

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

\$ 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人:中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,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、误导性陈述或重大遗漏。
基金托管人:承诺对事实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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。投资人投资前应仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要需经年度报告正文,投资人欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

\$ 2 基金简介

基金简称	中银全球策略证券投资基金(FOF)
基金代码	168813
交易代码	168813

基金运作方式:契约型开放式

基金合同特别约定:2013年3月13日

基金合同终止日:2013年3月31日

基金合同生效日:2013年3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

基金份额总额:314,764,036.45份

基金合同存续期:不定期

2.1 基金基本情况

基金投资目标:通过全球化的资产配置和组合管理,实现组合基金的分散化投资,力争“四重”投资策略,力争实现投资组合的收益最大化,严格遵守基金合同,追求基金资产增值。

基金投资策略:坚持价值投资,投资于成长型股票、债券及货币市场工具,降低风险,追求长期资本增值。

基金业绩基准:中银全球策略证券投资基金(FOF)的业绩基准为:60%×MSCI All Country World Index+40%×美国国债收益率+3-Month T-Bills收益率。

基金资产配置比例:股票资产占基金资产的比例为60%~95%;债券资产占基金资产的比例为0~40%;现金类资产占基金资产的比例为0~15%。

业绩比较基准:60%×MSCI 所有国家世界指数(MSCI All Country World Index)+40%×美国国债收益率+3-Month T-Bills收益率。

风险收益特征:本基金为混合型基金,风险与收益水平高于债券型基金,低于股票型基金。

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,实现组合基金的分散化投资,力争“四重”投资策略,力争实现投资组合的收益最大化,严格遵守基金合同,追求基金资产增值。

投资策略:坚持价值投资,投资于成长型股票、债券及货币市场工具,降低风险,追求长期资本增值。

业绩基准:中银全球策略证券投资基金(FOF)的业绩基准为:60%×MSCI All Country World Index+40%×美国国债收益率+3-Month T-Bills收益率。

风险收益特征:本基金为混合型基金,风险与收益水平高于债券型基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

名称:中银基金管理有限公司

住所:中国建设银行股份有限公司

法定代表人:田青

信息披露负责人:田青

联系电话:010-57596096

电子邮箱:clenver@zif.com.cn

客户服务电话:021-38834788 400-888-5566

传真:010-57596096

邮政编码:100007

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:Bank of New York Mellon

住所:中国建设银行

法定代表人:田青

信息披露负责人:田青

联系电话:010-57596096

电子邮箱:clenver@zif.com.cn

客户服务电话:021-38834788 400-888-5566

传真:010-57596096

邮政编码:100007

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

登载年度报告正文的管理人互联网网址:<http://www.zif.com.cn>

基金半年度报告要点:上海市淮海中路200号中银大厦2层

§ 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1日至2013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:-6,680,989.67 19,416,272.44 -96,655,519.86

加权平均基金份额本期利润:-0.0151 0.0409 -0.1424

本期基金份额净值增长率为:-0.09% 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:-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

注:1.本期未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.期末可供分配利润除采用月末平均法计算的期末利润外,还采用月末平均法计算的期末可供分配利润,即:期末可供分配利润=基金本期末可供分配利润/(期末基金资产净值+期末可供分配利润)/2。
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算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 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

期间 价差净额 增长率 (%) 单位净值 变幅 (%) 业绩比较基准收益率 (%) ①-④ ②-④

过去三个月 5.13% 0.52% 4.13% 0.35% 1.00% 0.19%

过去六个月 9.41% 0.47% 8.70% 0.35% 0.71% 0.14%

过去一年 -0.09% 0.54% 11.84% 0.35% -12.43% 0.15%

自基金合同生效起至今 -14.00% 0.82% 12.09% 0.61% -26.19% 0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变化与同期业绩比较基准收益率变化的对比图

单位:人民币元

时间 价差净额 增长率 (%) 单位净值 变幅 (%) 业绩比较基准收益率 (%) ①-④ ②-④

过去三个月 5.13% 0.52% 4.13% 0.35% 1.00% 0.19%

过去六个月 9.41% 0.47% 8.70% 0.35% 0.71% 0.14%

过去一年 -0.09% 0.54% 11.84% 0.35% -12.43% 0.15%

自基金合同生效起至今 -14.00% 0.82% 12.09% 0.61% -26.19% 0.21%

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

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

应付股利 - - -

应付利息 7.4.7.1 30,970,205.41 54,850,440.98

应付组合基金 - - -

应付赎回款 - - -

应付保证金 - - -

应付交易费用 - - -

应付税项 - - -

应付手续费 - - -

应付清算费 - - -

应付评估费 - - -

应付信息披露费 - - -

应付审计费 - - -

应付优先股股息 - - -

应付定期报告费 - - -

应付临时报告费 - - -

应付分红派息费 - - -

应付信息披露费 - - -