

中银全球策略证券投资基金（FOF）

2013年年度报告

2013年12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

报告送出日期：二〇一四年三月二十八日

§ 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 2014 年 3 月 25 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。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§ 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	18
6.1 管理层对财务报表的责任	18
6.2 注册会计师的责任	18
6.3 审计意见	18
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	47
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	48
8.4 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	48
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	49

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	51
8.7 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	51
8.8 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	51
8.9 投资组合报告附注	51
§ 9 基金份额持有人信息	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
§ 10 开放式基金份额变动	53
§ 11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
11.2 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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4 基金投资策略的改变	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	56
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 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	314,764,036.45 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	坚持理性投资、价值投资和长期投资，通过对全球宏观经济、各主要经济体及行业基本面的深入分析，在全球范围有效配置基金资产，应用“核心-卫星”投资策略，构建多元化的投资组合，降低基金资产非系统性风险，提高投资组合风险调整后的收益。此外，本基金通过精选基金、股票和债券，进一步为投资者实现资本稳健、长期增值的目标。
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	田青
	联系电话	021-38834999	010-67595096
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	tianqing1.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
办公地址		One Wall Street, New York, NY 10286
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》
登载基金年度报告正文的管理人互联	http://www.bocim.com

网网址	
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2013 年	2012 年	2011 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-58,548,319.32	-25,112,633.65	-14,257,115.76
本期利润	-5,680,989.67	19,416,272.74	-96,655,519.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0151	0.0409	-0.1424
本期加权平均净值利润率	-1.81%	4.79%	-14.94%
本期基金份额净值增长率	-0.69%	4.46%	-17.10%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	-70,388,572.87	-57,967,594.43	-90,776,309.38
期末可供分配基金份额利润	-0.2236	-0.1339	-0.1714
期末基金资产净值	270,637,465.97	374,917,796.68	438,759,241.56
期末基金份额净值	0.860	0.866	0.829
3.1.3 累计期末指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末

基金份额累计净值增长率	-14.00%	-13.40%	-17.10%
-------------	---------	---------	---------

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
过去三个月	5.13%	0.52%	4.13%	0.33%	1.00%	0.19%
过去六个月	9.41%	0.47%	8.70%	0.33%	0.71%	0.14%
过去一年	-0.69%	0.54%	11.84%	0.39%	-12.53%	0.15%
自基金合同生效起至今	-14.00%	0.82%	12.19%	0.61%	-26.19%	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

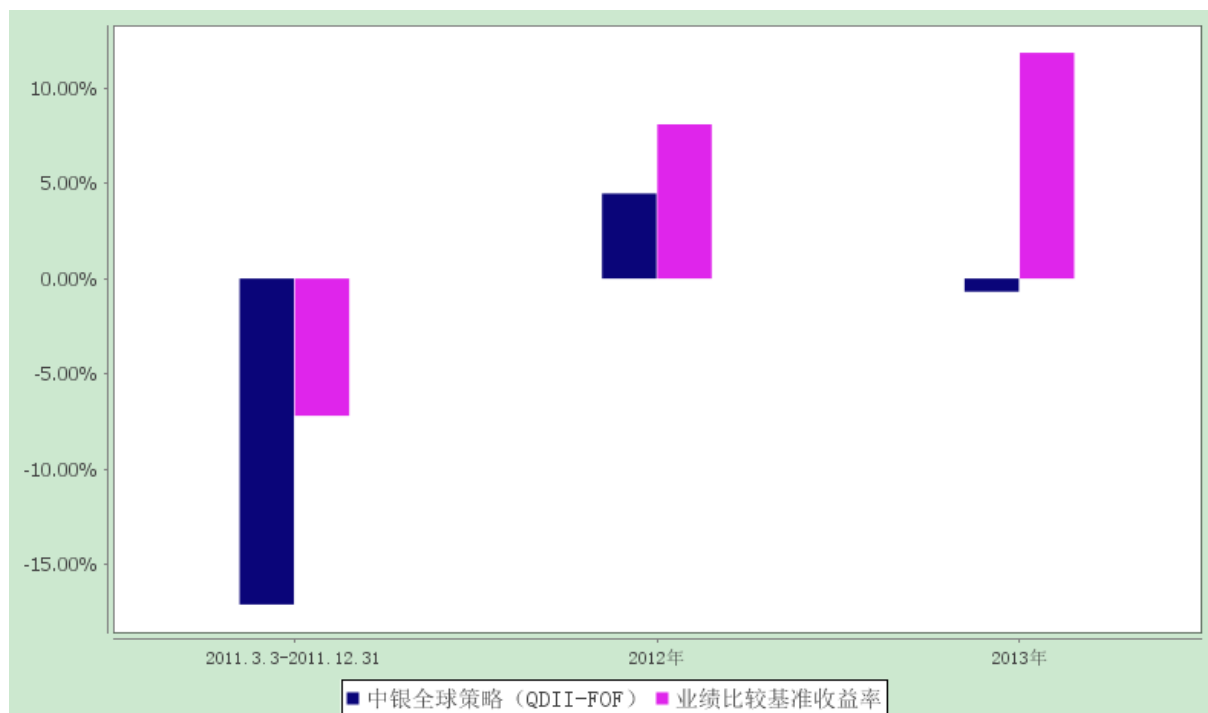
中银全球策略证券投资基金（FOF）
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2011年3月3日至2013年12月31日）



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部分（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%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期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）
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2011 年 3 月 3 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满五年。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
2011	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金基金合同于 2011 年 3 月 3 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满三年，无利润分配情况。

§ 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 2013 年 12 月 31 日，本管理人共管理三十四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、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）、中银主题策略股票型证券投资基金、中银保本混合型证券投资基金、中银理财 14 天债券型证券投资基金、中银理财 60 天债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、中银理财 7 天债券型证券投资基金、中银理财 30 天债券型证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、中银美丽中国股票型证券投资基金、中银盛利纯债一年定期开放债券型证券投资基金（LOF）、中银保本二号混合型证券投资基金、中银互利分级债券型证券投资基金、中银惠利纯债半年定期开放债券型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、中银理财 21 天债券型证券投资基金，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、公司国际业务部总经理（已离职）	2011-03-03	2013-07-18	15	中银基金管理有限公司国际业务部总经理，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，2011 年 3 月至 2013 年 7 月任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理。具有 15 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。
陈学林	本基金的基金经理、中银标普全球资源等权重指数（QDII）基金基金经理	2013-07-18	-	11	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），工商管理硕士。曾任统一期货股份有限公司交易员，凯基证券投资信托股份有限公司基金经理。2010 年加入中银基金管理有限公司，曾担任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理助理。2013 年 3 月至今任中银标普全球资源等权重指数（QDII）基金基金经理，2013 年 7 月至今任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理。具有 11 年证券从业年限。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 公平交易制度和控制方法

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》，公司制定了《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、《新股询价申购和参与公开增发管理制度》、《债券询价申购管理制度》、《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。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

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，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

本报告期内，本公司通过对公司管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，并对连续四个季度的不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.4.3 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的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

刚刚过去的 2013 年，是全球各国在应对经济危机的道路上出现分化的一年。欧美经济率先走出危机，欧元区经济摆脱衰退泥潭，美国经济复苏步伐加速，欧美货币政策边际趋紧；受到美联储缩减 QE 的冲击，新兴经济体大多增长乏力。从国内来看，全年经济增速低位窄幅波动，经济增长对投资与债务的依赖度继续上升；通胀水平上升后回落，整体压力较小。全球流动性环境不确定性上升、国内经济与通胀压力有限、金融体系与社会融资创新扩张动力较强，成为 2013 年国内宏观调控政策趋于谨慎的大背景，货币政策在以数量调控为主的情况下，兼顾维稳短期价格。

从国外的经济情况来看，2013 年欧元区经济走出衰退，美国经济加速复苏。具体来看，美国经济在 2013 年上半年延续缓慢复苏势头，GDP 环比折年率处于 3.0%附近，失业率缓慢降至 6 月份的 7.5%水平；下半年，美国经济复苏步伐明显加快，第三、四季度 GDP 环比折年率分别为 6.2%与 4.6%，失业率加速下降至 12 月份的 6.7%水平。从领先指标来看，美国 ISM 发布的制造业 PMI 持续稳定在扩张区间，预计一季度美国经济复苏步伐仍将延续。欧元区方面，上半年经济衰退势头进一步缓解，制造业 PMI 指数上升至 6 月份的 48.8 水平；下半年，欧元区经济走出衰退，制造业 PMI 指数维持于扩张区间，并于 12 月份升至 52.7 水平。

从国内的经济情况来看，“稳中求进”依然是全年经济工作重点，积极的财政政策与稳健的货币政策延续，经济增速与通胀均整体处于相对较低水平。具体来看，上半年，经济增速缓慢下滑，二季度 GDP 同比增速降至 7.5%的水平；与此同时，货币供应与信用扩张加速，M2 同比增速一度超过 16%。下半年，小库存周期与货币供应的滞后效应使得经济出现了短暂的小幅反弹，三季度 GDP 增速反弹至 7.8%水平；同时，央行货币政策持续保持谨慎，严格把控流动性总闸门，市场利率大幅上升。通胀方面，由于基数原因，1-5 月份通胀水平低位震荡，6-10 月份冲高超过 3.0%水平，但随后受到实体经济需求疲弱、高利率环境持续、居民消费受抑制、生猪存栏量充裕、暖冬等多重因素影响，通胀水平在 11-12 月份加速下滑。当前来看，中性谨慎的政策环境延续，货币供应与信用扩张受到抑制，地产销量下滑，经济短期内或将延续下滑态势。

报告期内，下半年因为判断全球利率将持续走高，债市 30 年超级大牛市将走到尽头，股市在美国经济逐渐增温、欧洲步出衰退的背景下表现有望超越债市，而发达国家股市的表现也会优于新兴市场，因此，相较上半年，我们对大类资产进行了重新调整，增持了美欧日的股市并同时减持新兴市场、债券的投资；另外，考虑到中国经济将进入稳定增长的阶段，对于大宗商品的需求将不如以

往，本基金也减持了大宗商品的配置。经过调整后，基金业绩表现逐渐改善并且在下半年超越了比较基准。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日为止，本基金的单位净值为 0.86 元，本基金的累计单位净值为 0.86 元。报告期内本基金份额净值增长率为-0.69%，同期业绩比较基准收益率为 11.84%。

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 2014 年，全球经济的分化或将延续，美国经济复苏的基础仍较为牢固，欧元区经济整体扩张动力尚显疲弱，新兴经济体经济发展模式调整还在进行，随着美国逐步退出量化宽松政策，长期利率可能继续上升，新兴经济体面临资本流动和融资成本变化的冲击。

国内经济方面，经济增长对投资与债务的依赖性依然较强，经济结构调整步伐缓慢，经济在缺乏增长动力的同时，还将面临融资受限的拖累；相对乐观的因素是欧美经济的复苏有望使得出口对经济增长的拉动作用增强。通胀方面，2013 年 11-12 月份通胀的下滑明显拉低了 2014 年通胀的翘尾因素，加之国内实体经济需求疲弱、消费受限、货币政策维持谨慎、生猪存栏量充裕，预计通胀水平全年整体压力有限，仅将在基数效应影响下在年中和年末小幅反弹。中央经济工作会议及央行四季度货币政策例会均表示保持政策的稳定性与连续性，政策仍将以稳为主。由于经济将长期处于降杠杆、降产能的过程，而金融体系与社会融资创新扩张的动力较强，预计央行总体仍将谨慎调控流动性的总闸门。央行将继续实施稳健的货币政策，处理好稳增长、调结构、促改革、防风险的关系。预计货币政策将主要依靠央行公开市场操作，在控制总量的同时，维稳短期资金面；积极的财政政策将以盘活存量及结构性减税为主，通过加速改革，在促进经济结构调整的同时，支撑经济维持较为平稳的增长。

综合上述展望，我们在 2014 年依然看好发达国家股市的表现，但是固定收益市场将会因为美联储收缩量化宽松政策而持续承压，全球流动性的降低也会影响新兴市场的资产价格，因此我们将依据实际状况继续优化资产配置。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2013 年度，本基金管理人坚持一切从防范风险、保护基金份额持有人利益出发，致力于内控机

制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司法律合规部与稽核部按照制度，通过基金运作监控和内部审计等方法，独立地开展工作，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改。

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

（1）全面开展基金运作稽核工作，防范内幕交易，确保基金投资的独立性、公平性及合规性

主要措施有：严格执行集中交易制度，确保投资研究、决策和交易风险隔离；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序。通过以上措施，保证了投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求。

（2）修订内部管理制度，完善投资业务流程

根据监管机关的规定，定期更新公司内部投资管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范投资风险。

通过以上工作的开展，在本报告期内，本基金运作过程中未发生违规关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高合规与稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.8 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，由运营部做出提示，风险管理部相关人员对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以

进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理做出提示，并由研究员提供估值研究报告，交估值委员会审议，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，但不介入基金日常估值业务。

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 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.9 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-70,388,572.87 元。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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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 审计报告

安永华明 (2014) 审字第 61062100_B13 号

中银全球策略证券投资基金 (FOF) 全体基金份额持有人:

我们审计了后附的中银全球策略证券投资基金 (FOF) 财务报表, 包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 年度的利润表和所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人中银基金管理有限公司的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。

我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为, 上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了中银全球策略证券投资基金 (FOF) 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)

中国注册会计师

陈露 许培菁

北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

2014 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：	-	-	-
银行存款	7.4.7.1	30,970,205.41	54,850,440.98
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	242,660,948.19	322,849,355.52
其中：股票投资	-	30,523,169.05	17,305,884.66
基金投资	-	212,137,779.14	305,543,470.86
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款	-	-	101,238.22
应收利息	7.4.7.5	3,437.50	1,667.10
应收股利	-	179,030.70	1,125,396.74
应收申购款	-	12,251.20	2,766.78
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	7.4.7.6	61,910.97	-
资产总计	-	273,887,783.97	378,930,865.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负债：	-	-	-
短期借款	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	2,535,982.32	3,152,156.29
应付管理人报酬	-	412,188.34	566,737.78
应付托管费	-	80,147.73	110,199.01
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	7.4.7.8	221,999.61	183,975.58
负债合计	-	3,250,318.00	4,013,068.66
所有者权益：	-	-	-
实收基金	7.4.7.9	314,764,036.45	432,885,391.11
未分配利润	7.4.7.10	-44,126,570.48	-57,967,594.43
所有者权益合计	-	270,637,465.97	374,917,796.68
负债和所有者权益总计	-	273,887,783.97	378,930,865.34

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.860 元，基金份额总额 314,764,036.45 份。

7.2 利润表

会计主体：中银全球策略证券投资基金（FOF）

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

一、收入	-	2,914,006.68	29,746,479.37
1. 利息收入	-	113,124.71	449,846.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	113,124.71	449,846.28
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	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	-47,328,875.48	-15,171,998.66
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,043,946.79	-689,582.62
基金投资收益	7.4.7.13	-51,375,190.71	-20,393,403.51
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	-	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,002,368.44	5,910,987.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	52,867,329.65	44,528,906.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-2,749,768.97	-127,765.76
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	12,196.77	67,491.12
减：二、费用	-	8,594,996.35	10,330,206.63
1. 管理人报酬	7.4.10.2	5,655,732.76	7,322,088.07
2. 托管费	7.4.10.2	1,099,725.85	1,423,739.28
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,490,066.45	1,201,288.29
5. 利息支出	-	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	349,471.29	383,090.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	-5,680,989.67	19,416,272.74
减：所得税费用	-	-	-

四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-	-5,680,989.67	19,416,272.74
--------------------	---	---------------	---------------

7.3 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: 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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)	432,885,391.11	-57,967,594.43	374,917,796.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-5,680,989.67	-5,680,989.67
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)	-118,121,354.66	19,522,013.62	-98,599,341.04
其中: 1. 基金申购款	1,790,555.36	-290,562.68	1,499,992.68
2. 基金赎回款	-119,911,910.02	19,812,576.30	-100,099,333.72
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)	314,764,036.45	-44,126,570.48	270,637,465.97
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,416,272.74	19,416,272.74
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）	-96,650,159.83	13,392,442.21	-83,257,717.62
其中：1. 基金申购款	4,094,716.40	-527,553.43	3,567,162.97
2. 基金赎回款	-100,744,876.23	13,919,995.64	-86,824,880.59
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）	432,885,391.11	-57,967,594.43	374,917,796.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李道滨，主管会计工作负责人：乔炳亚，会计机构负责人：乐妮

7.4 报表附注

7.4.1 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”),系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 号文《关于核准中银全球策略证券投资基金(FOF)募集的批复》的核准,由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2011 年 3 月 3 日正式生效,首次设立募集规模为 1,059,555,414.92 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,基金境外托管人为纽约梅隆银行(Bank of New York Mellon)。

本基金的投资范围为全球证券市场中具有良好流通性的金融工具，包括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境外公募基金(包括 ETF)，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公开发行和挂牌交易的股票，以及债券、现金、货币市场工具、股指期货等用于组合避险或有效管理的金融衍生工具和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。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 在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{MSCI 所有国家世界指数 (MSCI All Country World Index)} + 40\% \times \text{美国 3 月政府债券 (US3-Month T-Bills)}$ 收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和基金投资；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。

本基金持有的股票投资和基金投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值；

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值；

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行机构代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行机构代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 基金投资收益/(损失)于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股票股利收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地使用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值 1.80%的年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值 0.35%的年费率计提；

(3) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 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%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，红利再投资方式免收再投资的费用；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；

(7) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需进行分部报告的披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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；

(2) 基金取得的源自境外的差价收入, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂免征营业税和企业所得税;

(3) 基金取得的源自境外的股利收益, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末	上年度末
	2013 年 12 月 31 日	2012 年 12 月 31 日
活期存款	30,970,205.41	54,850,440.98
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-	-
其中: 存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	30,970,205.41	54,850,440.98

注: 于 2013 年 12 月 31 日, 银行存款中包含的外币余额为: 美元 2,716,029.25 元 (折合人民币 16,559,358.73 元); 于 2012 年 12 月 31 日, 银行存款中包含的外币余额为: 美元 7,598,852.61 元 (折合人民币 47,762,588.08 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末		
	2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	28,379,691.53	30,523,169.05	2,143,477.52
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金		199,283,424.72	212,137,779.14	12,854,354.42
其他		-	-	-
合计		227,663,116.25	242,660,948.19	14,997,831.94
项目	上年度末			
	2012年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		21,766,084.28	17,305,884.66	-4,460,199.62
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		338,952,768.95	305,543,470.86	-33,409,298.09
其他		-	-	-
合计		360,718,853.23	322,849,355.52	-37,869,497.71

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2013年12月31日	2012年12月31日
应收活期存款利息	3,437.50	1,667.10

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	3,437.50	1,667.10

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
其他应收款	61,910.97	-
待摊费用	-	-
合计	61,910.97	-

注：表中“其他应收款”为在途换汇资金，应收美元10,154.50元，折合人民币61,910.97元。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期及上年度末均无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	84.99	5,975.58
应付审计费	60,000.00	78,000.00
应付信息披露费	100,000.00	100,000.00
其他应付款	61,914.62	-
合计	221,999.61	183,975.58

注：表中“其他应付款”为在途换汇资金，应付港币78,740.00元，折合人民币61,914.62元。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	432,885,391.11	432,885,391.11
本期申购	1,790,555.36	1,790,555.36
本期赎回 (以“-”号填列)	-119,911,910.02	-119,911,910.02
本期末	314,764,036.45	314,764,036.45

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	-33,759,308.96	-24,208,285.47	-57,967,594.43
本期利润	-58,548,319.32	52,867,329.65	-5,680,989.67
本期基金份额交易产生的变动数	21,919,055.41	-2,397,041.79	19,522,013.62
其中：基金申购款	-314,824.46	24,261.78	-290,562.68
基金赎回款	22,233,879.87	-2,421,303.57	19,812,576.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-70,388,572.87	26,262,002.39	-44,126,570.48

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12
	31 日	月 31 日

活期存款利息收入	113,122.07	134,802.37
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	2.64	1.00
合计	113,124.71	449,846.28

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
卖出股票成交总额	118,839,970.80	29,636,444.26
减：卖出股票成本总额	117,796,024.01	30,326,026.88
买卖股票差价收入	1,043,946.79	-689,582.62

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	829,785,883.95	508,671,336.70
减：卖出/赎回基金成本总额	881,161,074.66	529,064,740.21
基金投资收益	-51,375,190.71	-20,393,403.51

7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
股票投资产生的股利收益	179,199.34	77,610.46
基金投资产生的股利收益	2,823,169.10	5,833,377.01
合计	3,002,368.44	5,910,987.47

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
1. 交易性金融资产	52,867,329.65	44,528,906.39
——股票投资	6,603,677.14	-2,302,451.32
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	46,263,652.51	46,831,357.71
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	52,867,329.65	44,528,906.39

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
基金赎回费收入	12,196.77	67,491.12
合计	12,196.77	67,491.12

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
交易所市场交易费用	1,490,066.45	1,201,288.29
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,490,066.45	1,201,288.29

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
审计费用	42,000.00	78,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他费用	4,018.29	1,385.49
帐户维护费	360.00	360.00
银行汇划费	3,093.00	3,345.50
合计	349,471.29	383,090.99

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行（“纽约梅隆”）	基金境外托管人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中银国际证券有限责任公司（“中银证券”）	受中国银行重大影响、基金销售机构
贝莱德投资管理（英国）有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,655,732.76	7,322,088.07
其中：支付销售机构的客户维护费	1,997,314.04	2,671,303.35

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,099,725.85	1,423,739.28

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年12月31日		2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	14,410,846.68	113,122.07	7,087,852.90	134,802.37
纽约梅隆	16,559,358.73	-	47,762,588.08	-
合计	30,970,205.41	113,122.07	54,850,440.98	134,802.37

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、法律合规部、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，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2012 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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、组合在短时间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。

于 2013 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 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	14,410,846.68	-	-	16,559,358.73	30,970,205.41
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	242,660,948.19	242,660,948.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,437.50	3,437.50
应收股利	-	-	-	179,030.70	179,030.70
应收申购款	-	-	-	12,251.20	12,251.20
其他资产	-	-	-	61,910.97	61,910.97
资产总计	14,410,846.68	-	-	259,476,937.29	273,887,783.97
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,535,982.32	2,535,982.32
应付管理人报酬	-	-	-	412,188.34	412,188.34
应付托管费	-	-	-	80,147.73	80,147.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	221,999.61	221,999.61
负债总计	-	-	-	3,250,318.00	3,250,318.00
利率敏感度缺口	14,410,846.68	-	-	256,226,619.29	270,637,465.97
上年度末 2012 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	7,087,852.90	-	-	47,762,588.08	54,850,440.98
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	322,849,355.52	322,849,355.52
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	101,238.22	101,238.22
应收利息	-	-	-	1,667.10	1,667.10
应收股利	-	-	-	1,125,396.74	1,125,396.74
应收申购款	-	-	-	2,766.78	2,766.78
资产总计	7,087,852.90	-	-	371,843,012.44	378,930,865.34
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,152,156.29	3,152,156.29
应付管理人报酬	-	-	-	566,737.78	566,737.78
应付托管费	-	-	-	110,199.01	110,199.01
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	183,975.58	183,975.58
负债总计	-	-	-	4,013,068.66	4,013,068.66
利率敏感度缺口	7,087,852.90	-	-	367,829,943.78	374,917,796.68

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2012 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，买入返售金融资产的利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2012 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
	2013年12月31日			
以外币计价的资产				
银行存款	16,559,358.73	-	-	16,559,358.73
交易性金融资产	232,990,286.77	5,138,763.71	4,531,897.71	242,660,948.19
应收证券清算款	-	-	-	-
应收股利	115,527.72	63,502.98	-	179,030.70
其他资产	61,910.97	-	-	61,910.97
资产合计	249,727,084.19	5,202,266.69	4,531,897.71	259,461,248.59
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
其他负债	-	61,914.62	-	61,914.62
负债合计	-	61,914.62	-	61,914.62
资产负债表外汇风险敞口净额	249,727,084.19	5,140,352.07	4,531,897.71	259,399,333.97
项目	上年度末			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币		
	2012年12月31日			
以外币计价的资产				
银行存款	47,762,666.65	-	-	47,762,666.65
交易性金融资产	280,253,300.57	42,596,054.95	-	322,849,355.52
应收证券清算款	101,238.22	-	-	101,238.22
应收股利	794,786.52	330,610.22	-	1,125,396.74
资产合计	328,911,991.96	42,926,665.17	-	371,838,657.13
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	328,911,991.96	42,926,665.17	-	371,838,657.13

7.4.13.4.2 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 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 1,297	增加约 1,859
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 1,297	减少约 1,859

7.4.13.4.3 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及证券市场公开发行和挂牌交易的股票，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 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	30,523,169.05	11.28	17,305,884.66	4.62
交易性金融资产—基金投资	212,137,779.14	78.38	305,543,470.86	81.50
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	242,660,948.19	89.66	322,849,355.52	86.11

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	增加约1,525	增加约2,576
	2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	减少约1,525	减少约2,576

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2、其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

3、财务报表的批准

本财务报表已于2014年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	30,523,169.05	11.14

	其中：普通股	30,523,169.05	11.14
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	212,137,779.14	77.45
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	30,970,205.41	11.31
8	其他各项资产	256,630.37	0.09
9	合计	273,887,783.97	100.00

8.2 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（%）
美国	20,852,507.63	7.70
中国香港	5,138,763.71	1.90
Japanese	4,531,897.71	1.67
合计	30,523,169.05	11.28

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。

8.3 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 (%)
非日常生活消费品	11,823,021.69	4.37
信息技术	8,834,964.37	3.26
工业	3,977,681.09	1.47
金融	2,701,841.23	1.00
保健	1,984,761.88	0.73
能源	618,835.35	0.23
公用事业	582,063.44	0.22
合计	30,523,169.05	11.28

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

8.4 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	FAST RETAILING CO LTD	迅销公司	9983 JP	Tokyo Stock Exchanges	JP	1,800	4,531,897.71	1.67
2	SANDS CHINA LTD	金沙中国有限公司	1928 HK	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	HK	70,000	3,486,923.59	1.29
3	500.COM LTD-CLASS A-ADR	500彩票网	WBAI US	New York Stock Exchange	US	16,000	3,450,357.65	1.27
4	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOG US	New York Stock Exchange	US	500	3,416,428.40	1.26
5	FACEBOOK INC-A	脸谱网	FB US	New York Stock Exchange	US	9,000	2,998,705.39	1.11
6	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛集团	GS US	New York Stock Exchange	US	2,500	2,701,841.23	1.00
7	LOCKHEED MARTIN CORP	洛克希德马丁公司	LMT US	New York Stock Exchange	US	2,400	2,175,276.37	0.80
8	FEDEX CORP	美国联邦快递集团	FDX US	New York Stock Exchange	US	2,000	1,753,102.63	0.65
9	MASTERCARD INC-CLASS A	万事达卡公司	MA US	New York Stock Exchange	US	300	1,528,114.82	0.56
10	MERCK & CO. INC.	美国默克集团	MRK US	New York Stock Exchange	US	5,000	1,525,749.22	0.56
11	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	New York Stock Exchange	US	200	684,096.57	0.25
12	HALLIBURTON CO	哈里伯顿公司	HAL US	New York Stock Exchange	US	2,000	618,835.35	0.23
13	BEIJING ENTERPRISES	北控水务	371 HK	Hong Kong Exchanges and	HK	152,000	582,063.44	0.22

	WATER GR	集团有限公司		Clearing Limited				
14	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	上海复星医药(集团)股份有限公司	2196 HK	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	HK	25,000	459,012.66	0.17
15	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	海尔电器集团有限公司	1169 HK	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	HK	20,000	353,842.74	0.13
16	LENOVO GROUP LTD	联想集团有限公司	992 HK	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	HK	28,000	207,619.19	0.08
17	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	中国机械设备工程股份有限公司	1829 HK	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	HK	10,000	49,302.09	0.02

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。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	11,618,273.91	3.10
2	GOOGLE INC-CL A	G00G US	8,104,470.71	2.16
3	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	7,288,505.36	1.94
4	APPLE INC	AAPL US	7,245,058.38	1.93
5	SANDS CHINA LTD	1928 HK	6,481,059.31	1.73
6	CANADIAN SOLAR INC	CSIQ US	5,997,078.55	1.60
7	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	5,636,585.53	1.50
8	STARBUCKS CORP	SBUX US	5,496,538.39	1.47
9	ZTE CORP-H	763 HK	5,470,126.77	1.46
10	HALLIBURTON CO	HAL US	5,215,538.10	1.39
11	FAST RETAILING CO LTD	9983 JP	4,309,632.95	1.15
12	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	4,243,042.35	1.13
13	MASTERCARD INC-CLASS A	MA US	4,161,971.12	1.11
14	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	3,663,881.54	0.98
15	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	3,517,913.96	0.94
16	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	3,238,483.99	0.86

17	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	2,915,388.70	0.78
18	MACY'S INC	M US	2,889,178.42	0.77
19	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	2,773,367.45	0.74
20	FACEBOOK INC-A	FB US	2,744,317.21	0.73

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。

8.5.2 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	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	11,896,364.88	3.17
2	GOME ELECTRICAL APPLIANCES	493 HK	9,862,130.25	2.63
3	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	1068 HK	8,832,639.47	2.36
4	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	8,338,289.82	2.22
5	APPLE INC	AAPL US	7,265,824.83	1.94
6	CANADIAN SOLAR INC	CSIQ US	7,140,996.67	1.90
7	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	5,746,112.30	1.53
8	ZTE CORP-H	763 HK	5,594,006.39	1.49
9	STARBUCKS CORP	SBUX US	5,425,537.80	1.45
10	GOOGLE INC-CL A	GOOG US	5,297,809.86	1.41
11	HALLIBURTON CO	HAL US	4,790,237.04	1.28
12	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	4,007,501.34	1.07
13	SANDS CHINA LTD	1928 HK	3,951,490.30	1.05
14	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	3,480,008.73	0.93
15	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	3,317,102.43	0.88
16	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	3,110,977.37	0.83
17	MACY'S INC	M US	2,903,237.99	0.77
18	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	2,785,745.45	0.74
19	MASTERCARD INC-CLASS A	MA US	2,764,845.16	0.74
20	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	2,715,770.42	0.72

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。

8.5.3 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	124,409,631.26
卖出收入 (成交) 总额	118,839,970.80

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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	SPDR EURO STOXX 50 ETF	ETF 基金	契约型 开放式	SSgA Funds Management Inc	14,665,483.26	5.42
2	VANGUARD EUROPEAN ETF	ETF 基金	契约型 开放式	Vanguard Group Inc	13,981,411.08	5.17
3	VANGUARD TOT WORLD STK ETF	ETF 基金	契约型 开放式	Vanguard Group Inc	13,870,569.44	5.13
4	POWERSHARES QQQ NASDAQ 100	ETF 基金	契约型 开放式	Invesco PowerShares Capital Management LLC	13,138,941.44	4.85
5	WISDOMTREE EUR S/C DIVIDEND	ETF 基金	契约型 开放式	WisdomTree Asset Management Inc	12,875,982.14	4.76
6	GUGGENHEIM S&P 500 PURE VALU	ETF 基金	契约型 开放式	Guggenheim Funds Distributors, LLC.	12,441,151.23	4.60
7	FIRST TRUST DJ INTERNET IND	ETF 基金	契约型 开放式	First Trust Advisors LP	11,678,733.89	4.32
8	POWERSHARES DWA SMALLCAP TEC	ETF 基金	契约型 开放式	Invesco PowerShares Capital Management LLC	10,647,382.28	3.93
9	RYDEX S&P EQUAL WEIGHT ETF	ETF 基金	契约型 开放式	Guggenheim Funds Distributors, LLC.	9,572,963.70	3.54
10	POWERSHARES BUYBACK ACHVERS	ETF 基金	契约型 开放式	Invesco PowerShares Capital Management LLC	8,667,596.92	3.20

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

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	-
3	应收股利	179,030.70
4	应收利息	3,437.50
5	应收申购款	12,251.20
6	其他应收款	61,910.97
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	256,630.37

8.9.4 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。

8.9.5 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。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
10,527	29,900.64	5,743,088.80	1.82%	309,020,947.65	98.18%

9.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	80,829.51	0.0257%

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。

§ 10 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	432,885,391.11
本报告期基金总申购份额	1,790,555.36
减：本报告期基金总赎回份额	119,911,910.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	314,764,036.45

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，宁敏女士不再担任本基金管理人副执行总裁职务，相关事项已向中国证券投资基金业协会备案，详情参见 2013 年 8 月 20 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》。

本报告期内，经本基金管理人董事会审议通过，聘任张家文先生担任本基金管理人副执行总裁。张家文先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券投资基金业协会备案，详情参见 2013 年 11 月 6 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，本基金管理人原职工监事陈宇先生因个人原因离任，由本公司基金运营部总经理乐妮女士担任职工监事，乐妮女士的简历详见本基金最新披露的招募说明书。

本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金管理人改聘了为基金进行审计的会计师事务所，为基金进行审计的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所股份有限公司变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 60,000.00 元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	47,248,751.69	19.42%	432,798.00	35.70%	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	83,003,022.71	34.12%	472,921.72	39.01%	-
Morgan Stanley	-	97,183,419.35	39.95%	162,711.13	13.42%	-
CLSA Ltd	-	14,025,400.18	5.77%	42,968.24	3.54%	-
KNIGHT	-	1,789,008.19	0.74%	100,798.44	8.32%	-
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，本报告期内没

有新增券商。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、收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，由交易部相关人员与其开设证券账户。

11.7.2 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	占当期回购成交总额的比例	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
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-	370,110,717.02	25.05%
Goldman Sachs Asia LLC	-	-	-	-	-	-	422,557,538.72	28.60%
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	556,924,151.42	37.69%
CLSA Ltd	-	-	-	-	-	-	14,620,094.22	0.99%
KNIGHT	-	-	-	-	-	-	113,495,667.55	7.68%
KGI	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	中银全球策略证券投资基金（FOF）2012 年第 4 季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-01-22
2	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行开通定期定额投资业务、基智定投业务并参加基金定投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	2013-02-20
3	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	2013-03-30
4	中银全球策略证券投资基金（FOF）2012 年年度报告	www.bocim.com	2013-03-30
5	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书（2013 年第 1 号）	www.bocim.com	2013-04-17
6	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书摘要（2013 年第 1 号）	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-04-17
7	中银全球策略证券投资基金（FOF）2013 年第 1 季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-04-20
8	中银基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-06-01
9	中银全球策略证券投资基金（FOF）2013 年第 2 季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-07-17
10	中银全球策略证券投资基金（FOF）基金经理变更公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-07-19
11	中银全球策略证券投资基金（FOF）2013 年半年度报告摘要	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-08-28
12	中银全球策略证券投资基金（FOF）2013 年半年度报告	www.bocim.com	2013-08-28
13	中银基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-08-30
14	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书（2013 年第 2 号）	www.bocim.com	2013-10-18
15	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书摘要（2013 年第 2 号）	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-10-18

16	中银全球策略证券投资基金（FOF）2013 年第 3 季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-10-25
17	中银基金管理有限公司关于新增交通银行股份有限公司直销账户的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-12-02
18	关于中银全球策略证券投资基金（FOF）2014 年境外主要市场节假日暂停相关交易的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2013-12-30
19	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定期定额投资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	2013-12-30

§ 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
二〇一四年三月二十八日