

博时大中华亚太精选股票证券投资基金

2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	5
2.5 信息披露方式	5
2.6 其他相关资料	5
3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
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合规守信情况的说明	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	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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	11
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
7 投资组合报告	26
7.1 期末基金资产组合情况	26
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	27
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	27
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	27
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	30
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	34
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	34
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	34
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	35
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	35
7.11 投资组合报告附注	35
8 基金份额持有人信息	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	36
9 开放式基金份额变动	36
10 重大事件揭示	36
10.1 基金份额持有人大会决议	36
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	36

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
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.....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8 其他重大事件	38
11 备查文件目录	38
11.1 备查文件目录	39
11.2 存放地点	39
11.3 查阅方式	39

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时大中华亚太精选股票证券投资基金
基金简称	博时大中华亚太精选股票(QDII)
基金主代码	050015
交易代码	050015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月27日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	94,944,959.09份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对亚太国家或地区企业的深入分析，运用价值与成长相结合的投资策略，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金采用“核心-卫星”配置策略。“核心”配置策略是指本基金将基金资产的40%-75%投资于大中华地区企业，包括中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区企业在境外几个主要证券市场（如美国证券市场、伦敦等欧洲证券市场、东京、香港、台湾、新加坡证券市场）所发行的股票、存托凭证（DR, Depositary Receipts）及其他衍生产品等。“卫星”配置策略是指本基金将基金资产的20%-55%投资于其他亚太国家或地区企业，包括日本、韩国、澳大利亚、新加坡、印度等众多亚太国家或地区企业在亚太区证券市场发行的普通股、优先股、存托凭证及其他衍生产品等。本基金“核心”加“卫星”股票投资比例合计不低于基金资产的60%。</p> <p>本基金将主要采取“自下而上，精选个股”和“价值策略为主，成长策略为辅”的股票投资策略，辅助以金融衍生品投资进行套期保值和汇率风险规避，以获得长期、稳定的收益。本基金固定收益类证券的投资以保证组合流动性的品种投资为主，作为股票投资的辅助手段，而非以承担高风险为代价来追求高额回报。</p>
业绩比较基准	65%×MSCI Zhonghua+35%×MSCI AC Asia Pacific ex Zhonghua
风险收益特征	本基金属于高风险/高收益的品种。

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		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	赵会军
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	杨鹤	姜建清

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	Fullerton Fund Management Company Ltd.	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	富敦资金管理有限公司	渣打银行(香港)有限公司
注册地址		新加坡乌节路60B号Atrium@Orchard办公楼2号楼#06-18	香港中环德辅道中四至四A渣打银行大厦三十二楼32/F
办公地址		新加坡乌节路60B号Atrium@Orchard办公楼2号楼#06-18	香港九龙388号观塘道渣打中心15楼
邮政编码		238891	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层

§ 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(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	-2,622,215.25
本期利润	-1,658,356.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0185
本期加权平均净值利润率	-1.83%
本期基金份额净值增长率	-1.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	-283,093.25
期末可供分配基金份额利润	-0.0030
期末基金资产净值	95,692,855.13
期末基金份额净值	1.008
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.38%

注：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。

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	-3.08%	0.91%	-3.16%	0.93%	0.08%	-0.02%
过去三个月	-0.69%	0.86%	-3.28%	0.87%	2.59%	-0.01%
过去六个月	-1.67%	0.98%	-3.41%	0.97%	1.74%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.38%	0.92%	6.43%	0.92%	-5.05%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准为：65%×MSCI Zhonghua+35%×MSCI AC Asia Pacific ex Zhonghua。

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



注：本基金的基金合同于2010年7月27日生效，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第11条“二、投资范围”、“六、投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。注册资本为一亿元人民币，总部设在深圳，在北京、上海、沈阳和郑州设有分公司；并设有海外子公司：博时基金（国际）有限公司。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份49%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；天津港（集团）有限公司，持有股份6%；璟安实业有限公司，持有股份6%；上海盛业资产管理有限公司，持有股份6%；丰益实业发展有限公司，持有股份6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份2%。

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财

富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2011 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理二十五只开放式基金和二只封闭式基金，并且受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，资产管理总规模逾 1856.66 亿元，累计分红超过人民币 552.64 亿元，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2011 年 6 月 30 日，二季度博时基金参与排名的 15 只公募主动基金中，共有 11 只位列市场前 50%。其中，博时主题行业基金、博时特许价值基金分列 217 只标准股票基金第 3、第 9；博时平衡配置混合基金位列 14 只股债平衡型基金第 8；博时价值增长基金、博时价值增长贰号基金分列 29 只混合偏股型基金第 3 和第 4；博时裕隆封闭基金位列 30 只封闭式基金第 2；博时信用债券 A/B、博时信用债券 C、博时宏观回报债券 A/B、博时宏观回报债券 C 分列 64 只普通债券型基金(二级)第 7、第 8、第 9 和第 10。

2、客户服务

2011 年 1 月至 6 月底，博时在北京、山东、南京、唐山、无锡、上海、广州、厦门等地圆满举办博时基金大学、理财沙龙等各类活动共计 75 场；通过网络会议室举办的博时快 e 财富论坛、博时 e 视界等活动共计 36 场；通过这些活动，博时与投资者充分沟通了当前市场的热点问题，受到了投资者的广泛欢迎。

3、品牌获奖

1) 2011 年 1 月 19 日，博时公司获得由《亚洲资产管理》(Asia Asset Management) 杂志颁发的“2010 年度中国最佳投资者教育奖”。

2) 2011 年 4 月，在由上海证券报主办的第八届中国“金基金奖”评选中，博时平衡配置混合型证券投资基金再度荣膺 2010 年度“金基金三年期产品奖·平衡型基金奖”，博时稳定价值债券投资基金荣获 2010 年度“金基金三年期产品奖·债券基金奖”。

3) 博时平衡配置混合基金在由中国证券报社主办、银河证券等机构协办的第八届(2010 年度)中国基金业金牛奖评选中获评为“三年期混合型金牛基金奖”。这是继 2010 年荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖之后，因持续稳定的投资管理能力再度蝉联同一金牛奖项。

4) 2011 年 6 月 28 日，世界品牌实验室发布了 2011 年中国 500 最具价值品牌榜，博时基金管理公司凭着 2010 年持续的品牌创新和优秀的客户服务，品牌价值首次突破 50 亿元，

以 56.24 亿元的品牌价值，位列品牌榜 227 名，连续 8 年成为国内最具品牌价值的基金公司。

4、其他大事件

1) 2011 年 3 月 19 日，博时公司深圳员工在莲花山公园种下了第七片“博时林”，自 2003 年至今，博时基金已先后在深圳中心公园、笔架山公园、大沙河公园、南山公园、梅林公园等地开辟了七片“博时林”。

2) 博时抗通胀增强回报(QDII-FOF)基金首募顺利结束并于 2011 年 4 月 25 日成立。

3) 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金及博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金首募顺利结束并于 2011 年 6 月 10 日成立。

4) 博时裕祥分级债券型证券投资基金首募顺利结束并于 2011 年 6 月 10 日成立。

5) 博时卓越品牌股票型证券投资基金 (LOF) 是由博时裕泽封闭基金转型而来，基金合同于 2011 年 4 月 22 日生效，5 月份进行了集中申购，并于 2011 年 6 月 30 日在深交所上市交易。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
杨锐	基金经理/副总裁/混合组投资总监	2010-7-27	-	11.5	1999年加入博时公司，任研究员；2004任研究部副总经理、高级策略分析师；2005纽约大学进修；2006.5兼任平衡配置基金经理；2007.1起兼任价值增长、价值增长贰号基金经理。现任公司副总裁、混合组投资总监、博时平衡配置混合基金、博时大中华亚太精选股票基金基金经理。
王政	股票投资部总经理/基金经理/ETF及量化投资组投资总监	2010-7-27	-	12	1995年至1997年在哈佛大学从事地球物理博士后研究工作。1997年8月起先后在美国新泽西州道琼斯投资公司、美国新泽西州彭博资讯研发部、美国加州巴克莱全球投资公司工作。2009年5月加入博时基金管理有限公司。现任股票投资部总经理、ETF及量化投资组投资总监、博时上证超大盘ETF及联接基金基金经理、博时大中华亚太精选股票基金基金经理、博时深证基本面200ETF及联接基金经理。
张溪冈	基金经理	2011-2-28	-	10	2001年起先后在香港新鸿基证券公司、深圳市和丰顺投资有限公司工作。2009年8月加入博时基金管理有限公司，历任研究部研究员、投资经理。现任博时大中华亚太精选股票基金基金经理。

注：上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

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

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
詹嘉琳	富敦公司投资总监	23	1986年-1996年在新加坡金融管理局任高级助理署长；1996年-2000年在荷兰银行任亚洲日本外策略与经济部主管；2000年在淡马锡控股有限公司任资金管理组股票投资部主管；2002年5月至今富敦资金管理有限公司投资总监。
张儒华	富敦公司股票部主管/富敦公司股票投资组基金经理	20	1988年4月-1992年5月在星展银行任助理资金专员；1992年5月在淡马锡控股有限公司任资金管理部门股票投资组主管，2003年12月至今在富敦资金管理有限公司股票投资组主管。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《博时大中华亚太精选股票证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2011年上半年，海外市场宽幅震荡。3月日本大地震，导致环球股市大幅下跌。而地震后随着上市公司2010年业绩的陆续披露，市场恐慌有所缓和。本基金抓住机遇，在地震最严重之时大举加仓至近乎满仓，并且重点配置了水泥、地产、金融等表现突出的行业，因而使基金净值很快恢复到地震前的水平。二季度，希腊债务危机重燃，美国经济复苏放缓，中国

地方政府债务问题浮现，导致许多前期上涨较多的板块都有了较大幅度的回落。更有甚者，美国不断传出不利于中资股的消息，做空者大举围猎中资股，影响到多家香港市场的中小盘股票出现了大幅下跌。市场风险明显加大，好在本基金并无持有任何受到重大利空影响的中小盘股，并且及时卖出了受地方债务问题困扰的银行股，因而基金净值变化不大，并且跑赢了基准。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.008 元，累计份额净值为 1.014 元，报告期内净值增长率为-1.67%，同期业绩基准涨幅为-3.41%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望港股下半年的走势，我们仍然坚持年初的看法，即市场仍将区间震荡。港股市场在相当程度上要受到海外（尤其是美国）的资金状况影响。美国自 2008 年危机以来至今仍未加息，而且还抛出了 QE2，以买国债的方式向市场注入资金，期望通过资本市场的财富增值来带动经济的复苏。QE2 计划已于今年 6 月底结束，美国经济尽管比起 2008 年金融危机时期，确实是复苏了，但复苏的步伐非常艰难，复苏的过程也十分曲折。不断公布的各种经济数据时好时坏，令美联储不敢贸然加息，美联储的资产负债规模难以降低。另一方面，欧洲对希腊不得不救，欧洲债务危机看似暂时缓解，但中长期风险仍在，问题仍没有根本解决。欧美国家的经济复苏仍要不断靠印钱来维持，而不是靠私人经济部门本身的内生复苏动力，这种情形恐怕要维持相当长一段时间。

基本面疲弱，导致股市的估值水平短期内受到压制。港股 2011 年市盈率为 11 倍左右，低于长期历史平均的 13 倍水平。在这一水平上，应该说再大幅下跌的风险也很小。今年下半年股市最有可能的表现将是继续区间震荡。半年业绩即将公布，仍将会有一些行业表现出强劲的盈利增长，如地产、奢侈品零售、能源等。我们将一如既往地贯彻本基金成立的初衷，即寻找受惠于中国崛起以及亚太地区产业优势的投资标的来进行投资。不宜过喜，也无须过悲，应积极在震荡之中寻找价值洼地。做好自下而上的精细选股，力争获得良好的投资回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具

有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金于 2011 年 1 月 12 日发布了分红公告，以截止到 2010 年 12 月 31 日的可供分配利润为基准，向基金份额持有人每 10 份基金份额派发红利 0.060 元。

§ 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

2011 年上半年，本基金托管人在对博时大中华亚太精选证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2011 年上半年，博时大中华亚太精选证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时大中华亚太精选证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，博时大中华亚太精选证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 571,473.87 元。

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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时大中华亚太精选证券投资基金 2011 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：博时大中华亚太精选股票证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	20,533,523.37	36,576,914.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	74,708,184.91	74,318,228.20
其中：股票投资		74,708,184.91	74,318,228.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		1,052,245.03	-
应收利息	6.4.3.5	956.24	1,033.41
应收股利		165,371.99	22,124.18
应收申购款		145,963.36	88,430.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	409,132.59	-
资产总计		97,015,377.49	111,006,730.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		409,132.59	10,837,695.56
应付赎回款		157,857.11	432,635.67
应付管理人报酬		140,221.39	148,699.22
应付托管费		27,265.28	28,913.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	588,045.99	61,630.49
负债合计		1,322,522.36	11,509,574.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	94,944,959.09	96,477,439.65

未分配利润	6.4.3.10	747,896.04	3,019,716.57
所有者权益合计		95,692,855.13	99,497,156.22
负债和所有者权益总计		97,015,377.49	111,006,730.92

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.008 元，基金份额总额 94,944,959.09 份。

6.2 利润表

会计主体：博时大中华亚太精选股票证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		675,637.48
1. 利息收入		20,236.58
其中：存款利息收入	6.4.3.11	20,236.58
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）		29,134.84
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-690,733.47
基金投资收益		
债券投资收益	6.4.3.13	
资产支持证券投资收益		
衍生工具收益	6.4.3.14	
股利收益	6.4.3.15	719,868.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	963,858.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-385,373.98
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	47,781.64
减：二、费用		2,333,994.33
1. 管理人报酬		809,149.22
2. 托管费		157,334.53
3. 销售服务费		
4. 交易费用	6.4.3.18	1,161,479.68
5. 利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
6. 其他费用	6.4.3.19	206,030.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,658,356.85
减：所得税费用		
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,658,356.85

注：本基金于 2010 年 7 月 27 日成立，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时大中华亚太精选股票证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2011年1月1日至2011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）	96,477,439.65	3,019,716.57	99,497,156.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,658,356.85	-1,658,356.85
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）	-1,532,480.56	-41,989.81	-1,574,470.37
其中：1. 基金申购款	35,423,111.53	1,226,731.03	36,649,842.56
2. 基金赎回款	-36,955,592.09	-1,268,720.84	-38,224,312.93
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）	-	-571,473.87	-571,473.87
五、期末所有者权益（基金净值）	94,944,959.09	747,896.04	95,692,855.13

注：本基金于2010年7月27日成立，无上年度可比期间。

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：

基金管理公司负责人：肖风 主管会计工作负责人：王德英 会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

6.4.1 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报报告相一致。

6.4.2 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》及其他境内外相关财税法规和实务操作，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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	20,533,523.37

定期存款	-
其他存款	-
合计	20,533,523.37

注：于 2011 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 16,083,567.42 元(折合人民币 13,375,416.34 元)，美元 366,363.71 元(折合人民币 2,370,959.39 元)，新台币 174,142.56 元(折合人民币 39,236.19 元)和澳元 0.31 元(折合人民币 2.15 元)。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	71,342,556.53	74,708,184.91	3,365,628.38
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	71,342,556.53	74,708,184.91	3,365,628.38

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	956.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	956.24

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
其他应收款	409,132.59
待摊费用	-
合计	409,132.59

6.4.3.7 应付交易费用

无余额。

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付赎回费	594.80
预提费用	178,518.49
其他应付款	408,932.70
合计	588,045.99

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	96,477,439.65	96,477,439.65
本期申购	35,423,111.53	35,423,111.53
本期赎回(以“-”号填列)	-36,955,592.09	-36,955,592.09
本期末	94,944,959.09	94,944,959.09

注：申购含转换入及红利再投资份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 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	2,416,611.89	603,104.68	3,019,716.57
本期利润	-2,622,215.25	963,858.40	-1,658,356.85
本期基金份额交易产生的变动数	493,983.98	-535,973.79	-41,989.81
其中：基金申购款	670,198.41	556,532.62	1,226,731.03
基金赎回款	-176,214.43	-1,092,506.41	-1,268,720.84
本期已分配利润	-571,473.87	-	-571,473.87
本期末	-283,093.25	1,030,989.29	747,896.04

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	18,981.44
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	1,255.14
合计	20,236.58

6.4.3.12 股票投资收益-买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	306,057,032.64

减：卖出股票成本总额	306,747,766.11
买卖股票差价收入	-690,733.47

6.4.3.13 债券投资收益

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	719,868.31
基金投资产生的股利收益	-
合计	719,868.31

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	963,858.40
——股票投资	963,858.40
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	963,858.40

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	47,779.79
基金转换费收入	1.85
合计	47,781.64

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费的 25% 归基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中归入基金资产的比例不低于赎回费部分的 25%。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	1,161,479.68
银行间市场交易费用	-
合计	1,161,479.68

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
账户维护费	4,500.00
银行汇划费用	1,711.12
其他费用	21,301.29
合计	206,030.90

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
渣打银行(香港)有限公司(“渣打银行”)	境外资产托管人
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
招商证券(香港)有限公司(“招商香港”)	基金管理人的股东招商证券的子公司

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商香港	71,170,658.80	11.62%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商香港	71,170.66	13.81%	-	-

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	809,149.22
其中：支付销售机构的客户维护费	84,297.00

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.8\% / \text{当年天数。}$$

本基金于 2010 年 7 月 27 日成立，无上年度可比期间。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	157,334.53

注：支付基金托管人中国工商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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数。}$$

本基金于 2010 年 7 月 27 日成立，无上年度可比期间。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	30,002,000.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	30,002,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.60%

注：本基金于 2010 年 7 月 27 日成立，无上年度可比期间。

6.4.6.4.2 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

无。

6.4.6.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,748,129.72	16,986.45
渣打银行	15,785,393.65	1,994.99

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人渣打银行保管，按适用利率或约定利率计息。

本基金于2010年7月27日成立，无上年度可比期间。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	利润分配 合计	备注
1	2011-01-14	2011-01-14	0.060	415,059.30	156,414.57	571,473.87	-
合计	-	-	0.060	415,059.30	156,414.57	571,473.87	-

6.4.8 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无余额。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无余额。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具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

是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现为基金持有人获取“超越业绩比较基准的投资回报”的投资目标。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由执行总裁和风险控制委员会、督察长、监察法律部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；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监察法律部负责，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。监察法律部对公司执行总裁负责。

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。

6.4.9.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行及境外资产托管人渣打银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外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，在境内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，违约风险不重大。

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2011年6月30日，本基金未持有信用类债券。

6.4.9.3 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。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金资产净值的10%，且本基金与本基金管理人管理的全部基金持有同一机构具有投票权的证券总量不超过该机构发行的具有投票权证券总量的10%。本基金所持大部分证券均在境内外证券交易所上市，均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过参与证券借贷交易和正回购交易融入短期资金应对流动性需求，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。

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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

本期末 2011年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,533,523.37	-	-	-	20,533,523.37
交易性金融资产	-	-	-	74,708,184.91	74,708,184.91
应收证券清算款	-	-	-	1,052,245.03	1,052,245.03
应收利息	-	-	-	956.24	956.24
应收股利	-	-	-	165,371.99	165,371.99
应收申购款	-	-	-	145,963.36	145,963.36
其他资产	-	-	-	409,132.59	409,132.59
资产总计	20,533,523.37	-	-	76,481,854.12	97,015,377.49
负债					
应付证券清算款	-	-	-	409,132.59	409,132.59
应付赎回款	-	-	-	157,857.11	157,857.11
应付管理人报酬	-	-	-	140,221.39	140,221.39
应付托管费	-	-	-	27,265.28	27,265.28
其他负债	-	-	-	588,045.99	588,045.99
负债总计	-	-	-	1,322,522.36	1,322,522.36
利率敏感度缺口	20,533,523.37	-	-	75,159,331.76	95,692,855.13

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2011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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末					合计
	2011年6月30日					
	港币 折合人民币	日元 折合人民币	美元 折合人民币	澳元 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产						
银行存款	13,375,416.34	-	2,370,959.39	2.15	39,236.19	15,785,614.07

交易性金融资产	50,485,088.82	6,847,456.18	-	4,117,642.71	13,257,997.20	74,708,184.91
应收股利	133,041.20	3,358.17	-	6,859.85	22,112.77	165,371.99
应收证券清算款	441,913.20				610,331.83	1,052,245.03
其他应收款					409,132.59	409,132.59
资产合计	64,435,459.56	6,850,814.35	2,370,959.39	4,124,504.71	14,338,810.58	92,120,548.59
以外币计价的负债						
其他应付款			408,932.70			408,932.70
应付证券清算款	-	-	-	-	409,132.59	409,132.59
负债合计	-	-	408,932.70	-	409,132.59	818,065.29
资产负债表外风险敞口净额	64,435,459.56	6,850,814.35	1,962,026.69	4,124,504.71	13,929,677.99	91,302,483.30

6.4.9.4.2.2 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 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	增加约 457	增加约 478
	所有外币相对人民币贬值5%	减少约 457	减少约 478

6.4.9.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市股票，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。本基金投资组合中股票投资比例不低于基金资产的60%，固定收益类证券的投资比例为基金资产的0-35%。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，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010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	74,708,184.91	78.07	74,318,228.20	74.69
合计	74,708,184.91	78.07	74,318,228.20	74.69

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	增加约418	增加约428
2. 业绩比较基准下降5%	减少约418	减少约428	

6.4.10 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

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。本基金持有属于第一层级的金融工具主要包括存在活跃市场的股票等，于2011年6月30日的余额为74,708,184.91元(2010年12月31日：74,318,228.20元)。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算)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。于2011年6月30日，本基金未持有属于第二层级的以公允价值计量的金融工具(2010年12月31日：同)。

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)。于2011年6月30日，本基金未持有属于第三层级的以公允价值计量的金融工具。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	74,708,184.91	77.01
	其中：普通股	74,708,184.91	77.01
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
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	20,533,523.37	21.17
8	其他各项资产	1,773,669.21	1.83
9	合计	97,015,377.49	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（%）
中国香港	50,485,088.82	52.76
日本	6,847,456.18	7.16
澳大利亚	4,117,642.71	4.30
中国台湾	4,084,883.47	4.27
韩国	3,140,638.33	3.28
新加坡	2,323,998.16	2.43
马来西亚	1,817,693.00	1.90
泰国	1,112,668.45	1.16
印度尼西亚	778,115.79	0.81
合计	74,708,184.91	78.07

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（%）
非日常生活消费品	19,815,356.60	20.71
金融	14,627,160.48	15.29
能源	12,068,169.59	12.61
信息技术	11,540,957.20	12.06
原材料	5,016,385.16	5.24
公用事业	3,594,261.64	3.76
工业	3,161,359.31	3.30
电信业务	2,512,150.63	2.63
日常消费品	1,352,896.98	1.41
医疗保健	1,019,487.32	1.07
合计	74,708,184.91	78.07

注：以上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	INTIME DEPARTMENT STORE	银泰百货	1833 HK	香港证券交易所	中国香港	493,000	5,420,050.09	5.66
2	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	2007 HK	香港证券交易所	中国香港	1,500,000	4,266,210.60	4.46
3	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	恒大地产	3333 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	4,216,313.40	4.41
4	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	590 HK	香港证券交易所	中国香港	130,000	4,081,175.15	4.26
5	PETROCHINA CO	中国石油股	857 HK	香港证	中国	400,000	3,785,534.24	3.96

	LTD-H	份		券交易所	香港			
6	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业股份	1171 HK	香港证券交易所	中国香港	150,000	3,692,392.80	3.86
7	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	BRILLIANCE CHI	1114 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	3,650,811.80	3.82
8	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	中国神华	1088 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	3,085,310.20	3.22
9	LARGAN PRECISION CO LTD	LARGAN PRECISION CO LTD	3008 TT	台湾证券交易所	中国台湾	14,000	2,902,002.16	3.03
10	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发展	688 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	2,774,284.32	2.90
11	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	2,345,168.40	2.45
12	CHOW SANG SANG HLDG	CHOW SANG SANG HLDG	116 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	2,187,160.60	2.29
13	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电信	728 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	2,095,682.40	2.19
14	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	华润电力	836 HK	香港证券交易所	中国香港	150,000	1,893,598.74	1.98
15	HENGDELI HOLDINGS LTD	亨得利	3389 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	1,708,979.10	1.79
16	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际电力股份	902 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	1,700,662.90	1.78
17	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源	3800 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	1,675,714.30	1.75
18	BHP BILLITON LTD	BHP BILLITON LTD	BHP AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	5,000	1,517,482.12	1.59
19	LAWSON INC	LAWSON INC	2651 JP	日本证券交易所	日本	4,000	1,352,896.98	1.41
20	NEWCREST MINING LTD	NEWCREST MINING LTD	NCM AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	5,000	1,306,489.75	1.37
21	KEPPEL CORP LTD	KEPPEL CORP LTD	KEP SP	新加坡证券交易所	新加坡	22,000	1,285,041.72	1.34
22	O-NET	O-NET	877 HK	香港证	中国	500,000	1,226,639.50	1.28

	COMMUNICATIONS GROUP	COMMUNICATIONS GROUP		券交易所	香港			
23	TPK HOLDING CO LTD	TPK HOLDING CO LTD	3673 TT	台湾证券交易所	中国台湾	6,000	1,182,881.31	1.24
24	PTT PCL/FOREIGN	PTT PCL/FOREIGN	PTT/F TB	泰国证券交易所	泰国	16,000	1,112,668.45	1.16
25	SAWAI PHARMACEUTICAL CO LTD	SAWAI PHARMACEUTICAL CO LTD	4555 JP	日本证券交易所	日本	1,500	1,019,487.32	1.07
26	TOYOTA MOTOR CORP	TOYOTA MOTOR CORP	7203 JP	日本证券交易所	日本	3,600	953,286.84	1.00
27	AUST AND NZ BANKING GROUP	AUST AND NZ BANKING GROUP	ANZ AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	5,500	838,426.20	0.88
28	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	PCHEM MK	马来西亚证券交易所	马来西亚	50,000	759,738.45	0.79
29	HONDA MOTOR CO LTD	HONDA MOTOR CO LTD	7267 JP	日本证券交易所	日本	3,000	742,648.97	0.78
30	NINTENDO CO LTD	NINTENDO CO LTD	7974 JP	日本证券交易所	日本	600	725,557.21	0.76
31	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	042660 KS	韩国证券交易所	韩国	2,600	713,106.43	0.75
32	TOKYO ELECTRON LTD	TOKYO ELECTRON LTD	8035 JP	日本证券交易所	日本	2,000	701,323.82	0.73
33	HARBIN POWER EQUIPMENT CO-H	哈尔滨动力股份	1133 HK	香港证券交易所	中国香港	92,000	679,400.28	0.71
34	KB FINANCIAL GROUP INC	KB FINANCIAL GROUP INC	105560 KS	韩国证券交易所	韩国	2,200	673,405.23	0.70
35	LIG INSURANCE CO LTD	LIG INSURANCE CO LTD	002550 KS	韩国证券交易所	韩国	4,000	661,888.85	0.69
36	UNITED OVERSEAS BANK LTD	UNITED OVERSEAS BANK LTD	UOB SP	新加坡证券交易所	新加坡	6,000	622,488.21	0.65
37	LG CHEM LTD	LG CHEM LTD	051910 KS	韩国证券交易所	韩国	200	591,578.31	0.62
38	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	CIMB MK	马来西亚证券交易所	马来西亚	30,000	574,143.67	0.60
39	ORIENTAL LAND	ORIENTAL	4661 JP	日本证	日本	1,000	547,257.26	0.57

	CO LTD	LAND CO LTD		券交易所				
40	YAMADA DENKI CO LTD	YAMADA DENKI CO LTD	9831 JP	日本证券交易所	日本	1,000	523,986.79	0.55
41	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	SAMSUNG ELECTRONIC S CO LTD	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	100	500,659.51	0.52
42	IJM CORP BHD	IJM CORP BHD	IJM MK	马来西亚证券交易所	马来西亚	35,000	483,810.88	0.51
43	MACARTHUR COAL LTD	MACARTHUR COAL LTD	MCC AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	6,000	455,244.64	0.48
44	SINGAPORE TELECOM LTD	SINGAPORE TELECOM LTD	ST SP	新加坡证券交易所	新加坡	25,000	416,468.23	0.44
45	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	PTBA IJ	印尼证券交易所	印度尼西亚	25,000	392,263.90	0.41
46	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	INTP IJ	印尼证券交易所	印度尼西亚	30,000	385,851.89	0.40
47	GREE INC	GREE INC	3632 JP	日本证券交易所	日本	2,000	281,010.99	0.29

注：所用证券代码采用当地市场代码。

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	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	14,033,956.28	14.10
2	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	12,907,190.06	12.97
3	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	3383 HK	11,534,589.45	11.59
4	YANZHOU COAL MINING CO-H	1171 HK	11,319,173.58	11.38
5	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1288 HK	9,504,842.00	9.55
6	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	7,562,550.00	7.60
7	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2007 HK	7,447,777.53	7.49
8	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	7,004,618.84	7.04
9	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	6,674,396.03	6.71

10	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	6,254,445.48	6.29
11	HARBIN POWER EQUIPMENT CO-H	1133 HK	5,593,458.41	5.62
12	SINGAMAS CONTAINER HLDGS	716 HK	5,126,782.94	5.15
13	INTIME DEPARTMENT STORE	1833 HK	5,072,341.07	5.10
14	CHINA MERCHANTS BANK - H	3968 HK	4,974,186.37	5.00
15	IND & COMM BK OF CHINA - H	1398 HK	4,870,226.20	4.89
16	CHINA RESOURCES CEMENT	1313 HK	4,779,734.37	4.80
17	CHINA LIANSU GROUP HOLDINGS	2128 HK	4,735,474.36	4.76
18	DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	1072 HK	4,292,556.62	4.31
19	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	3,930,969.00	3.95
20	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	836 HK	3,924,913.21	3.94
21	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	3,786,171.96	3.81
22	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	3,778,881.28	3.80
23	HUANENG POWER INTL INC-H	902 HK	3,637,928.52	3.66
24	CHINA LILANG LTD	1234 HK	3,599,017.87	3.62
25	MAOYE INTERNATIONAL HLDGS	848 HK	3,477,084.95	3.49
26	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	489 HK	3,397,039.79	3.41
27	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	3983 HK	3,376,132.20	3.39
28	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	590 HK	3,365,253.45	3.38
29	CNOOC LTD	883 HK	3,321,199.51	3.34
30	CHINA WIRELESS TECH LTD	2369 HK	3,307,059.98	3.32
31	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2601 HK	3,154,674.83	3.17
32	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	3,114,225.00	3.13
33	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	1088 HK	3,043,445.40	3.06
34	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1818 HK	3,010,941.00	3.03
35	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	2,916,564.13	2.93
36	WEST CHINA CEMENT	2233 HK	2,818,836.53	2.83

	LTD			
37	CHINA COAL ENERGY CO - H	1898 HK	2,784,012.00	2.80
38	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	2,553,974.28	2.57
39	CHIGO HOLDING LTD	449 HK	2,446,074.40	2.46
40	XINJIANG TIANYE WATER SAVI-H	840 HK	2,422,288.08	2.43
41	THE UNITED LABORATORIES INTE	3933 HK	2,409,678.22	2.42
42	REAL GOLD MINING LTD	246 HK	2,377,226.12	2.39
43	ZTE CORP-H	763 HK	2,314,850.40	2.33
44	BBMG CORPORATION - H	2009 HK	2,214,906.96	2.23
45	SINOREF HOLDINGS LTD	1020 HK	2,212,796.43	2.22
46	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	3308 HK	2,210,378.88	2.22
47	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	2,088,603.78	2.10
48	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	1068 HK	2,039,285.99	2.05
49	MINMETALS RESOURCES LTD	1208 HK	2,034,579.67	2.04
50	CHOW SANG SANG HLDG	116 HK	2,029,241.16	2.04

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	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	13,386,800.81	13.45
2	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	3383 HK	11,536,037.42	11.59
3	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	10,758,329.71	10.81
4	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1288 HK	9,966,451.51	10.02
5	HARBIN POWER EQUIPMENT CO-H	1133 HK	8,276,033.84	8.32
6	YANZHOU COAL MINING CO-H	1171 HK	7,348,790.30	7.39
7	SINOPEC YIZHENG CHEMICAL-H	1033 HK	7,141,151.34	7.18
8	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	6,595,949.84	6.63
9	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	6,354,523.42	6.39
10	SINGAMAS CONTAINER HLDGS	716 HK	5,442,091.64	5.47

11	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	5,399,239.43	5.43
12	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	5,285,293.83	5.31
13	CHINA MERCHANTS BANK - H	3968 HK	5,281,659.90	5.31
14	IND & COMM BK OF CHINA - H	1398 HK	5,195,405.60	5.22
15	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	5,038,760.04	5.06
16	TC INTERCONNECT HOLDINGS LTD	515 HK	4,967,304.93	4.99
17	CHINA RESOURCES CEMENT	1313 HK	4,859,124.60	4.88
18	CHINA LIANSU GROUP HOLDINGS	2128 HK	4,803,808.93	4.83
19	HISENSE KELON ELEC HLD-H	921 HK	4,324,682.65	4.35
20	DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	1072 HK	4,309,431.98	4.33
21	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	358 HK	4,173,065.00	4.19
22	GUANGZHOU SHIPYARD INTL CO-H	317 HK	4,064,646.77	4.09
23	AIR CHINA LIMITED-H	753 HK	3,812,803.86	3.83
24	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	3,776,243.23	3.80
25	CHINA LILANG LTD	1234 HK	3,621,864.42	3.64
26	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	3,602,937.00	3.62
27	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	489 HK	3,493,207.80	3.51
28	MAOYE INTERNATIONAL HLDGS	848 HK	3,245,846.03	3.26
29	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2007 HK	3,241,454.41	3.26
30	CNOOC LTD	883 HK	3,204,538.38	3.22
31	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2601 HK	3,169,667.12	3.19
32	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	3983 HK	3,165,376.93	3.18
33	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1818 HK	3,023,894.22	3.04
34	CHINA SHIPPING CONTAINER-H	2866 HK	2,956,954.48	2.97
35	GUANGZHOU PHARMACEUTICAL-H	874 HK	2,950,453.87	2.97
36	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 HK	2,918,243.33	2.93
37	XINJIANG TIANYE	840 HK	2,900,955.64	2.92

	WATER SAVI-H			
38	SIJIA GROUP CO	1863 HK	2,851,019.16	2.87
39	WEST CHINA CEMENT LTD	2233 HK	2,820,253.74	2.83
40	CHINA WIRELESS TECH LTD	2369 HK	2,784,766.06	2.80
41	CHINA COAL ENERGY CO - H	1898 HK	2,673,427.84	2.69
42	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	2,558,950.40	2.57
43	ROYALE FURNITURE HOLDINGS	1198 HK	2,436,651.93	2.45
44	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	3308 HK	2,391,367.08	2.40
45	THE UNITED LABORATORIES INTE	3933 HK	2,379,837.02	2.39
46	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	2,364,039.11	2.38
47	CHIGO HOLDING LTD	449 HK	2,195,305.20	2.21
48	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	1068 HK	2,173,919.63	2.18
49	REAL GOLD MINING LTD	246 HK	2,170,750.67	2.18
50	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	691 HK	2,078,550.40	2.09
51	BBMG CORPORATION - H	2009 HK	2,056,703.12	2.07
52	SINOREF HOLDINGS LTD	1020 HK	2,030,349.04	2.04
53	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	836 HK	2,027,076.05	2.04
54	LONKING HOLDINGS LTD	3339 HK	1,985,957.00	2.00

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	306,173,864.42
卖出收入（成交）总额	306,057,032.64

注：本项“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

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,052,245.03
3	应收股利	165,371.99
4	应收利息	956.24
5	应收申购款	145,963.36
6	其他应收款	409,132.59
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,773,669.21

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
2,458	38,626.92	42,374,199.92	44.63%	52,570,759.17	55.37%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,182,383.36	1.25%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年7月27日）基金份额总额	554,725,884.96
本报告期期初基金份额总额	96,477,439.65
本报告期基金总申购份额	35,423,111.53
减：本报告期基金总赎回份额	36,955,592.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	94,944,959.09

§ 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，本基金管理人、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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。

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，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

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 (%)	

瑞士银行有限公司 UBS Securities Asia Limited		97,811,996.61	15.98%	120,020.25	23.28%	
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) Securities Ltd.		143,870,165.14	23.50%	84,215.00	16.34%	
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co Ltd		71,170,658.80	11.62%	71,170.66	13.81%	
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited		52,500,246.43	8.58%	63,000.29	12.22%	
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited		98,282,541.65	16.05%	60,869.97	11.81%	
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited		77,090,487.73	12.59%	43,198.25	8.38%	
国泰君安证券(香港)有限公司 Guotai Junan Securities(Hong Kong) Co. Ltd.		33,805,705.94	5.52%	33,805.73	6.56%	
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited		16,312,316.29	2.66%	16,312.32	3.16%	
CAPITAL 群益证券股份有限公司		9,200,478.40	1.50%	13,063.30	2.53%	
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited		4,479,469.63	0.73%	5,032.44	0.98%	
里昂证券有限公司 CLSA Limited		5,862,578.15	0.96%	2,931.29	0.57%	
海通国际 Haitong International Securities Company Limited		1,844,252.29	0.30%	1,844.25	0.36%	

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能

及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司网上及手机银行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	2011-6-30
2	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金开通中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-6-22
3	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司“2011 倾心回馈”基金定期定额投资业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-6-21
4	关于博时旗下部分开放式基金增加北京农村商业银行股份有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-6-16
5	关于博时旗下部分开放式基金增加北京农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-6-15
6	博时大中华亚太精选股票证券投资基金开放转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-6-13
7	关于博时旗下部分开放式基金增加哈尔滨银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-13
8	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-21
9	博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加财富证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-12
10	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-8
11	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞银行股份有限公司网上银行申购费率和定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-1
12	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2010 年年度报告(正文/摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-31

13	博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加华鑫证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-25
14	博时基金管理有限公司增加山西证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-22
15	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加汉口银行股份有限公司网上银行申购费率与定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-15
16	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加汉口银行股份有限公司网上银行申购费率与定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-15
17	博时基金管理有限公司关于增聘博时大中华亚太精选股票证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-1
18	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-1-24
19	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳农村商业银行股份有限公司定期定额投资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	2011-1-20
20	博时大中华亚太精选股票证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-1-12

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会批准博时大中华亚太精选股票证券投资基金设立的文件
- 11.1.2 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金托管协议》
- 11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 11.1.5 博时大中华亚太精选股票证券投资基金各年度审计报告正本
- 11.1.6 报告期内博时大中华亚太精选股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

2011年8月27日