

博时大中华亚太精选股票证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 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：2012 年 8 月 25 日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 24 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 2012 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	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遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	26
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	32
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	32
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	32
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	32
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	33
7.11 投资组合报告附注	33
8 基金份额持有人信息	33
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	33
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	33
9 开放式基金份额变动	34
10 重大事件揭示	34
10.1 基金份额持有人大会决议	34
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	34

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	34
10.4 基金投资策略的改变	34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	34
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.....	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	34
10.8 其他重大事件	35
11 备查文件目录	37
11.1 备查文件目录	37
11.2 存放地点	37
11.3 查阅方式	37

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	84,585,188.41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(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	-2,759,145.93
本期利润	2,170,441.05
加权平均基金份额本期利润	0.0251
本期加权平均净值利润率	2.96%
本期基金份额净值增长率	4.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-14,106,505.50
期末可供分配基金份额利润	-0.1668
期末基金资产净值	70,478,682.91
期末基金份额净值	0.833
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-16.22%

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。

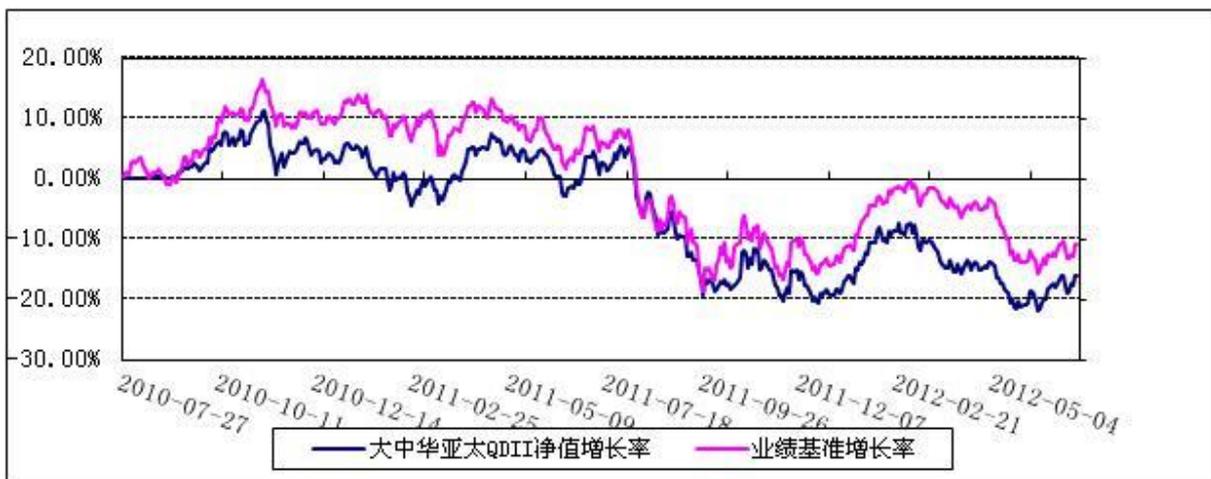
3.2 基金净值表现

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	3.87%	1.17%	2.46%	1.22%	1.41%	-0.05%
过去三个月	-0.72%	1.06%	-6.54%	1.10%	5.82%	-0.04%
过去六个月	4.00%	1.13%	3.92%	1.03%	0.08%	0.10%
过去一年	-17.36%	1.34%	-16.33%	1.46%	-1.03%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-16.22%	1.16%	-10.94%	1.23%	-5.28%	-0.07%

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、郑州、沈阳、成都设有分公司，此外，还设有海外子公司：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 2012 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理三十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，公募基金资产规模逾 1194 亿元人民币，累计分红 570.26 亿元人民币，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 2012 年 6 月 29 日，开放式基金中，博时超大盘 ETF 及超大盘 ETF 联接基金上半年收益率在同类型 115 只基金中分列第二和第四；另外，博时主题行业基金、博时创业成长基金、博时裕祥分级债 A 类、博时信用债 A/B/C 类的上半年收益率都进入了同类型基金的前 30%。封闭式基金中，基金裕隆上半年收益率在同类的 25 只基金中排名第三。

2、客户服务

2012 年 1 月至 6 月，博时基金共举办各类渠道培训活动共计 83 场；“博时 e 视界”共举办视频直播活动 23 场，在线人数累计 2164 人次；1 月 5 日举办“2012 博时基金投资策略媒体交流会”，到会 50 多家媒体。1 月 6 日在中华世纪坛举办“博时基金投资论坛暨 2012 投资策略交流会”，到会约 220 名机构和零售高端客户，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

6 月 28 日，世界品牌实验室(WBL)在京发布 2012 年（第九届）《中国 500 最具价值品牌》排行榜，博时基金以 61.92 亿元的品牌价值位列第 220 名，成为入选该榜单四家基金公司中的第一名。

2012 年 5 月 25 日，在由 21 世纪经济报道主办的“2011 年度赢基金奖”评选中，博时基金荣获“2011 年度中国最佳基金公司”奖项。

2012 年 4 月 20 日，由上海证券报社主办的第九届中国“金基金”奖评选揭晓，博时基金管理有限公司获得 2011 年度“金基金·TOP 公司奖”，博时主题行业股票基金获得 2011 年度“五年期金基金·股票型基金奖”，博时价值增长混合基金获得 2011 年度“一年期金基金·偏股混合型基金奖”。

3 月 28 日，由理财周报主办的“2012 中国金融品牌管理者年会暨 2011 中国金融品牌「金象奖」颁奖典礼”在京举行。“博时抗通胀增强回报基金”营销事件荣获 2011 中国金融品牌「金象奖」之“2011 中国金融品牌年度十大营销事件”。

3月28日，中证报“2012年金牛基金论坛暨第九届中国基金业金牛奖颁奖盛典”在京举行。博时基金荣膺六项大奖，分别是：博时基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”、博时裕隆封闭荣获“五年期封闭式金牛基金”、博时主题行业荣获“五年期股票型金牛基金”、博时第三产业荣获“2011年度股票型金牛基金”、博时特许价值荣获“2011年度股票型金牛基金”、博时价值增长荣获“2011年度混合型金牛基金”。

3月26日，在“晨星2012年度基金奖”中，我司旗下两只产品获得提名：博时主题行业股票基金获得“晨星2012年度股票型基金奖”提名、博时价值增长混合基金获得“晨星2012年度混合型基金奖”提名。

3月26日，在“证券时报2011年度中国基金业明星奖”中，我司共获得七项大奖：博时基金管理有限公司获得“2011年度十大明星基金公司奖”、博时特许价值股票基金获得“三年持续回报股票型明星基金奖”、博时主题行业股票基金和博时特许价值股票基金获得“2011年度股票型明星基金奖”、博时价值增长基金和博时价值增长贰号基金获得“2011年度平衡混合型明星基金奖”、博时裕隆封闭获得“2011年度封闭式明星基金奖”。

4、其他大事件

博时标普500指数型证券投资基金首募顺利结束并于6月14日正式成立。

博时于5月15日开通支付宝支付渠道，成为首家在直销网上交易中引入支付宝渠道的基金公司。

博时上证自然资源ETF于5月11日起在上交所上市，交易代码为510410，日常申购、赎回业务也同步开放。

博时天颐债券型证券投资基金首募顺利结束并于2月29日正式成立。

上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金及联接基金于2012年3月5日至3月30日完成了首次募集。

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	2010-7-27	-	13	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、博时平衡配置混合基金、博时大中华亚太精选股票基金、博时回报混合基金的基金经理。
张溪冈	基金经理	2011-2-28		11	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。博时基金管理有限公司于 2012 年 8 月 14 日公告称，杨锐先生不再担任博时大中华亚太精选股票证券投资基金的基金经理。

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
Manraj Singh Sekhon	富敦公司总裁兼首席投资官	17	1994 年 1 月-2002 年 4 月在水星资产管理公司 (Mercury Asset Management) 任全球股票部高级基金经理；2002 年 5 月-2003 年 3 月在景顺资产管理公司 (Invesco Asset Management) 任全球股票部副主管；2003 年 11 月-2011 年 9 月在亨德森全球投资 (Henderson Global Investors) 任总监兼国际股票部主管；2011 年 10 月至今富敦基金管理有限公司总裁兼首席投资官。
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	21	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 月至今在富敦基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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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 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

年初以来，海外市场宽幅震荡。一季度，受到欧洲推出长期再融资操作 (LTRO) 的刺激，

海外市场普遍上扬。进入二季度，陆续公布的美国、中国、欧洲的经济数据并不理想，令人揪心的法国、希腊大选为资本市场带来不安，海外股市普遍回吐了大部分年初以来的收益。在这种复杂的震荡市中，本基金坚持年初以来既定的策略，即通过自下而上的选股，在震荡市中寻找价值洼地，取得了超越基准的回报。

上半年，港股中的地产、医药、电力、汽车等行业都出现了表现不错的个股。我们通过深入并持续的研究，超配了这几个行业，并且抓住了这几个行业中的一些基本面优秀的个股。然而，我们在一些强周期行业（如工程机械、新能源、家电等行业）的选股中表现并不尽如人意，主要是由于我们对这些行业的复苏相对乐观，在震荡市中没有把握好获利了结的机会。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.833 元，累计份额净值为 0.839 元，报告期内净值增长率为 4.00%，同期业绩基准涨幅为 3.92%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们相信，从 2010 年开始的中国的货币紧缩周期应已结束，新的货币扩张周期或已来临，货币政策将缓步放松。尽管上半年各项经济数据仍十分疲弱，经济复苏的道路十分漫长，但由于去年的低基数原因，我们将有望看到下半年经济数据逐渐好转。此外，在今年底至明年初中国政府换届之后，新的领导层上台，估计新一届政府将于 2013 年在政策上有更积极的作为，以刺激经济的增长，这将有利于资本市场。

一直以来困扰着投资者的欧洲债务危机虽然没有彻底解决，但已不会像 2011 年那样令市场“泥沙俱下”，欧洲央行将继续实施量化宽松的政策，以防止“雷曼式”危机的爆发。美国经济正缓慢复苏，失业率已经从高峰期的 10% 下降到了 8% 左右。美国的房价已经逐渐企稳，新屋开工量已经有了明显复苏。美国经济的缓慢复苏将从某种程度上抵消欧洲需求的疲软。

我们认为，经历了 2011 年的大跌，大市的系统性风险已经大幅降低。港股目前的估值水平处于 9 倍 2012 年市盈率左右，已经接近历史上几次金融危机（98 年、2003 年、2008 年）的 8 倍市盈率的最低水平，下跌空间已经十分有限。在这种市场情况下，更适合我们“自下而上”地寻找投资品种，积极把握投资机会。我们看好亚太地区、尤其是大中华地区未来的经济前景，并将一如既往地贯彻本基金成立的初衷，即寻找最受惠于大中华崛起以及亚太地区最具产业优势的投资标的来进行投资。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

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

2012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

2012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未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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2012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：2012年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	8,654,227.07	9,040,497.98
结算备付金		-	1,068,105.36
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	61,075,057.49	56,221,738.79
其中：股票投资		61,075,057.49	56,221,738.79
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		682,288.07	-
应收利息	6.4.3.5	533.39	744.27
应收股利		330,126.57	8,259.97
应收申购款		95,839.62	13,615.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		70,838,072.21	66,352,961.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		59,254.72	117,532.13
应付管理人报酬		101,222.81	102,523.68
应付托管费		19,682.21	19,935.17
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	179,229.56	260,361.46
负债合计		359,389.30	500,352.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	84,585,188.41	82,233,080.96

未分配利润	6.4.3.10	-14,106,505.50	-16,380,471.66
所有者权益合计		70,478,682.91	65,852,609.30
负债和所有者权益总计		70,838,072.21	66,352,961.74

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.833 元，基金份额总额 84,585,188.41 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012 年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011 年6月30日
一、收入		3,718,134.66	675,637.48
1. 利息收入		15,617.94	20,236.58
其中：存款利息收入	6.4.3.11	15,617.94	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）		-1,268,027.31	29,134.84
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-2,171,557.84	-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	31,953.95	-
股利收益	6.4.3.15	871,576.58	719,868.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	4,929,586.98	963,858.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		8,946.65	-385,373.98
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	32,010.40	47,781.64
减：二、费用		1,547,693.61	2,333,994.33
1. 管理人报酬		656,079.74	809,149.22
2. 托管费		127,571.15	157,334.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	578,918.17	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	185,124.55	206,030.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,170,441.05	-1,658,356.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,170,441.05	-1,658,356.85

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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012年1月1日至2012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)	82,233,080.96	-16,380,471.66	65,852,609.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,170,441.05	2,170,441.05
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)	2,352,107.45	103,525.11	2,455,632.56
其中：1. 基金申购款	31,891,783.33	-3,148,060.97	28,743,722.36
2. 基金赎回款	-29,539,675.88	3,251,586.08	-26,288,089.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	84,585,188.41	-14,106,505.50	70,478,682.91
项目	上年度可比期间		
	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

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：何宝，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度报告相一致。

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 2012年6月30日
活期存款	8,654,227.07
定期存款	-
其他存款	-
合计	8,654,227.07

注：于2012年6月30日，银行存款中包含的外币余额为：港元3,785,141.47元(折合人民币3,085,723.03元)，美元444,757.70元(折合人民币2,813,047.98元)，新台币1,902,751.56元(折合人民币402,876.05元)和澳元0.39元(折合人民币2.53元)，新加坡元0.34元(折合人民币1.70元)，马来西亚林吉特726.00元(折合人民币1,445.17元)。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	59,779,119.67	61,075,057.49	1,295,937.82
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	59,779,119.67	61,075,057.49	1,295,937.82

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 2012年6月30日
应收活期存款利息	533.39
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	533.39
----	--------

6.4.3.6 其他资产

无余额。

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 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	216.18
预提费用	179,013.38
其他应付款	-
合计	179,229.56

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	82,233,080.96	82,233,080.96
本期申购	31,891,783.33	31,891,783.33
本期赎回（以“-”号填列）	29,539,675.88	29,539,675.88
本期末	84,585,188.41	84,585,188.41

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	-10,606,291.77	-5,774,179.89	-16,380,471.66
本期利润	-2,759,145.93	4,929,586.98	2,170,441.05
本期基金份额交易产生的变动数	-506,868.70	610,393.81	103,525.11
其中：基金申购款	-4,502,724.85	1,354,663.88	-3,148,060.97
基金赎回款	3,995,856.15	-744,270.07	3,251,586.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,872,306.40	-234,199.10	-14,106,505.50

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	15,611.04
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	6.90
合计	15,617.94

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 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	139,183,702.27
减：卖出股票成本总额	141,355,260.11
买卖股票差价收入	-2,171,557.84

6.4.3.13 债券投资收益

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
权证差价收入/行权收益	31,953.95
合计	31,953.95

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	871,576.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	871,576.58

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	4,929,586.98
——股票投资	4,929,586.98
——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	4,929,586.98

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	32,010.40
合计	32,010.40

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 2012年1月1日至2012年6月30日	
	交易所市场交易费用	578,918.17
银行间市场交易费用	-	
合计	578,918.17	

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12	
银行划款手续费	1,153.50	
其他费用	4,957.67	
合计	185,124.55	

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(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

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商香港	251,441,436.81	89.69%	71,170,658.80	11.62%

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012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	241,984.94	87.43%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 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	656,079.74	809,149.22
其中：支付销售机构的客户维护费	66,263.46	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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.8% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 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	127,571.15	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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 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	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	30,002,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	35.47%	31.60%

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
中国工商银行	2,351,383.60	14,383.09	4,748,129.72	16,986.45
渣打银行	6,302,843.47	1,234.85	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。

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

本基金于本会计期间无利润分配。

6.4.8 期末（2012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

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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2012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。

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

单位：人民币元

本期末 2012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	8,654,227.07	-	-	-	8,654,227.07
结算备付金	-	-	-	-	-
应收证券清算款	682,288.07	-	-	-	682,288.07
交易性金融资产	-	-	-	61,075,057.49	61,075,057.49
应收利息	-	-	-	533.39	533.39
应收股利	-	-	-	330,126.57	330,126.57
应收申购款	-	-	-	95,839.62	95,839.62
资产总计	9,336,515.14	-	-	61,501,557.07	70,838,072.21
负债					

应付赎回款	59,254.72	-	-	-	59,254.72
应付管理人报酬	101,222.81	-	-	-	101,222.81
应付托管费	19,682.21	-	-	-	19,682.21
其他负债	179,229.56	-	-	-	179,229.56
负债总计	359,389.30	-	-	-	359,389.30
利率敏感度缺口	8,977,125.84	-	-	61,501,557.07	70,478,682.91
上年度末 2011 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	9,040,497.98	-	-	-	9,040,497.98
结算备付金	-	-	-	1,068,105.36	1,068,105.36
交易性金融资产	-	-	-	56,221,738.79	56,221,738.79
应收利息	-	-	-	744.27	744.27
应收股利	-	-	-	8,259.97	8,259.97
应收申购款	-	-	-	13,615.37	13,615.37
资产总计	9,040,497.98	-	-	57,312,463.76	66,352,961.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	117,532.13	117,532.13
应付管理人报酬	-	-	-	102,523.68	102,523.68
应付托管费	-	-	-	19,935.17	19,935.17
其他负债	-	-	-	260,361.46	260,361.46
负债总计	-	-	-	500,352.44	500,352.44
利率敏感度缺口	9,040,497.98	-	-	56,812,111.32	65,852,609.30

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 2012 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 2012 年 6 月 30 日					
	港币 折合人民币	日元 折合人民币	澳元 折合人民币	美元 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	3,085,723.03	-	2.53	2,813,047.98	404,322.92	6,303,096.46
结算备付金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	41,511,744.24	9,456,567.22	2,434,650.45	-	7,672,095.58	61,075,057.49

应收股利	211,384.01	-	23,542.56	-	-	234,926.57
应收证券清算款	682,288.07	-	-	-	-	682,288.07
资产合计	45,491,139.35	9,456,567.22	2,458,195.54	2,813,047.98	8,076,418.50	68,295,368.59
以外币计价的负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
负债合计						
资产负债表 外汇风险敞口净额	45,491,139.35	9,456,567.22	2,458,195.54	2,813,047.98	8,076,418.50	68,295,368.59
项目	上年度末 2011年12月31日					
	港币 折合人民币	日元 折合人民币	澳元 折合人民币	美元 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	3,195,262.58	-	2.00	2,043,331.96	480,695.16	5,719,291.70
结算备付金	1,068,105.36	-	-	-	0.00	1,068,105.36
交易性金融资产	36,641,207.90	8,992,376.24	2,984,082.71	-	7,604,071.94	56,221,738.79
应收股利	-	-	-	-	8,259.97	8,259.97
资产合计	40,904,575.84	8,992,376.24	2,984,084.71	2,043,331.96	8,093,027.07	63,017,395.82
以外币计价的负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
负债合计						
资产负债表 外汇风险敞口净额	40,904,575.84	8,992,376.24	2,984,084.71	2,043,331.96	8,093,027.07	63,017,395.82

6.4.9.4.2 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 （2012年6月30日）	上年度末 （2011年12月31日）
	所有外币均相对人民币升值 5%		增加约341.00万元
所有外币均相对人民币贬值 5%		减少约341.00万元	减少约315.00万元

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 2012年6月30日		上年度末 2011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	61,075,057.49	86.66	56,221,738.79	85.38
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	61,075,057.49	86.66	56,221,738.79	85.38

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 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	1. 业绩比较基准（附注 7.4.1）上升5%	增加约324.48万元	增加约327.00万元
2. 业绩比较基准（附注 7.4.1）下降5%	减少约324.48万元	减少约327.00万元	

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 2012 年 6 月 30 日的余额为 61,075,057.49 元(2011 年 12 月 31 日：56,221,738.79 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 2012 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(2011 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 2012 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	61,075,057.49	86.22
	其中：普通股	61,075,057.49	86.22
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
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	8,654,227.07	12.22
8	其他各项资产	1,108,787.65	1.57
9	合计	70,838,072.21	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(人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	41,511,744.24	58.90
日本	9,456,567.22	13.42
韩国	2,805,124.42	3.98
澳大利亚	2,434,650.45	3.45
中国台湾	1,889,659.37	2.68
新加坡	1,411,492.37	2.00
泰国	791,764.49	1.12
马来西亚	610,115.77	0.87
印尼	163,939.16	0.23

合计	61,075,057.49	86.66
----	---------------	-------

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 (%)
金融	30,490,157.02	43.26
医疗保健	6,321,339.26	8.97
非必需消费品	5,176,453.08	7.34
信息技术	4,913,810.42	6.97
工业	3,883,336.30	5.51
公用事业	3,581,685.37	5.08
必需消费品	2,889,128.19	4.10
能源	2,165,224.32	3.07
原材料	1,489,984.37	2.11
电信业务	163,939.16	0.23
合计	61,075,057.49	86.66

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	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂房 地产	813 HK	香港证券交 易所	中国香 港	400,000	3,860,881.92	5.48
2	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	中国财 险	2328 HK	香港证券交 易所	中国香 港	400,000	2,827,182.96	4.01
3	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	2,372,290.20	3.37
4	SINO BIOPHARMA CEUTICAL	中国生 物制药	1177 HK	香港证券交 易所	中国香 港	1,000,000	2,274,463.80	3.23
5	GUANGZHOU PHARMACEU TICAL-H	广州药 业股份	874 HK	香港证券交 易所	中国香 港	200,000	2,243,485.44	3.18
6	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海 外发展	688 HK	香港证券交 易所	中国香 港	150,000	2,198,648.34	3.12
7	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中 国	1918 HK	香港证券交 易所	中国香 港	800,000	2,113,050.24	3.00
8	WHARF HOLDINGS LTD	九龙仓 集团	4 HK	香港证券交 易所	中国香 港	60,000	2,081,256.66	2.95
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平 安	2318 HK	香港证券交 易所	中国香 港	40,000	2,011,962.96	2.85

10	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港证券交易所	中国香港	150,000	1,932,071.40	2.74
11	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	中银香港	2388 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	1,923,919.20	2.73
12	CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	中国信托金融控股	2891 TT	台湾证券交易所	中国台湾	524,983	1,889,659.37	2.68
13	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	中国香港	10,000	1,842,397.20	2.61
14	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	海通证券	6837 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	1,757,614.32	2.49
15	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	1,627,179.12	2.31
16	LONGFOR PROPERTIES	龙湖地产	960 HK	香港证券交易所	中国香港	164,500	1,617,290.50	2.29
17	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富	1813 HK	香港证券交易所	中国香港	400,000	1,588,048.56	2.25
18	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六福集团	590 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	1,309,243.32	1.86
19	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	1,255,438.80	1.78
20	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	991 HK	香港证券交易所	中国香港	488,000	1,209,395.17	1.72
21	SAWAI PHARMACEUTICAL CO LTD	-	4555 JP	日本证券交易所	日本	1,500	1,025,069.76	1.45
22	NISSAN MOTOR CO LTD	-	7201 JP	日本证券交易所	日本	16,000	953,227.26	1.35
23	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	中石化冠德	934 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	909,785.52	1.29
24	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	-	8306 JP	日本证券交易所	日本	30,000	903,208.32	1.28
25	LAWSON INC	-	2651 JP	日本证券交易所	日本	2,000	888,871.68	1.26
26	FANUC CORP	-	6954 JP	日本证券交易所	日本	800	825,153.28	1.17
27	KEPPEL CORP LTD	-	KEP SP	新加坡证券交易所	新加坡	16,000	821,348.14	1.17
28	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	三星电子	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	120	795,823.84	1.13
29	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	-	4578 JP	日本证券交易所	日本	4,000	778,320.26	1.10

30	CHINA AGRI-INDUSTRIAL AGRI-INDUSTRIAL IES HLDGS	中国粮 油控股	606 HK	香港证券交 易所	中国香 港	224,000	772,437.25	1.10
31	TOKYO ELECTRON LTD	东京电 子	8035 JP	日本证券交 易所	日本	2,600	765,178.34	1.09
32	ORIENTAL LAND CO LTD	-	4661 JP	日本证券交 易所	日本	1,000	726,389.76	1.03
33	BHP BILLITON LTD	必和必 拓有限 公司	BHP AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利 亚	3,500	713,897.19	1.01
34	ANRITSU CORP	-	6754 JP	日本证券交 易所	日本	10,000	713,646.08	1.01
35	HYUNDAI MOTOR CO	现代汽 车公司	005380 KS	韩国证券交 易所	韩国	550	706,119.72	1.00
36	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽 车	2333 HK	香港证券交 易所	中国香 港	50,000	626,904.18	0.89
37	CHINA FOODS LTD	中国食 品	506 HK	香港证券交 易所	中国香 港	100,000	620,382.42	0.88
38	COCA-COLA AMATIL LTD	可口可 乐	CCL AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利 亚	7,000	607,436.84	0.86
39	AUST AND NZ BANKING GROUP	-	ANZ AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利 亚	4,200	600,082.23	0.85
40	EAST JAPAN RAILWAY CO	-	9020 JP	日本证券交 易所	日本	1,500	597,360.00	0.85
41	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	-	KBANK/F TB	泰国证券交 易所	泰国	16,000	528,911.50	0.75
42	NEWCREST MINING LTD	纽克雷 斯特矿 业	NCM AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利 亚	3,500	513,234.19	0.73
43	YAMADA DENKI CO LTD	山田电 器	9831 JP	日本证券交 易所	日本	1,500	484,458.96	0.69
44	KOMATSU LTD	-	6301 JP	日本证券交 易所	日本	3,000	448,736.83	0.64
45	KB FINANCIAL GROUP INC	-	105560 KS	韩国证券交 易所	韩国	2,200	448,272.13	0.64
46	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	大宇汽 造	042660 KS	韩国证券交 易所	韩国	2,800	405,090.46	0.57
47	PHOENIX SATELLITE TELEVISION	凤凰卫 视	2008 HK	香港证券交 易所	中国香 港	200,000	370,109.88	0.53
48	SINGAPORE TECH ENGINEERING	-	STE SP	新加坡证 券交易所	新加坡	20,000	310,602.23	0.44
49	DIALOG GROUP BHD	-	DLG MK	马来西亚证 券交易所	马来西 亚	66,000	308,740.48	0.44

50	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	-	CIMB MK	马来西亚证券交易所	马来西亚	20,000	301,375.29	0.43
51	UNITED OVERSEAS BANK LTD	-	UOB SP	新加坡证券交易所	新加坡	3,000	279,542.00	0.40
52	DUKSAN HI-METAL CO LTD	-	077360 KS	韩国证券交易所	韩国	2,000	268,919.10	0.38
53	SIAM CITY CEMENT PUB CO-NVDR	-	SCCC-R TB	泰国证券交易所	泰国	4,000	262,852.99	0.37
54	NINTENDO CO LTD	任天堂网游公司	7974 JP	日本证券交易所	日本	300	221,023.20	0.31
55	NCSOFT CORPORATION	-	036570 KS	韩国证券交易所	韩国	120	180,899.17	0.26
56	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	166,304.88	0.24
57	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	-	TLKM IJ	印尼证券交易所	印度尼西亚	30,000	163,939.16	0.23
58	GREE INC	GREE INC	3632 JP	日本证券交易所	日本	1,000	125,923.49	0.18

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）	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例（%）
1	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	813 HK	8,311,698.79	12.62
2	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	5,637,879.60	8.56
3	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	5,609,680.38	8.52
4	GUANGZHOU PHARMACEUTICAL-H	874 HK	4,577,175.90	6.95
5	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	4,048,379.80	6.15
6	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	3,918,634.16	5.95
7	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 HK	3,498,000.67	5.31
8	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	751 HK	3,368,048.55	5.11
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	3,250,451.00	4.94
10	KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	148 HK	2,943,871.48	4.47
11	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	1157 HK	2,884,988.10	4.38
12	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	2328 HK	2,801,287.39	4.25
13	LONGFOR PROPERTIES	960 HK	2,759,972.71	4.19
14	CNOOC LTD	883 HK	2,724,185.03	4.14
15	BBMG CORPORATION-H	2009 HK	2,670,944.79	4.06
16	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	3383 HK	2,546,563.92	3.87

17	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	2,458,654.63	3.73
18	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	3900 HK	2,443,590.20	3.71
19	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	691 HK	2,433,511.26	3.70
20	LONKING HOLDINGS LTD	3339 HK	2,388,876.68	3.63
21	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	1880 HK	2,334,605.33	3.55
22	NEW WORLD DEVELOPMENT	17 HK	2,308,303.90	3.51
23	CHINA VANADIUM TITANO - MAGN	893 HK	2,213,716.48	3.36
24	WHARF HOLDINGS LTD	4 HK	2,086,053.51	3.17
25	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	2,038,563.62	3.10
26	HUANENG POWER INTL INC-H	902 HK	2,018,521.17	3.07
27	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	1,931,808.53	2.93
28	WEICHAJ POWER CO LTD-H	2338 HK	1,930,281.34	2.93
29	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	1,859,080.05	2.82
30	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	1,831,282.59	2.78
31	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	1,806,752.64	2.74
32	SUN HUNG KAI PROPERTIES	16 HK	1,805,531.76	2.74
33	SINOPEC YIZHENG CHEMICAL-H	1033 HK	1,799,259.28	2.73
34	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	1,798,027.00	2.73
35	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	861 HK	1,793,759.77	2.72
36	SOHO CHINA LTD	410 HK	1,790,661.82	2.72
37	TCL COMMUNICATION TECH HLDGS	2618 HK	1,684,810.64	2.56
38	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1813 HK	1,656,651.37	2.52
39	TIANGONG INTL CO LTD	826 HK	1,641,056.36	2.49
40	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	1,627,180.00	2.47
41	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	1,600,353.31	2.43
42	CHINA ZHENGTONG AUTO SERVICE	1728 HK	1,509,445.18	2.29
43	CHINA COAL ENERGY CO-H	1898 HK	1,458,959.04	2.22
44	JIANGXI COPPER CO LTD-H	358 HK	1,354,313.94	2.06
45	HARBIN ELECTRIC CO LTD-H	1133 HK	1,347,162.74	2.05

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（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	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	5,846,503.54	8.88
2	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	813 HK	5,519,141.48	8.38
3	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3333 HK	5,177,230.48	7.86
4	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	4,957,402.16	7.53
5	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	4,718,840.71	7.17
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	4,618,078.50	7.01
7	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	3900 HK	4,135,916.60	6.28
8	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	4,083,504.73	6.20
9	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	3,917,687.47	5.95
10	CHINA COAL ENERGY CO-H	1898 HK	3,704,683.74	5.63
11	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	3,466,537.86	5.26
12	GUANGZHOU PHARMACEUTICAL-H	874 HK	3,320,000.26	5.04
13	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 HK	3,038,200.54	4.61
14	JIANGXI COPPER CO LTD-H	358 HK	3,026,339.77	4.60

15	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	1157 HK	2,849,618.82	4.33
16	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	2,849,137.20	4.33
17	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	751 HK	2,800,487.72	4.25
18	KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	148 HK	2,788,120.65	4.23
19	BBMG CORPORATION-H	2009 HK	2,716,996.61	4.13
20	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	2,673,865.64	4.06
21	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	2,650,577.96	4.03
22	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	691 HK	2,460,210.91	3.74
23	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	3383 HK	2,446,149.74	3.71
24	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	2,418,350.39	3.67
25	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	2,325,865.43	3.53
26	LONKING HOLDINGS LTD	3339 HK	2,265,296.32	3.44
27	NEW WORLD DEVELOPMENT	17 HK	2,192,254.96	3.33
28	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	1880 HK	2,165,076.34	3.29
29	CHINA VANADIUM TITANO - MAGN	893 HK	2,127,688.74	3.23
30	SOHO CHINA LTD	410 HK	1,817,761.52	2.76
31	SINOPEC YIZHENG CHEMICAL-H	1033 HK	1,777,263.48	2.70
32	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	1,749,108.50	2.66
33	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	1,629,852.83	2.48
34	YANZHOU COAL MINING CO-H	1171 HK	1,560,870.08	2.37
35	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	861 HK	1,552,989.86	2.36
36	SUN HUNG KAI PROPERTIES	16 HK	1,526,188.92	2.32
37	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	1,497,209.93	2.27
38	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	81 HK	1,472,728.35	2.24
39	TIANGONG INTL CO LTD	826 HK	1,435,084.51	2.18
40	TCL COMMUNICATION TECH HLDGS	2618 HK	1,379,489.60	2.09

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（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	141,149,851.12
卖出收入（成交）总额	139,183,702.27

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”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	682,288.07
3	应收股利	330,126.57
4	应收利息	533.39
5	应收申购款	95,839.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,108,787.65

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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
2713	31,177.73	44,550,241.70	52.67%	40,034,946.71	47.33%

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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	1,098,704.14	1.30%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；

2、本基金的基金经理持有本基金的区间为：50 万份至 100 万份（含）。

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	82,233,080.96
本报告期基金总申购份额	31,891,783.33
减：本报告期基金总赎回份额	29,539,675.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	84,585,188.41

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，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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 (%)	
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co Ltd	-	251,441,436.81	89.69%	241,984.94	87.43%	
瑞士银行有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	13,272,859.01	4.73%	20,728.29	7.49%	
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	5,828,797.07	2.08%	5,828.80	2.11%	
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	2,815,102.42	1.00%	3,378.12	1.22%	
花旗环球金融亚洲有限公司 citigroup global markets asia limited	-	2,760,924.69	0.98%	2,760.92	1.00%	
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	2,167,774.72	0.77%	1,083.90	0.39%	
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	2,046,658.67	0.73%	1,023.33	0.37%	
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	
国泰君安证券(香港)有限公司 Guotai Junan Securities (Hong Kong) Co. Ltd.	-	-	-	-	-	
CAPITAL 群益证券股份有限公司	-	-	-	-	-	
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	
海通国际 Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) Securities Ltd.	-	-	-	-	-	

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，我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、个股分析的报告及丰富全面的信息；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	2012-6-29
2	关于开通机构直销网上交易业务和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-25
3	博时基金管理有限公司关于开通中国银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-11
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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	2012-6-8
5	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加金华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	2012-6-5
6	博时基金管理有限公司成都分公司成立的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-25
7	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加重庆银行股份有限公司网上银行申购费率与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	2012-5-22
8	博时基金管理有限公司关于开通支付宝基金专户直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-15
9	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国邮政储蓄银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-2
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	2012-3-30
11	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国建设银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-3-12
12	关于博时大中华亚太精选股票证券投资基金新增中信证券（浙江）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	2012-2-13
13	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加汉口银行股份有限公司电子渠道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	2012-1-16
14	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国农业银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-1-9
15	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	2012-1-4
16	博时基金管理有限公司关于直销投资者汇款交易业务规则变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-1-4

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

2012年8月25日