按规定向监管机构报告。

本报告期内，经本基金管理人董事会审议通过，陈儒先生不再担任本基金管理人执行总裁职务，相关事项已按规定向监管机构报告，详情参见2012年4月28日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

此外，经本基金管理人董事会审议通过，聘任李道滨先生担任本基金管理人执行总裁。李道滨先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准，详情参见2012年8月10日刊登的《中银基金管理有限公司关于总经理任职事宜的公告》。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略没有发生改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金本报告期内没有改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
CLSA Ltd	-	18,476,819.77	49.85%	46,178.82	7.31%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	13,160,401.53	35.50%	189,823.46	30.04%	-

Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	5,430,846.40	14.65%	195,920.93	31.00%	-
KNIGHT	-	-	-	200,037.69	31.65%	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
KGI	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作，新增 Knight Capital Group, Inc 券商。公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受信责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行；

2、根据相关法规与基金管理人的制度，基金管理人 QDII 业务团队按照以下标准，对 QDII 投资交易单元进行选择：（一）交易执行能力。主要指境外券商是否对交易指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有：下单及成交回报的准确性和及时性、券款划拨的准确性和及时性、交易保密能力等；（二）研究团队的实力和水平。衡量境外券商的研究能力的指标主要有：宏观经济研究、行业研究、市场走向分析、专题研究报告的水平，以及推荐投资工具的有效性等；（三）服务水平。主要指是否与基金管理人有较强的长期合作意愿并积极提供个性化服务；（四）交易成本。主要指费用是否总体可控，交易佣金相较于交易执行水平以及投研支持服务而言是否合理、优惠。符合上述条件的境外券商是 QDII 业务团队考虑长期合作的对象，可成为备选券商，经 QDII 投资决策委员会审核批准，由交易室相关人员与其开设证券账户。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
CLSA Ltd	-	-	-	-	-	-	12,309,036.33	2.14%
Goldman Sachs Asia LLC	-	-	-	-	-	-	159,336,743.79	27.66%

Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-	176,536,846.68	30.65%
KNIGHT	-	-	-	-	-	-	227,838,721.16	39.55%
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银基金管理有限公司关于增加中信金通证券为旗下部分基金代销机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-1-10
2	中银全球策略证券投资基金（FOF）2011 年第 4 季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-1-19
3	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在申银万国证券开通定期定额投资业务并参加相关费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-3-19
4	中银全球策略证券投资基金（FOF）2011 年年度报告	www.bocim.com	2012-3-26
5	中银全球策略证券投资基金（FOF）2012 年年度报告摘要	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-3-26
6	中银基金管理有限公司关于旗下十二只基金继续参加工商银行网银申购业务费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-3-31
7	中银基金管理有限公司关于新增旗下部分基金参加国泰君安证券开放式基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-4-6
8	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书（2012 年第 1 号）	www.bocim.com	2012-4-17
9	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招	《上海证券报》、《中国证券	2012-4-17

	募说明书摘要（2012年第1号）	报》、《证券时报》、 www.bocim.com	
10	中银全球策略证券投资基金（FOF）2012年第1季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-4-24
11	中银基金管理有限公司关于网上直销通联支付通道新增支持银行卡并实施费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-5-7
12	中银基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-5-10
13	中银基金管理有限公司关于新增上海银联部分银行卡网上直销业务功能并实施费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-6-7
14	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2012-6-29

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，2012年1月16日本基金托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自2012年1月16日起，王洪章先生就任中国建设银行股份有限公司的董事长、执行董事。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银全球策略证券投资基金（FOF）募集的文件；
- 2、《中银全球策略证券投资基金（FOF）基金合同》；
- 3、《中银全球策略证券投资基金（FOF）托管协议》；
- 4、《中银全球策略证券投资基金（FOF）招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人互联网站。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司  
二〇一二年八月二十四日