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:二〇一三年三月三十日

中银全球策略证券投资基金(FOF)

2012年度报告摘要

2012年12月31日

§1 重要提示

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2013年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	432,885,391.11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,运用"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	柳明	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

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		-	-

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

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金年度报告备置地点	上海市银城中路200号中银大厦45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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年3月3日至2011年12月31日
本期已实现收益	-25,112,633.65	-14,257,115.76
本期利润	19,416,272.74	-96,655,519.86
加权平均基金份额本期利润	0.0409	-0.1424
本期基金份额净值增长率	4.46%	-17.10%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1339	-0.1714
期末基金资产净值	374,917,796.68	438,759,241.56
期末基金份额净值	0.866	0.829

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	0.93%	0.69%	1.51%	0.40%	-0.58%	0.29%
过去六个月	5.22%	0.77%	5.32%	0.45%	-0.10%	0.32%
过去一年	4.46%	0.82%	8.09%	0.50%	-3.63%	0.32%
自基金合同生效起至今	-13.40%	0.93%	0.31%	0.70%	-13.71%	0.23%

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

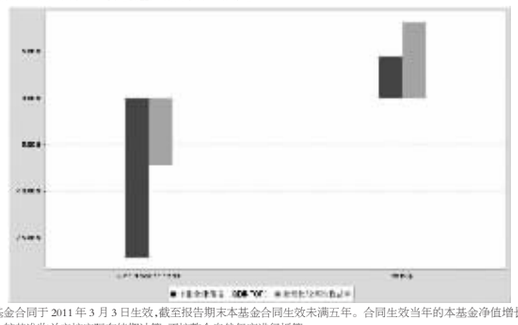
(2011年3月3日至2012年12月31日)

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)

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



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 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

金额单位: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
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2012年12月31日,本管理人共管理二十三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、中银监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及中银理财7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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
唐华	本基金的基金经理、公司国际业务部总经理	2011-03-03	-	14	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月至今任中银全球策略(QDII-FOF)基金基金经理。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遵规守信情况的说明

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

2012年,全球资本市场悄然发生了一场深刻的变革,即宏观经济局势的脆弱性和不确定性促使全球主要发达经济体从三季度开始坚定地推行"无上限"量化宽松,为市场注入充沛的流动性。如欧洲央行承诺在二级市场上无限量购买欧元区国债,大大降低甚至基本消除了欧元区崩溃的风险;美联储宣布每月向市场注入850亿美元,直到就业市场出现明显改善;随着新首相的当选,日本央行也推出无上限资产购买及贷款计划,直至通胀率达到2%。放眼全球,2012年通胀压力减小,超宽松的货币政策大行其道,帮助实体经济企稳回升。欧元区债务危机得到缓解,美国房地产市场触底反弹。同时,各国领导层换届完成,政策不明朗性得到扭转。这让资本市场产生了结构性变化,过去数年停靠于债券市场数万亿美元的投资有望从债市撤离,流向股市,而2012年则很可能是全球债市和股市牛熊交替的转捩点。一方面,美国10年期国债收益率在2007年金融危机爆发前一度达到5%的水平,随后大量避险资金涌入债市,推动债券收益率一路震荡下行,并在2012年年中触及1.5%的低点,此后回稳上扬。债市持续了几年的牛市可能告一段落;另一方面,2012年全球股市呈现普涨态势,美国、欧洲、印度、俄罗斯等市场的涨幅均超过10%,中国和巴西股市则表现欠佳,直到12月份才开始反转;最后,大宗商品市场全年表现平平,石油、煤炭等能源以下跌收官,贵金属在三季度各国开始推行无上限量化宽松后不升反跌,显示出市场信心的恢复。总体来说,2012年风险资产表现优于避险资产。

报告期内,本基金管理团队对宏观经济走势和市场趋势的判断较为准确,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。遗憾之处在于一季度对全球股市做出了超买预判,较早地在投资组合里增加了波动率指数ETF这一安全垫,牺牲了一季度末的部分涨幅,且该投资标的未能在市场下跌时有效地起到对冲作用,影响了组合业绩。此外,对中国大盘和香港中资概念股的把握和判断有所偏差,以及在欧美纷纷推出量化宽松后加仓贵金属矿ETF,拖累了组合整体表现。展望2013年,本基金管理团队将精简投资品种,向宽基ETF集中,集中精力重点把握市场的大趋势和大方向。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日为止,本基金的单位净值为0.866元,本基金的累计单位净值为0.866元。年内本基金净值增长率为4.46%,同期业绩基准增长率为8.09%。

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2013年,预计美国财政悬崖问题得以解决,欧洲债务问题也不再成为市场的拖累,中国再度通过大量财政刺激政策拉动经济增长。目前,全球PMI的改善显示实体经济正在恢复,而全球通胀仍在低水平徘徊,为宽松的货币政策提供基础,预计全球经济在宽松的货币环境下将继续回稳。分区域来看,美国经济领先指标动能已经开始放缓,后续表现可能不及其它地区。新兴市场综合PMI新订单指数及工业生产动能都已经超过发达国家,后续表现值得期待。在此,通胀率仍是一个关键指标,新兴市场的复苏可能推升大宗商品价格和出口价格,带动发达国家的通胀上扬,继而影响发达国家消费和整体经济表现。

从大类资产配置的角度,我们认为权益市场超额报酬的潜力将高于固定收益市场。权益市场方面,由于全球流动性充沛,市场信心恢复,而经济基本面向好,新兴市场的潜力将高于发达市场。同时,通胀是否能够保持稳定,将决定金融市场的表现,我们将在下半年严格防范通胀抬头的风险。

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,由交易部做出提示,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,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%。

本报告期期末可供分配利润为-57,967,594.43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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所审计,注册会计师汪棣、刘颖签字出具了普华永道中天审字(2013)第20485号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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:2012年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	54,850,440.98	67,243,231.34
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	322,849,355.52	373,900,725.39
其中:股票投资		17,305,884.66	16,187,471.43
基金投资		305,543,470.86	357,713,253.96
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	1,667.10	438,647.02
应收股利		1,125,396.74	601,544.98
应收申购款		2,766.78	32,852.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		378,930,865.34	442,217,001.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31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	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		3,152,156.29	2,546,811.50
应付管理人报酬		566,737.78	689,316.37
应付托管费		110,199.01	134,033.70
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	183,975.58	87,598.44
负债合计		4,013,068.66	3,457,760.01
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	432,885,391.11	529,535,550.94
未分配利润	7.4.7.10	-57,967,594.43	-90,776,309.38
所有者权益合计		374,917,796.68	438,759,241.56
负债和所有者权益总计		378,930,865.34	442,217,001.57

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.866元,基金份额总额432,885,391.11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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年3月3日至2011年12月31日
一、收入		29,746,479.37	-83,610,506.76
1.利息收入		449,846.28	8,604,284.28
其中:存款利息收入	7.4.7.11	449,846.28	2,918,698.42
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		-	5,685,585.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-15,171,998.66	-6,987,164.28
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-689,582.62	590,000.66
基金投资收益	7.4.7.13	-20,393,403.51	-12,978,198.74
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.15	5,910,987.47	5,401,033.80
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	44,528,906.39	-82,398,404.10
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-127,765.76	-3,504,641.99
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	67,491.12	675,419.33
减:二、费用		10,330,206.63	13,045,013.10
1. 管理人报酬		7,322,088.07	9,610,312.53
2. 托管费		1,423,739.28	1,868,671.88
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,201,288.29	1,280,953.34
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	383,090.99	285,075.35
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		19,416,272.74	-96,655,519.86
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		19,416,272.74	-96,655,519.86

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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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
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
项目	上年度可比期间 2011年3月3日至2011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)	1,059,555,414.92	-	1,059,555,414.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-96,655,519.86	-96,655,519.86
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)	-530,019,863.98	5,879,210.48	-524,140,653.50
其中:1.基金申购款	5,311,706.11	-346,378.76	4,965,327.35
2.基金赎回款	-535,331,570.09	6,225,589.24	-529,105,980.85
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)	529,535,550.94	-90,776,309.38	438,759,241.56

报告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:

基金管理公司负责人: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")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证券投资基金,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。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。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于2013年3月29日批准报出。

7.4.2 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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年度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12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有需作说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外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) 目前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) 目前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,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 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("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
中国银行股份有限公司	基金管理人的股东、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
中银国际证券有限责任公司	受中国银行重大影响、基金代销机构

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年3月3日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,322,088.07	9,610,312.53
其中:支付销售机构的客户维护费	2,671,303.35	3,635,093.34

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年3月3日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,423,739.28	1,868,671.88

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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2011年3月3日至2011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
中国建设银行	7,087,852.90	134,802.37	19,917,991.82	390,797.02
纽约梅隆银行有限公司	47,762,588.08	-	7,325,239.52	-
合计	54,850,440.98	134,802.37	27,243,231.34	390,797.02

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。

7.4.8.6 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在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2012年12月31日,本基金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中属于第一层级的余额为322,849,355.52元,无属于第二层级