

博时大中华亚太精选股票证券投资基金

2015 年半年度报告

2015 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：二〇一五年八月二十七日

§ 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 2015 年 8 月 26 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 2015 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
§ 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.....	6
§ 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.....	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	8
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	错误!未定义书签。
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
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.....	10
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.....	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§ 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.....	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.....	34
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.....	34
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基金的情况.....	35
8.2 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.....	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 报告期内改聘会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	38
§ 11 备查文件目录.....	39
11.1 备查文件目录.....	39
11.2 存放地点.....	40
11.3 查阅方式.....	40

§ 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	362,474,245.55 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	蒋松云
	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	张光华	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	-	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	-	渣打银行(香港)有限公司
注册地址		-	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		-	香港九龙 388 号观塘道渣打中心 15 楼
邮政编码		-	-

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 (2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-57,663,798.64
本期利润	-71,020,485.47
加权平均基金份额本期利润	-0.1945
本期加权平均净值利润率	-14.86%
本期基金份额净值增长率	3.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-40,995,449.97
期末可供分配基金份额利润	-0.1131
期末基金资产净值	444,838,679.52
期末基金份额净值	1.227
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	31.54%

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。

上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。

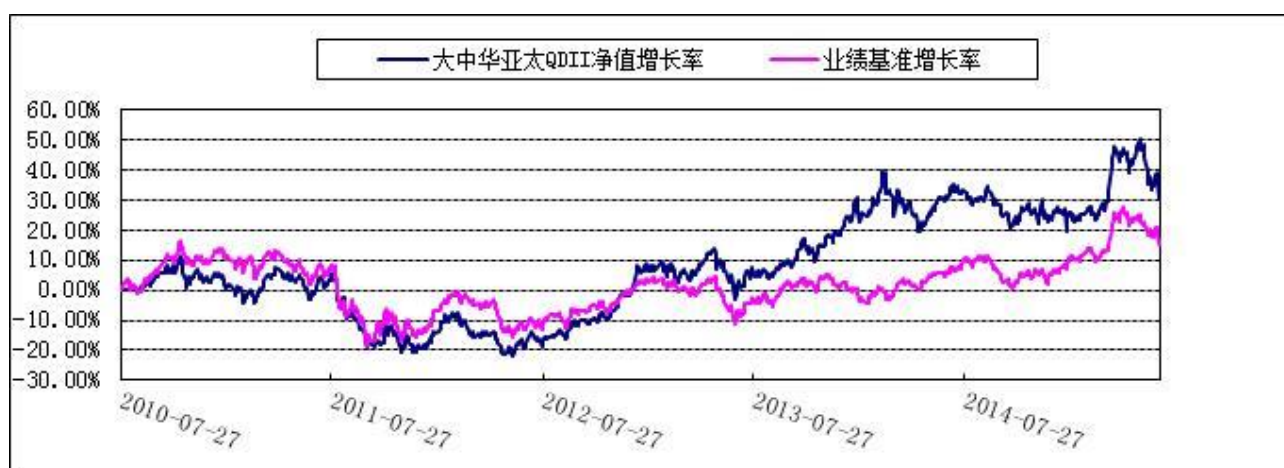
3.2 基金净值表现

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	-10.70%	1.70%	-4.78%	1.05%	-5.92%	0.65%
过去三个月	1.57%	1.63%	2.53%	1.15%	-0.96%	0.48%
过去六个月	3.90%	1.38%	9.38%	0.93%	-5.48%	0.45%
过去一年	-0.22%	1.18%	9.75%	0.84%	-9.97%	0.34%
自基金合同生效起至今	31.54%	1.12%	16.30%	1.01%	15.24%	0.11%

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 2014 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理四十七只开放式基金，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 1041 亿元人民币，累计分红超过 628 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，标准股票型基金中，截至 6 月 30 日，博时医疗保健股票基金、博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在 355 只标准型股票基金中排名前 1/4，博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在 355 只标准型股票基金中排名前 1/3。标准指数股票型基金中，博时沪深 300 指数、博时上证超大盘 ETF、博时深证基本面 200ETF 三只基金今年以来净值增长率在 150 只同类基金中排名前 1/2。混合基金方面，今年以来博时裕益收益率在 35 只灵活配置型同类基金中排名前 1/2，博时平衡配置在 16 只股债平衡型同类基金中排名前 1/2。

固定收益方面，博时信用债纯债今年以来收益率在 101 只长期标准债券型基金中排名前 1/4，博时安丰 18 个月定期开放基金排名前 1/3，博时安盈债券基金（A 类）在 6 只中短期标准债券型基金中排名前 1/2。

海外投资方面业绩方面，截至 6 月 30 日，博时亚洲票息收益债券基金在同类可比 7 只 QDII 债券基金中排名第 1，博时大中华亚太精选今年以来收益率在 9 只 QDII 亚太股票型基金中排名第 2，博时抗通胀在 8 只 QDII 商品基金中排名第 2。

2、客户服务

2014 年上半年，博时基金共举办各类渠道培训活动 284 场，参加人数 7355 人。

3、其他大事件

2014 年 1 月 9 日，金融界网站在北京举办“第二届领航中国 2013 金融行业年度颁奖典礼”，博时基金荣获“2013 金融界领航中国年度评选基金公司最佳品牌奖”。

2014 年 1 月 11 日，在和讯网主办的 2013 年第十一届财经风云榜基金行业评选中，博时基金荣获“2013 年度基金业最佳投资者关系奖”。

2014 年 6 月 16 日，大智慧在上海举办“智慧财经巅峰榜”，博时基金荣获“十佳基金公司”奖项，基金经理张溪冈荣获智慧财经巅峰榜“最佳基金经理”奖项。

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		
张溪冈	基金经理/ 国际组投资总监	2011-02-28	-	13.5	2001 年起先后在香港新鸿基证券公司、深圳

					市和风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：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《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

本基金未聘请境外投资顾问。

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、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 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

2015 年上半年，港股可谓大起大落。年初，黑天鹅接连出现：证监会查两融，中资地产股危机，中资银行高管被查等等。4 月份，在证监会宣布公募基金可以投资港股、保监会宣布险资可以投资香港创业板后，港股出现了短时间的大涨。国内投资者对投资港股的热情瞬

间爆发，有大量资金申购投资港股的 QDII 基金，令本基金规模在短短几日内增加数倍，这也给基金经理带来了不小的挑战。我们谨慎研究，利用新增的资金买入了大量互联网+、信息技术等新兴成长行业的个股。然而，随着市场热情消退，部分“港 A 股”出现暴跌，希腊债务危机复燃，港股又在 5 月、6 月归于沉寂，本基金的净值也随之出现了一定幅度的回调。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2270 元，累计份额净值为 1.3090 元，报告期内净值增长率为 3.90%，同期业绩基准涨幅为 9.38%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在 6 月份 A 股暴跌、港股跟跌之后，我们认为港股又进入了可投资区间。恒生国企指数目前只有 8 倍 2015 年市盈率，确实很便宜。希腊债务危机已经有所缓解，我们更需要关注的风险是美国，因为美国何时加息对全球市场的影响要比希腊债务危机更大。然而，在通胀维持低位、全球争相降息的大环境下，美联储可能对加息会更加谨慎。此外，随着下半年深港通即将推出，估值更低的香港中小盘股票对国内投资者非常有吸引力。我们已做好准备，努力挖掘港股的投资机会，争取为持有人带来更好的回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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、风险管理部负责人、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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银

行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人已于 2015 年 1 月 12 日发布公告,以 2014 年 12 月 31 日可分配利润为基准,每 10 份基金份额派发红利 0.06 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

2015 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

2015 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 635,552.81 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 2015 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	76,497,430.86	6,696,040.47
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.3.2	435,868,424.97	121,223,033.37
其中：股票投资		382,800,254.68	116,531,165.82
基金投资		53,068,170.29	4,691,867.55
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		164,342,420.65	5,309,088.55
应收利息	6.4.3.5	10,219.35	772.72
应收股利		1,503,735.06	17,986.24
应收申购款		581,172.59	51,535.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	316,376.29	-
资产总计		679,119,779.77	133,298,457.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		231,520,074.26	2,344,271.13
应付管理人报酬		1,167,711.90	206,130.58
应付托管费		227,055.08	40,080.95
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		0.00	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	1,366,259.01	367,331.60
负债合计		234,281,100.25	2,957,814.26
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	362,474,245.55	109,824,383.05
未分配利润	6.4.3.10	82,364,433.97	20,516,259.77
所有者权益合计		444,838,679.52	130,340,642.82
负债和所有者权益总计		679,119,779.77	133,298,457.08

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.227 元，基金份额总额 362,474,245.55 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6
----	-----	------------------	-----------------------------

		2015 年 6 月 30 日	月 30 日
一、收入		-60,727,008.65	9,447,718.54
1. 利息收入		118,604.92	38,478.99
其中：存款利息收入	6.4.3.11	118,604.92	38,478.99
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）		-41,123,209.83	3,699,187.46
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-45,593,383.95	2,514,009.61
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		0.00	-
股利收益	6.4.3.14	4,470,174.12	1,185,177.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	-13,356,686.83	6,163,950.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-7,180,957.25	-512,113.33
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	815,240.34	58,214.79
减：二、费用		10,293,476.82	2,007,289.75
1. 管理人报酬		4,115,237.98	1,100,446.86
2. 托管费		800,185.22	213,975.77
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.17	5,162,819.50	507,761.97
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.18	215,234.12	185,105.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-71,020,485.47	7,440,428.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-71,020,485.47	7,440,428.79

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	109,824,383.05	20,516,259.77	130,340,642.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-71,020,485.47	-71,020,485.47
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）	252,649,862.50	133,504,212.48	386,154,074.98
其中：1. 基金申购款	776,944,564.12	277,851,298.83	1,054,795,862.95

2. 基金赎回款	-524,294,701.62	-144,347,086.35	-668,641,787.97
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）	-	-635,552.81	-635,552.81
五、期末所有者权益（基金净值）	362,474,245.55	82,364,433.97	444,838,679.52
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	72,130,394.36	15,716,155.37	87,846,549.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,440,428.79	7,440,428.79
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）	74,489,256.54	16,688,565.84	91,177,822.38
其中：1. 基金申购款	118,360,905.74	25,521,084.28	143,881,990.02
2. 基金赎回款	-43,871,649.20	-8,832,518.44	-52,704,167.64
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）	-	-5,183,386.74	-5,183,386.74
五、期末所有者权益（基金净值）	146,619,650.90	34,661,763.26	181,281,414.16

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：江向阳，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 2015年6月30日
活期存款	76,497,430.86
定期存款	-
其他存款	-
合计	76,497,430.86

注：于 2015 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 33,827,755.51（折合人民币 26,676,906.28 元），美元 7,390,646.85 元（折合人民币 45,183,458.59 元），新台币 304,236.56 元（折合人民币 60,246.19 元）和澳元 0.42 元（折合人民币 1.97 元），新加坡元 0.34 元（折合人民币 1.54 元），韩元 140.00 元（折合人民币 0.77 元）。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	387,419,430.85	382,800,254.68	-4,619,176.17
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	53,614,415.12	53,068,170.29	-546,244.83
其他	-	-	-
合计	441,033,845.97	435,868,424.97	-5,165,421.00

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 2015年6月30日
应收活期存款利息	10,219.35
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	10,219.35

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
其他应收款	316,376.29
待摊费用	-
合计	316,376.29

注：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 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	870,558.18
预提费用	178,518.49
其他	317,182.34
合计	1,366,259.01

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	109,824,383.05	109,824,383.05
本期申购	776,944,564.12	776,944,564.12
本期赎回（以“-”号填列）	-524,294,701.62	-524,294,701.62
本期末	362,474,245.55	362,474,245.55

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	2,985,824.00	17,530,435.77	20,516,259.77
本期利润	-57,663,798.64	-13,356,686.83	-71,020,485.47
本期基金份额交易产生的变动数	14,318,077.48	119,186,135.00	133,504,212.48
其中：基金申购款	-2,800,994.73	280,652,293.56	277,851,298.83
基金赎回款	17,119,072.21	-161,466,158.56	-144,347,086.35
本期已分配利润	-635,552.81		-635,552.81

本期末	-40,995,449.97	123,359,883.94	82,364,433.97
-----	----------------	----------------	---------------

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	98,037.81
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	20,567.11
合计	118,604.92

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	1,013,447,978.27
减：卖出股票成本总额	1,059,041,362.22
买卖股票差价收入	-45,593,383.95

6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
基金投资收益	-

6.4.3.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,470,174.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,470,174.12

6.4.3.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-13,356,686.83
——股票投资	-12,747,199.64
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-609,487.19
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	-13,356,686.83

6.4.3.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	815,240.34
其他	-
转换费	-
合计	815,240.34

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%。

6.4.3.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	5,162,819.50
银行间市场交易费用	-
合计	5,162,819.50

6.4.3.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
其他费用	11,254.54
银行汇划费用	25,461.09
合计	215,234.12

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

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	39,838,279.36	1.69%	14,485,500.97	5.89%

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	39,838.28	1.39%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	11,443.14	3.80%	-	-

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,115,237.98	1,100,446.86
其中：支付销售机构的客户维护费	714,846.89	204,717.71

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	800,185.22	213,975.77

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：

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

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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014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	702,000.00	-
期末持有的基金份额	29,300,000.00	30,002,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.08%	20.46%

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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日	2014年1月1日至2014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	4,074,661.39	81,376.86	24,944,723.58	36,111.74
渣打银行	72,422,769.47	16,660.95	16,837,513.48	2,367.25

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

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	2015-01-15	2015-01-14	0.060	470,654.39	164,898.42	635,552.81	-
合计	-	-	0.060	470,654.39	164,898.42	635,552.81	-

6.4.8 期末（2015 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和基金投资等。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董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理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，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，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；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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 2015 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、组合在短期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%。

于 2015 年 6 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。

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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	75,934,588.89	-	-	562,841.97	76,497,430.86
结算备付金	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	164,342,420.65	164,342,420.65
交易性金融资产	-	-	-	435,868,424.97	435,868,424.97
应收利息	-	-	-	10,219.35	10,219.35
应收股利	-	-	-	1,503,735.06	1,503,735.06
应收申购款	-	-	-	581,172.59	581,172.59
其他资产	-	-	-	316,376.29	316,376.29
资产总计	75,934,588.89	-	-	603,185,190.88	679,119,779.77
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	231,520,074.26	231,520,074.26
应付管理人报酬	-	-	-	1,167,711.90	1,167,711.90
应付托管费	-	-	-	227,055.08	227,055.08
其他负债	-	-	-	1,366,259.01	1,366,259.01
负债总计	-	-	-	234,281,100.25	234,281,100.25
利率敏感度缺口	75,934,588.89	-	-	368,904,090.63	444,838,679.52

上期末 2014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	80,968,717.94	-	-	-	80,968,717.94
结算备付金	750,000.00	-	-	-	750,000.00
交易性金融资产	-	556,805,105.17	247,387,835.15	-	804,192,940.32
应收利息	-	-	-	17,246,959.26	17,246,959.26
应收申购款	-	-	-	5,687,425.96	5,687,425.96
买入返售金融资产	45,000,000.00	-	-	-	45,000,000.00
资产总计	126,718,717.94	556,805,105.17	247,387,835.15	22,934,385.22	953,846,043.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,288,384.45	5,288,384.45
应付管理人报酬	-	-	-	650,242.52	650,242.52
应付托管费	-	-	-	203,200.81	203,200.81
其他负债	-	-	-	96,682.40	96,682.40
负债总计	-	-	-	6,238,510.18	6,238,510.18
利率敏感度缺口	126,718,717.94	556,805,105.17	247,387,835.15	16,695,875.04	947,607,533.30

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 2015 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			
	2015年6月30日			
	港币 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	26,676,906.28	45,183,458.59	60,250.47	71,920,615.34
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	259,852,326.00	-	176,016,098.96	435,868,424.96
应收股利	157,327.70	-	759,007.36	916,335.06
应收证券清算款	-	-	-	-
其他资产	164,342,420.66	-	-	164,342,420.66
资产合计	451,028,980.64	45,183,458.59	176,835,356.79	673,047,796.02
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	451,028,980.64	45,183,458.59	176,835,356.79	673,047,796.02
项目	上期末			
	2014年12月31日			
	港币	美元	其他币种	合计
	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	3,854,545.21	1,975,094.47	1,215,741.73	7,045,381.41
交易性金融资产	54,341,984.71	3,107,699.67	22,220,639.62	79,670,324.00
应收利息	-	-	426.08	426.08
应收申购款	-	-	-	-
资产合计	58,196,529.92	5,082,794.14	23,436,807.43	86,716,131.49
以外币计价的负债	-	-	-	-
应付证券清算款	2,161,214.66	-	-	2,161,214.66
负债合计	2,161,214.66	-	-	2,161,214.66
资产负债表外汇风险敞口净额	56,035,315.26	5,082,794.14	23,436,807.43	84,554,916.83

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 （2015年6月30日）	上年度末 （2014年12月31日）
		所有外币均相对人民币升值5%	增加约3,365
	所有外币均相对人民币贬值5%	减少约3,365	减少约3,563

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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	382,800,254.68	86.05	116,531,165.82	89.41
衍生金融资产-权证投资		-	-	-
其他	53,068,170.29	11.93	4,691,867.55	3.60
合计	435,868,424.97	97.98	121,223,033.37	93.01

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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	增加约2934	增加约686
	业绩比较基准下降5%	减少约2934	减少约686

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

(i) 金融工具公允价值计量的方法根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

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

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

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 435,868,424.97 元(2014 年 12 月 31 日 121,223,033.37 元)，无属于第二层级和第三层级

的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	382,800,254.68	56.37
	其中：普通股	382,800,254.68	56.37
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	53,068,170.29	7.81
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	76,497,430.86	11.26
8	其他各项资产	166,753,923.94	24.55
9	合计	679,119,779.77	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	259,852,326.01	58.41
日本	69,295,492.44	15.58
澳大利亚	24,045,370.10	5.41
韩国	15,995,094.02	3.60
中国台湾	11,693,524.88	2.63
泰国	1,881,219.01	0.42
新加坡	37,228.22	0.01
合计	382,800,254.68	86.05

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 (%)
能源	37,228.22	0.01
原材料	3,608,274.91	0.81
工业	75,588,915.28	16.99
非日常生活消费品	45,699,519.45	10.27
日常消费品	14,983,590.00	3.37
金融	102,945,083.35	23.14
信息技术	139,937,643.47	31.46
合计	382,800,254.68	86.05

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	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	香港证 券交易 所	中国香港	5,000,000.00	24,880,645.50	5.59
2	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	中国南方 航空股份	1055 HK	香港证 券交易 所	中国香港	3,000,000.00	21,671,002.80	4.87
3	COOLPAD GROUP LTD	酷派集团	2369 HK	香港证 券交易 所	中国香港	10,000,000.00	21,213,609.00	4.77
4	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港证 券交易 所	中国香港	162,000.00	19,763,670.65	4.44
5	CHINASOF T INTERNAT IONAL LTD	中国软件 国际	354 HK	香港证 券交易 所	中国香港	5,000,000.00	16,679,101.50	3.75
6	BYD ELECTRON	比亚迪电 子	285 HK	香港证 券交易	中国香港	2,000,000.00	16,560,810.00	3.72

	IC INTL CO LTD			所				
7	PING AN INSURANC E GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	香港证 券交易 所	中国香港	200,000.00	16,513,493.40	3.71
8	CHINA TAIPING INSURANC E HOLD	中国太平	966 HK	香港证 券交易 所	中国香港	750,000.00	16,472,091.38	3.70
9	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	香港证 券交易 所	中国香港	4,000,000.00	14,983,590.00	3.37
10	MITSUBI SHI UFJ FINANCIA L GRO	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	8306 JP	日本证 券交易 所	日本	336,000.00	14,796,011.87	3.33
11	SUMITOMO MITSUI FINANCIA L GR	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	8316 JP	日本证 券交易 所	日本	53,000.00	14,481,395.00	3.26
12	SKY LIGHT HOLDINGS LTD	天彩控股	3882 HK	香港证 券交易 所	中国香港	5,000,000.00	13,327,509.00	3.00
13	DENSO CORP	DENSO CORP	6902 JP	日本证 券交易 所	日本	42,000.00	12,814,913.66	2.88
14	NATIONAL AUSTRALI A BANK LTD	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	NAB AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	77,760.00	12,169,473.15	2.74
15	FANUC CORP	FANUC CORP	6954 JP	日本证 券交易 所	日本	9,600.00	12,050,919.94	2.71
16	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	78,500.00	11,875,896.95	2.67
17	HUIYIN HOUSEHOL D APPLIANC ES	汇银家电	1280 HK	香港证 券交易 所	中国香港	7,674,000.00	11,800,996.62	2.65
18	SUMITOMO HEAVY INDUSTRI ES	SUMITOMO HEAVY INDUSTRIE S	6302 JP	日本证 券交易 所	日本	326,000.00	11,650,303.73	2.62
19	SAMSUNG ELECTRON ICS CO LTD	SAMSUNG ELECTRONI CS CO LTD	005930 KS	韩国证 券交易 所	韩国	1,650.00	11,466,288.30	2.58

20	CHINA ELECTRONICS CORP HOLDI	中国电子	85 HK	香港证券交易所	中国香港	3,500,000.00	11,150,945.40	2.51
21	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集团	698 HK	香港证券交易所	中国香港	8,100,000.00	9,581,611.50	2.15
22	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	红星美凯龙	1528 HK	香港证券交易所	中国香港	873,800.00	8,751,410.21	1.97
23	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安国际	1788 HK	香港证券交易所	中国香港	1,980,000.00	7,885,311.39	1.77
24	TECHNOVATOR INTERNATIONAL LT	同方泰德	1206 HK	香港证券交易所	中国香港	1,500,000.00	7,783,580.70	1.75
25	SINOSOFT TECHNOLOGY GROUP LT	中国擎天软件	1297 HK	香港证券交易所	中国香港	1,470,000.00	6,584,578.06	1.48
26	BAOXIN AUTO GROUP LTD	宝信汽车	1293 HK	香港证券交易所	中国香港	1,500,000.00	5,831,770.95	1.31
27	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港证券交易所	中国香港	400,000.00	5,331,003.60	1.20
28	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2474 TT	台湾证券交易所	中国台湾	66,000.00	5,044,863.59	1.13
29	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	台湾证券交易所	中国台湾	150,000.00	4,173,359.25	0.94
30	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	047810 KS	韩国证券交易所	韩国	8,000.00	3,485,593.80	0.78
31	FLEXIUM INTERCONNECT INC	FLEXIUM INTERCONNECT INC	6269 TT	台湾证券交易所	中国台湾	100,000.00	2,475,302.04	0.56
32	SIAM CEMENT PCL-NVDR	SIAM CEMENT PCL-NVDR	SCC-R TB	泰国证券交易所	泰国	20,000.00	1,881,219.01	0.42
33	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	中国宏桥	1378 HK	香港证券交易所	中国香港	300,000.00	1,727,055.90	0.39

34	CW GROUP HOLDINGS LTD	CW GROUP HOLD	1322 HK	香港证券交易所	中国香港	322,000.00	1,358,538.45	0.31
35	TOKYO ELECTRON LTD	TOKYO ELECTRON LTD	8035 JP	日本证券交易所	日本	2,800.00	1,085,707.96	0.24
36	SK HYNIX INC	SK HYNIX INC	000660 KS	韩国证券交易所	韩国	4,500.00	1,043,211.92	0.23
37	NISSAN MOTOR CO LTD	NISSAN MOTOR CO LTD	7201 JP	日本证券交易所	日本	16,000.00	1,021,060.80	0.23
38	TOYOTA MOTOR CORP	TOYOTA MOTOR CORP	7203 JP	日本证券交易所	日本	2,200.00	903,268.42	0.20
39	KOMATSU LTD	KOMATSU LTD	6301 JP	日本证券交易所	日本	4,000.00	491,911.06	0.11
40	EZION HOLDINGS LTD	EZION HOLDINGS LTD	EZI SP	新加坡证券交易所	新加坡	8,000.00	37,228.22	0.01

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	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	81,264,089.48	62.35
2	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	59,842,888.91	45.91
3	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	1528 HK	52,334,488.00	40.15
4	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	47,881,739.90	36.74
5	CNOOC LTD	883 HK	46,976,935.97	36.04
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	46,472,247.63	35.65
7	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	41,614,386.49	31.93
8	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	39,320,290.25	30.17
9	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1288 HK	35,389,359.90	27.15
10	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	2128 HK	33,291,383.61	25.54
11	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	1117 HK	33,160,415.79	25.44
12	COOLPAD GROUP LTD	2369 HK	32,799,787.66	25.16
13	CHINA FOODS LTD	506 HK	31,225,071.51	23.96
14	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	30,060,910.61	23.06

15	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	29,888,708.20	22.93
16	HARBIN ELECTRIC CO LTD-H	1133 HK	27,012,075.75	20.72
17	SHENZHEN INVESTMENT LTD	604 HK	25,958,695.76	19.92
18	CHINA GAS HOLDINGS LTD	384 HK	25,618,268.53	19.65
19	DIGITAL DOMAIN HOLDINGS LTD	547 HK	24,645,283.91	18.91
20	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	1833 HK	22,070,897.00	16.93
21	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	21,227,964.33	16.29
22	BEIJING CAPITAL LAND LTD-H	2868 HK	20,436,754.46	15.68
23	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	966 HK	20,198,336.62	15.50
24	JOY CITY PROPERTY LTD	207 HK	18,735,950.22	14.37
25	DENSO CORP	6902 JP	18,349,172.72	14.08
26	SINOFERT HOLDINGS LTD	297 HK	18,099,637.41	13.89
27	FANUC CORP	6954 JP	17,595,622.92	13.50
28	CHINA SILVER GROUP LTD	815 HK	17,519,813.20	13.44
29	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	17,259,415.43	13.24
30	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 HK	16,798,935.31	12.89
31	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	16,405,659.39	12.59
32	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	3383 HK	16,125,834.04	12.37
33	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1186 HK	15,911,655.69	12.21
34	CHINA ELECTRONICS CORP HOLDI	85 HK	15,620,331.32	11.98
35	BAOXIN AUTO GROUP LTD	1293 HK	14,409,031.02	11.05
36	SKY LIGHT HOLDINGS LTD	3882 HK	13,329,875.00	10.23
37	CHINA AIRCRAFT LEASING GROUP	1848 HK	13,212,545.55	10.14
38	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	8316 JP	13,001,360.95	9.97
39	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	NAB AU	12,783,480.06	9.81
40	SINGAPORE TECH ENGINEERING	STE SP	12,285,348.77	9.43
41	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	337 HK	12,228,854.31	9.38
42	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930 KS	12,194,249.73	9.36
43	AUST AND NZ BANKING GROUP	ANZ AU	12,030,515.14	9.23
44	LG HAUSYS LTD	108670 KS	11,906,304.57	9.13
45	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	8306 JP	11,889,925.41	9.12
46	SUMITOMO HEAVY	6302 JP	11,807,648.45	9.06

	INDUSTRIES			
47	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	881 HK	11,387,459.06	8.74
48	CHINA SANJIANG FINE CHEMICAL	2198 HK	10,705,734.04	8.21
49	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	1829 HK	10,648,809.31	8.17
50	HUIYIN HOUSEHOLD APPLIANCES	1280 HK	10,054,501.50	7.71
51	VALUE PARTNERS GROUP LTD	806 HK	8,992,457.34	6.90
52	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	1728 HK	8,833,425.06	6.78
53	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	698 HK	8,446,632.26	6.48
54	SINOSOFT TECHNOLOGY GROUP LT	1297 HK	8,154,821.87	6.26
55	HILONG HOLDING LTD	1623 HK	8,112,768.24	6.22
56	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	7,167,488.49	5.50
57	TECHNOVATOR INTERNATIONAL LT	1206 HK	7,135,946.76	5.47
58	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	6,795,943.74	5.21
59	TIMES PROPERTY HOLDINGS LTD	1233 HK	5,845,397.62	4.48
60	TOSHIBA CORP	6502 JP	5,074,871.54	3.89
61	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2474 TT	4,734,760.01	3.63
62	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	1788 HK	4,652,359.00	3.57
63	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	489 HK	4,446,815.97	3.41
64	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	3898 HK	3,638,230.56	2.79
65	CHINA HOUSEHOLD HOLDINGS LTD	692 HK	3,570,570.00	2.74
66	SANDS CHINA LTD	1928 HK	3,189,865.90	2.45
67	DATANG INTL POWER GEN CO-H	991 HK	2,889,180.58	2.22
68	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	665 HK	2,760,975.00	2.12
69	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	2,759,908.33	2.12

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	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 LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	79,315,152.37	60.85
2	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	56,017,934.61	42.98

3	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	47,343,492.41	36.32
4	CNOOC LTD	883 HK	46,356,386.06	35.57
5	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	45,951,477.39	35.25
6	RED STAR MACALLINE GROUP C-H	1528 HK	40,030,469.30	30.71
7	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	36,998,176.72	28.39
8	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1288 HK	34,470,997.00	26.45
9	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	1117 HK	33,030,828.49	25.34
10	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	29,706,584.60	22.79
11	JOY CITY PROPERTY LTD	207 HK	27,322,432.55	20.96
12	SHENZHEN INVESTMENT LTD	604 HK	24,515,718.86	18.81
13	BEIJING CAPITAL LAND LTD-H	2868 HK	24,472,536.18	18.78
14	HARBIN ELECTRIC CO LTD-H	1133 HK	23,969,591.54	18.39
15	CHINA GAS HOLDINGS LTD	384 HK	23,350,366.00	17.91
16	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	1833 HK	19,266,409.18	14.78
17	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	18,173,509.40	13.94
18	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	3383 HK	17,154,561.31	13.16
19	SINOFERT HOLDINGS LTD	297 HK	16,153,165.94	12.39
20	CHINA SILVER GROUP LTD	815 HK	15,530,124.98	11.92
21	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 HK	14,895,614.84	11.43
22	CHINA FOODS LTD	506 HK	14,337,479.52	11.00
23	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1186 HK	13,946,239.02	10.70
24	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	665 HK	13,598,510.54	10.43
25	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	12,548,405.11	9.63
26	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	11,704,620.87	8.98
27	LG HAUSYS LTD	108670 KS	11,157,246.92	8.56
28	COOLPAD GROUP LTD	2369 HK	10,889,915.49	8.35
29	SINGAPORE TECH ENGINEERING	STE SP	10,884,405.69	8.35
30	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	1829 HK	10,284,735.81	7.89
31	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	2128 HK	10,147,518.04	7.79
32	CHINA AIRCRAFT LEASING GROUP	1848 HK	9,673,311.07	7.42
33	CHINA SANJIANG FINE CHEMICAL	2198 HK	9,481,176.00	7.27
34	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	9,059,675.45	6.95
35	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	6881 HK	8,939,655.70	6.86
36	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3328 HK	8,859,254.62	6.80
37	VALUE PARTNERS GROUP LTD	806 HK	8,855,483.48	6.79
38	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	337 HK	8,757,900.00	6.72
39	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	881 HK	8,676,378.70	6.66
40	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	8,144,723.73	6.25
41	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	1728 HK	7,929,788.99	6.08
42	DIGITAL DOMAIN HOLDINGS LTD	547 HK	7,828,884.77	6.01
43	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	6,793,365.78	5.21
44	DENSO CORP	6902 JP	6,202,136.46	4.76
45	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	5,959,834.00	4.57
46	BAOXIN AUTO GROUP LTD	1293 HK	5,815,091.85	4.46
47	HILONG HOLDING LTD	1623 HK	5,620,102.22	4.31
48	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	966 HK	5,494,186.72	4.22
49	TOSHIBA CORP	6502 JP	5,214,820.93	4.00
50	FANUC CORP	6954 JP	5,185,719.73	3.98
51	TIMES PROPERTY HOLDINGS LTD	1233 HK	5,168,392.22	3.97
52	HUADIAN POWER INTL CORP-H	1071 HK	5,092,022.34	3.91

53	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	3898 HK	4,756,072.19	3.65
54	CHINA ELECTRONICS CORP HOLDI	85 HK	4,316,980.52	3.31
55	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	3,769,402.85	2.89
56	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2328 HK	3,603,228.84	2.76
57	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	489 HK	3,285,664.70	2.52
58	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	1138 HK	3,273,521.62	2.51
59	CHINA HOUSEHOLD HOLDINGS LTD	692 HK	2,927,610.58	2.25
60	DATANG INTL POWER GEN CO-H	991 HK	2,840,428.11	2.18
61	CTrip.COM INTERNATIONAL-ADR	CTRP US	2,798,227.38	2.15
62	SANDS CHINA LTD	1928 HK	2,779,173.22	2.13
63	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	2,642,282.83	2.03

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	1,337,267,160.65
卖出收入（成交）总额	1,013,447,978.27

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

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	DAIWA ETF - NIKKEI 225	ETF 基金	开放式	Daiwa Asset Management Co Ltd	14,088,386.70	3.17
2	NOMURA ETF - TOPIX	ETF 基金	开放式	Nomura Asset Management Co Ltd	13,966,810.39	3.14
3	NOMURA ETF - NIKKEI 225	ETF 基金	开放式	Nomura Asset Management Co Ltd	13,984,028.28	3.14
4	069500 KS	ETF 基金	开放式	Samsung Asset	11,028,944.92	2.48

				Management Co Ltd/South Korea		
--	--	--	--	-------------------------------------	--	--

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 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	164,342,420.65
3	应收股利	1,503,735.06
4	应收利息	10,219.35
5	应收申购款	581,172.59
6	其他应收款	316,376.29
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	166,753,923.94

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

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需要说明的事项

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
7,519	48,207.77	66,264,163.06	18.28%	296,210,082.49	81.72%

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	1,948,980.03	0.54%

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	份额级别	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	-	50-100
	合计	50-100
本基金基金经理持有本开放式基金	-	50-100
	合计	50-100

§ 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	109,824,383.05
本报告期基金总申购份额	776,944,564.12
减：本报告期基金总赎回份额	524,294,701.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	362,474,245.55

§ 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

1、基金管理人于 2015 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴姚东不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由王德英代任总经理职务。

2、基金管理人于 2015 年 6 月 20 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫担任博时基金管理有限公司副总经理职务。

3、基金管理人于 2015 年 7 月 10 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳担任博时基金管理有限公司总经理职务。

4、基金管理人于 2015 年 8 月 8 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人，洪小源不再任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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（特殊普通合伙）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

2015 年 2 月，我司收到《深圳证监局关于对博时基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求公司对后台权限设置等问题进行改正，我司立即进行了改正并已经完成了验收。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受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	股票投资		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	占当期股票成交总额的比例	
BOCI Securities Limited		222,524,479.14	9.47%	342,493.33	11.98%	
Capital Securities Corp.		1,418,417.22	0.06%	2,014.09	0.07%	
CCB international Securities Limited		23,622,478.15	1.00%	35,433.72	1.24%	
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited		252,008,819.78	10.72%	767,801.75	26.86%	
Citigroup global markets asia limited		573,564,770.04	24.40%	573,564.81	20.06%	
CLSA Asia-Pacific Markets		174,772,905.57	7.43%	206,414.36	7.22%	
China Merchants Securities (HK) Co Ltd		39,838,279.36	1.69%	39,838.28	1.39%	
Credit Suisse (Hong Kong) Limited		7,167,488.49	0.30%	17,918.73	0.63%	
Daiwa markets Hong Kong Limited		52,933,730.71	2.25%	52,933.72	1.85%	
Essence international Securities Limited		88,363,962.38	3.76%	106,036.76	3.71%	
Goldman Sachs Limited		209,839,157.20	8.93%	104,919.60	3.67%	
GuotaiJunan Securities(Hong Kong) Co. Ltd.		111,145,799.46	4.73%	111,145.80	3.89%	
MasterLink Securities Corp		7,305,942.20	0.31%	10,227.94	0.36%	
Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited		153,872,159.13	6.55%	76,936.09	2.69%	
Morgan Stanley Asia Limited		247,509,123.56	10.53%	153,554.21	5.37%	
UBS Securities Asia Limited		184,827,626.53	7.86%	257,358.11	9.00%	

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，在多家券商开立了券商交易账户。

1、基金券商交易账户的选择标准如下：

(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、基金券商交易账户的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构；

(2) 基金管理人在被选中的证券经营机构开立交易账户。

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	博时基金管理有限公司关于参加数米基金销售有限公司认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	2015/6/27
2	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加上海好买基金销售有限公司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	2015/6/20
3	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
4	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司认、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	2015/4/25
5	博时大中华亚太精选股票证券投资基金暂停大额申购、转换转入及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	2015/4/15
6	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/13
7	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳腾元基金销售有限公司为代销机构并参加其网上交易申购业务及定期定额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	2015/4/2
8	关于博时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	2015/4/1
9	关于博时旗下部分开放式基金增加苏州银行股份有限公司为代销机构并参加其网上银行、手机银行和柜面申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/27
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/26

11	关于博时旗下部分开放式基金增加中国国际金融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	2015/3/26
12	关于博时旗下部分开放式基金增加泉州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	2015/3/20
13	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司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	2015/2/26
14	博时基金管理有限公司关于暂停货币基金快速赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/14
15	关于厦门市鑫鼎盛控股有限公司暂停代理博时旗下开放式基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/7
16	关于博时旗下部分基金参加东莞银行股份有限公司网上银行、手机银行申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/31
17	关于博时旗下部分开放式基金参加江苏张家港农村商业银行股份有限公司柜面、网上银行、手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/31
18	关于博时旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为代销机构并参加其网上交易申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/19
19	公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/17
20	博时大中华亚太精选股票证券投资基金基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/12

§ 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
二〇一五年八月二十七日