

中银全球策略证券投资基金（FOF）

2014 年半年度报告

2014 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：二〇一四年八月二十七日

§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 2014 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 2014 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
§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.....	5
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.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
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遵规守信情况的说明.....	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的说明.....	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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	32
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	32
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.....	33
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	37
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.....	38
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.....	38
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.....	38
7.11 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	40
§9 开放式基金份额变动	40
§10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
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	41
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	41
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	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
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	43
11.3 查阅方式	43

§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	262,887,568.13 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	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	北京市西城区金融大街25号

	厦45层	
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
办公地址		-	One Wall Street, New York, NY 10286
邮政编码		-	NY 10286

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（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	5,619,812.32
本期利润	4,471,859.80
加权平均基金份额本期利润	0.0155
本期加权平均净值利润率	1.81%
本期基金份额净值增长率	1.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	-54,046,331.96
期末可供分配基金份额利润	-0.2056
期末基金资产净值	230,421,619.79
期末基金份额净值	0.877
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-12.30%

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	3.06%	0.49%	1.03%	0.16%	2.03%	0.33%
过去三个月	1.98%	0.62%	2.58%	0.25%	-0.60%	0.37%
过去六个月	1.98%	0.76%	2.98%	0.30%	-1.00%	0.46%
过去一年	11.58%	0.63%	11.93%	0.31%	-0.35%	0.32%
过去三年	-12.82%	0.85%	15.48%	0.57%	-28.30%	0.28%
自基金合同生效起至今	-12.30%	0.81%	15.53%	0.57%	-27.83%	0.24%

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 2014 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%。

§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 2014 年 6 月 30 日，本管理人共管理四十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、中银优秀企业股票型证券投资基金、中银活期宝货币市场基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、中银健康生活股票型证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、中银薪钱包货币市场基金，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		
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	-	12	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 12 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的说明

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

国外经济方面，美国经济逐步摆脱冬季暴风雪天气的扰动，恢复较为强劲的复苏势头。从领先指标来看，上半年美国 ISM 制造业 PMI 指数在扩张区间持续稳健上升，同时就业市场不断改善。美国是全球复苏前景最好的经济体，美联储在上半年已经提高对于收缩流动性的讨论。

上半年欧元区经济复苏态势持续放缓，制造业 PMI 指数扩张幅度减弱，价格水平在低位回升乏力。欧洲经济在上半年逐渐丧失动能，欧元的强势加大了欧元区的通缩压力，但是由于欧洲央行未能采用量化宽松政策，加上与俄罗斯的政治博弈，势必会影响欧洲经济的表现。日本经济在安倍没有意愿继续进行结构性改革之后也陷于停滞，核电厂一直无法顺利重启也使得日本的通胀只是来自于能源进口费用的高涨带动，而非安倍所冀望的良性通胀---因为经济复苏使得薪资增加，需求增加而带动的通胀。日本股市单纯只能依靠与日元汇率的反向联动。

此外，美国国债利率也由于资金持续泛滥，到处寻求安全稳定利息的资金将美债当做避风港，也让美国 10 年债收益率从年初市场预期的回到 3% 以上，反而向下突破 2.5%，债市及相关固定收益的资产类别也继续其牛市多头的上涨。

国内经济方面，年初经济增速以较低水平开局，随后在微刺激政策不断加码的支撑下逐步企稳回升。具体来看，领先指标制造业 PMI 指数探底回升，同步指标工业增加值同比增速触及 8.6% 低位后反弹至 9.2%。从经济增长动力来看，拉动经济的三驾马车涨跌不一：出口增速自低位稳步回升，消费增速基本保持平稳，而基建投资部分对冲房地产投资下滑，制造业投资增速持续处于下行周期，固定资产投资增速下行。通胀方面，CPI 同比增速在 1.8%-2.5% 的低位水平震荡，PPI 通缩幅度有所缓解。

2、行情回顾

标普 500 虽然在上半年小幅上涨 4%，但是市场宽度（上涨的个股数量）急剧变窄，分类指数以

下跌居多，特别是医疗生化类股、民生非必需品、科技股等周期性股票，而防御性板块表现较好。MSCI 欧洲指数区间震荡，日本东证指数在日元汇率稳定不再大幅下挫后失去上涨的依据而下跌。美国 10 年券利率则从 3% 下滑至 2.6%。

3、基金运作分析

由于依旧看好美国的经济及股市表现，本基金在上半年仍然超配美国股市及科技、能源股、生化医疗股等。此外，也开始逐渐增加类固定收益等资产类别的投资以应对年中可能的经济放缓。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金的单位净值为 0.877 元，本基金的累计单位净值为 0.877 元。报告期内本基金份额净值增长率为 1.98%，同期业绩比较基准收益率为 2.98%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，美国经济有望继续复苏，通胀水平或将开始抬升；欧元区经济在价格上升乏力、区域结构性问题难解的情况下，复苏可能再遇阻碍，如果欧洲继续加大对俄罗斯的制裁，对于欧洲经济及银行业将进一步的加重运营的压力，随着德国本身经济也开始放缓，如果欧洲央行仍不愿或无法实施量化宽松，我们认为欧洲股市下行风险将加大。美联储货币政策从紧的节奏稳步加速，但是从宏观经济指标来看，各项领先指标仍然上扬，美国经济在下半年或可能恢复活力，此外华尔街已经开始上修未来几年企业盈余预测目标，相信美国股市仍将在下半年上涨。

由于新兴市场在经历前几年的大跌后，估值低于美欧股市，因此国际资金持续流入新兴市场，我们认为这股趋势将会持续，加上中国政策如能在三季度较前期放松，使得经济减速放缓，中国稳增长的态度将会对新兴市场和金融市场的提振作用，新兴市场将会有上行的压力。

日本部分，如果安倍一直没有进行经济结构的改革的话，也就是所谓的第三支箭，日本经济或会重回日本央行再次量化宽松前疲软不振的局面，日本股市也只能继续与日圆的走势深度挂钩，去年大涨的牛市也将难以再现。

全球债市部分，虽然美国 10 年国债利率持续下行，我们认为这个趋势有可能持续下去，因为利率在一定程度上反应了目前美国低通胀的经济环境，而全球超额的储蓄仍然需要一个高质量、低风险的投资标的，但是欧洲，特别是德国国债的低利率水平，却是反应了欧洲经济再度下滑以及宏观基金陷入通缩的前兆，总结来看，下半年全球债市或将继续维持牛市局面。

鉴于对当前经济和通胀增速的判断，经济增速有所企稳，但需求疲弱、产能过剩、融资受限等根本性问题尚难解决，预计下半年经济增速仍将面临一定的下滑压力。国务院常务会议提出在当前经济平稳运行、但下行压力仍较大的情况下，要坚持稳健的货币政策，在落实好已有政策的同时，深化金融改革，用调结构的办法，适时适度预调微调，疏通金融服务实体经济的“血脉”。央行货币

政策执行报告提到坚持“总量稳定、结构优化”的取向，保持定力，主动作为，适时适度预调微调，增强调控的预见性、针对性和有效性，统筹稳增长、促改革、调结构、惠民生和防风险的关系。货币政策操作方面，下半年公开市场到期资金量明显减小，预计央行将使用多组政策工具，在管理短期流动性的同时，对中期利率建立一定的传导机制。社会融资方面，防范金融风险及规范表外融资的政策思路延续，但在微刺激政策的推动下，表内信贷投放将有所加速，预计社会融资总量增速或维持平稳增长。

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。

4.8 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-54,046,331.96 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：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	25,212,758.39	30,970,205.41
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	207,953,201.18	242,660,948.19
其中：股票投资		65,161,849.23	30,523,169.05
基金投资		142,791,351.95	212,137,779.14

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		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,805.63	3,437.50
应收股利		8,490.86	179,030.70
应收申购款		5,341.28	12,251.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	61,910.97
资产总计		233,182,597.34	273,887,783.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		311,737.21	-
应付赎回款		1,858,910.43	2,535,982.32
应付管理人报酬		340,323.11	412,188.34
应付托管费		66,173.94	80,147.73
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	183,832.86	221,999.61
负债合计		2,760,977.55	3,250,318.00
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	262,887,568.13	314,764,036.45
未分配利润	6.4.7.10	-32,465,948.34	-44,126,570.48
所有者权益合计		230,421,619.79	270,637,465.97
负债和所有者权益总计		233,182,597.34	273,887,783.97

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.877 元，基金份额总额 262,887,568.13 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至	上年度可比期间 2013年1月1日至
----	-----	------------------	-----------------------

		2014年6月30日	2013年6月30日
一、收入		8,064,331.50	-26,658,129.04
1.利息收入		61,064.76	62,729.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	61,064.76	62,729.97
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）		8,830,124.43	-38,951,311.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,526,947.76	-3,040,960.84
基金投资收益	6.4.7.13	5,249,913.37	-37,625,249.94
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,053,263.30	1,714,899.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,147,952.52	14,049,724.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		320,134.62	-1,830,779.15
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	960.21	11,506.82
减：二、费用		3,592,471.70	4,532,154.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2	2,205,026.49	3,052,469.66
2. 托管费	6.4.10.2	428,755.13	593,535.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	770,796.09	713,527.45
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	187,893.99	172,621.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,471,859.80	-31,190,283.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,471,859.80	-31,190,283.16

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：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2014年1月1日至2014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）	314,764,036.45	-44,126,570.48	270,637,465.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,471,859.80	4,471,859.80

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)	-51,876,468.32	7,188,762.34	-44,687,705.98
其中: 1.基金申购款	1,307,005.89	-173,853.17	1,133,152.72
2.基金赎回款	-53,183,474.21	7,362,615.51	-45,820,858.70
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)	262,887,568.13	-32,465,948.34	230,421,619.79
项目	上年度可比期间		
	2013年1月1日至2013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)	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)	-	-31,190,283.16	-31,190,283.16
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)	-52,453,928.17	7,875,258.40	-44,578,669.77
其中: 1.基金申购款	939,098.99	-139,444.96	799,654.03
2.基金赎回款	-53,393,027.16	8,014,703.36	-45,378,323.80
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)	380,431,462.94	-81,282,619.19	299,148,843.75

报表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

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”), 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%×MSCI 所有国家世界指数(MSCI All Country World Index)+40%×美国 3 月政府债券(US3-Month T-Bills)收益率。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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。

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 2014年6月30日
活期存款	25,212,758.39
定期存款	-
其他存款	-
合计	25,212,758.39

注: 于 2014 年 6 月 30 日, 活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,889,631.45 元(折合人民币 11,626,524.38 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	60,874,217.66	65,161,849.23	4,287,631.57
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	133,229,104.10	142,791,351.95	9,562,247.85
其他	-	-	-
合计	194,103,321.76	207,953,201.18	13,849,879.42

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 2014年6月30日
应收活期存款利息	2,805.55
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	0.08
其他	-
合计	2,805.63

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	354.97
预提费用	183,477.89
合计	183,832.86

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	314,764,036.45	314,764,036.45
本期申购	1,307,005.89	1,307,005.89
本期赎回（以“-”号填列）	-53,183,474.21	-53,183,474.21
本期末	262,887,568.13	262,887,568.13

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	-70,388,572.87	26,262,002.39	-44,126,570.48

本期利润	5,619,812.32	-1,147,952.52	4,471,859.80
本期基金份额交易产生的变动数	10,722,428.59	-3,533,666.25	7,188,762.34
其中：基金申购款	-266,262.79	92,409.62	-173,853.17
基金赎回款	10,988,691.38	-3,626,075.87	7,362,615.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-54,046,331.96	21,580,383.62	-32,465,948.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	61,054.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	10.08
合计	61,064.76

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	200,783,390.72
减：卖出股票成本总额	198,256,442.96
买卖股票差价收入	2,526,947.76

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	479,868,742.09
减：卖出/赎回基金成本总额	474,618,828.72
基金投资收益	5,249,913.37

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

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 2014年1月1日至2014年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	277,675.30
基金投资产生的股利收益	775,588.00
合计	1,053,263.30

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	-1,147,952.52
——股票投资	2,144,154.05
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-3,292,106.57
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,147,952.52

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	960.21
其他	-
合计	960.21

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 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	770,796.09
银行间市场交易费用	-
合计	770,796.09

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	148,765.71
其他	3,139.10
银行汇划费	1,277.00
合计	187,893.99

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**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露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、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、基金销售机构
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 权证交易

无。

6.4.10.1.3 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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,205,026.49	3,052,469.66
其中：支付销售机构的客户维护费	782,149.12	1,077,813.42

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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	428,755.13	593,535.78

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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013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	13,586,263.91	61,054.68	12,817,051.50	62,729.13
纽约梅隆银行有限公司	11,626,494.48	-	28,608,832.01	-
合计	25,212,758.39	61,054.68	41,425,883.51	62,729.13

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（2014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。

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 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2013 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。

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 2014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	25,212,758.39	-	-	-	25,212,758.39
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	207,953,201.18	207,953,201.18
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	-	-	-	2,805.63	2,805.63
应收股利	-	-	-	8,490.86	8,490.86
应收申购款	-	-	-	5,341.28	5,341.28
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,212,758.39	-	-	207,969,838.95	233,182,597.34
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	311,737.21	311,737.21
应付赎回款	-	-	-	1,858,910.43	1,858,910.43
应付管理人报酬	-	-	-	340,323.11	340,323.11
应付托管费	-	-	-	66,173.94	66,173.94
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	-	-	-	183,832.86	183,832.86
负债总计	-	-	-	2,760,977.55	2,760,977.55
利率敏感度缺口	25,212,758.39	-	-	205,208,861.40	230,421,619.79
上年度末 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

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 2014 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 (2013 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 2014年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计	
以外币计价的资产				
银行存款	11,626,524.38	-	11,626,524.38	
交易性金融资产	204,356,853.28	3,596,347.90	207,953,201.18	
应收证券清算款	-	-	-	
应收股利	8,490.86	-	8,490.86	
其他资产	1.72	-	1.72	
资产合计	215,991,870.24	3,596,347.90	219,588,218.14	
以外币计价的负债				
应付证券清算款	311,737.21	-	311,737.21	
负债合计	311,737.21	-	311,737.21	
资产负债表外汇 风险敞口净额	215,680,133.03	3,596,347.90	219,276,480.93	
项目	上年度末 2013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	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

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 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 1,096	增加约 1,297
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 1,096	减少约 1,297

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 2014年6月30日		上年度末 2013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	65,161,849.23	28.28	30,523,169.05	11.28
交易性金融资产—基金投资	142,791,351.95	61.97	212,137,779.14	78.38
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	207,953,201.18	90.25	242,660,948.19	89.66

6.4.13.4.3.2 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 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约 1,833	增加约 1,525
2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约 1,833	减少约 1,525	

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	65,161,849.23	27.94
	其中：普通股	65,161,849.23	27.94
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	142,791,351.95	61.24
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	25,212,758.39	10.81
8	其他各项资产	16,637.77	0.01
9	合计	233,182,597.34	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（%）
美国	61,565,501.33	26.72
中国香港	3,596,347.90	1.56
合计	65,161,849.23	28.28

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。

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（%）
信息技术	21,882,924.94	9.50
非日常生活消费品	20,291,060.71	8.81
能源	15,311,735.02	6.65
原材料	2,484,193.00	1.08

金融	2,263,984.29	0.98
公用事业	1,719,578.27	0.75
医疗保健	1,208,373.00	0.52
合计	65,161,849.23	28.28

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	TARENA INTERN ATIONA L INC-ADR	达内科技 有限公司	TEDU US	纽约证 券交易 所	美国	52,000	4,200,885.73	1.82
2	VIPSHOP HOLDIN GS LTD - ADS	广州唯品 会信息科 技有限公 司	VIPS US	纽约证 券交易 所	美国	3,200	3,696,405.35	1.60
3	HALLIB URTON CO	哈里伯顿 公司	HAL US	纽约证 券交易 所	美国	6,500	2,839,917.13	1.23
4	MICRON TECHNO LOGY INC	美光科技 公司	MU US	纽约证 券交易 所	美国	12,000	2,432,817.12	1.06
5	CONTIN ENTAL RESOUR CES INC/OK	大陆资源 公司	CLR US	纽约证 券交易 所	美国	2,500	2,430,971.28	1.06
6	WHITIN G PETROL EUM CORP	怀廷石油 公司	WLL US	纽约证 券交易 所	美国	4,900	2,419,434.78	1.05
7	GT ADVANC ED TECHNO LOGIES INC	极特先进 科技公司	GTAT US	纽约证 券交易 所	美国	20,000	2,288,841.60	0.99
8	APPLE	苹果公司	AAPL US	纽约证	美国	4,000	2,287,118.82	0.99

	INC			券交易所				
9	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢公司	SLB US	纽约证券交易所	美国	3,000	2,177,168.28	0.94
10	CTRIPO INTERNATIONAL-ADR	携程旅游网	CTRP US	纽约证券交易所	美国	5,500	2,167,139.22	0.94
11	EOG RESOURCES INC	依欧格资源公司	EOG US	纽约证券交易所	美国	3,000	2,157,048.62	0.94
12	CONOCOPHILLIPS	美国康菲国际石油有限公司	COP US	纽约证券交易所	美国	4,000	2,109,918.18	0.92
13	FACEBOOK INC-A	脸谱网	FB US	纽约证券交易所	美国	5,000	2,070,109.56	0.90
14	NETFLIX INC	NETFLIX 公司	NFLX US	纽约证券交易所	美国	700	1,897,646.58	0.82
15	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	香港	20,000	1,876,769.63	0.81
16	CAVIUM INC	Cavium 公司	CAVM US	纽约证券交易所	美国	6,000	1,833,288.29	0.80
17	JD.COM INC-ADR	北京京东世纪贸易有限公司	JD US	纽约证券交易所	美国	10,000	1,754,163.28	0.76
18	STARBUCKS CORP	星巴克股份有限公司	SBUX US	纽约证券交易所	美国	3,500	1,666,362.82	0.72
19	LINKEDIN CORP-A	领英公司	LNKD US	纽约证券交易所	美国	1,500	1,582,530.92	0.69
20	TAL EDUCATION GROUP-ADR	好未来	XRS US	纽约证券交易所	美国	9,000	1,522,818.00	0.66
21	GOOGLE INC-CLASS A	谷歌公司	GOOGL US	纽约证券交易所	美国	400	1,438,943.03	0.62

				所				
22	ALCOA INC	美铝公司	AA US	纽约证 券交易 所	美国	15,000	1,374,227.88	0.60
23	CANADI AN SOLAR INC	阿特斯太 阳能有 限公 司	CSIQ US	纽约证 券交易 所	美国	7,000	1,346,355.70	0.58
24	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽约证 券交易 所	美国	4,000	1,293,564.67	0.56
25	SANDIS K CORP	闪迪公司	SNDK US	纽约证 券交易 所	美国	2,000	1,285,073.81	0.56
26	CT ENVIRO NMENTA L GROUP LTD	中滔环保 集团有 限公 司	1363 HK	香港证 券交易 所	香港	270,000	1,208,944.50	0.52
27	ILLUMIN A INC	美国基因 测序公 司	ILMN US	纽约证 券交易 所	美国	1,100	1,208,373.00	0.52
28	BORGW ARNER INC	博格华纳 公司	BWA US	纽约证 券交易 所	美国	3,000	1,203,303.10	0.52
29	MARRIO TT INTERN ATIONA L-CL A	万豪国际 酒店集 团公 司	MAR US	纽约证 券交易 所	美国	3,000	1,183,183.44	0.51
30	YELP INC	美国点评 网站	YELP US	纽约证 券交易 所	美国	2,500	1,179,491.76	0.51
31	GASLOG LTD	GasLog 公 司	GLOG US	纽约证 券交易 所	美国	6,000	1,177,276.75	0.51
32	BAIDU INC - SPON ADR	百度公司	BIDU US	纽约证 券交易 所	美国	1,000	1,149,404.57	0.50
33	UBIQUIT I NETWO RKS INC	优比快科 技术有 限公 司	UBNT US	纽约证 券交易 所	美国	4,000	1,112,180.13	0.48
34	ALLEGH	阿勒格尼	ATI US	纽约证	美国	4,000	1,109,965.12	0.48

	ENY TECHNO LOGIES INC	技术公司		券交易 所				
35	AMAZO N.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纽约证 券交易 所	美国	500	999,153.19	0.43
36	BB&T CORP	BB&T 公 司	BBT US	纽约证 券交易 所	美国	4,000	970,419.62	0.42
37	CHINA GAS HOLDIN GS LTD	中国燃气 控股有限 公司	384 HK	香港证 券交易 所	香港	40,000	510,633.77	0.22

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	BOEING CO/THE	BA US	5,412,261.79	2.00
2	FACEBOOK INC-A	FB US	5,083,229.56	1.88
3	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	4,900,932.66	1.81
4	APPLE INC	AAPL US	4,447,818.04	1.64
5	CT ENVIRONMENTAL GROUP LTD	1363 HK	4,426,697.35	1.64
6	EXXON MOBIL CORP	XOM US	4,330,510.83	1.60
7	MCDONALD'S CORP	MCD US	4,265,420.29	1.58
8	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	4,162,549.33	1.54
9	COLGATE-PALMOLIVE CO	CL US	4,141,845.28	1.53
10	HALLIBURTON CO	HAL US	3,970,253.80	1.47
11	VALERO ENERGY CORP	VLO US	3,891,225.81	1.44
12	CANADIAN SOLAR INC	CSIQ US	3,808,175.54	1.41
13	YELP INC	YELP US	3,744,869.66	1.38
14	EOG RESOURCES INC	EOG US	3,721,564.91	1.38
15	TARENA INTERNATIONAL INC-ADR	TEDU US	3,698,802.10	1.37
16	NATIONAL BANK OF GREECE-ADR	NBG US	3,693,569.46	1.36
17	TESLA MOTORS INC	TSLA US	3,495,435.81	1.29

18	VMWARE INC-CLASS A	VMW US	3,341,038.68	1.23
19	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	VIPS US	3,286,546.08	1.21
20	QUALCOMM INC	QCOM US	3,246,926.53	1.20

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	FACEBOOK INC-A	FB US	5,999,127.43	2.22
2	500.COM LTD-CLASS A-ADR	WBAI US	5,506,351.98	2.03
3	BOEING CO/THE	BA US	5,389,056.56	1.99
4	GOOGLE INC-CL C	GOOG US	5,129,491.11	1.90
5	MCDONALD'S CORP	MCD US	4,419,326.36	1.63
6	EXXON MOBIL CORP	XOM US	4,377,503.32	1.62
7	FAST RETAILING CO LTD	9983 JP	4,176,948.26	1.54
8	COLGATE-PALMOLIVE CO	CL US	4,120,087.25	1.52
9	TESLA MOTORS INC	TSLA US	3,926,706.13	1.45
10	CT ENVIRONMENTAL GROUP LTD	1363 HK	3,822,968.34	1.41
11	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	3,753,309.76	1.39
12	VALERO ENERGY CORP	VLO US	3,700,927.97	1.37
13	NATIONAL BANK OF GREECE-ADR	NBG US	3,516,428.55	1.30
14	APPLE INC	AAPL US	3,460,857.86	1.28
15	SANDS CHINA LTD	1928 HK	3,460,403.48	1.28
16	LOCKHEED MARTIN CORP	LMT US	3,334,905.98	1.23
17	QUALCOMM INC	QCOM US	3,314,682.19	1.22
18	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	3,277,471.11	1.21
19	SPLUNK INC	SPLK US	3,270,805.64	1.21
20	VMWARE INC-CLASS A	VMW US	3,094,421.67	1.14

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	230,750,969.09
卖出收入(成交)总额	200,783,390.72

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	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR	ETF 基金	契约性开放式	State Street Bank and Trust Company	12,403,183.41	5.38
2	GUGGENHEIM S&P 500 PURE VALU	ETF 基金	契约性开放式	Guggenheim Funds Distributors Inc	11,367,667.17	4.93
3	WISDOM TREE EUR S/C DIVIDEND	ETF 基金	契约性开放式	WisdomTree Asset Management Inc	11,338,441.37	4.92
4	FIRST TRUST HEALTH CARE ALPH	ETF 基金	契约性开放式	First Trust Portfolios LP	9,832,789.68	4.27
5	KRANESH ARES CSI CHINA INTERN	ETF 基金	契约性开放式	Krane Funds Advisors LLC	9,587,292.96	4.16
6	BARING EUROPE SEL-A USD ACC	ETF 基金	契约性开放式	Baring Fund Managers Ltd	9,265,968.95	4.02
7	CREDIT SUISSE MLP EQUAL WEIG	ETF 基金	契约性开放式	Credit Suisse	7,806,488.06	3.39
8	GUGGENHEIM S&P 500	ETF 基金	契约性开放式	Guggenheim Funds Distributors	7,733,146.68	3.36

	EQUAL WEI			Inc		
9	ENERGY SELECT SECTOR SPDR	ETF 基金	契约性开放式	State Street Bank and Trust Company	7,698,691.00	3.34
10	VANGUARD REIT ETF	ETF 基金	契约性开放式	The Vanguard Group	6,861,085.72	2.98

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 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	8,490.86
4	应收利息	2,805.63
5	应收申购款	5,341.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,637.77

7.11.4 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。

7.11.5 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	持有份额	占总份额

			比例		比例
9,233	28,472.61	5,545,411.34	2.11%	257,342,156.79	97.89%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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	314,764,036.45
本报告期基金总申购份额	1,307,005.89
减：本报告期基金总赎回份额	53,183,474.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	262,887,568.13

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，基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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	
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	107,429,085.73	24.89%	205,951.00	32.17%	-
CLSA Ltd	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	104,030,901.97	24.11%	214,163.16	33.45%	-
Morgan Stanley	-	220,074,372.11	51.00%	220,044.42	34.37%	-
KNIGHT	-	-	-	-	-	-
FUNDSETTLE	-	-	-	-	-	-
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。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	-	-	-	-	-	-	113,020,207.70	12.72%
CLSA Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Asia LLC	-	-	-	-	-	-	93,645,996.98	10.54%
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	656,929,323.06	73.94%
KNIGHT	-	-	-	-	-	-	-	-
FUNDSEATTLE	-	-	-	-	-	-	24,837,722.48	2.80%
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	中银全球策略证券投资基金（FOF）2013年第4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2014-01-21
2	中银基金管理有限公司关于网上直销平台开通一户多卡功能的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2014-01-23
3	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2014-02-17
4	中银基金管理有限公司关于调整旗下公募基	《中国证券报》、《上海证	2014-03-27

	金对账单服务形式的公告	券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	
5	中银全球策略证券投资基金（FOF）2013 年年度报告	www.bocim.com	2014-03-28
6	中银全球策略证券投资基金（FOF）2013 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2014-03-28
7	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行网银申购业务费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2014-03-31
8	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书摘要（2014 年第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2014-04-17
9	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书（2014 年第 1 号）	www.bocim.com	2014-04-17
10	中银全球策略证券投资基金（FOF）2014 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2014-04-19

§11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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

二〇一四年八月二十七日