# 博时大中华亚太精选股票证券投资基金

## 【2015】半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。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。

2基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 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 | 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%。<br>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。本基金闲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。 |
| 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 |

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

| | |
|---|---|
| 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 |

§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 |

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。

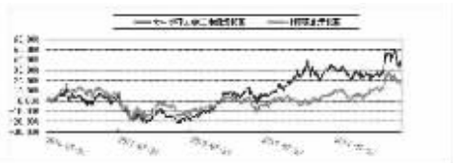
3.2 基金净值表现

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、深圳市和讯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遵规守信情况的说明

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 | 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 | 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 | 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 164,342,420.65 | 5,309,088.55 |
| 应收利息 | 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 | 316,376.29 | - |
| 资产总计 | 679,119,779.77 | 133,298,457.08 |
| 负债和所有者权益 | 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | 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 | 362,474,245.55 | 109,824,383.05 |
| 未分配利润 | 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

| | | | |
|---|---|---|---|
| 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关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1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% |

6.4.4.1.2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% | - | - |

6.4.4.2关联方报酬

6.4.4.2.1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。

6.4.4.2.2基金托管费

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:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

6.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1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 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 |
|---|---|---|
| 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% |

6.4.4.4.2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。

6.4.4.5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 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 | |
|---|---|---|---|---|
| | 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 | 16,660.96 | 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。

6.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无余额。

§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前十名权益投资明细

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 | CHINASOFT INTERNATIONAL 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 ELECTRONIC INTL CO LTD | 比亚迪电子 | 285 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 2,000,000.00 | 16,560,810.00 | 3.72 |
| 7 | PING AN INSURANCE 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 INSURANCE 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 | MIT-SUBISHI UFJ FINAN-CIAL GRO | MIT-SUBISHI UFJ FINAN-CIAL GRO | 8306 JP | 日本证券交易所 | 日本 | 336,000.00 | 14,796,011.87 | 3.33 |

注:所用证券代码采用当地市场代码。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细,应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

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 | 16,405,650.39 | 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 H