

# 中银全球策略证券投资基金（FOF）

## 2020 年中期报告

### 2020 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：二〇二〇年八月三十一日

## 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。本中期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 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
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.....	33
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.....	35
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.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	37
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	37
7.11 本报告期投资基金情况.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	40

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	41
<b>10 重大事件揭示</b> .....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
<b>11 备查文件目录</b> .....	44
11.1 备查文件目录.....	44
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	45

## 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	76,352,947.67 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	欧阳向军	李申
	联系电话	021-38834999	021-60637102
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	021-60637111
传真		021-68873488	021-60635778
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、27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	章砚	田国立

## 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		-	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
办公地址		-	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
邮政编码		-	-

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

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bocim.com">http://www.bocim.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼

## 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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	786,911.15
本期利润	1,308,995.81
加权平均基金份额本期利润	0.0167
本期加权平均净值利润率	2.86%
本期基金份额净值增长率	1.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-32,024,909.93
期末可供分配基金份额利润	-0.4194
期末基金资产净值	47,323,497.94
期末基金份额净值	0.620
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-38.00%

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	3.68%	1.11%	1.87%	0.91%	1.81%	0.20%
过去三个月	18.10%	1.40%	11.06%	1.07%	7.04%	0.33%
过去六个月	1.81%	2.27%	-3.47%	1.49%	5.28%	0.78%
过去一年	6.90%	1.62%	1.38%	1.07%	5.52%	0.55%
过去三年	6.53%	1.10%	10.18%	0.70%	-3.65%	0.40%
自基金合同生效起至今	-38.00%	1.09%	34.55%	0.58%	-72.55%	0.51%

#### 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2020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，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## 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

本基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至2020年6月30日，本基金管理人共管理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、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等124只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

#### 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	基金经理	2013-07-18	2020-04-02	19	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2020年4月任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理。具有19年证券从业年限。具备基金从业资格。
夏宜冰	基金经理	2020-04-02	-	17	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），应用金融学硕士。曾任三菱日联资管(香港)高级基金经理、平安资管投资经理。2018

					年加入中银基金管理有限公司，2020 年 4 月至今任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理。具有 17 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《中华人民共和国证券投资基金法》、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。

##### 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

2020 年上半年的全球经济，以我们完全没有预期的方式开启。全球的投资人在面对一场前所未有的疫情的同时，也在经历着史无前例的宏观政策。疫情或许会在未来的某个时间点离开我们，也或

许我们将在一个较长时期与此病毒共存，这些至少目前都未有定论，但是它对于我们的宏观研究框架的影响应该会长期存在。未来很长的时间里，我们将要面对空前庞大的美联储资产负债表，我们将面对有史以来最宽松的全球货币政策，我们将面对长期接近零利率甚至负利率环境的可能性，我们将面对各个国家对于全球化的反思以及全球供应链的重新思考，我们将面对之后可能更加跌宕起伏的中美关系，我们还将可能面对很多我们之前未有预料过的新情况，这些都需要我们认真地思考和分析。

传统上，我们在解读全球宏观经济的时候，习惯于以美国为出发点；而在解读美国的宏观经济时，我们非常依赖不断更新的各项经济指标数字。但在 2020 年上半年，尤其是第二季度，一些更为宏观的变量对于这一时期的投资决策影响非常显著。我们对于 2020 年上半年的宏观分析，主要关注三条主线：（1）疫情、包括相关的疫苗同药物的研发进展，以及各国复产复工的进展情况；（2）全球各国的货币与财政政策及其边际变化趋势；（3）美国今年以总统竞选为核心的国内政治情况，以及相关的中美关系的演进。在 2020 年上半年的多数时间里，这三个因素交替对包括中国市场在内的全球金融市场产生较大影响。在下半年的相当长的时间里，可能仍旧是这个情况，因此我们仍会沿用这个分析框架。总体上看，随着时间的推移，我们认为全球宏观经济基本面逐渐向好是大概率事件，但是一些扰动因素造成的市场波动亦不可避免。

## 2. 市场回顾

回首上半年，全球多数发达经济体的走势，均出现了相当多投资人预期之外的 V 形反转态势：在经历了第一季度的冲击之后，随着疫情在多数国家逐步得到控制，以及力度空前的财政货币政策的支撑，全球金融市场逐步走出阴霾，甚至美国纳斯达克指数还在第二季度末创出历史新高。

从市场内部结构来看，行业之间的分化也较为明显。以医药，科技，互联网等为代表的疫情受益或者受损较小的行业在反弹的过程中，整体表现十分强劲，多数创出历史新高。而很多传统行业，虽然也有相当幅度的反弹，却仍旧受困于诸多因素，后期走势较为纠结。

## 3. 运行分析

就基金的配置上，在经历了第一季度的冲击之后，我们在第二季度前半期重点配置了受疫情影响较小甚至受益的资产，以云计算，互联网，科技为代表。而在第二季度后半段，基于对全球复工复产情况的具体分析，以及对于各国宏观政策和相关经济指标的紧密跟踪，我们逐步增加了与复工复产相关的资产配置。本基金业绩表现好于比较基准。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 1.81%，同期业绩比较基准收益率为-3.47%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

接手管理本基金的时候，正值欧美疫情剧烈冲击，全球市场喘息未定之时。而到我们撰写这次半年度报告的时候，以美国市场为代表的全球主要股市，从连续熔断的阴影中逐步走出，指数纷纷创出或者接近历史新高。直面市场，经历这样前所未有的跌宕起伏，对于我们来说，的确有如履薄冰之感。

展望第三季度以及下半年，我们认为，随着各国经济秩序逐步恢复正常，投资人会更加关注宏观经济指标的趋势走向，以及各国货币和财政政策的边际变化趋势。随着复产复工的不断推进，投资人对于企业盈利预测的变化也会成为影响市场的重要因素。同时，随着美国大选逐步进入关键时期，中美关系的议题也会对市场产生影响，反映在市场走势上，就是会有波动。但是我们认为，全球经济基本面逐步向好是越来越明确的趋势。我们会综合考虑各方面因素，适时调整我们的配置。

就更长的时间跨度而言，我们已经越来越清晰地看到，经过本次疫情的洗礼，未来中美两个大国在全球政治经济的影响力还会不断加大，相应地对于全球资本市场的影响也将会愈来愈大。我们的资产配置将会从这个基本点出发，并围绕每一阶段的主要变量展开调整。

最后，就整体投资而言，我们深感自己所能够把握的东西总是有限的，而我们所需要学习的东西总是无限的。但是，我们相信时间的力量。在正确的方向上，耐心地不断做点滴的正向累积，其结果将是惊人的。全球的资本市场经过长时间反复筛选和不断积累，穿越时空，把最优秀的公司展示在我们面前。我们有幸，怀谦卑之心，择其若干，放入我们的组合，分享其不断努力成果，这才是我们全球策略的初心和本质。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.6.1 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，由研究部、风险管理部、基金运营部及投资相关部门的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。估值委员会审议并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环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、托管行的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的

相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2 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。

4.6.3 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-32,024,909.93 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期末，本基金已连续超过 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，相应解决方案已报送中国证监会。

## 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 托管人对本中期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 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：2020年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	7,376,823.94	3,595,117.19
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	41,366,753.48	42,565,906.53
其中：股票投资		9,996,691.41	12,590,866.87
基金投资		31,370,062.07	29,975,039.66
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		-	485,073.05
应收利息	6.4.7.5	341.96	391.42
应收股利		28,336.06	29,391.22
应收申购款		100,831.31	24,698.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	2,625.15	-
<b>资产总计</b>		<b>48,875,711.90</b>	<b>46,700,577.78</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负债：</b>		-	-
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		169,922.16	-
应付赎回款		1,203,447.83	564,147.27
应付管理人报酬		69,984.17	70,934.45
应付托管费		13,608.07	13,792.82
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	95,251.73	81,104.27
<b>负债合计</b>		<b>1,552,213.96</b>	<b>729,978.81</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	76,352,947.67	75,491,561.22

未分配利润	6.4.7.10	-29,029,449.73	-29,520,962.25
<b>所有者权益合计</b>		<b>47,323,497.94</b>	<b>45,970,598.97</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>48,875,711.90</b>	<b>46,700,577.78</b>

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.620 元，基金份额总额 76,352,947.67 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>1,907,855.36</b>	<b>1,850,000.26</b>
1.利息收入		12,952.56	23,123.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,952.56	23,123.13
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,341,272.93	-1,442,058.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	676,160.09	-279,964.90
基金投资收益	6.4.7.13	435,067.16	-1,400,576.82
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	230,045.68	238,483.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	522,084.66	3,291,322.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		19,923.63	-26,386.72
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	11,621.58	3,999.34
<b>减：二、费用</b>		<b>598,859.55</b>	<b>866,209.77</b>
1. 管理人报酬	<b>6.4.10.2</b>	409,483.28	427,146.05
2. 托管费	6.4.10.2	79,621.80	83,056.19
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	62,472.27	298,647.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		4,495.30	0.00
7. 其他费用	6.4.7.20	42,786.90	57,360.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,308,995.81</b>	<b>983,790.49</b>

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,308,995.81</b>	<b>983,790.49</b>

### 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：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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）	75,491,561.22	-29,520,962.25	45,970,598.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,308,995.81	1,308,995.81
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）	861,386.45	-817,483.29	43,903.16
其中：1.基金申购款	23,879,978.42	-10,336,477.17	13,543,501.25
2.基金赎回款	-23,018,591.97	9,518,993.88	-13,499,598.09
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）	76,352,947.67	-29,029,449.73	47,323,497.94
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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）	86,296,189.91	-37,262,633.04	49,033,556.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	983,790.49	983,790.49
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）	-5,778,478.26	2,451,767.20	-3,326,711.06
其中：1.基金申购款	4,885,973.56	-2,073,634.74	2,812,338.82
2.基金赎回款	-10,664,451.82	4,525,401.94	-6,139,049.88
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）	80,517,711.65	-33,827,075.35	46,690,636.30

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：张家文，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]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)。

本基金投资于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： $60\% \times \text{MSCI 所有国家世界指数 (MSCI All Country World Index)}$  +  $40\% \times \text{美国 3 月政府债券 (US 3-Month T-Bills)}$  收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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，对于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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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 3 号《半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<年度报告和中期报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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于 2020 年 6 月 30 日的财务

状况以及 2020 年上半年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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营

业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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，在境内暂免征增值税和企业所得税；

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	7,376,823.94
定期存款	-
其他存款	-
合计	7,376,823.94

注：于 2020 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 700,917.80 元(折合人民币 4,962,147.56 元)，港币活期存款 2,874.00 元(折合人民币 2,625.10 元)。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,535,474.29	9,996,691.41	1,461,217.12
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	28,143,227.11	31,370,062.07	3,226,834.96
其他	-	-	-

合计	36,678,701.40	41,366,753.48	4,688,052.08
----	---------------	---------------	--------------

**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 2020年6月30日
应收活期存款利息	341.96
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	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	341.96

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	2,625.15
待摊费用	-
合计	2,625.15

**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 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	2,845.07
应付证券出借违约金	-
应付审计费	14,918.54
应付信息披露费	74,863.02
应付在途资金	2,625.10
合计	95,251.73

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,491,561.22	75,491,561.22
本期申购	23,879,978.42	23,879,978.42
本期赎回（以“-”号填列）	-23,018,591.97	-23,018,591.97
本期末	76,352,947.67	76,352,947.67

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	-32,563,237.36	3,042,275.11	-29,520,962.25
本期利润	786,911.15	522,084.66	1,308,995.81
本期基金份额交易产生的变动数	-248,583.72	-568,899.57	-817,483.29
其中：基金申购款	-10,018,718.18	-317,758.99	-10,336,477.17
基金赎回款	9,770,134.46	-251,140.58	9,518,993.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-32,024,909.93	2,995,460.20	-29,029,449.73

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	21.36
合计	12,952.56

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	16,049,405.24
减：卖出股票成本总额	15,373,245.15
买卖股票差价收入	676,160.09

**6.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	28,413,937.12
减：卖出/赎回基金成本总额	27,978,869.96
基金投资收益	435,067.16

**6.4.7.14 债券投资收益****6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	47,134.32
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	182,911.36
合计	230,045.68

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	522,084.66
——股票投资	174,633.31
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	347,451.35
——其他	-

2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	522,084.66

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	11,621.58
合计	11,621.58

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 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	32,956.53
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	29,515.74
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	62,472.27

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,680.00
其他	325.34
合计	42,786.90

**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，本基金并无需作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 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。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.1.1 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	409,483.28	427,146.05
其中：支付销售机构的客户维护费	146,239.12	153,465.98

注：基金管理费每日计提，按月支付。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

##### 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
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年6月 30日	2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	79,621.80	83,056.19

注：基金托管费每日计提，按月支付。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

#### 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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	
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019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
中国建设银行股份有限公司	2,412,067.63	12,074.82	1,948,006.94	7,869.67
纽约梅隆	4,964,756.31	856.38	2,362,017.26	15,252.83
合计	7,376,823.94	12,931.20	4,310,024.20	23,122.50

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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 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（2020 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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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、内控与法律合规部、审计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。

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业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 2020 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资(2019 年 12 月 31 日:同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在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在基金每个开放日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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金投资于一家公司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一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余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 2020 年 06 月 30 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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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因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。

本基金的生息资产主要为银行存款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	7,376,823.94	-	-	-	7,376,823.94
交易性金融资产	-	-	-	41,366,753.48	41,366,753.48
应收利息	-	-	-	341.96	341.96
应收股利	-	-	-	28,336.06	28,336.06
其他应收款	-	-	-	2,625.15	2,625.15
应收申购款	-	-	-	100,831.31	100,831.31
资产总计	7,376,823.94	-	-	41,498,887.96	48,875,711.90

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	169,922.16	169,922.16
应付赎回款	-	-	-	1,203,447.83	1,203,447.83
应付管理人报酬	-	-	-	69,984.17	69,984.17
应付托管费	-	-	-	13,608.07	13,608.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	95,251.73	95,251.73
负债总计	-	-	-	1,552,213.96	1,552,213.96
利率敏感度缺口	7,376,823.94	-	-	39,946,674.00	47,323,497.94
上年度末 2019 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	3,595,117.19	-	-	-	3,595,117.19
交易性金融资产	-	-	-	42,565,906.53	42,565,906.53
应收利息	-	-	-	391.42	391.42
应收股利	-	-	-	29,391.22	29,391.22
应收申购款	99.99	-	-	24,598.38	24,698.37
证券清算款	-	-	-	485,073.05	485,073.05
资产总计	3,595,217.18	-	-	43,105,360.60	46,700,577.78
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	564,147.27	564,147.27
应付管理人报酬	-	-	-	70,934.45	70,934.45
应付托管费	-	-	-	13,792.82	13,792.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	81,104.27	81,104.27
负债总计	-	-	-	729,978.81	729,978.81
利率敏感度缺口	3,595,217.18	-	-	42,375,381.79	45,970,598.97

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者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例低于 10%（2019 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 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 2020年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	4,962,147.56	2,625.10	-	4,964,772.66
交易性金融资产	34,247,079.83	7,119,673.65	-	41,366,753.48
应收股利	27,376.99	-	959.07	28,336.06
应收利息	11.26	-	-	11.26
其他应收款	2,625.15	-	-	2,625.15
资产合计	39,239,240.79	7,122,298.75	959.07	46,362,498.61
以外币计价的负债				
应付证券清算款	169,922.16	-	-	169,922.16
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	2,625.10	-	2,625.10

负债合计	169,922.16	2,625.10	-	172,547.26
资产负债表外 汇风险敞口净 额	39,069,318.63	7,119,673.65	959.07	46,189,951.35
项目	上年度末 2019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	2,001,948.46	-	-	2,001,948.46
交易性金融资 产	37,752,771.55	3,840,081.70	973,053.28	42,565,906.53
应收证券清算 款	485,073.05	-	-	485,073.05
应收股利	29,391.22	-	0.00	29,391.22
应收利息	10.05	-	-	10.05
其它资产	-	-	-	-
资产合计	40,269,194.33	3,840,081.70	973,053.28	45,082,329.31
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	40,269,194.33	3,840,081.70	973,053.28	45,082,329.31

## 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		
	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）	
分析		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	港币相对人民币升值 5%	增加约 36	增加约 19
	港币相对人民币贬值 5%	减少约 36	减少约 19
	美元相对人民币升值 5%	增加约 195	增加约 201
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 195	减少约 201
	其他货币相对人民币升值 5%	增加约 0	增加约 5
	其他货币相对人民币贬值 5%	减少约 0	减少约 5

## 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。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%。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	9,996,691.41	21.12	-	-
交易性金融资产—基金投资	31,370,062.07	66.29	-	-
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	41,366,753.48	87.41	-	-

#### 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	上年度末

		2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 334	增加约 97
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 334	减少约 97

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

本报告期内无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	9,996,691.41	20.45
	其中：普通股	9,538,576.97	19.52
	存托凭证	458,114.44	0.94
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	31,370,062.07	64.18
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	7,376,823.94	15.09
8	其他各项资产	132,134.48	0.27
9	合计	48,875,711.90	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 (%)
香港	6,265,173.32	13.24
美国	3,731,518.09	7.89
合计	9,996,691.41	21.12

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（%）
医疗保健	3,010,097.44	6.36
非日常生活消费品	2,717,788.49	5.74
通讯服务	1,669,832.28	3.53
信息技术	1,114,214.19	2.35
工业	656,549.83	1.39
日常消费品	591,881.31	1.25
金融	236,327.87	0.50
合计	9,996,691.41	21.12

注：由管理人与托管人协商确认，采用国际通用的具有权威性的行业分类标准。

### 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	TENCEN T HOLDIN GS LTD	腾讯控股	700 HK	香港证 券交易 所	香港	2,000	910,839.58	1.92
2	AMAZO N.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克交易 所	美国	40	781,242.65	1.65
3	EVER SUNSHI NE LIFESTY LE SERV	永升生活 服务	1995 HK	香港证 券交易 所	香港	60,000	656,549.83	1.39
4	ASCENT AGE PHARMA GROUP INTER	亚盛医药	6855 HK	香港证 券交易 所	香港	15,000	646,685.14	1.37
5	JINXIN FERTILI TY GROUP LTD	锦欣生殖	1951 HK	香港证 券交易 所	香港	60,000	643,396.91	1.36
6	CHINA	中国东方	667 HK	香港证	香港	50,000	640,291.36	1.35

	EAST EDUCATION HOLDING	教育		券交易所				
7	ALPHABET INC-CLASS	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	60	602,345.10	1.27
8	CHINA RESOURCES ENTERPRISE	华润啤酒	291 HK	香港证券交易所	香港	15,000	591,881.31	1.25
9	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	400	576,299.62	1.22
10	VIVA BIOTECH HOLDINGS	维亚生物	1873 HK	香港证券交易所	香港	70,000	554,980.07	1.17
11	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	200	537,914.57	1.14
12	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药	1177 HK	香港证券交易所	香港	40,000	533,423.90	1.13
13	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴	BABA US	纽约证券交易所	美国	300	458,114.44	0.97
14	CANSINO BIOLOGICS INC-HK	康希诺	6185 HK	香港证券交易所	香港	2,000	390,568.60	0.83
15	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴	9988 HK	香港证券交易所	香港	2,000	382,896.06	0.81
16	JD.COM INC-ADR	京东集团	JD US	纳斯达克交易所	美国	700	298,231.02	0.63
17	LEGEND	传奇生物	LEGN US	纳斯达克交易所	美国	800	241,042.82	0.51

	BIOTEC H CORP-A DR			克交易 所				
18	MSCI US	MSCI 明 晟	MSCI US	纽约证 券交易 所	美国	100	236,327.87	0.50
19	MEITUA N DIANPIN G-CLASS B	美团点评	3690 HK	香港证 券交易 所	香港	1,000	157,012.96	0.33
20	FRIENDT IMES INC	友谊时光	6820 HK	香港证 券交易 所	香港	50,000	156,647.60	0.33

## 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	APPLE INC	AAPL US	1,319,148.68	2.87
2	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	860,683.65	1.87
3	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	685,182.75	1.49
4	CHINA RESOURCES ENTE	291 HK	665,079.63	1.45
5	EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	1995 HK	653,301.10	1.42
6	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	634,638.20	1.38
7	AMAZON.COM INC	AMZN US	601,365.83	1.31
8	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	667 HK	588,893.85	1.28
9	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA US	586,884.50	1.28
10	NVIDIA CORP	NVDA US	560,566.95	1.22
11	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1951 HK	559,258.79	1.22
12	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	EDU US	556,630.17	1.21
13	ASCENTAGE PHARMA GROUP INTER	6855 HK	521,729.49	1.13

14	SINO BIOPHARMACEUTIC	1177 HK	518,548.25	1.13
15	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	452,938.75	0.99
16	VIVA BIOTECH HOLDINGS	1873 HK	449,655.57	0.98
17	MSCI US	MSCI US	428,717.17	0.93
18	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	366,888.80	0.80
19	FACEBOOK INC-A	FB US	305,238.32	0.66
20	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	255,806.06	0.56

注：“买入金额”按买入成交金额(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	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	1,463,085.93	3.18
2	FERRARI NV	RACE US	1,197,933.05	2.61
3	APPLE INC	AAPL US	1,159,898.20	2.52
4	MASTERCARD INC - A	MA US	1,084,585.90	2.36
5	MICROSOFT CORP	MSFT US	1,053,201.07	2.29
6	Starbucks Corp	SBUX US	957,557.43	2.08
7	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	MC FP	934,720.56	2.03
8	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	934,473.96	2.03
9	MSCI US	MSCI US	928,136.76	2.02
10	McDonald's Corp	MCD US	883,121.73	1.92
11	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	1579 HK	831,805.66	1.81
12	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	853 HK	816,470.00	1.78
13	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	611,338.82	1.33
14	LI NING CO LTD	2331 HK	589,991.73	1.28
15	LOCKHEED MARTIN CORP	LMT US	542,115.75	1.18
16	H Aidilao International Holdi	6862 HK	477,313.41	1.04
17	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	EDU US	476,142.11	1.04
18	NVIDIA CORP	NVDA US	254,574.02	0.55
19	FACEBOOK INC-A	FB US	252,877.23	0.55
20	CHINA RESOURCES ENTE	291 HK	164,086.51	0.36

注：“卖出金额”按卖出成交金额(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	12,604,436.38
卖出收入（成交）总额	16,049,405.24

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

#### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	POWERS HARES QQQ NASDAQ 100	ETF 基金	契约型开放式	Invesco Capital Management LLC	5,083,364.18	10.74
2	SPDR BBG BARC 1-3 MONTH TBIL	ETF 基金	契约型开放式	SSGA FM	4,341,510.45	9.17
3	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF 基金	契约型开放式	SSgA Funds Management Inc	4,147,765.78	8.76
4	TECHNOLOGY SELECT SECT SPDR	ETF 基金	契约型开放式	SSgA Funds Management Inc	3,698,684.77	7.82
5	SPDR GOLD TRUST	ETF 基金	契约型开放式	World Gold Trust Services LLC	2,369,791.83	5.01
6	VANGUARD INFO	ETF 基金	契约型开放式	Vanguard Group	2,367,752.93	5.00

	TECH ETF			Inc/The		
7	VANGUARD FTSE EUROPE ETF	ETF 基金	契约型 开放式	Vanguard Group Inc/The	2,316,023.03	4.89
8	FIRST TRUST TECHNOLOGY ALPHA	ETF 基金	契约型 开放式	First Trust Advisors LP	1,771,078.51	3.74
9	VANECK VECTORS SEMICONDUCTOR	ETF 基金	契约型 开放式	Van Eck Associates Corp	1,514,446.64	3.20
10	PWR S&P 500 EQ WGT TECH	ETF 基金	契约型 开放式	Invesco Capital Management LLC	1,127,792.67	2.38

## 7.11 本报告期投资基金情况

### 7.11.1 投资政策及风险说明

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。

#### 1). 实现核心投资策略具体步骤：

(1) 根据各主要资本市场和行业在基金业绩比较基准指数中的占比和权重，初步设定本基金“核心”组合在各主要资本市场和行业的投资比例；

(2) 根据基金管理人对全球各区域及产业短、中、长期发展走势的分析和预期，调整“核心”组合在各主要资本市场和行业的投资比例；

(3) 基金管理人在前述配置比例基础上，从投资品种库中选择代表性强、跟踪质量好、流动性高和低费率 ETF 或指数型基金实现“核心”配置。

2). 精选指数型基金（包含 ETF）保证核心投资策略的实现：本基金根据以下指标精选指数型基金：

- (1) 基金的长期表现和跟踪效率；
- (2) 基金所跟踪指数和市场的代表性；
- (3) 基金的流动性；
- (4) 基金的费率；

(5) 基金管理团队的经验,长期表现和稳定性。

### 7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比 例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	QQQ US	POWERS HARES QQQ NASDAQ 100	契约型开 放式	2,900.00	5,083,364. 18	10.74%	否
2	BIL US	SPDR BBG BARC 1-3 MONTH TBIL	契约型开 放式	6,700.00	4,341,510. 45	9.17%	否
3	SPY US	SPDR S&P 500 ETF TRUST	契约型开 放式	1,900.00	4,147,765. 78	8.76%	否
4	XLK US	TECHNO LOGY SELECT SECT SPDR	契约型开 放式	5,000.00	3,698,684. 77	7.82%	否
5	GLD US	SPDR GOLD TRUST	契约型开 放式	2,000.00	2,369,791. 83	5.01%	否
6	VGT US	VANGUA RD INFO TECH ETF	契约型开 放式	1,200.00	2,367,752. 93	5.00%	否
7	VGK US	VANGUA RD FTSE EUROPE ETF	契约型开 放式	6,500.00	2,316,023. 03	4.89%	否
8	FXL US	FIRST TRUST TECHNO LOGY ALPHA	契约型开 放式	3,000.00	1,771,078. 51	3.74%	否
9	SMH US	VANECK	契约型开	1,400.00	1,514,446.	3.20%	否

		VECTOR S SEMICO DUCTO R	放式		64		
10	RYT US	PWR S&P 500 EQ WGT TECH	契约型开 放式	800.00	1,127,792. 67	2.38%	否
11	DIA US	SPDR DJIA TRUST	契约型开 放式	500.00	912,795.3 3	1.93%	否
12	XLY US	CONSUM ER DISCRET IONARY SELT	契约型开 放式	700.00	632,886.0 6	1.34%	否
13	3147 HK	CSOP SZSE CHINEXT ETF-	契约型开 放式	50,200.00	428,491.9 3	0.91%	否
14	3188 HK	CHINAA MC CSI 300 IDX ET	契约型开 放式	10,000.00	426,008.4 0	0.90%	否
15	QTEC US	FIRST TRUST NASDAQ 100 TECH I	契约型开 放式	300.00	231,669.5 6	0.49%	否

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 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。

**7.12.2** 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。

### 7.12.3 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	28,336.06
4	应收利息	341.96

5	应收申购款	100,831.31
6	其他应收款	2,625.15
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	132,134.48

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
4,931	15,484.27	2,444,181.32	3.2012%	73,908,766.35	96.7988%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	381,732.12	0.5000%

### 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	10~50

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	75,491,561.22
本报告期基金总申购份额	23,879,978.42
减：本报告期基金总赎回份额	23,018,591.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	76,352,947.67

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

本报告期内未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，基金管理人副总经理陈军离任。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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	
Morgan Stanley	1	-	-	141.54	0.29%	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	1	18,823,407.50	65.69%	36,365.04	73.43%	-
China International Capital Corp Ltd	1	665,079.63	2.32%	997.62	2.01%	-
Credit Suisse Hong Kong Ltd	1	9,165,354.49	31.99%	12,019.51	24.27%	-

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；

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：报告期无新增交易单元。

### 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
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	1,296,100.09	2.25%
Goldman Sachs And Co. LLC.	-	-	-	-	-	-	43,228,890.34	75.21%
China International Capital Corp Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Hong	-	-	-	-	-	-	12,952,848.48	22.54%

Kong Ltd								
----------	--	--	--	--	--	--	--	--

## 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）更新招募说明书（2020 年第 1 号）	规定网站	2020-01-17
2	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书摘要（2020 年第 1 号）	规定网站	2020-01-17
3	中银全球策略证券投资基金（FOF）2019 年第 4 季度报告	规定网站	2020-01-18
4	中银基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期延长期间申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	规定报刊及规定网站	2020-01-30
5	中银基金管理有限公司关于新增北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	规定报刊及规定网站	2020-02-05
6	中银基金管理有限公司关于使用自有资金投资本公司旗下权益类基金的公告	规定报刊及规定网站	2020-02-06
7	中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊及规定网站	2020-02-29
8	中银基金管理有限公司关于新增阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	规定报刊及规定网站	2020-03-24
9	中银基金管理有限公司关于旗下公募基金 2019 年年度报告延期披露的提示公告	规定报刊及规定网站	2020-03-26
10	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书（2020 年第 2 号）	规定网站	2020-04-03
11	中银全球策略证券投资基金（FOF）更新招募说明书摘要（2020 年第 2 号）	规定网站	2020-04-03
12	中银全球策略证券投资基金（FOF）基金经理变更公告	规定报刊及规定网站	2020-04-03
13	中银全球策略证券投资基金（FOF）2019 年年度报告	规定网站	2020-04-08
14	中银全球策略证券投资基金（FOF）2020 年第 1 季度报告	规定网站	2020-04-21
15	中银基金管理有限公司关于新增中信证券华南股份有限公司为旗下部分基金销售机构及参与其费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2020-05-20

## 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、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、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  
二〇二〇年八月三十一日