

博时大中华亚太精选股票证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 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：二〇一七年八月二十四日

§ 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 2017 年 8 月 23 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 2017 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	28
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	28
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.....	29
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	36
7.11 投资组合报告附注.....	37
§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
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.....	38
§9 开放式基金份额变动	39

§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	40
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	41
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	42
§ 12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

§ 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	270,866,433.92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	郭明
	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	易会满

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		-	-

注：本基金未聘请境外投资顾问。

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（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	22,254,491.61
本期利润	26,526,698.20
加权平均基金份额本期利润	0.0992
本期加权平均净值利润率	8.56%
本期基金份额净值增长率	13.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-98,565,252.48
期末可供分配基金份额利润	-0.3639
期末基金资产净值	317,484,778.66
期末基金份额净值	1.172
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	25.64%

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	1.38%	0.64%	0.60%	0.57%	0.78%	0.07%
过去三个月	-0.09%	0.65%	5.31%	0.53%	-5.40%	0.12%
过去六个月	13.46%	0.76%	15.95%	0.53%	-2.49%	0.23%
过去一年	28.09%	0.80%	26.64%	0.67%	1.45%	0.13%
过去三年	-4.69%	1.26%	22.77%	0.99%	-27.46%	0.27%
过去五年	49.97%	1.18%	46.09%	0.93%	3.88%	0.25%
自基金合同生效起至今	25.64%	1.18%	30.10%	1.02%	-4.46%	0.16%

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



§ 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 2017 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 186 只开放式基金，并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，管理资产总规模逾 6357.79 亿元人民币，其中公募基金规模逾 3763.55 亿元人民币，累计分红逾 814 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 2017 年 2 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时深证基本面 200ETF 今年以来净值增长率为 16.07%，在同类 104 只基金中排名前 10，博时裕富沪深 300 指数、博时上证 50ETF 等今年以来净值增长率排名前 1/5；股票型分级子基金里，博时中证银行指数分级 B 今年以来净值增长率为 20.90%，在同类 128 只基金中排名前 1/6；混合偏股型基金中，博时主题行业今年以来净值增长率为 12.13%，在同类基金排名位居前 1/4；混合灵活配置型基金中，博时产业新动力、博时互联网主题基金今年以来净值增长率分别为 8.95%、8.40%，在同类基金中排名均位于前 1/4。

保本型基金中，博时保泰保本混合基金今年以来净值增长率在同类 137 只中排名前 1/3；绝对收益目标基金里，博时新起点灵活配置混合今年以来净值增长率在同类基金中排名前 10。

黄金基金类，博时黄金 ETF (D 类) 今年以来净值增长率 3.67%，在同类 14 只中排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债 (A 类)、博时裕昂纯债债券基金今年以来净值增长率在同类 797 只排名前 1/10；普通债券型基金中，博时信用债券基金、博时天颐债券基金今年以来净值增长率在 417 只中排名前 1/10；货币市场基金里，博时外服货币今年以来净值增长率在 631 只同类基金中排名前 1/4；转债基金方面，博时转债增强债券 (A 类) 今年以来收益率 3.78%，同类排名第一。

QDII 基金方面，博时大中华亚太精选股票基金 (QDII)、博时大中华亚太精选股票基金 (QDII) (美元)，今年以来净值增长率分别为 13.46%、15.92%，同类排名前 1/2、1/4。

2、其他大事件

2017 年 6 月 23 日，由南方日报社主办的“2017 年南方金融峰会暨第六届金榕奖颁奖典礼”在广州举行，博时基金获得“年度资产管理优秀奖”。

2017 年 6 月 17 日，由中国证券报主办的“全球配置时代海外投资动力与机遇——首届海外基金金牛奖颁奖典礼暨高端论坛”在深召开，博时基金海外全资子公司博时基金（国际）有限公司荣获“一年期海外金牛私募管理公司（固定收益策略）”。

2017 年 5 月 12 日，由中国基金报主办的第四届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在深召开。博时摘得“2016 年度十大明星基金公司奖”和“2016 年度固定收益投资明星团队奖”两项公司类大奖，

博时双月薪和博时稳定价值获“三年持续回报普通债券型明星基金奖”、博时新财富获“2016 年度绝对收益明星基金奖”、博时信用债纯债获“2016 年度积极债券型明星基金奖”、博时信用债券获“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

2017 年 4 月 25 日，博时基金在 2017 中国基金业峰会暨第十四届中国“金基金”奖颁奖典礼上，获得“2016 年度金基金·TOP 公司奖”。

2017 年 4 月 25 日，在由中国基金报主办的第四届中国基金业英华奖颁奖典礼暨高峰论坛上，博时基金过钧获评“三年期二级债最佳基金经理”、“五年期二级债最佳基金经理”，陈凯杨获评“三年期纯债型最佳基金经理”。

2017 年 4 月 8 日，在第十四届中国基金业金牛奖颁奖典礼上，博时基金被评为“2016 年度固定收益投资金牛基金公司”，旗下博时卓越品牌混合(160512)被评为“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”、博时主题行业(160505)获“2016 年度开放式混合型金牛基金”、博时信用债券(050011)获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”、博时信用债纯债债券(050027)获“2016 年度开放式债券型金牛基金”。

2017 年 3 月 10 日，由中国工商银行私人银行部举办的“第十八届资本市场投资论坛会议”在杭州落下帷幕。工行私行对管理人的过往表现给予充分肯定并对 2016 年表现突出的管理人进行了表彰，博时基金荣获“2016 年度优秀管理人奖”。

2017 年 2 月 22 日，第二届中国基金业营销创新高峰论坛暨“金果奖”颁奖典礼在京举办，博时基金一举斩获最佳品牌形象建设奖、最具创新精神奖、最佳自媒体建设奖三项大奖。

2017 年 1 月 19 日，深交所召开了新一代交易系统上线运行总结会，会上介绍了深交所新一代交易系统运行情况，并表彰了在新一代交易系统上线过程中，积极参与各项准备和测试工作，为系统顺利上线做出突出贡献的单位和个人。博时基金被授予新一代交易系统建设先行者、突出贡献单位殊荣。博时基金信息技术部车宏原、陈小平、祁晓东被授予突出贡献奖殊荣。

2017 年 1 月 16 日，博时基金荣登中央国债登记结算有限责任公司评选的“优秀资产管理机构”榜单，成为全国十家获此殊荣的基金公司之一。

2017 年 1 月 12 日，由华夏时报、新浪财经联合主办的“第十届金蝉奖颁奖典礼”上，博时基金荣获“2016 年度市场营销力公司”奖项。

2017 年 1 月 10 日，由信息时报主办的“2016 年度金狮奖金融行业风云榜”颁奖典礼于广州盛大举办，博时基金斩获“年度最佳投研基金公司”大奖。

2017 年 1 月 6 日，由东方财富网、天天基金网主办的“2016 东方财富风云榜”评选活动于广州举行，博时基金荣膺“2016 年度最佳基金公司”大奖，同时，旗下产品博时银智 100 荣获“2016 年度最受欢迎新发基金奖”。

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	股票投资	2011-02-28	-	15.8	2001 年起先后在香港新鸿基证

	部国际组 投资总监/ 基金经理			券有限公司、和丰顺投资有限公司工作；2009 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、投资经理、国际投资部副总经理、股票投资部国际组投资副总监。现任股票投资部国际组投资总监兼博时大中华亚太精选股票（QDII）基金、博时沪港深优质企业混合基金、博时沪港深成长企业混合基金、博时沪港深价值优选混合基金的基金经理。
--	-----------------------	--	--	--

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、本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 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

2017 上半年，港股市场呈现出典型的牛市行情，北水南下资金持续流入，板块轮动上涨。恒生指数 6 月 30 日收于 25765 点，上半年累计升幅 17.11%；恒生国企指数上半年累计升幅 10.33%。期内，本基金的港股部分表现良好，超配了汽车、信息技术、消费、保险等行业。但由于亚太部分的金融、工业等行业配置受到了澳洲及日本的负面因素影响，拖累了基金总体表现。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.172 元，份额累计净值为 1.254 元。报告期内，本

基金基金份额净值增长率为 13.46%，同期业绩基准增长率 15.95%。

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，我们认为港股在经历了上半年的上涨之后，可能出现短暂的整固，但下半年仍将涌现相当多的投资机会。因为：1) 今年港股的牛市特征明显，资金面在北水南下的支撑下相当充裕，投资者不断追逐市场热点以及业绩好的公司；2) 欧美与中国的经济走势向好，PMI 稳定在 50 以上，大量公司运营趋势良好；3) 市场对港股的总体盈利预期仍然偏低，大行对港股的盈利预测和评级仍将继续上调。

当然，我们仍需警惕未来几个月可能出现的市场风险：美国的加息速度是否会比市场预期更快？欧洲这个黑天鹅湖会否再飞出黑天鹅？

我们将继续从两个方面寻找投资机会：一是业绩反转超预期、估值修复的投资机会；二是把握北水南下的脉搏，重点配置港股通名单中的高成长、低估值、基本面良好的个股。同时，我们也会更加注重对市场风险的防范。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

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

无

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

2017 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2017 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。

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 2017 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	52,889,902.91	17,107,607.05
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	279,913,056.64	162,627,410.27
其中：股票投资		266,135,343.29	150,283,312.14
基金投资		13,777,713.35	12,344,098.13
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		4,010,909.39	-
应收利息	6.4.3.5	7,348.52	1,488.50
应收股利		1,488,398.67	43,227.31
应收申购款		556,287.89	61,265.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	76,976.69	-
资产总计		338,942,880.71	179,840,998.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		13,126,707.74	16,252.21
应付赎回款		7,096,211.18	1,488,748.94
应付管理人报酬		495,559.33	275,148.28
应付托管费		96,358.76	53,501.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	372,458.30	2,012.57
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	270,806.74	152,812.27
负债合计		21,458,102.05	1,988,475.33
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	270,866,433.92	172,225,672.95

未分配利润	6.4.3.10	46,618,344.74	5,626,850.19
所有者权益合计		317,484,778.66	177,852,523.14
负债和所有者权益总计		338,942,880.71	179,840,998.47

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.172 元，基金份额总额 270,866,433.92 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		32,137,726.52	-19,509,178.26
1. 利息收入		130,395.56	41,936.04
其中：存款利息收入	6.4.3.11	130,395.56	41,936.04
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）		28,327,954.77	-24,048,336.46
其中：股票投资收益	6.4.3.12	24,979,559.07	-27,600,320.41
基金投资收益	6.4.3.13	-	-52,982.77
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.3.14	3,348,395.70	3,604,966.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	4,272,206.59	3,708,345.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-718,484.56	771,863.27
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	125,654.16	17,013.64
减：二、费用		5,611,028.32	3,356,342.97
1. 管理人报酬		2,746,141.18	1,794,052.03
2. 托管费		533,971.94	348,843.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.17	2,124,715.75	1,029,443.21
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	206,199.45	184,004.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,526,698.20	-22,865,521.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,526,698.20	-22,865,521.23

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	172,225,672.95	5,626,850.19	177,852,523.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,526,698.20	26,526,698.20
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）	98,640,760.97	14,464,796.35	113,105,557.32
其中：1. 基金申购款	203,801,598.02	31,518,579.77	235,320,177.79
2. 基金赎回款	-105,160,837.05	-17,053,783.42	-122,214,620.47
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）	270,866,433.92	46,618,344.74	317,484,778.66
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	231,071,102.95	2,815,391.82	233,886,494.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-22,865,521.23	-22,865,521.23
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）	-16,107,433.21	1,695,205.48	-14,412,227.73
其中：1. 基金申购款	3,435,185.32	-310,607.65	3,124,577.67
2. 基金赎回款	-19,542,618.53	2,005,813.13	-17,536,805.40
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）	214,963,669.74	-18,354,923.93	196,608,745.81

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[2004]78号《财政部、国家税务总局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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税

改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	52,889,902.91
定期存款	-
其他存款	-
合计	52,889,902.91

注：于 2017 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 18,341,395.41 (折合人民币 15,918,863.90 元)，美元 396,183.85 元(折合人民币 2,683,907.87 元)，新台币 174,830.56 元(折合人民币 38,927.60 元)和澳元 0.87 元(折合人民币 4.52 元)，新加坡元 0.34 元(折合人民币 1.67 元)，韩元 140.00 元(折合人民币 0.81 元)泰铢 0.14 元(折合人民币 0.05)。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	243,400,614.12	266,135,343.29	22,734,729.17
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	11,302,653.91	13,777,713.35	2,475,059.44
其他	-	-	-
合计	254,703,268.03	279,913,056.64	25,209,788.61

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	6,389.58
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	958.94
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	7,348.52

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	76,976.69
待摊费用	-
合计	76,976.69

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	372,458.30
银行间市场应付交易费用	-
合计	372,458.30

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20,157.10
预提费用	173,560.90
应付在途资金	77,088.74
合计	270,806.74

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,225,672.95	172,225,672.95
本期申购	203,801,598.02	203,801,598.02
本期赎回（以“-”号填列）	-105,160,837.05	-105,160,837.05

本期末	270,866,433.92	270,866,433.92
-----	----------------	----------------

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	-78,419,704.98	84,046,555.17	5,626,850.19
本期利润	22,254,491.61	4,272,206.59	26,526,698.20
本期基金份额交易产生的变动数	-42,400,039.11	56,864,835.46	14,464,796.35
其中：基金申购款	-82,370,041.75	113,888,621.52	31,518,579.77
基金赎回款	39,970,002.64	-57,023,786.06	-17,053,783.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-98,565,252.48	145,183,597.22	46,618,344.74

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	112,078.96
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	15,985.92
其他	2,330.68
合计	130,395.56

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	462,884,039.01
减：卖出股票成本总额	437,904,479.94
买卖股票差价收入	24,979,559.07

6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,348,395.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,348,395.70

6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	4,272,206.59
——股票投资	2,838,591.37
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——基金投资	1,433,615.22
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	4,272,206.59

6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	125,654.16
其他	-
转换费	-
合计	125,654.16

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%。

6.4.3.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	2,124,715.75
银行间市场交易费用	-
合计	2,124,715.75

6.4.3.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
其他费用	30,654.32
银行汇划费用	1,984.23
合计	206,199.45

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、基金销售机构
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
工银国际控股有限公司(工银国际)	基金托管人中国工商银行的子公司

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	76,859,842.25	7.59%	76,425,309.14	15.62%
工银国际	29,880,276.31	2.89%	-	-

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 2017年1月1日至2017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	76,860.00	7.44%	-	-
工银国际	29,880.00	2.89%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	76,425.32	14.46%	-	-

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,746,141.18	1,794,052.03
其中：支付销售机构的客户维护费	634,001.57	429,329.14

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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	533,971.94	348,843.48

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	
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日	2016年1月1日至2016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	34,246,228.51	109,657.56	3,233,823.07	37,668.21
渣打银行	18,643,674.40	2,425.44	32,842,831.76	4,267.83

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

本基金报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2017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。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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同责任，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 2017 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%。

于 2017 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 2017 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	52,848,793.65	-	-	41,109.26	52,889,902.91
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	279,913,056.64	279,913,056.64
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,010,909.39	4,010,909.39
应收利息	-	-	-	7,348.52	7,348.52
应收股利	-	-	-	1,488,398.67	1,488,398.67
应收申购款	-	-	-	556,287.89	556,287.89
其他资产	-	-	-	76,976.69	76,976.69
资产总计	52,848,793.65	-	-	286,094,087.06	338,942,880.71
负债					
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	13,126,707.74	13,126,707.74
应付赎回款	-	-	-	7,096,211.18	7,096,211.18

应付管理人报酬	-	-	-	495,559.33	495,559.33
应付托管费	-	-	-	96,358.76	96,358.76
其他负债	-	-	-	643,265.04	643,265.04
负债总计	-	-	-	21,458,102.05	21,458,102.05
利率敏感度缺口	52,848,793.65	-	-	264,635,985.01	317,484,778.66
上年度末 2016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	17,067,911.39	-	-	39,695.66	17,107,607.05
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	162,627,410.27	162,627,410.27
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,488.50	1,488.50
应收股利	-	-	-	43,227.31	43,227.31
应收申购款	-	-	-	61,265.34	61,265.34
资产总计	17,067,911.39	-	-	162,773,087.08	179,840,998.47
负债					
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	16,252.21	16,252.21
应付赎回款	-	-	-	1,488,748.94	1,488,748.94
应付管理人报酬	-	-	-	275,148.28	275,148.28
应付托管费	-	-	-	53,501.06	53,501.06
其他负债	-	-	-	154,824.84	154,824.84
负债总计	-	-	-	1,988,475.33	1,988,475.33
利率敏感度缺口	17,067,911.39	-	-	160,784,611.75	177,852,523.14

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 2017 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 2017年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	2,683,907.87	15,918,863.90	38,934.65	18,641,706.42
交易性金融资	-	115,792,010.58	87,958,922.31	203,750,932.89

产				
应收股利	-	325,470.00	200,023.61	525,493.61
资产合计	2,683,907.87	132,036,344.48	88,197,880.57	222,918,132.92
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	13,126,707.74	-	13,126,707.74
负债合计	-	13,126,707.74	-	13,126,707.74
资产负债表外汇风险敞口净额	2,683,907.87	118,909,636.74	88,197,880.57	209,791,425.18
项目	上年度末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	5,821,075.68	5,801,622.80	37,561.79	11,660,260.27
交易性金融资产	2,944,398.55	110,558,976.11	49,124,035.61	162,627,410.27
应收股利	-	-	43,227.31	43,227.31
资产合计	8,765,474.23	116,360,598.91	49,204,824.71	174,330,897.85
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	16,252.21	-	16,252.21
负债合计	-	16,252.21	-	16,252.21
资产负债表外汇风险敞口净额	8,765,474.23	116,344,346.70	49,204,824.71	174,314,645.64

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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 1,049	增加约 872
所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 1,049	减少约 872	

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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	266,135,343.29	83.83	150,283,312.14	84.50
交易性金融资产—基金投资	13,777,713.35	4.34	12,344,098.13	6.94
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	279,913,056.64	88.17	162,627,410.27	91.44

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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%	增加约 1,584	增加约 933
2. 业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	减少约 1,584	减少约 933	

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 2017 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 279,913,056.64 元(2016 年 12 月 31 日 162,627,410.27 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	266,135,343.29	78.52
	其中：普通股	266,135,343.29	78.52
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	13,777,713.35	4.06
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	52,889,902.91	15.60
8	其他各项资产	6,139,921.16	1.81
9	合计	338,942,880.71	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	191,954,134.34	60.46
澳大利亚	32,175,866.52	10.13
日本	18,383,677.84	5.79
中国台湾	12,742,774.43	4.01
韩国	8,866,454.94	2.79
泰国	2,012,435.22	0.63
合计	266,135,343.29	83.83

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	75,132,709.89	23.66
金融	65,158,681.64	20.52
信息技术	54,967,094.85	17.31
原材料	25,823,273.34	8.13

日常消费品	15,396,257.94	4.85
工业	11,133,031.34	3.51
医疗保健	10,792,585.20	3.40
房地产	4,469,788.00	1.41
能源	3,261,921.09	1.03
合计	266,135,343.29	83.83

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	PING AN INSURANC E GROUP CO-H	中国平安	2318 H1	香港证 券交易 所	中国香港	335,000.0 0	14,959,252.14	4.71
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港证 券交易 所	中国香港	60,000.00	14,539,395.84	4.58
3	LARGAN PRECISIO N CO LTD	大立光电	3008 TT	台湾证 券交易 所	中国台湾	11,800.00	12,742,774.43	4.01
4	HISENSE KELON ELEC HLD-H	海信科龙	921 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,100,000 .00	12,697,669.60	4.00
5	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 H1	香港证 券交易 所	中国香港	1,780,000 .00	11,942,058.45	3.76
6	GEELY AUTOMOB ILE HOLDINGS LT	吉利汽车	175 HK	香港证 券交易 所	中国香港	800,000.0 0	11,692,618.24	3.68
7	YICHANG HEC CHANGJIA NG PHA-H	东阳光药	1558 HK	香港证 券交易 所	中国香港	750,000.0 0	10,792,585.20	3.40
8	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIO NAL	枫叶教育	1317 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,000,000 .00	5,537,329.60	1.74
			1317 H2	香港证 券交易 所	中国香港	700,000.0 0	3,876,130.72	1.22
9	SAMSUNG ELECTRON ICS CO	三星电子	005930 KS	韩国证 券交易 所	韩国	630.00	8,866,454.94	2.79

	LTD							
10	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	香港证 券交易 所	中国香港	2,000,000 .00	8,418,824.00	2.65
11	CHINA LIFE INSURANC E CO-H	中国人寿	2628 HK	香港证 券交易 所	中国香港	400,000.0 0	8,279,956.80	2.61
12	CHINA ZHENGTON G AUTO SERVICE	正通汽车	1728 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,500,000 .00	8,136,750.00	2.56
13	RIO TINTO LTD	力拓股份	RIO AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	23,500.00	7,725,594.28	2.43
14	SHANDONG CHENMING PAPER-H	晨鸣纸业	1812 HK	香港证 券交易 所	中国香港	831,500.0 0	7,130,153.74	2.25
15	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	3988 H1	香港证 券交易 所	中国香港	2,000,000 .00	6,648,267.20	2.09
16	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	中银香港	2388 HK	香港证 券交易 所	中国香港	200,000.0 0	6,483,362.40	2.04
17	BHP BILLITON LIMITED	必和必拓	BHP AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	52,600.00	6,362,604.38	2.00
18	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	5 HK	香港证 券交易 所	中国香港	100,000.0 0	6,305,438.80	1.99
19	COMMONWE ALTH BANK OF AUSTRAL	澳大利亚 联邦银行	CBA AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	13,500.00	5,808,750.91	1.83
20	HAITIAN INTERNAT IONAL HLDGS	海天国际	1882 HK	香港证 券交易 所	中国香港	300,000.0 0	5,702,234.40	1.80
21	SEIKO EPSON CORP	精工爱普 生公司	6724 JP	东京证 券交易 所	日本	37,700.00	5,698,430.97	1.79
22	AUST AND NZ BANKING GROUP	澳新银行	ANZ AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	37,700.00	5,625,899.71	1.77
23	CHINA PACIFIC INSURANC E GR-H	中国太保	2601 H1	香港证 券交易 所	中国香港	200,000.0 0	5,537,329.60	1.74

24	NABTESCO CORP	NABTESCO CORP	6268 JP	东京证 券交易 所	日本	27,500.00	5,430,796.94	1.71
25	BYD ELECTRON IC INTL CO LTD	比亚迪电 子	285 H1	香港证 券交易 所	中国香港	400,000.0 0	5,374,160.64	1.69
26	HAIER ELECTRON ICS GROUP CO	海尔电器	1169 H1	香港证 券交易 所	中国香港	300,000.0 0	5,285,632.80	1.66
27	HENGAN INTL GROUP CO LTD	恒安国际	1044 H1	香港证 券交易 所	中国香港	100,000.0 0	4,999,219.20	1.57
28	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	和谐汽车	3836 H2	香港证 券交易 所	中国香港	1,400,000 .00	4,532,278.24	1.43
29	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	龙光地产	3380 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,000,000 .00	4,469,788.00	1.41
30	AAC TECHNOLO GIES HOLDINGS IN	瑞声科技	2018 H1	香港证 券交易 所	中国香港	50,000.00	4,235,449.60	1.33
31	SAPPORO HOLDINGS LTD	札幌控股	2501 JP	东京证 券交易 所	日本	20,000.00	3,744,021.50	1.18
32	MURATA MANUFACT URING CO LTD	株式会社 村田製作 所	6981 JP	东京证 券交易 所	日本	3,400.00	3,510,428.43	1.11
33	WESFARME RS LTD	西农集团	WES AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	16,000.00	3,335,393.72	1.05
34	WOOLWORT HS LTD	澳大利亚 伍尔沃斯 公司	WOW AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	25,000.00	3,317,623.52	1.04
35	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	中石化冠 德	934 H1	香港证 券交易 所	中国香港	872,000.0 0	3,261,921.09	1.03
36	MGM CHINA HOLDINGS LTD	美高梅中 国	2282 HK	香港证 券交易 所	中国香港	200,000.0 0	3,013,418.24	0.95
37	DAH SING BANKING	大新银行 集团	2356 H1	香港证 券交易	中国香港	200,000.0 0	2,884,966.08	0.91

	GROUP LTD			所				
38	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	建设银行	939 H1	香港证券交易所	中国香港	500,000.00	2,625,458.00	0.83
39	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	香港证券交易所	中国香港	999,000.00	2,592,485.72	0.82
40	SIAM CEMENT PCL-NVDR	-	SCC-R TB	泰国证券交易所	泰国	20,000.00	2,012,435.22	0.63

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	KINGSOFT CORP LTD	3888 H1	16,639,764.31	9.36
2	O-NET TECHNOLOGIES GROUP LTD	877 HK	14,292,470.09	8.04
3	ANGANG STEEL CO LTD-H	347 HK	14,165,774.78	7.96
4	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 H1	12,625,383.94	7.10
5	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	12,225,217.34	6.87
6	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 H1	11,785,618.32	6.63
7	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 H1	11,517,186.29	6.48
8	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	1728 HK	11,470,023.87	6.45
9	SUNNY OPTICAL TECH	2382 H1	11,443,688.61	6.43
10	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	11,360,963.31	6.39
11	YICHANG HEC CHANGJIANG PHA-H	1558 HK	10,951,166.79	6.16
12	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	670 H1	10,499,051.28	5.90
13	HISENSE KELON ELEC HLD-H	921 HK	10,332,303.62	5.81
14	MAANSHAN IRON & STEEL-H	323 HK	10,327,854.34	5.81
15	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 H1	9,578,211.72	5.39
16	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 H1	9,531,622.72	5.36
17	BBMG CORP-H	2009 H1	9,511,859.85	5.35
18	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 H1	9,085,576.39	5.11
19	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 H1	9,071,385.18	5.10
20	CHINA LIFE INSURANCE	2628 HK	8,951,919.97	5.03

	CO-H			
21	CHINA NATIONAL MATERIALS - H	1893 HK	8,891,627.98	5.00
22	SINOTRANS SHIPPING LTD	368 HK	8,863,741.08	4.98
23	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 H1	8,223,318.32	4.62
24	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	732 H1	8,133,067.03	4.57
25	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	751 HK	8,042,829.73	4.52
26	CHINA SANJIANG FINE CHEMICAL	2198 HK	7,600,000.02	4.27
27	CHINA RESOURCES CEMENT	1313 H1	7,529,140.78	4.23
28	KUNMING DIANCHI WATER TREA-H	3768 HK	7,093,315.86	3.99
29	BANK OF CHINA LTD-H	3988 H1	6,909,697.85	3.89
30	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	1317 HK	6,255,291.14	3.52
31	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 HK	6,237,692.07	3.51
32	AUST AND NZ BANKING GROUP	ANZ AU	6,165,855.27	3.47
33	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	6,134,907.65	3.45
34	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 H1	6,054,385.80	3.40
35	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	6,006,564.20	3.38
36	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	CBA AU	5,966,790.21	3.35
37	SEIKO EPSON CORP	6724 JP	5,796,474.88	3.26
38	AIR CHINA LTD-H	753 H1	5,760,742.95	3.24
39	LONGFOR PROPERTIES	960 H1	5,736,803.46	3.23
40	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2328 HK	5,693,682.72	3.20
41	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 H1	5,686,256.27	3.20
42	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 H1	5,683,877.98	3.20
43	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	1882 HK	5,677,203.17	3.19
44	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	813 H1	5,593,851.79	3.15
45	CHINA EVERGRANDE GROUP	3333 H1	5,546,008.38	3.12
46	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	2298 HK	5,451,369.28	3.07
47	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	3836 HK	5,444,741.48	3.06
48	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	698 H2	5,394,753.60	3.03
49	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2601 H1	5,259,044.33	2.96

50	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1316 HK	5,099,828.69	2.87
51	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1169 H1	5,072,895.24	2.85
52	JIANGXI COPPER CO LTD-H	358 H1	4,998,931.56	2.81
53	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1638 HK	4,895,459.24	2.75
54	HUANENG POWER INTL INC-H	902 H1	4,869,300.11	2.74
55	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 H1	4,808,419.47	2.70
56	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	934 H1	4,775,060.20	2.68
57	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 H1	4,709,231.69	2.65
58	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	3380 HK	4,669,121.82	2.63
59	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1316 H1	4,626,345.17	2.60
60	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1186 H1	4,594,903.90	2.58
61	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	2777 H1	4,579,758.66	2.58
62	RIO TINTO LTD	RIO AU	4,520,669.55	2.54
63	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	3836 H2	4,480,863.49	2.52
64	DYNAGREEN ENVIRONMENTAL PR-H	1330 HK	4,053,989.63	2.28
65	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	1317 H2	4,005,760.78	2.25
66	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	1293 HK	3,756,962.72	2.11
67	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	3983 HK	3,633,421.08	2.04

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	KINGSOFT CORP LTD	3888 H1	16,488,332.85	9.27
2	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	13,904,107.85	7.82
3	ANGANG STEEL CO LTD-H	347 HK	13,556,384.12	7.62
4	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 H1	12,285,181.18	6.91
5	O-NET TECHNOLOGIES GROUP LTD	877 HK	11,810,041.27	6.64
6	SUNNY OPTICAL TECH	2382 H1	11,302,202.29	6.35
7	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	3983 HK	11,079,243.64	6.23
8	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	10,626,954.93	5.98
9	BBMG CORP-H	2009 H1	10,580,924.48	5.95
10	CHINA ZHENGTONG AUTO SERVICE	1728 HK	10,034,020.72	5.64
11	TIMES PROPERTY HOLDINGS LTD	1233 HK	9,797,731.17	5.51
12	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	670 H1	9,722,925.78	5.47

13	MAANSHAN IRON & STEEL-H	323 HK	9,657,458.50	5.43
14	CHINA NATIONAL MATERIALS - H	1893 HK	9,158,333.86	5.15
15	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 H1	8,936,441.26	5.02
16	SINOTRANS SHIPPING LTD	368 HK	8,929,915.01	5.02
17	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 H1	8,521,453.71	4.79
18	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 H1	8,426,209.40	4.74
19	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	8,411,183.09	4.73
20	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	732 H1	7,998,001.84	4.50
21	CHINA RESOURCES CEMENT	1313 H1	7,747,733.59	4.36
22	CHINA SANJIANG FINE CHEMICAL	2198 HK	7,345,411.99	4.13
23	HUADIAN POWER INTL CORP-H	1071 HK	7,226,912.47	4.06
24	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	6,826,028.32	3.84
25	AIR CHINA LTD-H	753 H1	6,613,385.16	3.72
26	GRAND BAOXIN AUTO GROUP LTD	1293 HK	6,411,817.17	3.61
27	CHINA HARMONY NEW ENERGY AUT	3836 HK	6,345,763.46	3.57
28	KUNMING DIANCHI WATER TREA-H	3768 HK	6,098,742.02	3.43
29	HUANENG POWER INTL INC-H	902 HK	5,826,669.91	3.28
30	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	5,798,901.36	3.26
31	LONGFOR PROPERTIES	960 H1	5,783,739.79	3.25
32	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 H1	5,737,818.11	3.23
33	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	2298 HK	5,542,023.88	3.12
34	CHINA EVERGRANDE GROUP	3333 H1	5,534,603.46	3.11
35	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	813 H1	5,533,984.27	3.11
36	ANTON OILFIELD SERVICES GP	3337 HK	5,531,012.24	3.11
37	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2328 HK	5,492,809.39	3.09
38	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 HK	5,394,267.65	3.03
39	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1316 H1	5,099,520.70	2.87
40	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1316 HK	5,024,616.20	2.83
41	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 H1	4,897,988.75	2.75
42	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 H1	4,816,408.04	2.71
43	HUANENG POWER INTL INC-H	902 H1	4,708,788.74	2.65
44	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	2777 H1	4,641,199.23	2.61
45	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	698 H2	4,600,033.48	2.59
46	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 H1	4,494,351.58	2.53
47	JIANGXI COPPER CO LTD-H	358 H1	4,481,983.56	2.52
48	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	257 HK	4,383,018.62	2.46
49	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	3899 HK	4,342,777.55	2.44
50	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 H1	4,305,624.92	2.42
51	ZHENGZHOU COAL MINING MACH-H	564 HK	4,214,331.19	2.37
52	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 H1	4,212,494.92	2.37
53	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1186 H1	4,157,202.87	2.34
54	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1638 HK	4,131,391.73	2.32
55	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 H1	4,006,554.79	2.25
56	DYNAGREEN ENVIRONMENTAL PR-H	1330 HK	3,810,705.42	2.14
57	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	3,760,190.16	2.11
58	BAIC MOTOR CORP LTD-H	1958 HK	3,738,396.29	2.10
59	SINOPEC KANTONS HOLDINGS	934 HK	3,582,159.04	2.01

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	462,884,039.01
卖出收入（成交）总额	437,904,479.94

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	NOMURA ETF - TOPIX	ETF 基金	开放式	Nomura Asset Management Co Ltd	5,050,497.50	1.59
2	DAIWA ETF - NIKKEI 225	ETF 基金	开放式	Daiwa Asset Management Co Ltd	5,017,835.60	1.58
3	SAMSUNG KODEX 200 ETF	ETF 基金	开放式	Samsung Asset Management Co Ltd	3,709,380.25	1.17

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	4,010,909.39
3	应收股利	1,488,398.67
4	应收利息	7,348.52
5	应收申购款	556,287.89
6	其他应收款	76,976.69
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,139,921.16

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
14,346	18,880.97	64,810,531.83	23.93%	206,055,902.09	76.07%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	254,840.43	0.09%

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

- 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、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 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	172,225,672.95
本报告期基金总申购份额	203,801,598.02
减：本报告期基金总赎回份额	105,160,837.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	270,866,433.92

§ 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、本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 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

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

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	
华泰联合	1	44,967,168.75	43.92%	355,667	34.41%	-
CMS-招商证券香港	-	76,859,842.25	7.59%	76,860	7.44%	-
BOCI-中银国际	-	68,466,350.83	6.76%	68,466	6.62%	-
CG-花旗	-	52,883,178.87	5.22%	52,883	5.12%	-
DAR5-DAR5	-	51,646,108.64	5.10%	51,646	5.00%	-
CICC-CICC	-	50,325,975.80	4.97%	60,391	5.84%	-
CLSA-里昂证券	-	40,995,289.63	4.05%	43,901	4.25%	-

UBS-瑞士银行	-	38,024,934.27	3.75%	50,821	4.92%	-
JEF3-JEF3	-	33,551,824.13	3.31%	70,412	6.81%	-
ICBC-ICBC	-	29,880,276.31	2.95%	29,880	2.89%	-
HTIL-HTIL	-	23,834,157.22	2.35%	23,834	2.31%	-
MS-摩根士坦利	-	18,682,320.92	1.84%	9,341	0.90%	-
中信建投	1	18,481,411.35	1.82%	14,779	1.43%	-
GS-高盛	-	18,334,499.72	1.81%	9,167	0.89%	-
SWS1-SWS1	-	14,370,901.10	1.42%	17,245	1.67%	-
CSFB-瑞士信贷	-	13,446,376.09	1.33%	16,136	1.56%	-
CCB2-CCB2	-	8,063,840.24	0.80%	8,064	0.78%	-
ABCI-ABCI	-	7,093,315.86	0.70%	70,933	6.86%	-
GTHK-国泰君安	-	3,177,684.40	0.31%	3,178	0.31%	-

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》（证监基金字[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	关于博时旗下部分开放式基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-05-15
2	关于博时旗下部分开放式基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-05-10
3	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-04-22
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投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	2017-04-22
5	关于博时旗下部分开放式基金增加济安财富（北京）资本管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-27
6	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-27
7	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2016	中国证券报、上海证券	2017-03-27

	年年度报告（正文）	报、证券时报	
8	关于博时旗下部分开放式基金增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-24
9	关于博时旗下部分开放式基金增加大有期货有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-17
10	博时大中华亚太精选股票证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-13
11	博时大中华亚太精选股票证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-13
12	关于博时旗下部分开放式基金增加上海挖财金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-01
13	关于博时旗下部分开放式基金新增江苏银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-02-28
14	关于博时大中华亚太精选股票基金增加南海农商行为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-02-24
15	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投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	2017-02-23
16	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-01-21
17	关于博时旗下部分开放式基金增加郑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	2017-01-11

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 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
- 12.1.2 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 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
- 12.1.6 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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 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
二〇一七年八月二十四日